

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年10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 惠正
【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】	三木谷 正直
【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。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

投資のソムリエ

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下、「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

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

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%(税抜3.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

平成29年10月12日から平成30年4月11日まで

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

上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は以下の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

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

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

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

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

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

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

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

3 年2回決算を行います。

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

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

■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

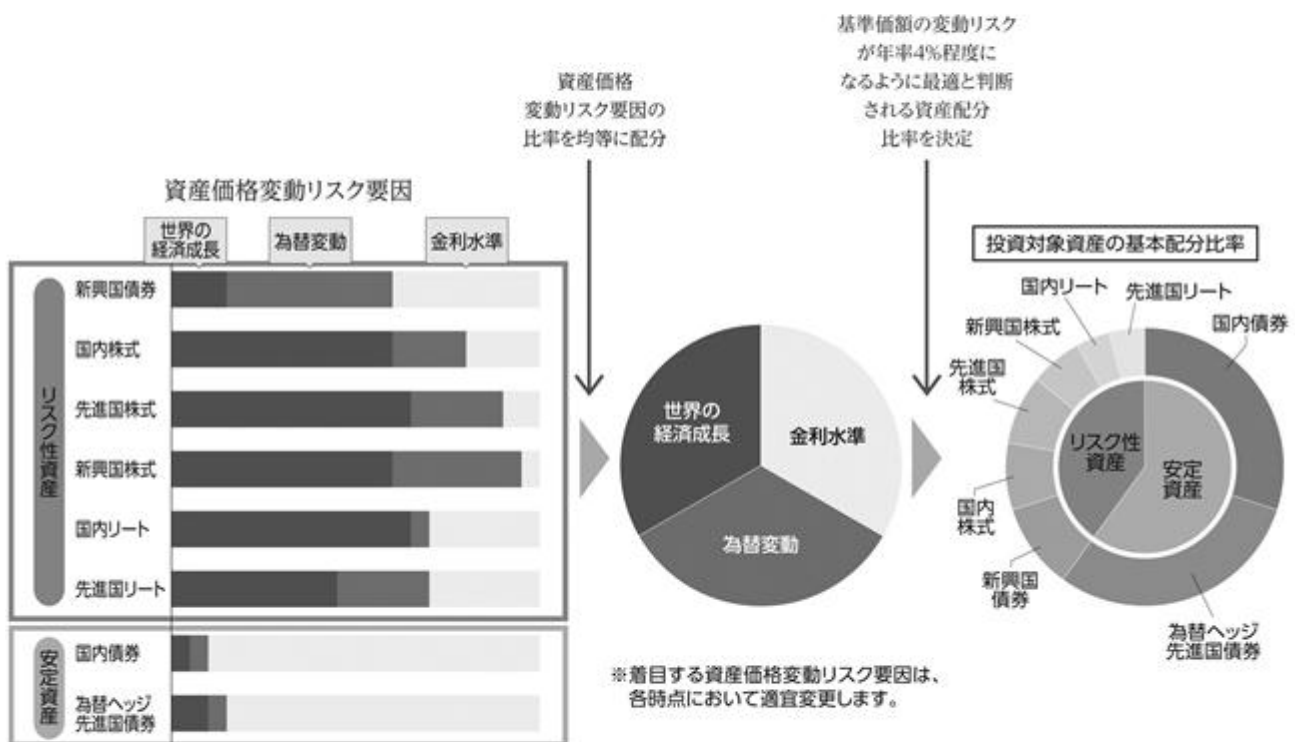
- ・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。
- ・機動的配分戦略は日次で行います。

月次戦略—基本配分戦略

資産価格に影響を与える変動要因に着目し、その変動要因がバランスするように基本配分比率を決定します。基本配分比率は、月次で決定し、原則月間を通じて維持します。

基本配分比率決定のイメージ

当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。



※上記は資産価格変動リスク要因のすべてを網羅したものではありません。

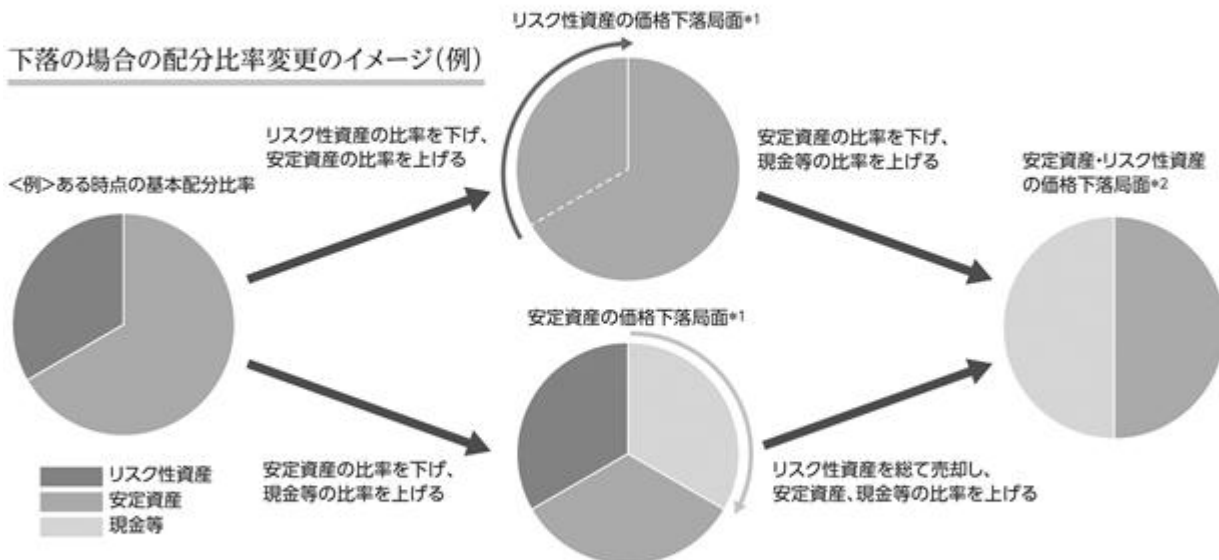
※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

日次戦略—機動的配分戦略

当ファンドは、リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定します。下落の危険性が高まったと判定した場合は、リスク性資産を安定資産に、安定資産を現金等*に入れ替えます。

* 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。

※ 基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。



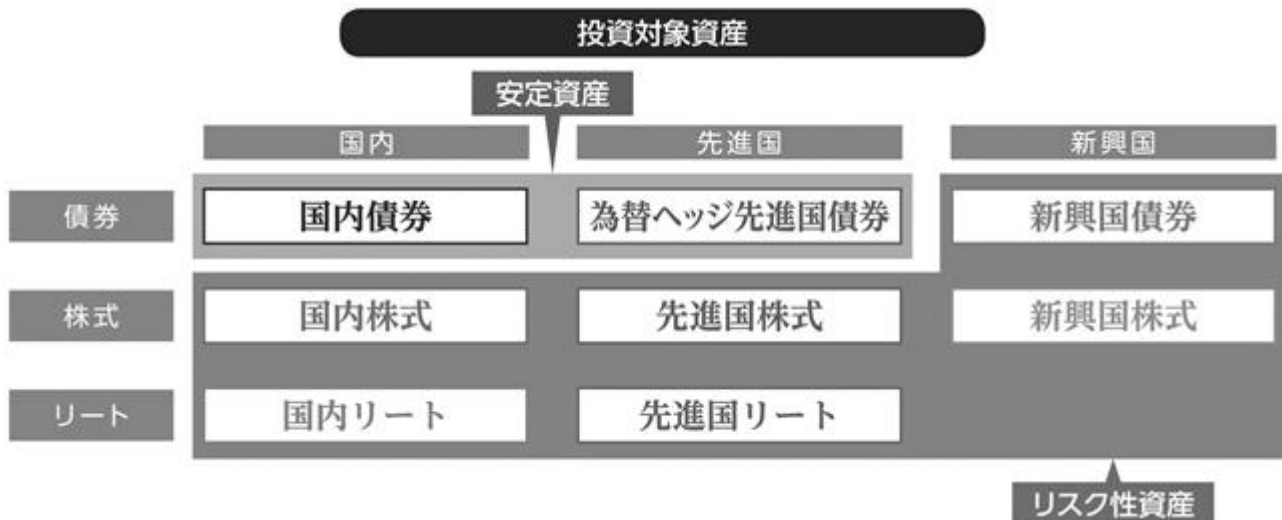
相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合があります。

*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。

*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかに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。

※ 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。



商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

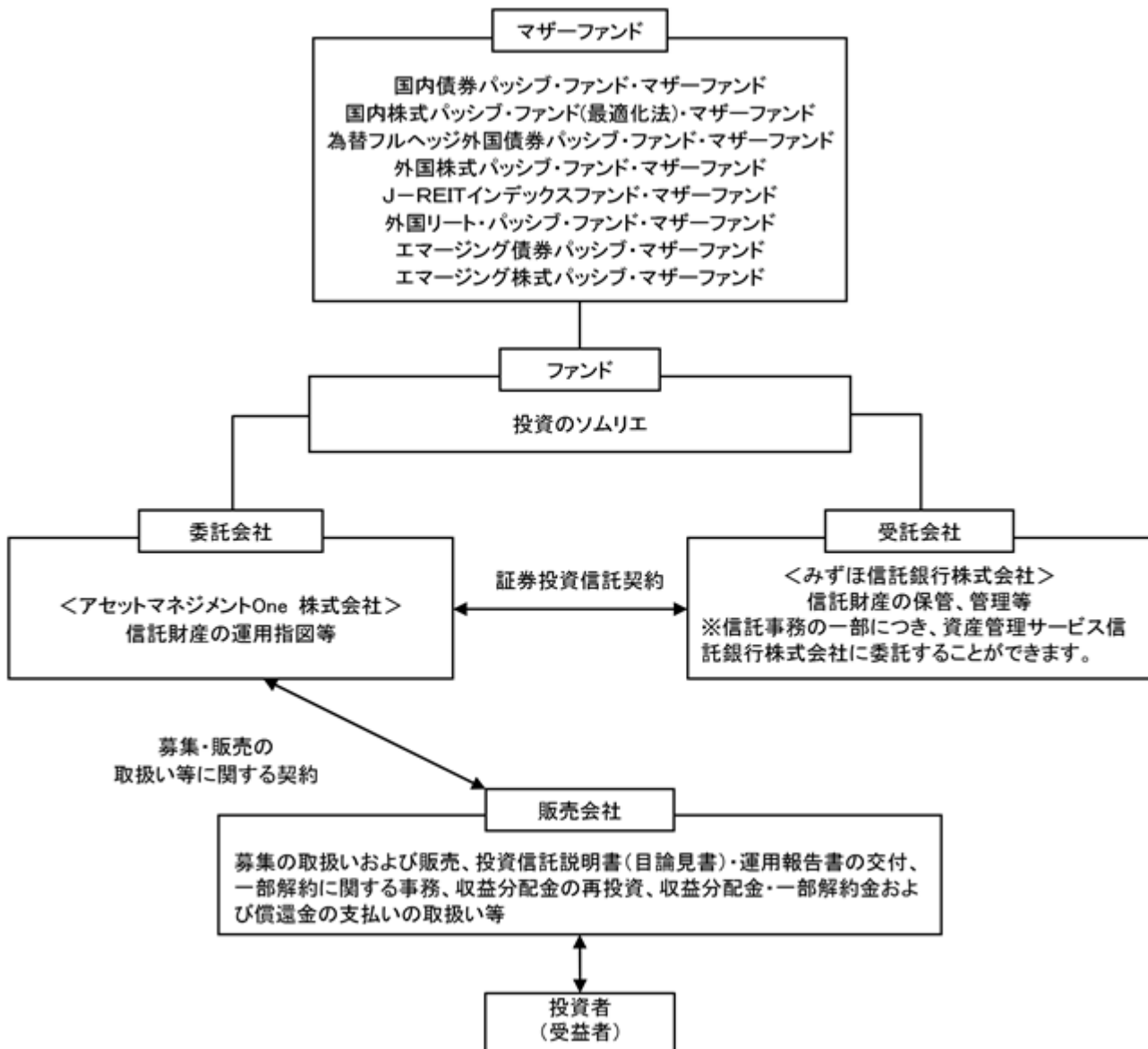
<p>その他資産 (投資信託証券 (資産複合(債券、株式、不動産投信)資産配 分変更型))</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(債券、株式、不動産投信)を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(資産複合(債券、株式、不動産投信)資産配分変更型))に分類されます。</p>
<p>年 2 回</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>グローバル (日本を含む)</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>ファミリー ファンド</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。</p>
<p>為替ヘッジあり</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジ又は一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。</p>

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

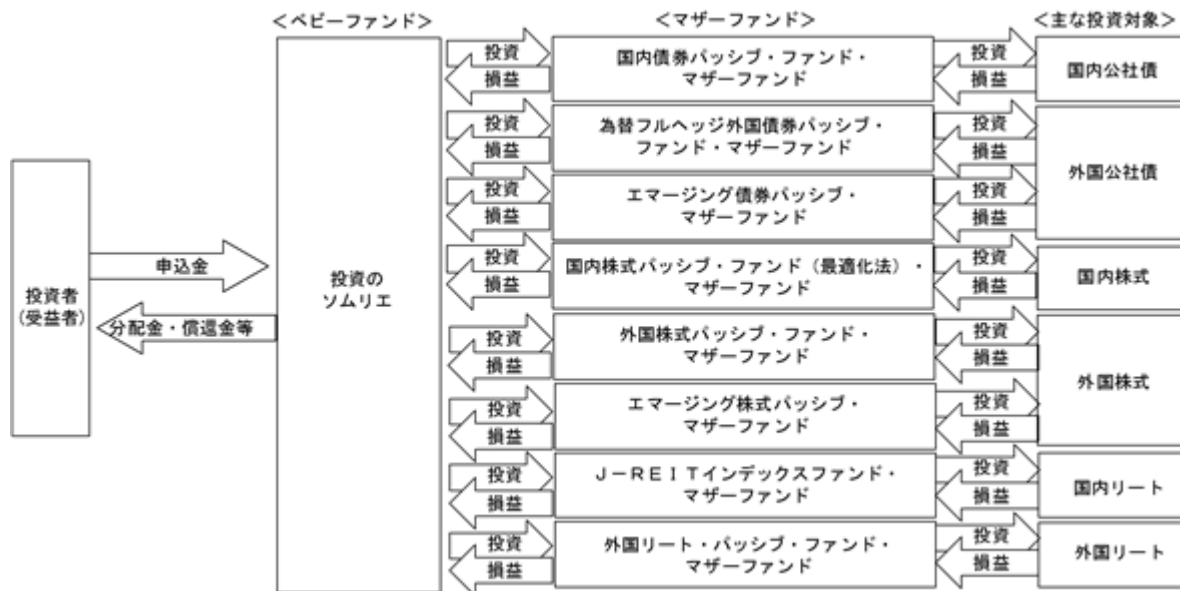
- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を各マザーファンドにて行います。



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

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

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

資本金の額

20億円（平成29年7月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（平成29年7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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

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

<投資態度>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

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

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

・ エマージング株式パッシブ・マザーファンド
(それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。)

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

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

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

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

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

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

基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

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

・ 基本配分戦略は月次で行います。

機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

・ 機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J・REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、上記に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することの指図をすることができます。

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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

運用プロセス

1.流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因

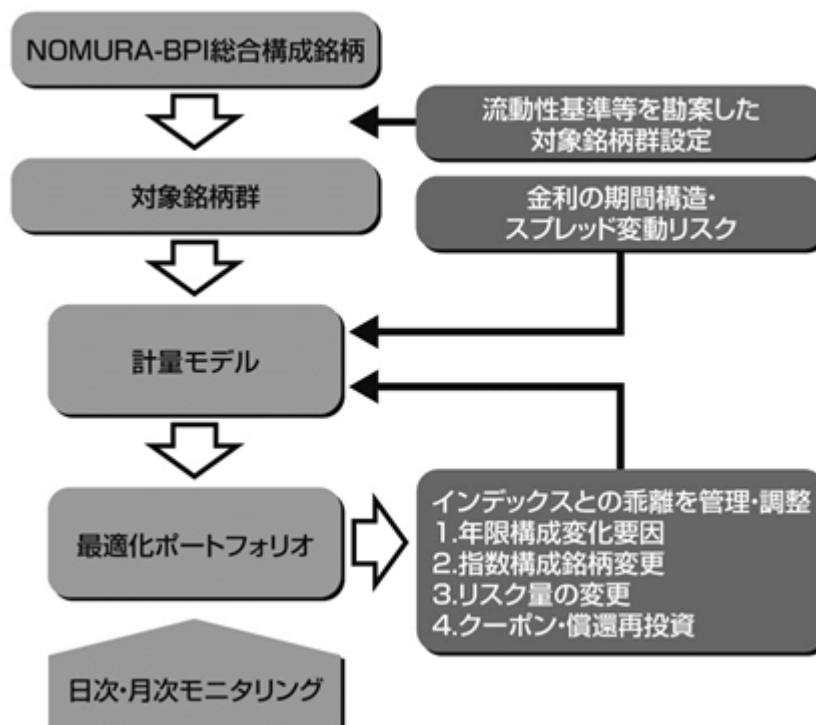
1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3.インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

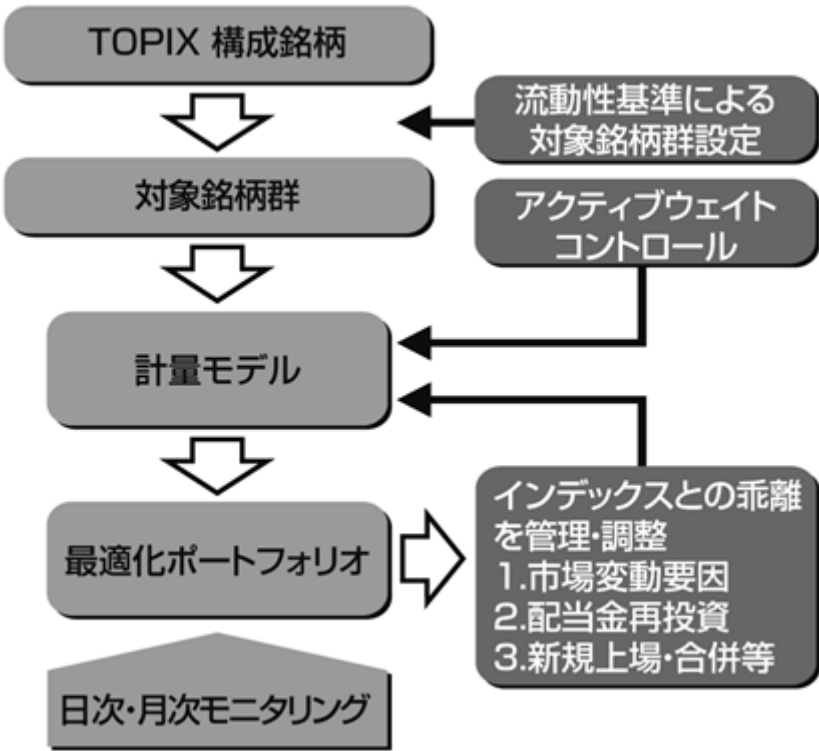
- ・ 年限構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン、償還再投資



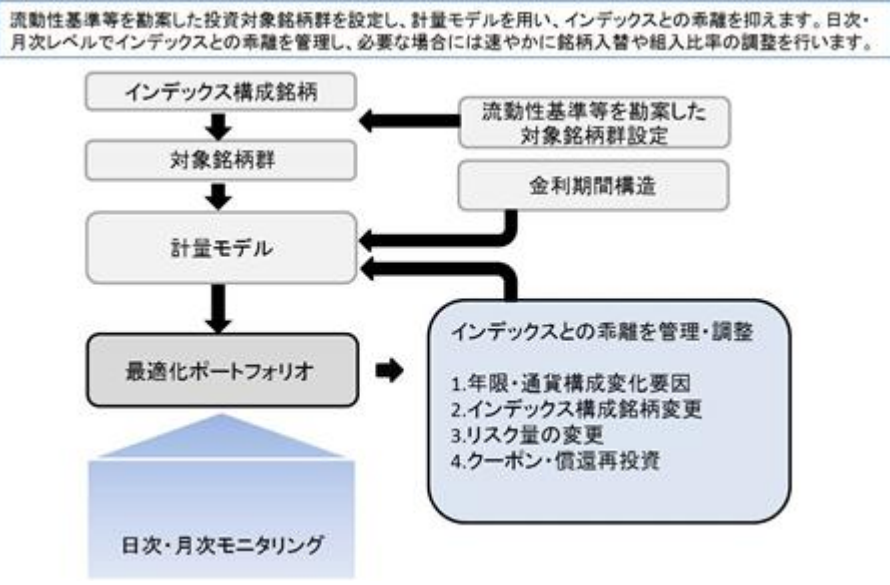
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
---------------	--

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

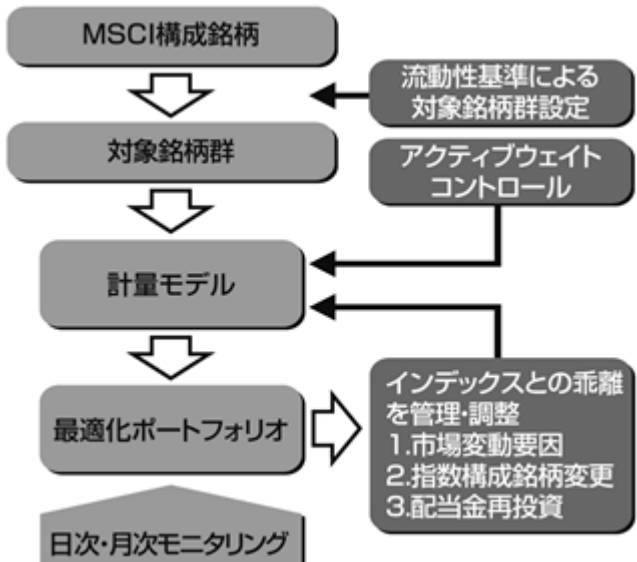
投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨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

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p>

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	------------------------------

基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>シティ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。</p> </div>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日々・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C C --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> I["1. 年限・通貨構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資"] H --> F H --> G </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の転換社債等への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

<p>運用プロセス</p>	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

<p>ファンド名</p>	<p>J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド</p>
--------------	--------------------------------------

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

投資態度

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

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

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

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

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

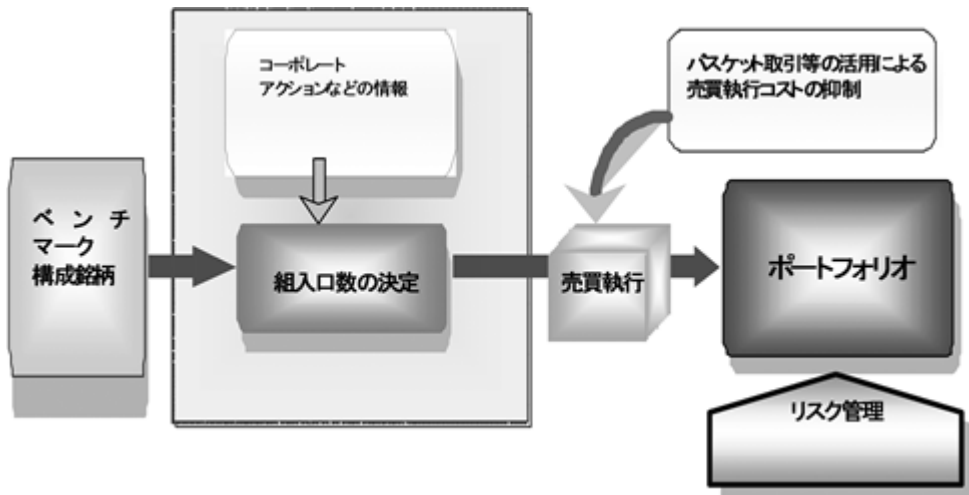
当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取り得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p>

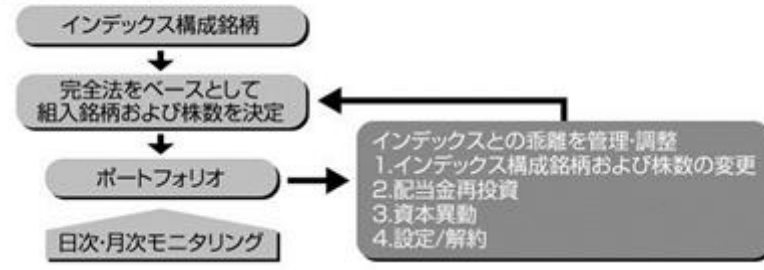
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
------	--

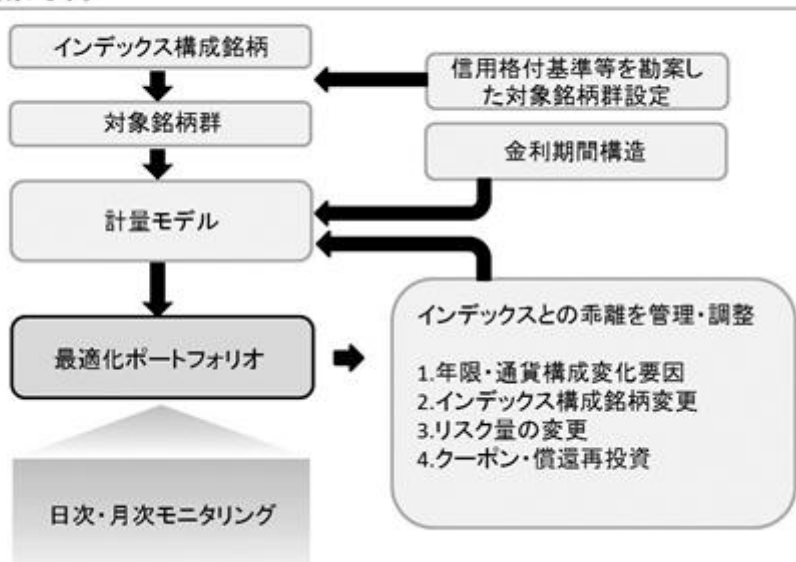
Standard & Poor's®並びに S&P®は、スタンダード・プアーズ・フィナンシャル・サービシーズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、委託会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P 先進国 REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、委託会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、委託会社の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの委託会社に対するS&P 先進国 REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、委託会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、委託会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。

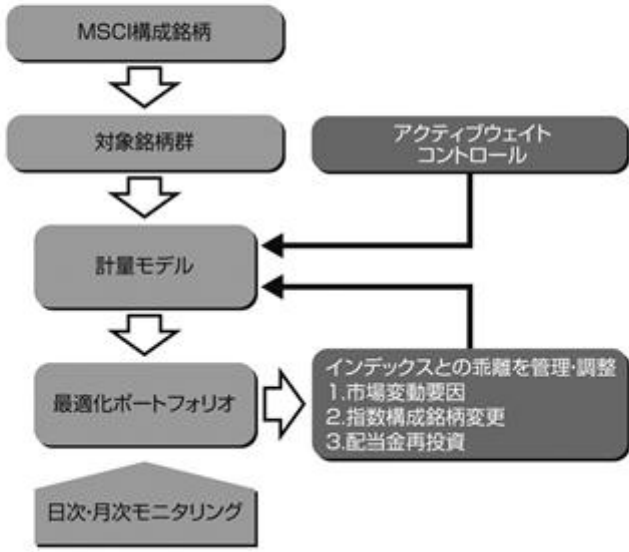
S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくは委託会社が得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、トレーディング損

	<p>失、損失時間、のれんを含む）について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスと委託会社間での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日次・月次モニタリング] C --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p>

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
-------	----------------------

基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[アクティブウェイトコントロール] --> C F --> D G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> D G --> E </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資割合には、制限を設けません。2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。4. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
--------	---

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



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。

運用計画の決定

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。

売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

モニタリング

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（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的で開催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b．ファンドの関係法人に関する管理

当ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c．運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は平成29年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

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

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

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

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

非株式割合(マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)については制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲(約款第21条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2.株式分割により取得する株券
- 3.有償増資により取得する株券
- 4.売出しにより取得する株券
- 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
- 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

2)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

3)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- 2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとし、
- 4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとし、

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第24条の2)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第26条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引の指図(約款第27条)

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

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

資金の借入れ(約款第33条)

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

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

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

株価変動リスク

当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

金利リスク

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

リートの価格変動リスク

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

当ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

為替リスク

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

為替ヘッジを行わない場合、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

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

信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした

状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることもあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

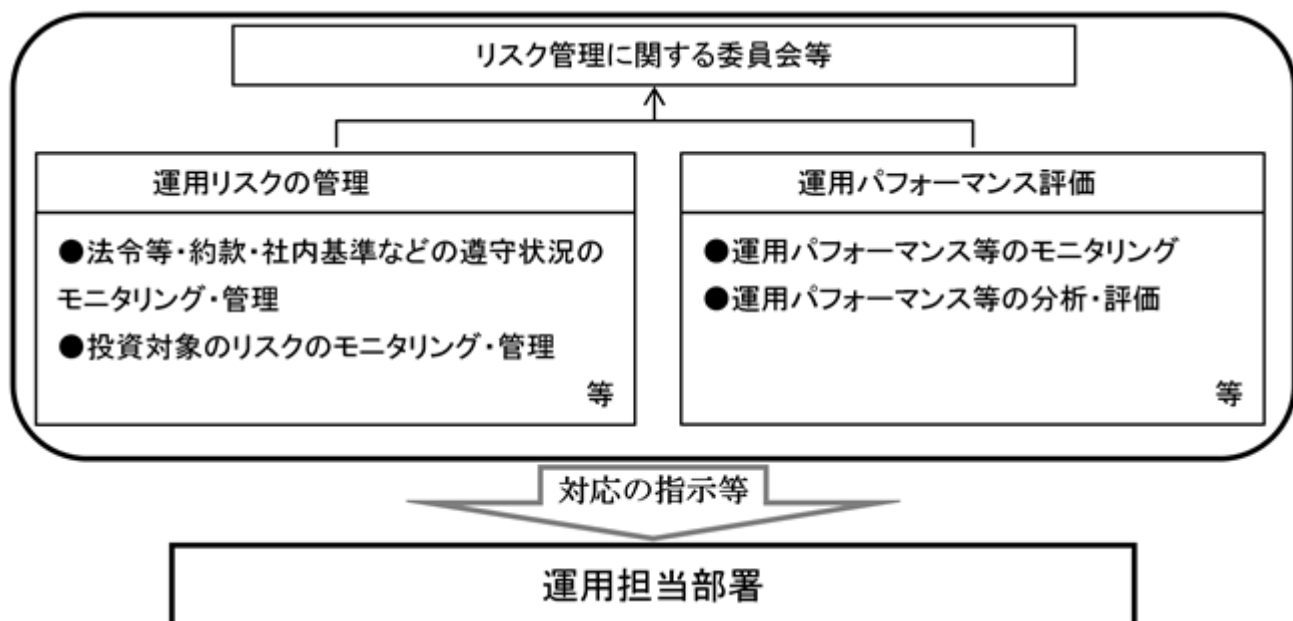
注意事項

- ・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券（リート）など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

委託会社における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下の通りです。

- ・運用リスクの管理：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。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



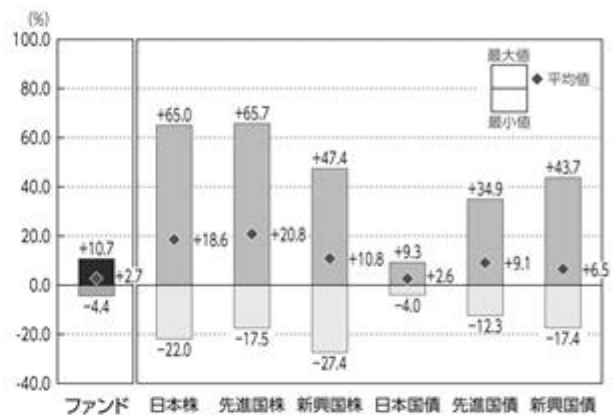
上記体制は平成29年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率およ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年間騰落率の比較



ファンド:2013年10月~2017年7月

代表的な資産クラス:2012年8月~2017年7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 (配当込み、円ベース)
 - 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 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・ディバーシファイド (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、円換算しております。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、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。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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。また、同社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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.512%（税抜1.40%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.65%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

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

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

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

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

原則として確定申告が必要ですが、特定口座(源泉徴収口座)を利用する場合、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。)を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA(ジュニアニーサ)」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成29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。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

<収益分配金の課税について>

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	60,481,223,420	94.62
内 日本	60,481,223,420	94.62
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,435,956,830	5.38
純資産総額	63,917,180,250	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	8,746,258,000	13.68
-	8,746,258,000	13.68
為替予約取引（売建）	23,802,006,000	37.24
-	23,802,006,000	37.24

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	287,757,187,600	97.55
内 日本	287,757,187,600	97.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,230,031,677	2.45
純資産総額	294,987,219,277	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,109,605,000	2.41
内 日本	7,109,605,000	2.41

（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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	316,285,726,500	83.72
内 日本	316,285,726,500	83.72
地方債証券	23,891,024,278	6.32
内 日本	23,891,024,278	6.32
特殊債券	17,602,432,970	4.66
内 日本	17,602,432,970	4.66
社債券	17,965,338,080	4.76
内 日本	17,764,142,080	4.70
内 オランダ	201,196,000	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,040,979,037	0.54
純資産総額	377,785,500,865	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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	29,251,423,800	98.00
内 日本	29,251,423,800	98.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	598,119,117	2.00
純資産総額	29,849,542,917	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	435,200,000	1.46
内 日本	435,200,000	1.46

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	262,459,446,094	95.48
内 アメリカ	160,074,435,819	58.23
内 イギリス	18,642,363,157	6.78
内 カナダ	10,652,325,613	3.88
内 フランス	10,485,132,844	3.81
内 ドイツ	10,393,312,413	3.78
内 スイス	9,973,915,900	3.63
内 オーストラリア	7,071,888,414	2.57
内 オランダ	5,301,016,346	1.93
内 アイルランド	4,188,556,864	1.52
内 スペイン	3,876,821,682	1.41
内 スウェーデン	3,117,804,195	1.13
内 香港	2,636,070,635	0.96
内 イタリア	2,209,055,297	0.80
内 シンガポール	2,132,994,269	0.78
内 デンマーク	2,021,609,312	0.74
内 ジャージー	1,552,155,147	0.56
内 ベルギー	1,334,808,472	0.49
内 バミューダ	1,310,770,402	0.48
内 フィンランド	1,137,790,896	0.41
内 オランダ領キュラソー	754,232,261	0.27
内 ノルウェー	728,896,579	0.27
内 ケイマン諸島	715,624,538	0.26
内 イスラエル	627,599,817	0.23
内 ルクセンブルグ	371,067,942	0.13
内 オーストリア	297,428,378	0.11
内 パナマ	182,565,511	0.07
内 ポルトガル	181,356,734	0.07
内 ニュージーランド	170,763,066	0.06
内 リベリア	153,817,225	0.06
内 パプアニューギニア	54,285,444	0.02
内 イギリス領バージン諸島	48,088,946	0.02
内 マン島	38,940,895	0.01
内 モーリシャス	21,951,081	0.01
投資信託受益証券	800,030,170	0.29
内 オーストラリア	683,946,095	0.25
内 シンガポール	116,084,075	0.04
投資証券	6,210,385,608	2.26
内 アメリカ	5,377,634,035	1.96
内 フランス	376,269,642	0.14
内 イギリス	261,000,767	0.09
内 香港	147,625,294	0.05
内 カナダ	47,855,870	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,409,322,477	1.97
純資産総額	274,879,184,349	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	26,853,100	0.01
-	26,853,100	0.01
為替予約取引(売建)	182,337,000	0.07
-	182,337,000	0.07
株価指数先物取引(買建)	4,967,977,076	1.81
内 アメリカ	3,284,734,654	1.19
内 ドイツ	949,909,248	0.35
内 イギリス	380,850,141	0.14
内 カナダ	203,914,453	0.07
内 オーストラリア	148,568,580	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7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	5,322,003,105	11.17
内 オーストラリア	3,775,631,298	7.93
内 シンガポール	1,531,945,892	3.22
内 カナダ	14,425,915	0.03
投資証券	42,040,645,982	88.24
内 アメリカ	33,791,085,066	70.93
内 イギリス	2,605,858,152	5.47
内 フランス	2,124,452,482	4.46
内 香港	925,381,368	1.94
内 カナダ	865,302,457	1.82
内 スペイン	430,845,721	0.90
内 ベルギー	381,456,867	0.80
内 ニュージーランド	239,339,829	0.50
内 オランダ	227,864,371	0.48
内 アイルランド	121,145,780	0.25
内 ドイツ	98,633,754	0.21
内 シンガポール	96,423,183	0.20
内 イタリア	47,916,669	0.10
内 ガーンジー	32,666,908	0.07
内 マン島	26,698,840	0.06
内 イスラエル	25,574,535	0.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	278,426,694	0.58
純資産総額	47,641,075,781	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	101,939,600	0.21
-	101,939,600	0.21
為替予約取引(売建)	5,056,350	0.01
-	5,056,350	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) 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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	175,329,268,318	96.95
内 アメリカ	76,145,265,110	42.11
内 フランス	18,050,079,778	9.98
内 イタリア	17,451,675,858	9.65
内 ドイツ	12,890,197,107	7.13
内 イギリス	12,559,388,619	6.95
内 スペイン	10,258,882,721	5.67
内 ベルギー	4,381,208,489	2.42
内 オランダ	3,937,716,750	2.18
内 オーストラリア	3,797,919,227	2.10
内 カナダ	3,620,743,817	2.00
内 オーストリア	2,639,098,020	1.46
内 メキシコ	1,511,040,066	0.84
内 アイルランド	1,406,604,763	0.78
内 ポーランド	1,125,769,507	0.62
内 フィンランド	1,060,854,076	0.59
内 デンマーク	1,031,515,506	0.57
内 南アフリカ	871,249,494	0.48
内 スウェーデン	835,630,397	0.46
内 マレーシア	659,257,768	0.36
内 シンガポール	644,998,685	0.36
内 ノルウェー	450,172,560	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,508,714,689	3.05
純資産総額	180,837,983,007	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	176,805,151,922	97.77
-	176,805,151,922	97.77

（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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	46,895,642,189	92.34
内 韓国	7,179,971,603	14.14
内 ケイマン諸島	6,841,925,967	13.47
内 台湾	5,611,897,266	11.05
内 中国	4,518,649,344	8.90
内 インド	4,264,476,413	8.40
内 ブラジル	3,265,210,117	6.43
内 南アフリカ	2,928,853,024	5.77
内 香港	1,620,095,860	3.19
内 ロシア	1,463,036,861	2.88
内 メキシコ	1,365,966,062	2.69
内 インドネシア	1,095,670,473	2.16
内 マレーシア	1,084,319,716	2.14
内 タイ	1,010,957,199	1.99
内 ポーランド	621,336,228	1.22
内 チリ	560,122,536	1.10
内 トルコ	548,531,400	1.08
内 フィリピン	548,256,583	1.08
内 バミューダ	526,329,512	1.04
内 アラブ首長国連邦	354,188,042	0.70
内 カタール	323,892,037	0.64
内 コロンビア	214,246,722	0.42
内 ギリシャ	173,631,380	0.34
内 ハンガリー	164,939,140	0.32
内 アメリカ	164,535,248	0.32
内 オランダ	149,154,720	0.29
内 チェコ	92,451,662	0.18
内 エジプト	60,193,599	0.12
内 パキスタン	55,902,337	0.11
内 マン島	41,411,910	0.08
内 ベルギー	30,033,131	0.06
内 マルタ	15,456,097	0.03
投資信託受益証券	329,449,244	0.65
内 メキシコ	329,449,244	0.65
投資証券	112,963,614	0.22
内 南アフリカ	51,624,373	0.10
内 メキシコ	44,862,424	0.09
内 トルコ	16,476,817	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,447,129,759	6.79
純資産総額	50,785,184,806	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	182,061,000	0.36
-	182,061,000	0.36
株価指数先物取引（買建）	3,394,175,094	6.68
内 アメリカ	3,394,175,094	6.68

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	90,750,465,596	95.18
内 トルコ	12,579,800,125	13.19
内 メキシコ	11,808,989,381	12.39
内 ロシア	10,359,318,495	10.86
内 インドネシア	9,780,417,267	10.26
内 ブラジル	9,492,515,448	9.96
内 コロンビア	7,966,235,689	8.35
内 フィリピン	6,847,708,884	7.18
内 ハンガリー	4,675,593,722	4.90
内 パナマ	4,284,873,947	4.49
内 ペルー	4,080,170,283	4.28
内 南アフリカ	3,712,943,688	3.89
内 クロアチア	2,831,670,493	2.97
内 ルーマニア	2,330,228,174	2.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,597,303,562	4.82
純資産総額	95,347,769,158	100.00

その他資産の投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	77,238,000	0.08
-	77,238,000	0.08

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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7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	12,139,480,231	1.2749 15,477,524,825	1.2787 15,522,753,371	- -	24.29%
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	11,629,803,368	1.3271 15,434,400,116	1.3334 15,507,179,810	- -	24.26%
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	4,320,214,216	1.8809 8,126,145,547	1.8475 7,981,595,764	- -	12.49%
4	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,794,002,722	2.4342 6,801,372,624	2.4218 6,766,515,792	- -	10.59%
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	4,893,206,158	1.1776 5,762,467,054	1.1810 5,778,876,472	- -	9.04%
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	3,222,414,209	1.1185 3,604,592,534	1.1406 3,675,485,646	- -	5.75%
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	1,651,900,209	1.6604 2,742,879,881	1.7277 2,853,987,991	- -	4.47%
8	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	754,894,898	3.2131 2,425,620,812	3.1724 2,394,828,574	- -	3.75%

(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7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	94.62%
合計	94.62%

(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7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	1,486,600	6,346.00 9,433,963,600	6,234.00 9,267,464,400	- -	3.14%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,146,600	751.20 6,870,925,920	700.00 6,402,620,000	- -	2.17%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	968,800	4,874.00 4,721,931,200	5,390.00 5,221,832,000	- -	1.77%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	543,400	8,664.00 4,708,017,600	8,958.00 4,867,777,200	- -	1.65%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	966,300	4,479.00 4,328,057,700	4,195.00 4,053,628,500	- -	1.37%
6	ソニー 日本	株式 電気機器	863,800	3,599.00 3,108,816,200	4,540.00 3,921,652,000	- -	1.33%
7	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,178,900	2,947.00 3,474,218,300	2,920.00 3,442,388,000	- -	1.17%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,100,300	3,541.00 3,896,162,300	3,108.00 3,419,732,400	- -	1.16%
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	16,386,800	208.50 3,416,647,800	196.40 3,218,367,520	- -	1.09%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	759,400	3,632.00 2,758,140,800	3,834.00 2,911,539,600	- -	0.99%
11	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,400	43,880.00 2,430,952,000	51,020.00 2,826,508,000	- -	0.96%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	75,300	23,230.00 1,749,219,000	37,480.00 2,822,244,000	- -	0.96%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	480,200	5,021.00 2,411,084,200	5,832.00 2,800,526,400	- -	0.95%
14	ファナック 日本	株式 電気機器	124,000	21,565.00 2,674,060,000	22,565.00 2,798,060,000	- -	0.95%
15	キヤノン 日本	株式 電気機器	658,100	3,252.00 2,140,141,200	3,837.00 2,525,129,700	- -	0.86%
16	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	236,500	9,995.00 2,363,817,500	10,350.00 2,447,775,000	- -	0.83%
17	信越化学工業 日本	株式 化学	229,700	9,505.00 2,183,298,500	10,110.00 2,322,267,000	- -	0.79%
18	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	888,300	2,690.00 2,389,527,000	2,563.00 2,276,712,900	- -	0.77%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	486,000	4,705.00 2,286,630,000	4,645.00 2,257,470,000	- -	0.77%
20	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	505,100	4,428.00 2,236,582,800	4,445.00 2,245,169,500	- -	0.76%

21	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,304,300	1,608.50 2,097,966,550	1,710.50 2,231,005,150	- -	0.76%
22	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,936,000	672.30 1,973,872,800	759.60 2,230,185,600	- -	0.76%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	128,300	15,385.00 1,973,895,500	17,180.00 2,204,194,000	- -	0.75%
24	三菱商事 日本	株式 卸売業	905,700	2,541.00 2,301,383,700	2,396.50 2,170,510,050	- -	0.74%
25	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,404,200	1,175.50 1,650,644,426	1,521.00 2,135,788,200	- -	0.72%
26	花王 日本	株式 化学	300,800	5,863.00 1,763,590,400	6,714.00 2,019,571,200	- -	0.68%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	432,200	4,054.00 1,752,138,800	4,657.00 2,012,755,400	- -	0.68%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	166,900	11,245.00 1,876,790,500	11,700.00 1,952,730,000	- -	0.66%
29	日本電産 日本	株式 電気機器	158,500	10,405.00 1,649,192,500	12,160.00 1,927,360,000	- -	0.65%
30	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	101,700	17,995.00 1,830,091,500	17,750.00 1,805,175,000	- -	0.61%

(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7月31日現在

種類	投資比率
株式	97.55%
合計	97.55%

(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7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.08%
輸送用機器		8.48%
情報・通信業		7.80%
銀行業		7.55%
化学		6.89%
機械		5.12%
小売業		4.50%
食料品		4.44%
医薬品		4.42%
卸売業		4.33%
陸運業		3.99%
サービス業		3.75%
建設業		3.14%
保険業		2.42%
不動産業		2.33%
その他製品		2.08%
電気・ガス業		1.75%
精密機器		1.59%
鉄鋼		1.26%
その他金融業		1.25%
証券、商品先物取引業		1.07%
ガラス・土石製品		0.97%
非鉄金属		0.96%
ゴム製品		0.93%
繊維製品		0.69%
金属製品		0.69%
空運業		0.55%
石油・石炭製品		0.49%
鋳業		0.30%
パルプ・紙		0.25%
海運業		0.21%
倉庫・運輸関連業	0.19%	
水産・農林業	0.11%	
合計		97.55%

(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7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	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.73 4,532,864,000	100.46 4,520,925,000	0.100000 2019/12/20	1.20%
2	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.64 4,529,245,000	100.33 4,515,030,000	0.100000 2027/3/20	1.20%
3	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	100.82 4,234,524,000	100.43 4,218,312,000	0.200000 2018/12/20	1.12%
4	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.38 4,015,295,000	100.55 4,022,360,000	0.100000 2026/3/20	1.06%
5	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.84 4,033,960,000	100.51 4,020,560,000	0.200000 2019/3/20	1.06%
6	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.34 4,013,635,000	100.42 4,016,800,000	0.100000 2026/12/20	1.06%
7	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.91 3,733,892,000	100.59 3,721,978,000	0.200000 2019/6/20	0.99%
8	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	102.02 3,570,700,000	102.30 3,580,500,000	0.300000 2025/12/20	0.95%
9	131回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.15 3,540,285,000	100.76 3,526,810,000	0.100000 2022/3/20	0.93%
10	129回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.92 3,532,270,000	100.70 3,524,640,000	0.100000 2021/9/20	0.93%
11	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.78 3,527,580,000	100.54 3,519,215,000	0.100000 2020/6/20	0.93%
12	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.18 3,506,425,000	100.48 3,517,010,000	0.100000 2026/6/20	0.93%
13	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.87 3,530,450,000	100.47 3,516,485,000	0.300000 2018/9/20	0.93%
14	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.14 3,504,970,000	100.45 3,515,890,000	0.100000 2026/9/20	0.93%
15	377回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.42 3,514,955,000	100.41 3,514,385,000	0.100000 2019/6/15	0.93%

16	313回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,000,000,000	105.76 3,173,010,000	104.98 3,149,550,000	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	102.90 3,087,180,000	103.12 3,093,810,000	0.400000 2025/9/20	0.82%
18	130回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,000,000,000	101.06 3,031,845,000	100.72 3,021,750,000	0.100000 2021/12/20	0.80%
19	128回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,000,000,000	100.91 3,027,450,000	100.66 3,019,830,000	0.100000 2021/6/20	0.80%
20	127回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,000,000,000	100.88 3,026,490,000	100.63 3,019,110,000	0.100000 2021/3/20	0.80%
21	126回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,000,000,000	100.84 3,025,440,000	100.59 3,017,790,000	0.100000 2020/12/20	0.80%
22	125回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,000,000,000	100.81 3,024,330,000	100.56 3,016,950,000	0.100000 2020/9/20	0.80%
23	123回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,490,000	100.50 3,015,000,000	0.100000 2020/3/20	0.80%
24	301回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,900,000,000	103.95 3,014,811,000	103.04 2,988,334,000	1.500000 2019/6/20	0.79%
25	321回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,500,000,000	105.49 2,637,250,000	104.92 2,623,025,000	1.000000 2022/3/20	0.69%
26	305回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,500,000,000	104.15 2,603,800,000	103.34 2,583,600,000	1.300000 2019/12/20	0.68%
27	143回 利付国庫債券(20年)	日本	国債証券	2,100,000,000	117.77 2,473,274,000	118.96 2,498,265,000	1.600000 2033/3/20	0.66%
28	310回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,300,000,000	104.04 2,392,920,000	103.39 2,378,039,000	1.000000 2020/9/20	0.63%
29	297回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,300,000,000	103.01 2,369,299,000	102.09 2,348,277,000	1.400000 2018/12/20	0.62%
30	312回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,200,000,000	105.07 2,311,606,000	104.32 2,295,150,000	1.200000 2020/12/20	0.61%

(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7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.72%
地方債証券	6.32%
特殊債券	4.66%
社債券	4.76%
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-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成29年7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	3,700	598,202.78 2,213,350,304	595,000.00 2,201,500,000	- -	7.38%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,612	580,565.52 2,097,002,678	579,000.00 2,091,348,000	- -	7.01%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,963	164,697.55 1,805,579,250	156,300.00 1,713,516,900	- -	5.74%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	7,351	217,069.72 1,595,679,547	210,600.00 1,548,120,600	- -	5.19%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	8,428	164,475.76 1,386,201,783	164,400.00 1,385,563,200	- -	4.64%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,372	175,749.75 1,295,627,200	167,400.00 1,234,072,800	- -	4.13%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	3,930	278,974.40 1,096,369,405	273,200.00 1,073,676,000	- -	3.60%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,470	239,197.96 1,069,214,917	232,500.00 1,039,275,000	- -	3.48%
9	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,413	424,038.18 1,023,204,150	414,500.00 1,000,188,500	- -	3.35%
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,538	290,320.06 1,027,152,404	269,400.00 953,137,200	- -	3.19%
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	11,029	80,146.07 883,931,051	79,700.00 879,011,300	- -	2.94%
12	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,652	505,422.39 834,957,790	495,500.00 818,566,000	- -	2.74%
13	GLP投資法人 日本	投資証券	6,690	124,182.62 830,781,788	120,000.00 802,800,000	- -	2.69%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,117	611,162.18 682,668,160	623,000.00 695,891,000	- -	2.33%
15	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,300	489,785.61 636,721,293	471,500.00 612,950,000	- -	2.05%
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,270	483,349.00 613,853,237	458,000.00 581,660,000	- -	1.95%
17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,105	143,382.47 588,585,076	138,900.00 570,184,500	- -	1.91%

18	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券	2,428	238,699.46 579,562,295	224,000.00 543,872,000	- -	1.82%
19	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	1,038	499,409.65 518,387,222	499,000.00 517,962,000	- -	1.74%
20	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,731	179,103.94 489,132,885	182,800.00 499,226,800	- -	1.67%
21	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	824	559,685.63 461,180,964	543,000.00 447,432,000	- -	1.50%
22	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,422	132,146.19 452,204,295	128,800.00 440,753,600	- -	1.48%
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,450	184,812.64 452,790,987	173,700.00 425,565,000	- -	1.43%
24	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	8,520	52,672.15 448,766,762	49,400.00 420,888,000	- -	1.41%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,353	124,640.12 417,918,342	120,900.00 405,377,700	- -	1.36%
26	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,451	121,132.79 418,029,277	112,500.00 388,237,500	- -	1.30%
27	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,298	83,278.75 357,932,110	82,100.00 352,865,800	- -	1.18%
28	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,562	137,804.62 353,055,462	134,200.00 343,820,400	- -	1.15%
29	ケネディクス商業リート投資法人 日本	投資証券	1,389	241,264.41 335,116,269	241,900.00 335,999,100	- -	1.13%
30	積水ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	2,897	120,643.55 349,504,392	114,600.00 331,996,200	- -	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7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.00%
合計	98.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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7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 コンピューター・周辺機器	372,766	14,899.45 5,554,010,988	16,497.32 6,149,641,850	- -	2.24%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	521,733	7,125.29 3,717,503,884	8,059.96 4,205,149,197	- -	1.53%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	28,806	92,298.72 2,658,757,170	112,561.41 3,242,444,091	- -	1.18%
4	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	167,244	14,772.05 2,470,537,747	19,029.85 3,182,629,487	- -	1.16%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	192,938	12,840.32 2,477,386,817	14,549.64 2,807,179,889	- -	1.02%
6	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	294,326	9,139.18 2,689,900,352	8,783.85 2,585,318,378	- -	0.94%
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,203	9,882.94 2,512,274,522	10,072.74 2,560,522,759	- -	0.93%
8	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	22,237	90,538.09 2,013,295,573	103,897.83 2,310,376,168	- -	0.84%
9	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	21,047	92,700.65 1,951,070,699	105,751.71 2,225,756,356	- -	0.81%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	221,371	8,328.56 1,843,703,869	9,321.15 2,063,432,960	- -	0.75%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	338,228	6,398.09 2,164,014,199	5,881.65 1,989,340,407	- -	0.72%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	711,506	2,655.02 1,889,063,371	2,651.71 1,886,707,931	- -	0.69%
13	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	435,529	4,496.76 1,958,470,474	4,303.64 1,874,364,380	- -	0.68%
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	181,616	9,695.35 1,760,830,867	9,954.67 1,807,927,982	- -	0.66%
15	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	618,326	3,341.39 2,066,073,259	2,817.23 1,741,969,957	- -	0.63%
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	88,195	18,422.93 1,624,810,531	19,200.89 1,693,423,375	- -	0.62%

17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	134,175	12,416.58 1,665,994,889	11,931.04 1,600,847,560	- -	0.58%
18	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	422,273	3,613.96 1,526,078,786	3,658.10 1,544,717,916	- -	0.56%
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	288,233	5,326.59 1,535,300,312	5,290.17 1,524,804,163	- -	0.55%
20	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,411,039	1,010.52 1,425,885,502	1,077.77 1,520,780,920	- -	0.55%
21	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	158,500	8,568.15 1,358,053,201	9,315.44 1,476,498,587	- -	0.54%
22	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	289,822	4,472.48 1,296,224,692	5,077.20 1,471,485,272	- -	0.54%
23	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	335,266	4,198.26 1,407,535,766	4,361.03 1,462,105,754	- -	0.53%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	196,346	6,602.24 1,296,323,513	7,440.90 1,460,991,049	- -	0.53%
25	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	131,981	9,583.89 1,264,892,375	10,941.20 1,444,030,847	- -	0.53%
26	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	110,255	11,319.70 1,248,053,854	13,077.57 1,441,868,417	- -	0.52%
27	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	68,346	18,001.39 1,230,323,376	21,093.40 1,441,649,687	- -	0.52%
28	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,252	15,599.07 1,345,451,503	16,340.62 1,409,411,846	- -	0.51%
29	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	195,588	7,245.58 1,417,148,696	7,074.53 1,383,694,836	- -	0.50%
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	49,851	27,084.96 1,350,212,640	27,666.82 1,379,218,893	- -	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7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.48%
投資信託受益証券	0.29%
投資証券	2.26%
合計	98.03%

（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7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.61%
石油・ガス・消耗燃料		5.90%
医薬品		5.64%
保険		4.28%
ソフトウェア		3.73%
インターネットソフトウェア・サービス		3.12%
資本市場		2.87%
情報技術サービス		2.79%
コンピュータ・周辺機器		2.59%
半導体・半導体製造装置		2.54%
メディア		2.54%
化学		2.49%
各種電気通信サービス		2.36%
バイオテクノロジー		2.28%
飲料		2.10%
航空宇宙・防衛		2.05%
ヘルスケア機器・用品		2.02%
食品		2.00%
コングロマリット		1.97%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.96%
電力		1.90%
インターネット販売・通信販売		1.81%
ホテル・レストラン・レジャー		1.77%
食品・生活必需品小売り		1.75%
専門小売り		1.57%
機械		1.56%
金属・鉱業		1.50%
タバコ		1.46%
家庭用品		1.39%
繊維・アパレル・贅沢品		1.20%
総合公益事業		1.08%
自動車		0.96%
各種金融サービス		0.91%
陸運・鉄道		0.86%
通信機器		0.82%
電気設備		0.78%
パーソナル用品		0.76%
専門サービス		0.60%

エネルギー設備・サービス	0.58%
不動産管理・開発	0.55%
航空貨物・物流サービス	0.55%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.54%
消費者金融	0.49%
家庭用耐久財	0.48%
自動車部品	0.47%
建設関連製品	0.42%
電子装置・機器・部品	0.41%
商業サービス・用品	0.38%
無線通信サービス	0.38%
建設資材	0.36%
複合小売り	0.35%
建設・土木	0.33%
容器・包装	0.30%
商社・流通業	0.29%
運送インフラ	0.27%
旅客航空輸送業	0.15%
ガス	0.15%
紙製品・林産品	0.10%
海運業	0.09%
水道	0.08%
販売	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
レジャー用品	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.03%
各種消費者サービス	0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
合計	95.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年7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	117,500	17,557.98 2,063,062,886	17,713.38 2,081,322,385	- -	4.37%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	199,680	6,415.84 1,281,115,951	6,792.04 1,356,235,046	- -	2.85%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	56,300	23,403.70 1,317,628,671	22,383.39 1,260,185,082	- -	2.65%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	137,900	8,491.70 1,171,006,092	8,063.27 1,111,925,553	- -	2.33%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,900	21,451.12 1,113,313,625	21,242.37 1,102,479,262	- -	2.31%
6	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	37,370	29,888.05 1,116,916,513	27,673.79 1,034,169,625	- -	2.17%
7	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	138,270	7,487.93 1,035,357,445	7,471.79 1,033,125,578	- -	2.17%
8	VENTAS INC アメリカ	投資証券	133,650	7,791.63 1,041,352,411	7,406.69 989,904,385	- -	2.08%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	57,960	13,789.25 799,225,247	13,499.11 782,408,734	- -	1.64%
10	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	60,200	13,072.65 786,973,633	12,489.41 751,862,662	- -	1.58%
11	LINK REIT 香港	投資証券	832,520	865.08 720,201,245	902.90 751,688,135	- -	1.58%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,006,000	367.06 736,334,282	360.39 722,942,340	- -	1.52%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	24,720	29,337.45 725,221,834	29,205.23 721,953,310	- -	1.52%
14	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	102,900	6,119.25 629,671,448	6,312.02 649,506,858	- -	1.36%
15	HCP INC アメリカ	投資証券	176,570	3,638.54 642,458,075	3,512.44 620,191,619	- -	1.30%
16	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	278,180	2,052.30 570,909,025	2,064.64 574,343,919	- -	1.21%
17	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	64,700	8,273.12 535,271,234	8,713.23 563,746,369	- -	1.18%
18	GGP INC アメリカ	投資証券	219,050	2,605.42 570,717,822	2,513.77 550,641,975	- -	1.16%
19	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	719,270	740.30 532,476,759	691.77 497,571,565	- -	1.04%
20	MID AMERICA アメリカ	投資証券	42,720	12,102.03 516,998,779	11,444.39 488,904,703	- -	1.03%
21	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	34,260	13,155.03 450,691,386	13,286.13 455,183,156	- -	0.96%
22	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	297,610	1,497.37 445,634,947	1,471.14 437,826,273	- -	0.92%

23	UDR INC アメリカ	投資証券	100,590	4,413.72 443,976,704	4,338.96 436,456,187	- -	0.92%
24	SL GREEN アメリカ	投資証券	38,280	11,748.48 449,732,042	11,393.63 436,148,443	- -	0.92%
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	133,790	3,138.23 419,863,855	3,185.80 426,228,784	- -	0.89%
26	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	599,430	730.24 437,732,361	696.16 417,303,984	- -	0.88%
27	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	47,370	8,615.68 408,125,072	8,598.47 407,309,618	- -	0.85%
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	55,040	6,654.75 366,277,545	7,300.75 401,833,610	- -	0.84%
29	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	27,180	13,660.88 371,302,904	14,655.58 398,338,759	- -	0.84%
30	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	160,600	1,948.10 312,865,878	2,252.24 361,710,306	- -	0.76%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	11.17%
投資証券	88.24%
合計	99.42%

(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7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 2.25 01/31/24 アメリカ	国債証券	1,478,690,000	101.82 1,505,602,158	101.23 1,496,937,034	2.250000 2024/1/31	0.83%
2	US T N/B 1.25 11/30/18 アメリカ	国債証券	1,489,725,000	99.87 1,487,907,535	99.94 1,488,965,240	1.250000 2018/11/30	0.82%
3	US T N/B 1.25 10/31/18 アメリカ	国債証券	1,379,375,000	99.88 1,377,747,337	99.97 1,379,043,950	1.250000 2018/10/31	0.76%
4	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,318,682,500	102.65 1,353,706,707	102.59 1,352,875,937	2.375000 2020/12/31	0.75%
5	US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ	国債証券	1,308,751,000	103.41 1,353,471,021	103.35 1,352,607,246	2.625000 2020/11/15	0.75%
6	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,324,200,000	101.70 1,346,751,126	101.53 1,344,579,438	2.125000 2021/12/31	0.74%
7	US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,324,200,000	99.14 1,312,811,880	99.18 1,313,434,254	1.375000 2021/1/31	0.73%
8	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,224,885,000	104.94 1,285,455,563	104.33 1,277,983,764	2.750000 2023/11/15	0.71%
9	US T N/B 0.75 07/15/19 アメリカ	国債証券	1,213,850,000	98.73 1,198,434,105	98.84 1,199,854,309	0.750000 2019/7/15	0.66%
10	US T N/B 1.0 09/15/18 アメリカ	国債証券	1,191,780,000	99.63 1,187,441,920	99.71 1,188,323,838	1.000000 2018/9/15	0.66%
11	US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ	国債証券	1,180,745,000	99.13 1,170,496,133	99.23 1,171,700,493	1.000000 2019/9/30	0.65%
12	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,147,640,000	99.62 1,143,320,989	99.73 1,144,587,277	1.375000 2020/5/31	0.63%
13	US T N/B 2.0 08/31/21 アメリカ	国債証券	1,125,570,000	100.94 1,136,201,560	101.11 1,138,097,594	2.000000 2021/8/31	0.63%
14	US T N/B 1.25 10/31/21 アメリカ	国債証券	1,158,675,000	97.87 1,134,036,603	97.96 1,135,130,724	1.250000 2021/10/31	0.63%
15	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,081,430,000	101.70 1,099,846,752	101.60 1,098,830,208	2.125000 2021/9/30	0.61%
16	US T N/B 0.75 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,103,500,000	99.37 1,096,636,230	99.45 1,097,507,995	0.750000 2018/8/31	0.61%
17	US T N/B 1.0 11/15/19 アメリカ	国債証券	1,103,500,000	99.02 1,092,762,945	99.14 1,094,054,040	1.000000 2019/11/15	0.60%
18	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,103,500,000	98.96 1,092,111,880	98.96 1,092,111,880	1.375000 2021/4/30	0.60%
19	US T N/B 1.125 06/30/21 アメリカ	国債証券	1,103,500,000	97.85 1,079,874,065	97.85 1,079,785,785	1.125000 2021/6/30	0.60%
20	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,031,772,500	103.30 1,065,903,534	103.29 1,065,779,721	2.625000 2020/8/15	0.59%
21	US T N/B 1.625 04/30/23 アメリカ	国債証券	1,081,430,000	98.50 1,065,208,550	98.21 1,062,072,403	1.625000 2023/4/30	0.59%
22	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,037,290,000	99.02 1,027,197,168	99.11 1,028,089,237	1.000000 2019/11/30	0.57%
23	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	1,081,430,000	94.71 1,024,222,353	93.81 1,014,511,111	1.500000 2026/8/15	0.56%

24	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	982,115,000	101.24 994,352,152	101.10 993,006,655	2.000000 2021/11/15	0.55%
25	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	993,150,000	99.65 989,733,564	99.73 990,468,495	1.250000 2019/10/31	0.55%
26	US T N/B 1.5 02/28/19 アメリカ	国債証券	937,975,000	100.28 940,610,709	100.28 940,610,709	1.500000 2019/2/28	0.52%
27	US T N/B 1.125 12/31/19 アメリカ	国債証券	937,975,000	99.25 931,005,845	99.36 932,000,099	1.125000 2019/12/31	0.52%
28	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	882,800,000	105.62 932,422,188	105.50 931,354,000	3.625000 2020/2/15	0.52%
29	US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ	国債証券	904,870,000	100.49 909,321,960	100.32 907,837,973	1.875000 2022/3/31	0.50%
30	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	889,421,000	101.30 901,019,049	101.20 900,182,994	2.000000 2021/5/31	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7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.95%
合計	96.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年7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	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	494,700	3,294.78 1,629,927,859	4,306.82 2,130,585,832	- -	4.20%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	8,522	205,079.64 1,747,688,734	234,501.59 1,998,422,635	- -	3.94%
3	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	98,400	12,479.47 1,227,979,959	17,386.74 1,710,855,806	- -	3.37%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,138,083	688.26 1,471,560,321	777.44 1,662,252,628	- -	3.27%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	38,000	21,008.43 798,320,475	24,169.95 918,458,115	- -	1.81%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,327,530	88.59 649,207,232	91.42 669,890,852	- -	1.32%
7	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	534,000	1,194.19 637,701,330	1,179.14 629,665,299	- -	1.24%
8	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,359,532	356.31 484,422,968	428.87 583,069,286	- -	1.15%
9	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	23,900	19,188.70 458,610,077	24,277.00 580,220,300	- -	1.14%
10	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,399,235	71.09 454,979,565	76.58 490,082,852	- -	0.97%
11	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	131,000	2,574.51 337,261,723	3,088.65 404,613,870	- -	0.80%
12	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,903,200	52.54 362,709,334	53.55 369,684,998	- -	0.73%
13	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	456,500	605.34 276,339,165	808.23 368,959,734	- -	0.73%
14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	281,698	1,360.58 383,274,127	1,307.03 368,188,582	- -	0.72%
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	50,844	4,889.04 248,578,736	6,343.71 322,540,099	- -	0.64%

16	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	112,800	2,403.46 271,110,492	2,758.39 311,147,350	- -	0.61%
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	238,600	1,198.86 286,048,155	1,298.81 309,898,332	- -	0.61%
18	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,534	157,207.74 241,156,674	188,544.00 289,226,496	- -	0.57%
19	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,927,878	84.60 247,719,666	98.67 288,913,924	- -	0.57%
20	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	57,500	3,642.32 209,433,861	4,990.02 286,926,552	- -	0.56%
21	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	268,696	1,027.23 276,014,645	1,048.09 281,618,262	- -	0.55%
22	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	159,700	1,604.15 256,182,792	1,725.41 275,548,855	- -	0.54%
23	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	409,495	636.50 260,643,659	672.89 275,546,319	- -	0.54%
24	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	6,900	29,544.59 203,857,728	34,626.72 238,924,412	- -	0.47%
25	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	652,000	326.89 213,134,545	349.01 227,555,172	- -	0.45%
26	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR ケイマン諸島	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	32,800	5,402.35 177,197,103	6,588.99 216,119,150	- -	0.43%
27	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	6,483	25,990.71 168,497,824	32,160.49 208,496,521	- -	0.41%
28	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	474,700	479.07 227,415,161	427.05 202,722,771	- -	0.40%
29	KB FINANCIAL GROUP INC 韓国	株式 銀行	35,133	4,985.75 175,164,438	5,754.51 202,173,551	- -	0.40%
30	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	13,584	14,312.37 194,419,299	14,680.89 199,425,345	- -	0.39%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年7月31日現在

種類	投資比率
株式	92.34%
投資信託受益証券	0.65%
投資証券	0.22%
合計	93.21%

（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7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.37%
インターネットソフトウェア・サービス		10.03%
石油・ガス・消耗燃料		6.03%
コンピュータ・周辺機器		5.52%
半導体・半導体製造装置		4.95%
無線通信サービス		3.32%
保険		3.32%
金属・鉱業		2.93%
電子装置・機器・部品		2.69%
自動車		2.39%
メディア		2.34%
化学		2.20%
不動産管理・開発		2.18%
コングロマリット		1.71%
各種電気通信サービス		1.62%
食品・生活必需品小売り		1.61%
情報技術サービス		1.55%
食品		1.42%
医薬品		1.27%
各種金融サービス		1.20%
資本市場		1.17%
インターネット販売・通信販売		1.09%
電力		1.04%
運送インフラ		1.01%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.97%
飲料		0.95%
建設資材		0.91%
建設・土木		0.77%
自動車部品		0.74%
パーソナル用品		0.72%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
タバコ		0.66%
家庭用耐久財		0.66%
機械		0.60%
複合小売り		0.59%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.58%
ガス		0.48%
各種消費者サービス		0.48%

ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.45%
繊維・アパレル・贅沢品	0.42%
家庭用品	0.37%
専門小売り	0.35%
紙製品・林産品	0.33%
バイオテクノロジー	0.25%
水道	0.25%
旅客航空輸送業	0.24%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.21%
消費者金融	0.21%
航空宇宙・防衛	0.19%
ソフトウェア	0.19%
電気設備	0.18%
陸運・鉄道	0.17%
商業サービス・用品	0.10%
海運業	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%
総合公益事業	0.07%
航空貨物・物流サービス	0.05%
容器・包装	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
商社・流通業	0.05%
レジャー用品	0.04%
建設関連製品	0.04%
販売	0.04%
通信機器	0.03%
ヘルスケア・テクノロジー	0.03%
合計	92.34%

(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7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	3,260,014,875	121.01 3,945,213,383	120.40 3,925,318,710	7.500000 2030/3/31	4.12%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,533,865,000	99.72 1,529,622,042	99.74 1,530,030,337	4.250000 2025/1/7	1.60%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,169,710,000	120.24 1,406,493,512	122.48 1,432,719,293	5.625000 2050/11/18	1.50%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,412,480,000	99.18 1,400,926,355	100.65 1,421,661,120	4.750000 2044/3/8	1.49%
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,368,340,000	102.44 1,401,765,015	101.87 1,393,996,375	5.000000 2045/6/15	1.46%
6	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	971,080,000	129.75 1,260,068,994	130.65 1,268,716,020	7.350000 2025/7/21	1.33%
7	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	982,115,000	116.33 1,142,539,071	118.74 1,166,261,562	6.050000 2040/1/11	1.22%
8	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,103,500,000	105.10 1,159,831,026	104.87 1,157,295,625	4.750000 2026/5/27	1.21%
9	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,092,465,000	104.23 1,138,745,790	105.40 1,151,458,110	4.000000 2023/10/2	1.21%
10	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	882,800,000	127.61 1,126,571,978	130.28 1,150,111,840	6.700000 2036/1/26	1.21%
11	RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 ロシア	国債証券	1,103,500,000	102.44 1,130,443,276	101.69 1,122,237,430	3.500000 2019/1/16	1.18%
12	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	949,010,000	110.58 1,049,456,087	112.97 1,072,144,047	5.550000 2045/1/21	1.12%
13	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	915,905,000	114.73 1,050,863,050	116.04 1,062,907,752	7.375000 2025/2/5	1.11%
14	TURKEY 7.0 06/05/20 トルコ	国債証券	960,045,000	109.79 1,054,037,157	109.92 1,055,281,464	7.000000 2020/6/5	1.11%
15	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	926,940,000	113.24 1,049,698,636	112.85 1,046,051,790	6.375000 2021/3/29	1.10%
16	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	949,010,000	110.49 1,048,583,219	109.46 1,038,824,306	5.625000 2042/4/4	1.09%
17	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	971,080,000	106.77 1,036,898,257	106.13 1,030,607,204	5.000000 2020/4/29	1.08%
18	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,147,640,000	90.67 1,040,655,675	89.34 1,025,370,434	5.000000 2045/1/27	1.08%

19	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	949,010,000	106.06 1,006,579,595	106.16 1,007,516,466	4.875000 2021/1/22	1.06%
20	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	860,730,000	114.24 983,339,885	115.46 993,798,858	5.750000 2023/11/22	1.04%
21	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	904,870,000	107.82 975,703,223	108.15 978,662,148	4.875000 2023/9/16	1.03%
22	BRAZIL 6.0 04/07/26 ブラジル	国債証券	882,800,000	109.53 967,002,567	109.87 969,976,500	6.000000 2026/4/7	1.02%
23	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	816,590,000	116.14 948,436,180	116.25 949,285,875	6.125000 2041/1/18	1.00%
24	TURKEY 6.875 03/17/36 トルコ	国債証券	838,660,000	110.60 927,619,756	112.97 947,434,202	6.875000 2036/3/17	0.99%
25	TURKEY 4.875 10/09/26 トルコ	国債証券	949,010,000	97.97 929,757,897	99.73 946,514,103	4.875000 2026/10/9	0.99%
26	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 メキシコ	国債証券	904,870,000	104.04 941,506,200	104.60 946,494,020	4.125000 2026/1/21	0.99%
27	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	904,870,000	103.41 935,790,070	103.86 939,807,030	4.125000 2025/1/15	0.99%
28	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	805,555,000	116.20 936,084,152	116.22 936,272,409	6.750000 2022/2/7	0.98%
29	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	573,820,000	159.35 914,404,681	161.38 926,036,454	9.500000 2030/2/2	0.97%
30	BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル	国債証券	871,765,000	107.20 934,574,564	105.93 923,504,252	5.875000 2019/1/15	0.97%

(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7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	95.18%
合計	95.18%

(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7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	-	ユーロ買/円売2017年09月	買建	32,600,000	4,243,868,000	4,227,568,000	6.61%
		イギリス・ポンド買/円売2017年09月	買建	12,800,000	1,881,344,000	1,854,336,000	2.90%
		カナダ・ドル買/円売2017年09月	買建	13,000,000	1,149,590,000	1,148,810,000	1.80%
		アメリカ・ドル買/円売2017年09月	買建	8,900,000	1,013,977,000	980,513,000	1.53%
		オーストラリア・ドル買/円売2017年09月	買建	6,100,000	528,260,000	535,031,000	0.84%
		イギリス・ポンド売/円買2017年09月	売建	60,600,000	8,906,988,000	8,779,122,000	13.74%
		ユーロ売/円買2017年09月	売建	41,600,000	5,415,488,000	5,394,688,000	8.44%
		アメリカ・ドル売/円買2017年09月	売建	45,200,000	5,149,636,000	4,979,684,000	7.79%
		カナダ・ドル売/円買2017年09月	売建	26,400,000	2,334,552,000	2,332,968,000	3.65%
		オーストラリア・ドル売/円買2017年09月	売建	26,400,000	2,286,240,000	2,315,544,000	3.62%

(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7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 2909月	買建	439	7,084,105,636	7,109,605,000	2.41%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成29年7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
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 2909月	買建	256	443,904,000	435,200,000	1.46%

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年7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	-	ユーロ買/円売2017年08月	買建	90,000	11,674,620	11,668,500	0.00%
		イギリス・ポンド買/円売2017年08月	買建	50,000	7,261,340	7,246,500	0.00%
		カナダ・ドル買/円売2017年08月	買建	50,000	4,427,170	4,422,500	0.00%
		オーストラリア・ドル買/円売2017年08月	買建	40,000	3,539,360	3,515,600	0.00%
		アメリカ・ドル売/円買2017年08月	売建	1,300,000	143,440,700	143,442,000	0.05%
		ユーロ売/円買2017年08月	売建	300,000	38,895,120	38,895,000	0.01%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep 17	買建	241	3,233,968,136	3,284,734,654	1.19%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep 17	買建	212	951,829,364	949,909,248	0.35%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep 17	買建	36	381,055,231	380,850,141	0.14%
	モントルオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep 17	買建	13	203,629,612	203,914,453	0.07%
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep 17	買建	12	149,183,880	148,568,580	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7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08月	買建	800,000	88,851,600	88,272,000	0.19%
		オーストラリア・ドル 買/円売2017年0 8月	買建	100,000	8,848,400	8,789,000	0.02%
		シンガポール・ドル 買/円売2017年0 8月	買建	25,000	2,044,325	2,032,750	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2017年08月	買建	21,000	1,859,411	1,857,450	0.00%
		香港・ドル買/円売2 017年08月	買建	70,000	996,100	988,400	0.00%
		ユーロ売/円買201 7年08月	売建	39,000	5,056,357	5,056,350	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7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08月	売建	694,316,700	77,910,628,289	76,603,961,511	42.36%
		ユーロ売/円買2017年08月	売建	561,543,500	72,003,825,040	72,804,114,775	40.26%
		イギリス・ポンド売/円買2017年08月	売建	86,870,800	12,673,796,933	12,590,185,044	6.96%
		オーストラリア・ドル売/円買2017年08月	売建	43,715,300	3,761,509,218	3,841,263,411	2.12%
		カナダ・ドル売/円買2017年08月	売建	41,905,000	3,622,641,154	3,706,497,250	2.05%
		メキシコ・ペソ売/円買2017年08月	売建	245,820,500	1,516,687,903	1,524,087,100	0.84%
		ポーランド・ズロチ売/円買2017年08月	売建	37,902,000	1,146,769,930	1,154,115,900	0.64%
		デンマーク・クローネ売/円買2017年08月	売建	60,204,300	1,038,066,622	1,049,962,992	0.58%
		南アフリカ・ランド売/円買2017年08月	売建	108,374,900	923,267,448	917,935,403	0.51%
		スウェーデン・クローナ売/円買2017年08月	売建	62,132,800	828,018,973	845,006,080	0.47%
		マレーシア・リンギット売/円買2017年08月	売建	25,370,000	666,825,080	654,038,600	0.36%
		シンガポール・ドル売/円買2017年08月	売建	8,019,200	653,839,859	651,960,960	0.36%
		ノルウェー・クローネ売/円買2017年08月	売建	33,191,300	444,902,824	462,022,896	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7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08月	買建	1,650,000	183,075,050	182,061,000	0.36%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 17	買建	578	3,255,026,503	3,394,175,094	6.68%

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年7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08月	買建	700,000	77,745,150	77,238,000	0.08%

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

(注2) 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7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成25年1月11日)	50	50	1.0170	1.0170
第2特定期間末 (平成25年7月11日)	51	51	1.0312	1.0312
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
第11計算期間末 (平成29年7月11日)	59,334	59,493	1.1175	1.1205
平成28年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	-
2月末日	44,560	-	1.1233	-
3月末日	48,740	-	1.1207	-
4月末日	50,707	-	1.1242	-
5月末日	53,967	-	1.1277	-
6月末日	57,742	-	1.1244	-
7月末日	63,917	-	1.1227	-

【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
第11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
第11計算期間	0.0

(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（分配額の額）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（分配額の額。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
第11計算期間	23,156,860,002	4,001,221,708

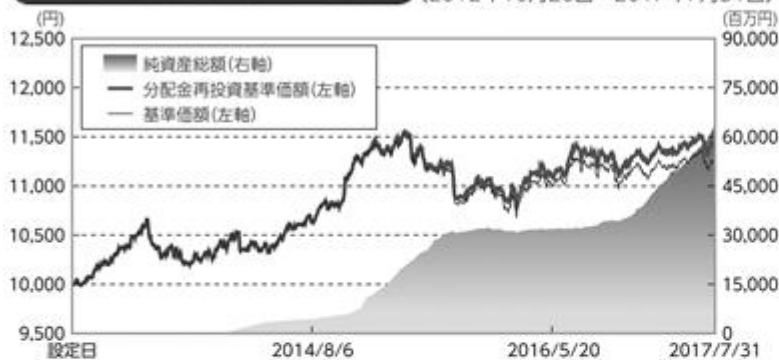
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2017年7月31日

基準価額・純資産の推移

(2012年10月26日～2017年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2012年10月26日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

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
第11期 (2017.07.11)	30円
設定来累計	180円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

※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	24.29%
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	24.26%
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	12.49%
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.59%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.04%
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.75%
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.47%
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.75%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	13.68
為替予約取引(売建)	△37.24

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	83.72
内 日本	83.72
地方債証券	6.32
内 日本	6.32
特殊債券	4.66
内 日本	4.66
社債券	4.76
内 日本	4.70
内 オランダ	0.05
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	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.20%
2	346回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2027/3/20	1.20%
3	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.12%
4	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	1.06%
5	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.06%

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.55
内 日本	97.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.45
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	組入上位5業種(国内株式)	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.14%	1	電気機器	13.08%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.17%	2	輸送用機器	8.48%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.77%	3	情報・通信業	7.80%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.65%	4	銀行業	7.55%
5	三井住友フィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.37%	5	化学	6.89%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.41

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

○委託会社の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。

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※投資比率(%)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	96.95
内 アメリカ	42.11
内 フランス	9.98
内 イタリア	9.65
内 ドイツ	7.13
内 イギリス	6.95
内 その他	21.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.05
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	アメリカ	2.250000	2024/1/31	0.83%
2	US T N/B 1.25 11/30/18	国債証券	アメリカ	1.250000	2018/11/30	0.82%
3	US T N/B 1.25 10/31/18	国債証券	アメリカ	1.250000	2018/10/31	0.76%
4	US T N/B 2.375 12/31/20	国債証券	アメリカ	2.375000	2020/12/31	0.75%
5	US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/11/15	0.75%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△97.77

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	95.48
内 アメリカ	58.23
内 イギリス	6.78
内 カナダ	3.88
内 フランス	3.81
内 ドイツ	3.78
内 その他	19.00
投資信託受益証券	0.29
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.26
内 アメリカ	1.96
内 フランス	0.14
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)	1.97
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	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.24%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.53%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.18%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	1.16%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.02%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	銀行	9.61%
2	石油・ガス・消耗燃料	5.90%
3	医薬品	5.64%
4	保険	4.28%
5	ソフトウェア	3.73%

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)	0.01
為替予約取引(売建)	△0.07
株価指数先物取引(買建)	1.81

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

※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	98.00
内 日本	98.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.00
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	7.38%
2	ジャパニリアルエステイト投資法人	日本	7.01%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	5.74%
4	日本リテールファンド投資法人	日本	5.19%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	4.64%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1.46

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	11.17
内 オーストラリア	7.93
内 シンガポール	3.22
内 カナダ	0.03
投資証券	88.24
内 アメリカ	70.93
内 イギリス	5.47
内 フランス	4.46
内 香港	1.94
内 カナダ	1.82
内 その他	3.62
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	0.58
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	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	4.37%
2	PROLOGIS INC	アメリカ	2.85%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.65%
4	WELLTOWER INC	アメリカ	2.33%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.31%

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)	0.21
為替予約取引(売建)	△0.01

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

○委託会社の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。

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

※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	95.18
内 トルコ	13.19
内 メキシコ	12.39
内 ロシア	10.86
内 インドネシア	10.26
内 ブラジル	9.96
内 その他	38.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.82
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	4.12%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.60%
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.50%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.49%
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.46%

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)	0.08

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

※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	92.34
内 韓国	14.14
内 ケイマン諸島	13.47
内 台湾	11.05
内 中国	8.90
内 インド	8.40
内 その他	36.38
投資信託受益証券	0.65
内 メキシコ	0.65
投資証券	0.22
内 南アフリカ	0.10
内 メキシコ	0.09
内 トルコ	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6.79
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	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	4.20%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.94%
3	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	3.37%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.27%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.81%

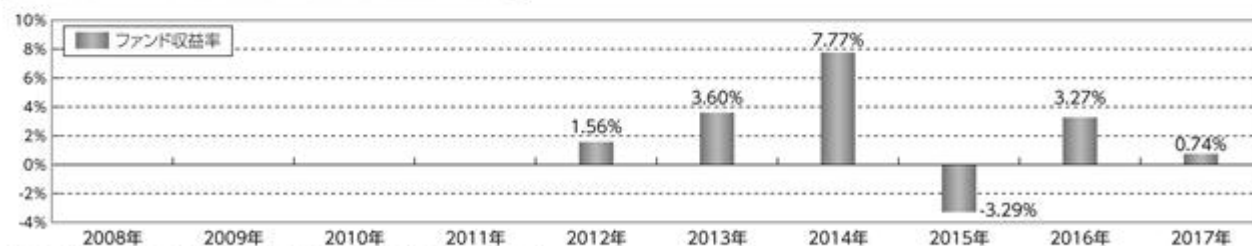
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	銀行	15.37%
2	インターネットソフトウェア・サービス	10.03%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.03%
4	コンピュータ・周辺機器	5.52%
5	半導体・半導体製造装置	4.95%

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)	0.36
株価指数先物取引(買建)	6.68

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※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、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受

益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
公社債等	計算日 における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
株式	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
不動産投資信託証券	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま

す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（２）【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、平成24年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

- イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、受益権口数が10億口を下回るようになった場合、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ.信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八. 関係法人との契約の更改

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

二. 公告

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

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

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

ホ.運用報告書

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3)一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、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11期計算期間(平成29年1月12日から平成29年7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10期 平成29年1月11日現在	第11期 平成29年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,303,443,883	2,548,383,352
親投資信託受益証券	37,302,015,864	57,955,003,393
派生商品評価勘定	53,586,540	242,018,200
流動資産合計	38,659,046,287	60,745,404,945
資産合計		
38,659,046,287		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	85,156,040	847,679,870
未払収益分配金	101,821,531	159,288,446
未払解約金	197,686,634	36,915,212
未払受託者報酬	9,267,541	13,063,375
未払委託者報酬	250,224,929	352,712,115
その他未払費用	833,984	1,164,214
流動負債合計	644,990,659	1,410,823,232
負債合計		
644,990,659		
純資産の部		
元本等		
元本	1 33,940,510,532	1 53,096,148,826
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,073,545,096	6,238,432,887
(分配準備積立金)	506,978,684	555,643,007
元本等合計	38,014,055,628	59,334,581,713
純資産合計		
38,014,055,628		
負債純資産合計		
38,659,046,287		
60,745,404,945		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自	平成28年7月12日 平成29年1月11日	自	平成29年1月12日 平成29年7月11日
営業収益				
受取利息		98		69
有価証券売買等損益		1,006,730,262		952,987,529
為替差損益		688,078,060		596,472,410
営業収益合計		318,652,300		356,515,188
営業費用				
支払利息		1,548,825		729,335
受託者報酬		9,267,541		13,063,375
委託者報酬		250,224,929		352,712,115
その他費用		844,784		1,164,214
営業費用合計		261,886,079		367,669,039
営業利益又は営業損失()		56,766,221		11,153,851
経常利益又は経常損失()		56,766,221		11,153,851
当期純利益又は当期純損失()		56,766,221		11,153,851
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()		10,122,394		14,957,757
期首剰余金又は期首欠損金()		3,478,296,059		4,073,545,096
剰余金増加額又は欠損金減少額		937,831,778		2,829,302,408
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		937,831,778		2,829,302,408
剰余金減少額又は欠損金増加額		307,649,825		479,014,563
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		307,649,825		479,014,563
分配金		1,101,821,531		1,159,288,446
期末剰余金又は期末欠損金()		4,073,545,096		6,238,432,887

(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10期 平成29年1月11日現在	第11期 平成29年7月11日現在
1. 1 期首元本額	28,447,660,191円	33,940,510,532円
期中追加設定元本額	8,018,264,356円	23,156,860,002円
期中一部解約元本額	2,525,414,015円	4,001,221,708円
2. 受益権の総数	33,940,510,532口	53,096,148,826口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日	第11期 自 平成29年1月12日 至 平成29年7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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(252,588,954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(5,857,026,488円)及び分配準備積立金(462,342,499円)より分配対象収益は6,571,957,941円(1万口当たり1,237.75円)であり、うち159,288,446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10期 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日	第11期 自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用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10期 平成29年1月11日現在	第11期 平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第10期 平成29年1月11日現在	第11期 平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	812,624,838	787,408,683
合計	812,624,838	787,408,683

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第10期 平成29年1月11日 現在				第11期 平成29年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	8,977,903,500	-	9,009,473,000	31,569,500	23,245,224,130	-	24,092,904,000	847,679,870
アメリカ・ドル	1,856,795,100	-	1,886,399,000	29,603,900	4,998,255,540	-	5,149,636,000	151,380,460
イギリス・ポンド	3,396,411,780	-	3,345,255,000	51,156,780	8,717,552,300	-	8,906,988,000	189,435,700
オーストラリア・ドル	1,308,312,160	-	1,327,404,000	19,091,840	2,203,969,080	-	2,286,240,000	82,270,920
カナダ・ドル	1,095,629,240	-	1,127,847,000	32,217,760	2,171,733,500	-	2,334,552,000	162,818,500
ユーロ	1,320,755,220	-	1,322,568,000	1,812,780	5,153,713,710	-	5,415,488,000	261,774,290
買 建	-	-	-	-	8,575,020,800	-	8,817,039,000	242,018,200
アメリカ・ドル	-	-	-	-	987,322,000	-	1,013,977,000	26,655,000
イギリス・ポンド	-	-	-	-	1,826,176,000	-	1,881,344,000	55,168,000
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	499,754,700	-	528,260,000	28,505,300
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,083,132,700	-	1,149,590,000	66,457,300
ユーロ	-	-	-	-	4,178,635,400	-	4,243,868,000	65,232,600
合計	8,977,903,500	-	9,009,473,000	31,569,500	31,820,244,930	-	32,909,943,000	605,661,670

（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取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取相場の仲値で評価しております。
 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第10期 平成29年1月11日現在	第11期 平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1200円	1.1175円
(1万口当たり純資産額)	(11,200円)	(11,175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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	2,687,057,437	6,541,372,624	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,584,189,540	14,767,524,825	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1,585,499,146	2,632,879,881	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	745,556,085	2,395,620,812	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,706,179,039	5,542,467,054	
	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	11,111,915,078	14,744,400,116	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3,222,414,209	3,604,592,534	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4,107,030,378	7,726,145,547	
親投資信託受益証券 合計		39,749,840,912	57,955,003,393	
合計		39,749,840,912	57,955,003,393	

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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,742,283,611	8,308,426,899
株式	2	290,967,130,996	290,122,126,356
派生商品評価勘定		48,038,424	65,717,084
未収入金		723,088	22,253,197
未収配当金		382,674,497	336,309,264
流動資産合計		301,140,850,616	298,854,832,800
資産合計		301,140,850,616	298,854,832,800
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,123,328	-
前受金		7,256,000	24,817,800
未払解約金		230,382,000	204,812,000
流動負債合計		240,761,328	229,629,800
負債合計		240,761,328	229,629,800
純資産の部			
元本等			
元本	1	131,210,790,341	122,668,273,869
剰余金			
剰余金又は欠損金()		169,689,298,947	175,956,929,131
元本等合計		300,900,089,288	298,625,203,000
純資産合計		300,900,089,288	298,625,203,000
負債純資産合計		301,140,850,616	298,854,832,800

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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	147,673,783,029円	131,210,790,341円
同期中追加設定元本額	9,639,079,750円	10,379,609,266円
同期中一部解約元本額	26,102,072,438円	18,922,125,738円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	6,264,153,363円	7,006,673,259円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,939,783,051円	1,843,565,480円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,829,084円	5,597,963円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	12,125,194円	11,990,373円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	25,790,682円	22,375,409円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	14,387,127円	8,966,000円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	11,695,488円	11,580,263円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,446,785円	13,936,951円
たわらノーロード TOPIX	- 円	46,143,437円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	37,202,520,698円	36,008,858,667円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	834,342,825円	810,191,291円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,934,010,309円	2,788,293,656円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,972,946,997円	2,873,686,385円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	388,762,191円	364,567,248円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,259,504,097円	1,210,122,602円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,110,130,669円	1,086,132,171円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	59,701,755円	52,752,566円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,326,073,224円	1,206,946,366円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	31,399,302円	25,954,176円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	34,624,546円	37,314,317円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	67,708,056円	82,116,400円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	135,592,368円	156,698,053円

投資のソムリエ	1,657,754,563円	2,687,057,437円
クルーズコントロール	2,114,151,120円	2,214,096,389円
投資のソムリエ<DC年金>	49,029,800円	136,995,504円
DIAM 8資産バランスファン ドN<DC年金>	111,573,577円	139,626,542円
DIAM DC バランス・F (成長型)	117,305,991円	157,708,328円
クルーズコントロール<DC年 金>	834,609円	728,707円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	23,449,979円	16,476,765円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	52,178,275円	41,470,353円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	14,041,767円	44,415,712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	1,946,192円 308,417円	2,128,555円 454,683,015円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	- 円	456,546円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	- 円	456,546円
DIAM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)	297,550,647円	- 円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	89,036,727円	82,861,084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)	221,073,539円	173,481,565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)	420,742,486円	354,034,785円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	28,397,862円	24,122,899円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	123,576,045円	104,399,878円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	30,732,422円	26,973,517円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	34,193,002円	29,124,667円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	1,475,082,939円	56,321,645円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	565,911,402円	100,680,200円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,538,646,735円	1,322,486,695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)	1,345,964,796円	1,213,438,243円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,664,912,196円	3,301,428,688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)	286,143,893円	250,524,274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)	524,618,280円	234,382,934円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	833,834,770円	728,651,510円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	3,287,226,831円	2,876,453,894円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	51,147,517円	31,157,719円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	1,122,253,720円	491,762,989円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	4,941,715,812円	3,817,964,843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)	19,074,904,863円	17,575,455,912円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	705,123,751円	632,594,356円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	2,158,376,756円	1,997,924,602円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	12,087,103,172円	11,250,348,248円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	6,771,701円	5,294,136円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	563,380円	1,959,932円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	5,160,286円	4,519,143円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	10,838,905,774円	10,045,815,761円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	97,767,082円	81,098,112円
D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	34,287,827円	31,594,151円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	37,297,374円	32,623,114円

	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	73,509円	71,462円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	119,094円	117,139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)	621,830,741円	556,068,690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)	1,622,373,744円	1,542,113,531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)	2,159,696,264円	2,030,985,091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)	91,571,301円	88,675,028円
	計	131,210,790,341円	122,668,273,869円
2.	受益権の総数	131,210,790,341口	122,668,273,869口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,456,000,000円	株式 3,131,500,000円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	32,981,281,426	19,828,211,320
合計	32,981,281,426	19,828,211,320

（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29年1月11日まで及び平成29年2月8日から平成29年7月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買建	8,412,448,000	-	8,457,540,000	45,092,000	6,592,670,400	-	6,658,520,000	65,849,600
合計	8,412,448,000	-	8,457,540,000	45,092,000	6,592,670,400	-	6,658,520,000	65,849,600

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.2933円	2.4344円
（1万口当たり純資産額）	(22,933円)	(24,344円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,600	3,140.00	17,584,000	
日本水産	178,200	637.00	113,513,400	
マルハニチロ	26,100	2,914.00	76,055,400	
ハウスイ	12,000	127.00	1,524,000	
カネコ種苗	4,800	1,453.00	6,974,400	
サカタのタネ	20,300	3,485.00	70,745,500	
ホクト	13,900	1,977.00	27,480,300	
ホクリヨウ	1,600	1,053.00	1,684,800	
ショーボンドホールディングス	13,200	5,710.00	75,372,000	
ミライト・ホールディングス	42,100	1,309.00	55,108,900	
タマホーム	10,800	640.00	6,912,000	
サンヨーホームズ	3,200	639.00	2,044,800	
ファーストコーポレーション	3,100	1,100.00	3,410,000	
インベスターズクラウド	1,300	5,760.00	7,488,000	
住石ホールディングス	39,800	101.00	4,019,800	
日鉄鉱業	3,800	6,150.00	23,370,000	
三井松島産業	8,700	1,424.00	12,388,800	
国際石油開発帝石	721,700	1,072.00	773,662,400	
日本海洋掘削	4,800	2,204.00	10,579,200	
石油資源開発	21,700	2,292.00	49,736,400	
K&Oエナジーグループ	9,200	1,781.00	16,385,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,350.00	5,265,000	
安藤・間	99,100	723.00	71,649,300	
東急建設	48,800	904.00	44,115,200	
コムシスホールディングス	53,500	2,315.00	123,852,500	
ミサワホーム	16,200	1,022.00	16,556,400	
ピーアールホールディングス	13,200	394.00	5,200,800	
高松コンストラクショングループ	10,300	2,834.00	29,190,200	
東建コーポレーション	5,100	13,920.00	70,992,000	
ヤマウラ	6,900	968.00	6,679,200	
大成建設	697,000	1,056.00	736,032,000	
大林組	410,900	1,333.00	547,729,700	
清水建設	419,000	1,207.00	505,733,000	
飛鳥建設	133,100	169.00	22,493,900	
長谷工コーポレーション	159,900	1,393.00	222,740,700	
松井建設	15,200	903.00	13,725,600	
銭高組	20,000	459.00	9,180,000	
鹿島建設	602,000	985.00	592,970,000	
不動テトラ	111,100	190.00	21,109,000	
大末建設	5,000	1,044.00	5,220,000	
鉄建建設	84,000	343.00	28,812,000	
西松建設	158,000	630.00	99,540,000	
三井住友建設	524,800	122.00	64,025,600	

大豊建設	50,000	555.00	27,750,000
前田建設工業	90,000	1,348.00	121,320,000
佐田建設	9,300	439.00	4,082,700
ナカノフード建設	10,700	640.00	6,848,000
奥村組	112,000	762.00	85,344,000
東鉄工業	16,500	3,435.00	56,677,500
イチケン	13,000	422.00	5,486,000
浅沼組	45,000	343.00	15,435,000
戸田建設	159,000	741.00	117,819,000
熊谷組	215,000	364.00	78,260,000
青木あすなる建設	8,800	914.00	8,043,200
北野建設	27,000	325.00	8,775,000
植木組	18,000	272.00	4,896,000
三井ホーム	18,000	731.00	13,158,000
矢作建設工業	18,800	934.00	17,559,200
ピーエス三菱	14,600	490.00	7,154,000
日本ハウスホールディングス	27,900	525.00	14,647,500
大東建託	49,600	18,025.00	894,040,000
新日本建設	16,500	956.00	15,774,000
NIPPO	31,000	2,268.00	70,308,000
東亜道路工業	26,000	466.00	12,116,000
前田道路	43,000	2,312.00	99,416,000
日本道路	41,000	612.00	25,092,000
東亜建設工業	11,200	1,762.00	19,734,400
若築建設	80,000	178.00	14,240,000
東洋建設	39,700	456.00	18,103,200
五洋建設	152,400	652.00	99,364,800
世紀東急工業	20,400	600.00	12,240,000
福田組	4,400	5,170.00	22,748,000
日本ドライケミカル	1,700	2,367.00	4,023,900
住友林業	94,200	1,747.00	164,567,400
日本基礎技術	15,600	397.00	6,193,200
日成ビルド工業	41,000	632.00	25,912,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	74,000	92.00	6,808,000
巴コーポレーション	16,800	369.00	6,199,200
パナホーム	26,000	1,199.00	31,174,000
大和ハウス工業	404,700	3,902.00	1,579,139,400
ライト工業	26,300	1,209.00	31,796,700
積水ハウス	419,100	1,990.00	834,009,000
日特建設	11,900	615.00	7,318,500
北陸電気工事	6,700	969.00	6,492,300
ユアテック	21,000	785.00	16,485,000
西部電気工業	2,400	2,401.00	5,762,400
四電工	6,000	578.00	3,468,000
中電工	15,300	3,005.00	45,976,500
関電工	55,000	1,150.00	63,250,000
きんでん	91,100	1,846.00	168,170,600
東京エネシス	14,100	1,069.00	15,072,900
トーエネック	19,000	721.00	13,699,000
住友電設	9,300	1,651.00	15,354,300

日本電設工業	21,000	2,266.00	47,586,000
協和エクシオ	53,600	1,904.00	102,054,400
新日本空調	10,600	1,588.00	16,832,800
日本工営	8,600	3,155.00	27,133,000
N D S	2,100	3,140.00	6,594,000
九電工	26,700	4,325.00	115,477,500
三機工業	29,000	1,257.00	36,453,000
日揮	127,800	1,813.00	231,701,400
中外炉工業	42,000	227.00	9,534,000
ヤマト	12,500	673.00	8,412,500
太平電業	19,000	1,385.00	26,315,000
高砂熱学工業	37,700	1,835.00	69,179,500
三晃金属工業	1,200	3,350.00	4,020,000
N E C ネットエスアイ	13,200	2,567.00	33,884,400
朝日工業社	3,200	3,275.00	10,480,000
明星工業	25,000	689.00	17,225,000
大気社	18,100	2,966.00	53,684,600
ダイダン	19,000	1,560.00	29,640,000
日比谷総合設備	15,000	1,983.00	29,745,000
東芝プラントシステム	22,200	1,852.00	41,114,400
日本製粉	40,600	1,786.00	72,511,600
日清製粉グループ本社	150,200	1,805.00	271,111,000
日東富士製粉	800	3,920.00	3,136,000
昭和産業	56,000	605.00	33,880,000
鳥越製粉	11,100	800.00	8,880,000
中部飼料	15,100	1,451.00	21,910,100
フィード・ワン	83,800	225.00	18,855,000
東洋精糖	23,000	116.00	2,668,000
日本甜菜製糖	7,000	2,142.00	14,994,000
三井製糖	9,700	3,225.00	31,282,500
塩水港精糖	16,300	244.00	3,977,200
日新製糖	5,800	1,886.00	10,938,800
L I F U L L	32,000	937.00	29,984,000
ジェイエシーリクルートメント	8,000	1,877.00	15,016,000
日本M & A センター	37,000	4,115.00	152,255,000
メンバーズ	3,300	687.00	2,267,100
中広	1,400	749.00	1,048,600
タケエイ	11,500	1,087.00	12,500,500
トラスト・テック	5,400	2,367.00	12,781,800
コシダカホールディングス	6,000	3,125.00	18,750,000
パソナグループ	9,700	1,096.00	10,631,200
C D S	3,200	1,339.00	4,284,800
リンクアンドモチベーション	29,800	744.00	22,171,200
G C A	11,600	1,080.00	12,528,000
エス・エム・エス	18,200	3,415.00	62,153,000
パーソルホールディングス	99,100	2,121.00	210,191,100
リニカル	7,600	1,815.00	13,794,000
クックパッド	28,900	922.00	26,645,800
エスクリ	4,700	736.00	3,459,200
アイ・ケイ・ケイ	6,000	796.00	4,776,000

森永製菓	26,800	6,510.00	174,468,000
中村屋	3,200	5,150.00	16,480,000
江崎グリコ	34,300	6,110.00	209,573,000
名糖産業	6,200	1,437.00	8,909,400
不二家	8,000	2,485.00	19,880,000
山崎製パン	100,500	2,225.00	223,612,500
第一屋製パン	2,300	1,218.00	2,801,400
モロゾフ	22,000	653.00	14,366,000
亀田製菓	7,700	5,500.00	42,350,000
寿スピリッツ	13,100	3,620.00	47,422,000
カルビー	56,000	4,370.00	244,720,000
森永乳業	123,000	837.00	102,951,000
六甲バター	6,200	2,583.00	16,014,600
ヤクルト本社	73,500	7,670.00	563,745,000
明治ホールディングス	81,200	8,990.00	729,988,000
雪印メグミルク	29,700	3,200.00	95,040,000
プリマハム	87,000	690.00	60,030,000
日本ハム	96,000	3,340.00	320,640,000
林兼産業	4,600	843.00	3,877,800
丸大食品	66,000	518.00	34,188,000
S Foods	7,400	4,110.00	30,414,000
伊藤ハム米久ホールディングス	79,200	1,016.00	80,467,200
学情	5,500	1,297.00	7,133,500
スタジオアリス	5,300	2,451.00	12,990,300
シミックホールディングス	6,500	1,510.00	9,815,000
システナ	9,800	2,215.00	21,707,000
NJS	3,000	1,368.00	4,104,000
デジタルアーツ	5,400	3,955.00	21,357,000
新日鉄住金ソリューションズ	19,000	2,661.00	50,559,000
総合警備保障	46,600	5,020.00	233,932,000
キューブシステム	5,600	854.00	4,782,400
いちご	115,300	343.00	39,547,900
日本駐車場開発	146,600	165.00	24,189,000
コア	5,200	1,562.00	8,122,400
カカクコム	89,800	1,677.00	150,594,600
アイロムグループ	3,900	1,713.00	6,680,700
ルネサンス	6,800	1,993.00	13,552,400
ディップ	16,700	2,336.00	39,011,200
SBSホールディングス	12,200	876.00	10,687,200
オプトホールディング	9,300	1,426.00	13,261,800
新日本科学	13,900	673.00	9,354,700
ツクイ	31,000	673.00	20,863,000
キャリアデザインセンター	2,800	1,462.00	4,093,600
エムスリー	110,900	3,100.00	343,790,000
ツカダ・グローバルホールディング	9,600	624.00	5,990,400
アウトソーシング	8,300	5,390.00	44,737,000
ウェルネット	9,800	1,343.00	13,161,400
ワールドホールディングス	3,000	2,700.00	8,100,000
ディー・エヌ・エー	57,500	2,639.00	151,742,500
博報堂DYホールディングス	177,200	1,492.00	264,382,400

ぐるなび	18,700	1,848.00	34,557,600
エスアールジータカミヤ	14,300	546.00	7,807,800
ジャパンベストレスキューシステム	16,600	287.00	4,764,200
ファンコミュニケーションズ	32,700	1,004.00	32,830,800
ライク	2,400	3,220.00	7,728,000
WDBホールディングス	4,700	2,269.00	10,664,300
ティア	6,500	787.00	5,115,500
バリューコマース	12,800	704.00	9,011,200
インフォマート	54,500	832.00	45,344,000
サッポロホールディングス	45,000	3,120.00	140,400,000
アサヒグループホールディングス	257,200	4,438.00	1,141,453,600
麒麟ホールディングス	590,100	2,365.50	1,395,881,550
宝ホールディングス	99,300	1,176.00	116,776,800
オエノンホールディングス	37,000	287.00	10,619,000
養命酒製造	4,300	2,099.00	9,025,700
コカ・コーラボトラーズジャパン	86,500	3,345.00	289,342,500
サントリー食品インターナショナル	93,900	5,190.00	487,341,000
ダイドーグループホールディングス	6,300	5,730.00	36,099,000
伊藤園	40,800	4,170.00	170,136,000
キーコーヒー	12,200	2,196.00	26,791,200
ユニカフェ	4,000	982.00	3,928,000
ジャパンフーズ	2,100	1,380.00	2,898,000
日清オイリオグループ	79,000	640.00	50,560,000
不二製油グループ本社	36,700	2,591.00	95,089,700
J-オイルミルズ	6,400	3,920.00	25,088,000
ローソン	38,100	7,350.00	280,035,000
サンエー	9,100	4,685.00	42,633,500
カワチ薬品	9,400	2,689.00	25,276,600
エービーシー・マート	22,000	6,340.00	139,480,000
ハードオフコーポレーション	5,500	1,132.00	6,226,000
高千穂交易	4,900	1,064.00	5,213,600
アスクル	12,700	3,610.00	45,847,000
ゲオホールディングス	20,200	1,193.00	24,098,600
アダストリア	18,600	2,796.00	52,005,600
ジーフット	7,300	802.00	5,854,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,900	779.00	1,480,100
伊藤忠食品	2,900	4,655.00	13,499,500
くらコーポレーション	7,900	5,260.00	41,554,000
キャンドウ	6,500	1,683.00	10,939,500
エレマテック	4,800	1,851.00	8,884,800
パルグループホールディングス	6,200	2,873.00	17,812,600
JALUX	4,000	2,712.00	10,848,000
エディオン	46,900	996.00	46,712,400
あらた	5,500	3,960.00	21,780,000
サーラコーポレーション	15,000	808.00	12,120,000
ワッツ	5,100	1,282.00	6,538,200
トーメンデバイス	1,900	2,206.00	4,191,400
ハローズ	4,000	2,340.00	9,360,000
J Pホールディングス	37,600	292.00	10,979,200
あみやき亭	2,400	4,140.00	9,936,000

東京エレクトロン デバイス	4,200	1,694.00	7,114,800
ひらまつ	17,100	638.00	10,909,800
フィールズ	9,200	1,191.00	10,957,200
双日	711,300	280.00	199,164,000
ゲンキー	4,900	3,250.00	15,925,000
アルフレッサ ホールディングス	142,700	2,136.00	304,807,200
大黒天物産	2,900	5,720.00	16,588,000
ハニーズホールディングス	10,900	1,195.00	13,025,500
ファーマライズホールディングス	3,100	528.00	1,636,800
キッコーマン	95,900	3,575.00	342,842,500
味の素	282,300	2,398.50	677,096,550
キューピー	69,800	2,836.00	197,952,800
ハウス食品グループ本社	50,700	2,847.00	144,342,900
カゴメ	49,300	3,370.00	166,141,000
焼津水産化学工業	6,900	1,193.00	8,231,700
アリアケジャパン	11,300	7,750.00	87,575,000
ピエトロ	1,700	1,633.00	2,776,100
エバラ食品工業	3,300	2,056.00	6,784,800
ニチレイ	63,800	3,265.00	208,307,000
横浜冷凍	28,700	1,071.00	30,737,700
東洋水産	67,400	4,215.00	284,091,000
イトアンド	1,700	2,305.00	3,918,500
日清食品ホールディングス	53,500	6,990.00	373,965,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,391.00	9,737,000
一正蒲鉾	5,000	1,295.00	6,475,000
フジッコ	13,400	2,558.00	34,277,200
ロック・フィールド	13,300	1,845.00	24,538,500
日本たばこ産業	759,400	3,874.00	2,941,915,600
ケンコーマヨネーズ	7,500	3,210.00	24,075,000
わらべや日洋ホールディングス	8,100	2,968.00	24,040,800
なとり	7,000	2,075.00	14,525,000
北の達人コーポレーション	6,200	864.00	5,356,800
ユーグレナ	47,500	1,175.00	55,812,500
片倉工業	16,000	1,288.00	20,608,000
グンゼ	96,000	413.00	39,648,000
ヒューリック	251,700	1,119.00	281,652,300
神栄	18,000	166.00	2,988,000
山下医科器械	1,100	1,781.00	1,959,100
ラサ商事	5,600	984.00	5,510,400
アルペン	9,100	2,008.00	18,272,800
ラクーン	5,600	685.00	3,836,000
クオール	13,700	1,731.00	23,714,700
アルコニックス	6,900	2,042.00	14,089,800
神戸物産	6,500	5,260.00	34,190,000
ジンズ	8,200	5,990.00	49,118,000
ビックカメラ	69,400	1,184.00	82,169,600
DCMホールディングス	73,300	957.00	70,148,100
MonotaRO	42,900	3,655.00	156,799,500
東京一番フーズ	2,400	582.00	1,396,800
ダイヤモンドダイニング	2,800	2,238.00	6,266,400

あい ホールディングス	17,300	3,030.00	52,419,000	
ディービーエックス	4,500	1,276.00	5,742,000	
きちり	3,600	668.00	2,404,800	
アークランドサービスホールディングス	10,200	1,907.00	19,451,400	
J.フロント リテイリング	152,600	1,641.00	250,416,600	
ドトール・日レスホールディングス	21,200	2,424.00	51,388,800	
マツモトキヨシホールディングス	22,800	6,380.00	145,464,000	
ブロンコピリー	6,400	2,617.00	16,748,800	
スタートトゥデイ	110,300	2,716.00	299,574,800	
トレジャー・ファクトリー	3,700	801.00	2,963,700	
物語コーポレーション	3,300	5,670.00	18,711,000	
ココカラファイン	12,600	5,400.00	68,040,000	
三越伊勢丹ホールディングス	240,200	1,113.00	267,342,600	
東洋紡	507,000	213.00	107,991,000	
ユニチカ	354,000	83.00	29,382,000	
富士紡ホールディングス	6,300	3,265.00	20,569,500	
日清紡ホールディングス	67,600	1,160.00	78,416,000	
倉敷紡績	129,000	263.00	33,927,000	
ダイワボウホールディングス	104,000	415.00	43,160,000	
シキボウ	72,000	152.00	10,944,000	
日東紡績	104,000	610.00	63,440,000	
トヨタ紡織	42,800	2,308.00	98,782,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	22,400	1,660.00	37,184,000	
H a m e e	1,900	1,632.00	3,100,800	
ウエルシアホールディングス	31,900	4,100.00	130,790,000	
クリエイトSDホールディングス	17,800	2,760.00	49,128,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,600	889.00	20,091,400	
八洲電機	9,500	834.00	7,923,000	
メディアスホールディングス	1,900	2,913.00	5,534,700	
U K Cホールディングス	7,800	1,899.00	14,812,200	
丸善C H Iホールディングス	14,700	364.00	5,350,800	
O C H Iホールディングス	3,300	1,337.00	4,412,100	
T O K A Iホールディングス	53,200	832.00	44,262,400	
ミサワ	1,800	450.00	810,000	
ティーライフ	1,700	1,690.00	2,873,000	
エー・ピーカンパニー	2,300	886.00	2,037,800	
三洋貿易	6,700	2,624.00	17,580,800	
チムニー	3,400	2,816.00	9,574,400	
シュッピン	4,700	2,075.00	9,752,500	
ビューティガレージ	1,100	1,549.00	1,703,900	
ウイン・パートナーズ	8,800	1,302.00	11,457,600	
ネクステージ	4,400	1,944.00	8,553,600	
ジョイフル本田	19,700	3,160.00	62,252,000	
鳥貴族	4,500	2,550.00	11,475,000	
キリン堂ホールディングス	3,900	1,041.00	4,059,900	
ホットランド	4,900	1,397.00	6,845,300	
すかいらく	52,000	1,680.00	87,360,000	
綿半ホールディングス	4,900	2,474.00	12,122,600	

日本毛織	35,500	924.00	32,802,000
ダイトウボウ	20,000	77.00	1,540,000
トーア紡コーポレーション	5,500	554.00	3,047,000
ダイドーリミテッド	14,500	441.00	6,394,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	39,700	1,111.00	44,106,700
三栄建築設計	4,800	1,806.00	8,668,800
野村不動産ホールディングス	80,600	2,198.00	177,158,800
三重交通グループホールディングス	21,000	389.00	8,169,000
サムティ	10,000	1,335.00	13,350,000
ディア・ライフ	8,800	431.00	3,792,800
日本商業開発	6,900	1,673.00	11,543,700
プレサンスコーポレーション	19,000	1,535.00	29,165,000
ユニゾホールディングス	10,000	2,589.00	25,890,000
THEグローバル社	4,900	557.00	2,729,300
日本管理センター	8,800	1,402.00	12,337,600
サンセイランディック	2,700	775.00	2,092,500
エストラスト	2,400	727.00	1,744,800
フージャースホールディングス	16,000	997.00	15,952,000
オープンハウス	19,700	3,505.00	69,048,500
東急不動産ホールディングス	291,700	660.00	192,522,000
飯田グループホールディングス	100,600	1,879.00	189,027,400
ムゲンエステート	4,000	984.00	3,936,000
帝国繊維	13,500	1,975.00	26,662,500
ブックオフコーポレーション	7,300	791.00	5,774,300
日本コークス工業	107,000	98.00	10,486,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	798.00	3,112,200
ミタチ産業	3,200	777.00	2,486,400
B E E N O S	1,500	1,439.00	2,158,500
あさひ	9,200	1,320.00	12,144,000
日本調剤	4,300	3,540.00	15,222,000
コスモス薬品	6,100	23,050.00	140,605,000
シップヘルスケアホールディングス	23,200	3,415.00	79,228,000
トーエル	6,100	903.00	5,508,300
一六堂	3,300	395.00	1,303,500
ソフトクリエイトホールディングス	6,100	1,469.00	8,960,900
セブン&アイ・ホールディングス	505,100	4,528.00	2,287,092,800
薬王堂	6,100	2,980.00	18,178,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,600	1,024.00	33,382,400
明治電機工業	4,300	1,357.00	5,835,100
ツルハホールディングス	24,200	11,820.00	286,044,000
デリカフーズ	2,900	1,735.00	5,031,500
スターティア	2,600	678.00	1,762,800
サンマルクホールディングス	7,800	3,465.00	27,027,000
フェリシモ	3,600	1,181.00	4,251,600
トリドールホールディングス	14,900	2,881.00	42,926,900
帝人	104,600	2,223.00	232,525,800
東レ	929,100	967.90	899,275,890
クラレ	215,500	2,165.00	466,557,500

旭化成	799,000	1,227.50	980,772,500
サカイオーベックス	3,200	1,797.00	5,750,400
稲葉製作所	6,800	1,445.00	9,826,000
宮地エンジニアリンググループ	38,000	263.00	9,994,000
トーカロ	8,400	3,810.00	32,004,000
アルファ	4,400	2,444.00	10,753,600
SUMCO	133,800	1,753.00	234,551,400
川田テクノロジーズ	2,500	7,680.00	19,200,000
RS Technologies	1,200	4,390.00	5,268,000
ファーストブラザーズ	1,300	1,720.00	2,236,000
ハウズドゥ	2,000	1,696.00	3,392,000
シーアールイー	1,800	1,512.00	2,721,600
ケイアイスター不動産	3,300	2,077.00	6,854,100
住江織物	33,000	277.00	9,141,000
日本フェルト	7,900	508.00	4,013,200
イチカワ	9,000	312.00	2,808,000
エコナックホールディングス	44,000	73.00	3,212,000
日東製網	1,500	1,878.00	2,817,000
芦森工業	29,000	351.00	10,179,000
アツギ	108,000	126.00	13,608,000
コメダホールディングス	22,100	1,840.00	40,664,000
サツドラホールディングス	1,700	1,982.00	3,369,400
ダイユー・リックホールディングス	4,200	814.00	3,418,800
パロックジャパンリミテッド	9,600	1,207.00	11,587,200
クスリのアオキホールディングス	9,600	5,720.00	54,912,000
ダイニック	26,000	190.00	4,940,000
共和レザー	7,500	964.00	7,230,000
スシローグローバルホールディングス	11,000	3,395.00	37,345,000
LIXILピバ	11,600	2,004.00	23,246,400
セーレン	32,000	1,791.00	57,312,000
ソトー	4,800	1,155.00	5,544,000
東海染工	18,000	136.00	2,448,000
小松精練	18,100	720.00	13,032,000
ワコールホールディングス	76,000	1,527.00	116,052,000
ホギメディカル	8,100	7,470.00	60,507,000
レナウン	35,700	159.00	5,676,300
クラウドシア	3,400	654.00	2,223,600
T S Iホールディングス	52,700	816.00	43,003,200
T I S	40,100	3,110.00	124,711,000
ネオス	3,900	502.00	1,957,800
電算システム	4,300	1,775.00	7,632,500
グリー	74,100	938.00	69,505,800
コーエーテクモホールディングス	28,600	2,201.00	62,948,600
三菱総合研究所	4,800	3,305.00	15,864,000
ボルテージ	2,500	1,599.00	3,997,500
電算	1,500	2,200.00	3,300,000
A G S	2,600	1,616.00	4,201,600
ファインデックス	9,100	925.00	8,417,500
ヒト・コミュニケーションズ	2,800	2,084.00	5,835,200
ブレインパッド	1,900	1,300.00	2,470,000

K L a b	23,100	2,139.00	49,410,900
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	8,900	1,533.00	13,643,700
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	1,126.00	2,364,600
ネクソン	132,800	2,197.00	291,761,600
アイスタイル	26,100	824.00	21,506,400
エムアップ	3,500	1,833.00	6,415,500
エイチーム	8,300	2,917.00	24,211,100
テクノスジャパン	9,500	1,136.00	10,792,000
e n i s h	3,700	2,875.00	10,637,500
コロプラ	38,900	1,164.00	45,279,600
モバイルクリエイト	8,600	420.00	3,612,000
オルトプラス	5,000	1,257.00	6,285,000
ブロードリーフ	30,100	712.00	21,431,200
ハーツユニテッドグループ	6,500	1,760.00	11,440,000
メディアドゥ	2,700	2,781.00	7,508,700
ブイキューブ	6,900	610.00	4,209,000
サイバーリンクス	2,000	1,282.00	2,564,000
ディー・エル・イー	3,800	568.00	2,158,400
フィックスターズ	1,800	4,670.00	8,406,000
VOYAGE GROUP	6,100	2,473.00	15,085,300
オブティム	2,200	3,240.00	7,128,000
セレス	2,200	1,551.00	3,412,200
特種東海製紙	7,400	4,045.00	29,933,000
ベリサーブ	1,500	3,440.00	5,160,000
ティーガイア	12,100	2,102.00	25,434,200
日本アジアグループ	14,100	442.00	6,232,200
豆蔵ホールディングス	9,200	1,012.00	9,310,400
テクマトリックス	7,700	1,808.00	13,921,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	253,200	302.00	76,466,400
GMOペイメントゲートウェイ	8,500	6,400.00	54,400,000
ザップラス	7,500	509.00	3,817,500
インターネットイニシアティブ	18,000	2,112.00	38,016,000
さくらインターネット	8,800	911.00	8,016,800
GMOクラウド	2,700	3,755.00	10,138,500
SRAホールディングス	6,400	3,100.00	19,840,000
MINORIソリューションズ	2,700	1,318.00	3,558,600
システムインテグレータ	2,000	794.00	1,588,000
朝日ネット	11,700	516.00	6,037,200
アドソル日進	2,500	1,209.00	3,022,500
フリービット	6,900	923.00	6,368,700
コムチュア	2,100	4,915.00	10,321,500
サイバーコム	1,600	1,079.00	1,726,400
王子ホールディングス	500,000	583.00	291,500,000
日本製紙	57,300	2,246.00	128,695,800
三菱製紙	18,800	791.00	14,870,800
北越紀州製紙	71,600	856.00	61,289,600
中越パルプ工業	51,000	232.00	11,832,000
巴川製紙所	21,000	237.00	4,977,000

大王製紙	51,100	1,474.00	75,321,400
メディカル・データ・ビジョン	4,200	2,720.00	11,424,000
gumi	12,800	1,459.00	18,675,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,800	1,982.00	3,567,600
PCIホールディングス	1,500	2,608.00	3,912,000
パイプドHD	1,800	1,237.00	2,226,600
オープンドア	1,200	3,285.00	3,942,000
LINE	27,100	3,910.00	105,961,000
レンゴー	123,900	654.00	81,030,600
トモク	40,000	392.00	15,680,000
ザ・バック	9,100	3,625.00	32,987,500
オークネット	3,800	1,402.00	5,327,600
AOI TYO HOLDINGS	10,000	1,152.00	11,520,000
マクロミル	15,700	2,616.00	41,071,200
昭和電工	85,300	2,739.00	233,636,700
住友化学	943,000	653.00	615,779,000
住友精化	5,300	5,530.00	29,309,000
日産化学工業	69,300	3,835.00	265,765,500
ラサ工業	51,000	145.00	7,395,000
クレハ	9,700	5,520.00	53,544,000
多木化学	1,600	4,560.00	7,296,000
テイカ	20,000	993.00	19,860,000
石原産業	23,200	1,164.00	27,004,800
片倉コープアグリ	17,000	264.00	4,488,000
日東エフシー	7,500	955.00	7,162,500
日本曹達	77,000	634.00	48,818,000
東ソー	370,000	1,237.00	457,690,000
トクヤマ	199,000	561.00	111,639,000
セントラル硝子	130,000	484.00	62,920,000
東亜合成	79,700	1,430.00	113,971,000
大阪ソーダ	55,000	548.00	30,140,000
関東電化工業	26,400	1,014.00	26,769,600
デンカ	252,000	601.00	151,452,000
イビデン	85,600	1,972.00	168,803,200
信越化学工業	229,700	10,025.00	2,302,742,500
日本カーバイド工業	45,000	182.00	8,190,000
堺化学工業	47,000	435.00	20,445,000
エア・ウォーター	105,500	2,095.00	221,022,500
大陽日酸	98,700	1,254.00	123,769,800
日本化学工業	48,000	238.00	11,424,000
日本パーカライジング	65,300	1,634.00	106,700,200
高圧ガス工業	18,900	842.00	15,913,800
チタン工業	16,000	196.00	3,136,000
四国化成工業	19,000	1,365.00	25,935,000
戸田工業	26,000	297.00	7,722,000
ステラ ケミファ	6,200	3,040.00	18,848,000
保土谷化学工業	4,500	4,640.00	20,880,000
日本触媒	20,100	7,350.00	147,735,000
大日精化工業	53,000	924.00	48,972,000

カネカ	173,000	885.00	153,105,000
協和発酵キリン	153,300	1,997.00	306,140,100
三菱瓦斯化学	119,400	2,500.00	298,500,000
三井化学	582,000	626.00	364,332,000
J S R	128,700	1,966.00	253,024,200
東京応化工業	24,000	3,850.00	92,400,000
大阪有機化学工業	8,500	1,325.00	11,262,500
三菱ケミカルホールディングス	862,700	978.70	844,324,490
K Hネオケム	21,100	2,135.00	45,048,500
ダイセル	172,800	1,431.00	247,276,800
住友ベークライト	113,000	830.00	93,790,000
積水化学工業	285,100	2,020.00	575,902,000
日本ゼオン	108,000	1,256.00	135,648,000
アイカ工業	41,000	3,415.00	140,015,000
宇部興産	645,000	300.00	193,500,000
積水樹脂	19,600	2,063.00	40,434,800
タキロンシーアイ	27,000	587.00	15,849,000
旭有機材	41,000	257.00	10,537,000
日立化成	71,200	3,330.00	237,096,000
ニチパン	13,000	967.00	12,571,000
リケンテクノス	27,600	627.00	17,305,200
大倉工業	31,000	631.00	19,561,000
積水化成品工業	17,500	968.00	16,940,000
群栄化学工業	3,000	3,625.00	10,875,000
タイガースポリマー	6,500	752.00	4,888,000
ミライアル	4,800	1,084.00	5,203,200
ダイキアクシス	4,400	1,025.00	4,510,000
ダイキョーニシカワ	22,500	1,619.00	36,427,500
日本化薬	83,000	1,630.00	135,290,000
カーリットホールディングス	12,000	613.00	7,356,000
E P Sホールディングス	16,300	1,800.00	29,340,000
ソルクシーズ	4,700	808.00	3,797,600
レグス	3,000	786.00	2,358,000
プレステージ・インターナショナル	24,500	1,202.00	29,449,000
フェイス	3,400	1,170.00	3,978,000
アミューズ	7,100	2,936.00	20,845,600
野村総合研究所	90,200	4,360.00	393,272,000
ドリームインキュベータ	4,000	2,175.00	8,700,000
サイバネットシステム	10,100	728.00	7,352,800
クイック	6,700	1,487.00	9,962,900
T A C	7,700	252.00	1,940,400
C Eホールディングス	1,800	1,113.00	2,003,400
ケネディクス	162,100	536.00	86,885,600
電通	142,400	5,240.00	746,176,000
インテージホールディングス	7,000	2,397.00	16,779,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,300	812.00	5,115,600
東邦システムサイエンス	4,300	726.00	3,121,800
ぴあ	4,000	3,760.00	15,040,000
イオンファンタジー	3,800	3,305.00	12,559,000
ソースネクスト	6,800	618.00	4,202,400

シーティーエス	7,100	1,499.00	10,642,900
ネクシィーズグループ	4,700	1,864.00	8,760,800
メディカルシステムネットワーク	14,100	500.00	7,050,000
日本精化	10,800	1,097.00	11,847,600
扶桑化学工業	9,200	3,520.00	32,384,000
A D E K A	54,800	1,683.00	92,228,400
日油	99,000	1,496.00	148,104,000
ミヨシ油脂	4,900	1,432.00	7,016,800
新日本理化	21,600	162.00	3,499,200
ハリマ化成グループ	11,100	1,070.00	11,877,000
花王	319,500	6,661.00	2,128,189,500
第一工業製薬	29,000	526.00	15,254,000
日華化学	4,100	1,182.00	4,846,200
三洋化成工業	8,000	5,330.00	42,640,000
武田薬品工業	480,200	5,706.00	2,740,021,200
アステラス製薬	1,256,900	1,386.50	1,742,691,850
大日本住友製薬	90,700	1,534.00	139,133,800
塩野義製薬	162,500	5,995.00	974,187,500
田辺三菱製薬	149,200	2,619.00	390,754,800
わかもと製薬	7,000	282.00	1,974,000
あすか製薬	14,000	1,674.00	23,436,000
日本新薬	29,400	7,110.00	209,034,000
バイオフェルミン製薬	2,100	3,020.00	6,342,000
中外製薬	127,500	4,350.00	554,625,000
科研製薬	23,900	6,070.00	145,073,000
エーザイ	157,600	6,095.00	960,572,000
理研ビタミン	4,000	4,330.00	17,320,000
ロート製薬	62,800	2,319.00	145,633,200
小野薬品工業	290,900	2,474.50	719,832,050
久光製薬	36,200	5,310.00	192,222,000
有機合成薬品工業	9,400	289.00	2,716,600
持田製薬	8,600	7,890.00	67,854,000
参天製薬	231,600	1,568.00	363,148,800
扶桑薬品工業	4,300	2,719.00	11,691,700
日本ケミファ	1,800	5,160.00	9,288,000
ツムラ	43,000	4,450.00	191,350,000
日医工	30,000	1,745.00	52,350,000
テルモ	187,500	4,370.00	819,375,000
みらかホールディングス	32,600	4,960.00	161,696,000
キッセイ薬品工業	22,700	2,947.00	66,896,900
生化学工業	23,700	1,840.00	43,608,000
栄研化学	10,800	3,485.00	37,638,000
日水製薬	5,200	1,385.00	7,202,000
鳥居薬品	8,800	2,721.00	23,944,800
J C R ファーマ	9,900	2,869.00	28,403,100
東和薬品	5,900	5,190.00	30,621,000
富士製薬工業	4,300	3,825.00	16,447,500
沢井製薬	21,800	6,170.00	134,506,000
ゼリア新薬工業	26,200	2,108.00	55,229,600
第一三共	376,800	2,528.00	952,550,400

キョーリン製薬ホールディングス	31,200	2,437.00	76,034,400
大幸薬品	6,600	2,278.00	15,034,800
ダイト	7,400	2,461.00	18,211,400
大塚ホールディングス	275,400	4,775.00	1,315,035,000
大正製薬ホールディングス	27,400	8,490.00	232,626,000
ペプチドリーム	48,000	3,445.00	165,360,000
大日本塗料	74,000	308.00	22,792,000
日本ペイントホールディングス	98,900	4,310.00	426,259,000
関西ペイント	134,700	2,569.00	346,044,300
神東塗料	10,000	203.00	2,030,000
中国塗料	36,700	880.00	32,296,000
日本特殊塗料	9,100	1,975.00	17,972,500
藤倉化成	17,400	638.00	11,101,200
太陽ホールディングス	10,500	5,120.00	53,760,000
D I C	50,600	4,320.00	218,592,000
サカタイクス	26,200	1,829.00	47,919,800
東洋インキS Cホールディングス	125,000	586.00	73,250,000
T & K T O K A	9,000	1,179.00	10,611,000
アルプス技研	5,200	3,700.00	19,240,000
サニックス	22,000	280.00	6,160,000
ダイオーズ	2,600	1,226.00	3,187,600
日本空調サービス	12,700	692.00	8,788,400
オリエンタルランド	138,100	7,589.00	1,048,040,900
フォーカスシステムズ	5,100	1,298.00	6,619,800
ダスキン	31,400	2,823.00	88,642,200
パーク24	61,400	2,919.00	179,226,600
明光ネットワークジャパン	14,900	1,480.00	22,052,000
ファルコホールディングス	6,300	1,539.00	9,695,700
クレスコ	2,900	3,450.00	10,005,000
フジ・メディア・ホールディングス	125,700	1,515.00	190,435,500
秀英予備校	2,800	455.00	1,274,000
田谷	2,600	669.00	1,739,400
ラウンドワン	40,100	1,144.00	45,874,400
リゾートトラスト	49,500	2,052.00	101,574,000
オービック	41,600	6,970.00	289,952,000
ジャストシステム	19,700	1,635.00	32,209,500
T D C ソフトウェアエンジニアリング	5,500	1,258.00	6,919,000
ヤフー	867,700	496.00	430,379,200
ビー・エム・エル	16,800	2,189.00	36,775,200
ワタベウェディング	2,100	544.00	1,142,400
トレンドマイクロ	64,000	5,780.00	369,920,000
りらいあコミュニケーションズ	21,300	1,219.00	25,964,700
インフォメーション・ディベロプメント	3,700	1,467.00	5,427,900
リソー教育	22,000	811.00	17,842,000
日本オラクル	19,400	7,390.00	143,366,000
早稲田アカデミー	1,900	1,471.00	2,794,900
アルファシステムズ	4,000	2,182.00	8,728,000
フューチャー	16,800	962.00	16,161,600
C A C H o l d i n g s	9,200	1,040.00	9,568,000

ソフトバンク・テクノロジー	6,000	2,031.00	12,186,000
トーセ	3,300	2,893.00	9,546,900
ユー・エス・エス	154,700	2,229.00	344,826,300
オービックビジネスコンサルタント	6,100	6,000.00	36,600,000
伊藤忠テクノソリューションズ	27,400	3,995.00	109,463,000
アイティフォー	16,400	639.00	10,479,600
東京個別指導学院	4,300	1,495.00	6,428,500
東計電算	2,200	2,785.00	6,127,000
サイバーエージェント	77,000	3,630.00	279,510,000
楽天	653,500	1,328.00	867,848,000
エクスネット	2,600	895.00	2,327,000
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,453.00	6,829,100
テー・オー・ダブリュー	10,600	892.00	9,455,200
大塚商会	32,500	6,960.00	226,200,000
総合メディカル	5,900	4,850.00	28,615,000
サイボウズ	16,800	515.00	8,652,000
ソフトブレーン	16,800	499.00	8,383,200
セントラルスポーツ	4,400	4,580.00	20,152,000
バラカ	3,600	2,083.00	7,498,800
電通国際情報サービス	7,500	2,574.00	19,305,000
デジタルガレージ	23,600	2,127.00	50,197,200
イーエムシステムズ	4,200	2,568.00	10,785,600
ウェザーニューズ	4,100	3,495.00	14,329,500
C I J	11,400	566.00	6,452,400
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,751.00	2,451,400
日本エンタープライズ	13,400	274.00	3,671,600
WOWOW	5,900	3,100.00	18,290,000
スカラ	7,800	870.00	6,786,000
フルキャストホールディングス	13,400	1,347.00	18,049,800
富士フイルムホールディングス	254,000	4,143.00	1,052,322,000
コニカミノルタ	286,100	963.00	275,514,300
資生堂	243,100	3,848.00	935,448,800
ライオン	159,100	2,290.00	364,339,000
高砂香料工業	8,400	4,305.00	36,162,000
マンダム	12,800	6,080.00	77,824,000
ミルボン	6,900	6,230.00	42,987,000
ファンケル	27,300	2,099.00	57,302,700
コーセー	20,700	11,960.00	247,572,000
コタ	5,400	1,209.00	6,528,600
シーズ・ホールディングス	16,700	4,070.00	67,969,000
シーボン	1,600	2,466.00	3,945,600
ポーラ・オルビスホールディングス	52,300	2,966.00	155,121,800
ノエビアホールディングス	8,000	5,580.00	44,640,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	952.00	2,665,600
エステー	8,800	2,658.00	23,390,400
アグロ カネショウ	5,200	1,563.00	8,127,600
コニシ	20,100	1,617.00	32,501,700
長谷川香料	16,200	2,311.00	37,438,200
星光P M C	7,200	1,309.00	9,424,800
小林製薬	34,200	6,670.00	228,114,000

荒川化学工業	11,000	1,920.00	21,120,000
メック	10,100	1,373.00	13,867,300
日本高純度化学	3,800	2,467.00	9,374,600
タカラバイオ	36,600	1,572.00	57,535,200
JCU	8,100	4,140.00	33,534,000
新田ゼラチン	8,200	794.00	6,510,800
OATアグリオ	1,600	1,657.00	2,651,200
デクセリアルズ	33,700	1,105.00	37,238,500
アース製薬	9,200	6,270.00	57,684,000
北興化学工業	13,000	522.00	6,786,000
大成ラミック	3,800	2,880.00	10,944,000
クミアイ化学工業	54,500	633.00	34,498,500
日本農薬	30,000	662.00	19,860,000
昭和シェル石油	114,300	1,110.00	126,873,000
富士興産	4,400	521.00	2,292,400
ニチレキ	15,600	1,392.00	21,715,200
ユシロ化学工業	6,900	1,511.00	10,425,900
ピーピー・カストロール	5,300	1,878.00	9,953,400
富士石油	30,300	335.00	10,150,500
MORESCO	4,500	2,182.00	9,819,000
出光興産	60,800	2,836.00	172,428,800
JXTGホールディングス	1,952,100	491.60	959,652,360
コスモエネルギーホールディングス	38,600	1,812.00	69,943,200
横浜ゴム	77,200	2,326.00	179,567,200
東洋ゴム工業	67,700	2,421.00	163,901,700
ブリヂストン	432,200	4,902.00	2,118,644,400
住友ゴム工業	119,800	2,037.00	244,032,600
藤倉ゴム工業	11,100	716.00	7,947,600
オカモト	39,000	1,332.00	51,948,000
アキレス	10,300	1,936.00	19,940,800
フコク	5,200	1,034.00	5,376,800
ニッタ	11,400	3,610.00	41,154,000
クリエートメディック	4,200	990.00	4,158,000
住友理工	23,600	1,168.00	27,564,800
三ツ星ベルト	29,000	1,245.00	36,105,000
バンドー化学	22,900	1,104.00	25,281,600
旭硝子	126,200	4,935.00	622,797,000
日本板硝子	58,400	987.00	57,640,800
石塚硝子	19,000	219.00	4,161,000
有沢製作所	21,700	920.00	19,964,000
日本山村硝子	52,000	185.00	9,620,000
日本電気硝子	52,800	4,075.00	215,160,000
オハラ	5,000	1,245.00	6,225,000
住友大阪セメント	238,000	546.00	129,948,000
太平洋セメント	772,000	417.00	321,924,000
リソルホールディングス	13,000	367.00	4,771,000
日本ヒューム	12,400	721.00	8,940,400
日本コンクリート工業	28,800	431.00	12,412,800
三谷セキサン	6,400	2,766.00	17,702,400
アジアパイルホールディングス	15,900	766.00	12,179,400

東海カーボン	119,700	660.00	79,002,000
日本カーボン	6,300	3,410.00	21,483,000
東洋炭素	7,100	1,950.00	13,845,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,100	3,955.00	28,080,500
TOTO	94,000	4,280.00	402,320,000
日本碍子	161,600	2,255.00	364,408,000
日本特殊陶業	110,400	2,347.00	259,108,800
ダントーホールディングス	11,000	148.00	1,628,000
MARUWA	4,700	4,505.00	21,173,500
品川リフラクトリーズ	32,000	273.00	8,736,000
黒崎播磨	28,000	444.00	12,432,000
ヨータイ	7,000	376.00	2,632,000
イソライト工業	6,800	376.00	2,556,800
東京窯業	16,000	213.00	3,408,000
ニッカトー	4,800	600.00	2,880,000
フジインコーポレーテッド	10,900	2,392.00	26,072,800
エーアンドエーマテリアル	28,000	126.00	3,528,000
ニチアス	67,000	1,403.00	94,001,000
新日鐵住金	577,400	2,641.00	1,524,913,400
神戸製鋼所	221,400	1,225.00	271,215,000
中山製鋼所	14,500	687.00	9,961,500
合同製鐵	7,200	2,324.00	16,732,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	350,000	2,039.00	713,650,000
日新製鋼	41,800	1,268.00	53,002,400
東京製鐵	65,000	986.00	64,090,000
共英製鋼	13,600	1,918.00	26,084,800
大和工業	25,600	3,010.00	77,056,000
東京鐵鋼	27,000	448.00	12,096,000
大阪製鐵	8,000	2,241.00	17,928,000
淀川製鋼所	17,600	3,055.00	53,768,000
東洋鋼鈑	30,600	425.00	13,005,000
丸一鋼管	42,800	3,410.00	145,948,000
モリ工業	4,100	2,256.00	9,249,600
大同特殊鋼	215,000	679.00	145,985,000
日本高周波鋼業	46,000	85.00	3,910,000
日本冶金工業	107,100	241.00	25,811,100
山陽特殊製鋼	76,000	666.00	50,616,000
愛知製鋼	7,500	4,640.00	34,800,000
日立金属	130,300	1,636.00	213,170,800
日本金属	3,200	1,664.00	5,324,800
大平洋金属	83,000	294.00	24,402,000
新日本電工	73,600	414.00	30,470,400
栗本鐵工所	6,100	2,105.00	12,840,500
虹 技	19,000	237.00	4,503,000
日本鑄鉄管	14,000	181.00	2,534,000
日本製鋼所	42,300	1,859.00	78,635,700
三菱製鋼	89,000	282.00	25,098,000
日亜鋼業	18,200	282.00	5,132,400
日本精線	9,000	703.00	6,327,000

大紀アルミニウム工業所	22,000	608.00	13,376,000
日本軽金属ホールディングス	329,600	281.00	92,617,600
三井金属鉱業	349,000	476.00	166,124,000
東邦亜鉛	73,000	469.00	34,237,000
三菱マテリアル	79,900	3,415.00	272,858,500
住友金属鉱山	331,000	1,526.50	505,271,500
DOWAホールディングス	141,000	875.00	123,375,000
古河機械金属	200,000	203.00	40,600,000
エス・サイエンス	58,500	198.00	11,583,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,100	1,767.00	24,914,700
東邦チタニウム	21,800	808.00	17,614,400
UACJ	167,000	320.00	53,440,000
古河電気工業	43,000	5,090.00	218,870,000
住友電気工業	482,200	1,791.50	863,861,300
フジクラ	168,700	984.00	166,000,800
昭和電線ホールディングス	156,000	93.00	14,508,000
東京特殊電線	1,900	2,022.00	3,841,800
タツタ電線	24,400	667.00	16,274,800
沖電線	14,000	273.00	3,822,000
カナレ電気	1,900	2,469.00	4,691,100
平河ヒューテック	6,200	1,521.00	9,430,200
リョービ	74,000	477.00	35,298,000
アーレスティ	15,000	1,148.00	17,220,000
アサヒホールディングス	19,500	1,879.00	36,640,500
東洋製罐グループホールディングス	90,600	1,894.00	171,596,400
ホッカンホールディングス	34,000	427.00	14,518,000
コロナ	6,400	1,162.00	7,436,800
横河ブリッジホールディングス	22,500	1,622.00	36,495,000
OSJBホールディングス	43,000	289.00	12,427,000
駒井ハルテック	2,500	2,220.00	5,550,000
高田機工	12,000	286.00	3,432,000
三和ホールディングス	127,100	1,194.00	151,757,400
文化シャッター	35,700	902.00	32,201,400
三協立山	16,700	1,759.00	29,375,300
アルインコ	8,600	1,115.00	9,589,000
東洋シャッター	3,400	635.00	2,159,000
LIXILグループ	178,400	2,855.00	509,332,000
日本フィルコン	9,800	600.00	5,880,000
ノーリツ	25,000	2,241.00	56,025,000
長府製作所	13,600	2,621.00	35,645,600
リンナイ	21,800	10,270.00	223,886,000
ユニプレス	23,600	2,685.00	63,366,000
ダイニチ工業	6,500	794.00	5,161,000
日東精工	19,000	488.00	9,272,000
三洋工業	17,000	220.00	3,740,000
岡部	26,500	1,038.00	27,507,000
ジーテクト	13,300	2,247.00	29,885,100
中国工業	2,300	752.00	1,729,600
東プレ	24,600	2,990.00	73,554,000
高周波熱錬	23,200	1,029.00	23,872,800

東京製綱	8,800	1,711.00	15,056,800
サンコール	7,100	648.00	4,600,800
モリテックスチール	7,200	295.00	2,124,000
パイオラックス	19,400	3,115.00	60,431,000
エイチワン	9,900	1,225.00	12,127,500
日本発条	120,100	1,241.00	149,044,100
中央発條	15,000	351.00	5,265,000
アドバネクス	2,300	1,656.00	3,808,800
三浦工業	52,400	2,128.00	111,507,200
タクマ	41,100	1,144.00	47,018,400
テクノプロ・ホールディングス	20,900	4,530.00	94,677,000
インターワークス	2,600	1,138.00	2,958,800
Keepers 技研	3,000	1,382.00	4,146,000
ファーストロジック	700	2,608.00	1,825,600
デザインワン・ジャパン	2,300	1,439.00	3,309,700
イー・ガーディアン	6,100	2,280.00	13,908,000
リブセンス	9,100	623.00	5,669,300
ジャパンマテリアル	9,400	1,989.00	18,696,600
ベクトル	10,600	1,777.00	18,836,200
ウチヤマホールディングス	6,300	467.00	2,942,100
サクセスホールディングス	1,100	1,690.00	1,859,000
キャリアリンク	3,100	648.00	2,008,800
IBJ	10,300	759.00	7,817,700
アサンテ	4,900	2,040.00	9,996,000
N・フィールド	6,200	1,498.00	9,287,600
バリューHR	1,300	3,030.00	3,939,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,200	5,060.00	11,132,000
ライドオン・エクスプレス	3,100	1,172.00	3,633,200
E R Iホールディングス	3,700	817.00	3,022,900
アピスト	1,800	4,320.00	7,776,000
ウィルグループ	5,400	1,002.00	5,410,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	3,090.00	8,961,000
日本ビューホテル	1,900	1,436.00	2,728,400
リクルートホールディングス	837,600	1,894.00	1,586,414,400
エラン	1,700	2,680.00	4,556,000
ツガミ	35,000	844.00	29,540,000
オークマ	83,000	1,063.00	88,229,000
東芝機械	76,000	517.00	39,292,000
アマダホールディングス	172,200	1,301.00	224,032,200
アイダエンジニアリング	36,300	1,095.00	39,748,500
滝澤鉄工所	39,000	185.00	7,215,000
富士機械製造	39,200	1,764.00	69,148,800
牧野フライス製作所	64,000	934.00	59,776,000
オーエスジー	58,200	2,339.00	136,129,800
ダイジェット工業	17,000	176.00	2,992,000
旭ダイヤモンド工業	36,000	893.00	32,148,000
D M G 森精機	73,800	1,838.00	135,644,400
ソディック	32,700	1,365.00	44,635,500
ディスコ	15,000	18,960.00	284,400,000
日東工器	7,400	2,629.00	19,454,600

パンチ工業	4,800	1,317.00	6,321,600
富士ダイス	4,700	738.00	3,468,600
日本郵政	332,700	1,432.00	476,426,400
ベルシステム24ホールディングス	19,600	1,141.00	22,363,600
エポラブルアジア	2,400	2,927.00	7,024,800
ソラスト	8,300	1,458.00	12,101,400
豊田自動織機	111,200	6,380.00	709,456,000
豊和工業	7,600	811.00	6,163,600
OKK	48,000	140.00	6,720,000
石川製作所	3,400	1,160.00	3,944,000
東洋機械金属	8,900	812.00	7,226,800
津田駒工業	30,000	180.00	5,400,000
エンシュウ	34,000	118.00	4,012,000
島精機製作所	16,700	5,620.00	93,854,000
NCホールディングス	4,400	868.00	3,819,200
フリー	7,700	1,298.00	9,994,600
ヤマシンフィルタ	2,600	2,187.00	5,686,200
日阪製作所	17,400	979.00	17,034,600
やまびこ	23,500	1,346.00	31,631,000
ペガサスミシン製造	12,700	729.00	9,258,300
ナプテスコ	66,500	3,330.00	221,445,000
三井海洋開発	12,900	2,595.00	33,475,500
レオン自動機	11,000	1,244.00	13,684,000
SMC	38,400	35,350.00	1,357,440,000
新川	10,900	749.00	8,164,100
ホソカワミクロン	4,400	5,300.00	23,320,000
ユニオンツール	5,600	3,200.00	17,920,000
オイレス工業	15,600	2,025.00	31,590,000
日精エー・エス・ビー機械	4,100	3,945.00	16,174,500
サトーホールディングス	15,900	2,680.00	42,612,000
日本エアータック	4,400	849.00	3,735,600
日精樹脂工業	10,400	1,138.00	11,835,200
オカダアイヨン	2,800	1,399.00	3,917,200
ワイエイシイホールディングス	4,900	1,351.00	6,619,900
小松製作所	590,500	2,927.50	1,728,688,750
住友重機械工業	373,000	802.00	299,146,000
日立建機	57,200	2,886.00	165,079,200
日工	3,900	2,240.00	8,736,000
巴工業	5,300	1,810.00	9,593,000
井関農機	13,100	2,259.00	29,592,900
TOWA	10,600	1,746.00	18,507,600
丸山製作所	2,800	1,790.00	5,012,000
北川鉄工所	5,900	2,489.00	14,685,100
シンニッタン	10,500	698.00	7,329,000
ローツェ	6,100	2,592.00	15,811,200
タカキタ	3,600	525.00	1,890,000
クボタ	612,500	1,968.50	1,205,706,250
荏原実業	3,700	1,503.00	5,561,100
東洋エンジニアリング	81,000	277.00	22,437,000
三菱化工機	43,000	257.00	11,051,000

月島機械	24,000	1,271.00	30,504,000
帝国電機製作所	9,500	1,147.00	10,896,500
東京機械製作所	50,000	76.00	3,800,000
新東工業	28,900	1,172.00	33,870,800
澁谷工業	10,700	3,365.00	36,005,500
アイチコーポレーション	18,200	792.00	14,414,400
小森コーポレーション	30,700	1,411.00	43,317,700
鶴見製作所	9,500	1,863.00	17,698,500
住友精密工業	20,000	349.00	6,980,000
酒井重工業	25,000	341.00	8,525,000
荏原製作所	58,000	3,325.00	192,850,000
石井鐵工所	1,900	1,653.00	3,140,700
西島製作所	12,600	1,158.00	14,590,800
北越工業	13,900	1,088.00	15,123,200
千代田化工建設	99,000	647.00	64,053,000
ダイキン工業	166,900	11,765.00	1,963,578,500
オルガノ	24,000	564.00	13,536,000
トーヨーカネツ	59,000	325.00	19,175,000
栗田工業	70,400	3,040.00	214,016,000
椿本チエイン	72,000	1,019.00	73,368,000
大同工業	26,000	321.00	8,346,000
日機装	42,400	1,120.00	47,488,000
木村化工機	11,500	373.00	4,289,500
新興プランテック	27,900	929.00	25,919,100
アネスト岩田	22,200	1,033.00	22,932,600
ダイフク	61,100	3,360.00	205,296,000
サムコ	3,300	934.00	3,082,200
加藤製作所	6,800	3,440.00	23,392,000
油研工業	24,000	228.00	5,472,000
タダノ	64,000	1,351.00	86,464,000
フジテック	35,500	1,509.00	53,569,500
C K D	36,700	1,937.00	71,087,900
キトー	15,500	1,252.00	19,406,000
平和	37,900	2,405.00	91,149,500
理想科学工業	12,100	2,226.00	26,934,600
SANKYO	33,900	3,685.00	124,921,500
日本金銭機械	11,500	1,193.00	13,719,500
マースエンジニアリング	6,800	2,342.00	15,925,600
福島工業	7,600	4,785.00	36,366,000
オーイズミ	5,500	600.00	3,300,000
ダイコク電機	5,100	1,699.00	8,664,900
竹内製作所	22,400	2,033.00	45,539,200
アマノ	37,900	2,406.00	91,187,400
JUKI	19,400	1,668.00	32,359,200
サンデンホールディングス	76,000	330.00	25,080,000
蛇の目ミシン工業	12,100	900.00	10,890,000
ブラザー工業	149,400	2,755.00	411,597,000
マックス	19,000	1,587.00	30,153,000
モリタホールディングス	21,400	1,717.00	36,743,800
グローリー	39,100	3,770.00	147,407,000

新晃工業	11,400	1,801.00	20,531,400
大和冷機工業	19,600	1,266.00	24,813,600
セガサミーホールディングス	121,300	1,450.00	175,885,000
日本ピストンリング	4,900	2,308.00	11,309,200
リケン	5,700	5,290.00	30,153,000
T P R	13,700	3,660.00	50,142,000
ツバキ・ナカシマ	13,800	2,314.00	31,933,200
ホシザキ	35,800	10,260.00	367,308,000
大豊工業	10,000	1,476.00	14,760,000
日本精工	251,300	1,488.00	373,934,400
N T N	283,000	534.00	151,122,000
ジェイテクト	130,100	1,705.00	221,820,500
不二越	123,000	627.00	77,121,000
ミネベアミツミ	222,700	1,850.00	411,995,000
日本トムソン	39,500	610.00	24,095,000
T H K	86,400	3,275.00	282,960,000
ユーシン精機	5,500	2,679.00	14,734,500
前澤給装工業	4,700	1,569.00	7,374,300
イーグル工業	13,300	1,924.00	25,589,200
前澤工業	8,600	322.00	2,769,200
日本ピラー工業	12,500	1,759.00	21,987,500
キッツ	58,800	1,020.00	59,976,000
日立製作所	2,936,000	712.10	2,090,725,600
東芝	2,736,000	250.90	686,462,400
三菱電機	1,304,300	1,673.00	2,182,093,900
富士電機	368,000	615.00	226,320,000
東洋電機製造	5,000	1,680.00	8,400,000
安川電機	141,800	2,433.00	344,999,400
シンフォニア テクノロジー	80,000	469.00	37,520,000
明電舎	113,000	400.00	45,200,000
オリジン電気	18,000	312.00	5,616,000
山洋電気	32,000	1,132.00	36,224,000
デンヨー	11,200	1,977.00	22,142,400
三櫻工業	15,600	817.00	12,745,200
マキタ	159,500	4,260.00	679,470,000
東芝テック	77,000	615.00	47,355,000
芝浦メカトロニクス	20,000	332.00	6,640,000
マブチモーター	34,100	5,720.00	195,052,000
日本電産	158,500	11,580.00	1,835,430,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	1,780.00	5,340,000
東光高岳	6,300	1,702.00	10,722,600
ダブル・スコープ	11,900	2,027.00	24,121,300
宮越ホールディングス	4,500	462.00	2,079,000
ダイヘン	67,000	883.00	59,161,000
田淵電機	19,100	342.00	6,532,200
ヤーマン	1,600	8,450.00	13,520,000
J V C ケンウッド	90,000	329.00	29,610,000
ミマキエンジニアリング	11,200	849.00	9,508,800
第一精工	5,800	2,169.00	12,580,200
日新電機	24,600	1,240.00	30,504,000

大崎電気工業	25,000	886.00	22,150,000
オムロン	130,000	5,060.00	657,800,000
日東工業	17,800	1,786.00	31,790,800
I D E C	16,400	1,464.00	24,009,600
不二電機工業	1,400	1,399.00	1,958,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	235,000	498.00	117,030,000
サクサホールディングス	31,000	225.00	6,975,000
メルコホールディングス	6,700	3,265.00	21,875,500
テクノメディカ	2,800	1,918.00	5,370,400
日本電気	1,680,000	297.00	498,960,000
富士通	1,179,000	837.30	987,176,700
沖電気工業	52,900	1,662.00	87,919,800
岩崎通信機	56,000	87.00	4,872,000
電気興業	35,000	563.00	19,705,000
サンケン電気	72,000	545.00	39,240,000
ナカヨ	13,000	384.00	4,992,000
アイホン	7,000	1,994.00	13,958,000
ルネサスエレクトロニクス	63,500	1,007.00	63,944,500
セイコーエプソン	182,000	2,660.00	484,120,000
ワコム	95,600	364.00	34,798,400
アルバック	20,700	5,620.00	116,334,000
アクセル	5,200	798.00	4,149,600
E I Z O	12,100	4,415.00	53,421,500
ジャパンディスプレイ	229,100	203.00	46,507,300
日本信号	33,800	1,083.00	36,605,400
京三製作所	29,000	605.00	17,545,000
能美防災	13,900	1,671.00	23,226,900
ホーチキ	8,900	1,891.00	16,829,900
エレコム	10,600	2,282.00	24,189,200
日本無線	7,500	1,467.00	11,002,500
パナソニック	1,404,200	1,521.00	2,135,788,200
アンリツ	89,300	1,001.00	89,389,300
富士通ゼネラル	41,600	2,665.00	110,864,000
日立国際電気	32,000	2,672.00	85,504,000
ソニー	863,800	4,439.00	3,834,408,200
T D K	68,900	7,560.00	520,884,000
帝国通信工業	26,000	212.00	5,512,000
タムラ製作所	47,000	539.00	25,333,000
アルプス電気	113,000	3,250.00	367,250,000
池上通信機	40,000	158.00	6,320,000
パイオニア	183,900	219.00	40,274,100
日本電波工業	11,900	911.00	10,840,900
鈴木	4,900	722.00	3,537,800
日本トリム	3,000	4,430.00	13,290,000
ローランド ディー・ジー	6,300	2,736.00	17,236,800
日本コロムビア	3,900	688.00	2,683,200
フォスター電機	14,400	2,005.00	28,872,000
クラリオン	65,000	431.00	28,015,000
S M K	31,000	445.00	13,795,000
ヨコオ	9,000	1,418.00	12,762,000

ティアック	92,000	50.00	4,600,000	
ホシデン	37,200	1,214.00	45,160,800	
ヒロセ電機	19,700	16,000.00	315,200,000	
日本航空電子工業	35,000	1,657.00	57,995,000	
TOA	14,500	1,086.00	15,747,000	
日立マクセル	18,200	2,357.00	42,897,400	
古野電気	15,800	648.00	10,238,400	
ユニデンホールディングス	37,000	288.00	10,656,000	
アルパイン	29,100	1,705.00	49,615,500	
スミダコーポレーション	10,300	2,103.00	21,660,900	
アイコム	6,800	2,569.00	17,469,200	
リオン	4,800	1,804.00	8,659,200	
本多通信工業	3,600	1,715.00	6,174,000	
船井電機	13,700	1,043.00	14,289,100	
横河電機	132,600	1,826.00	242,127,600	
新電元工業	47,000	634.00	29,798,000	
アズビル	37,000	4,285.00	158,545,000	
東亜ディーケーケー	6,300	725.00	4,567,500	
日本光電工業	51,100	2,701.00	138,021,100	
チノー	4,600	1,273.00	5,855,800	
共和電業	14,400	462.00	6,652,800	
日本電子材料	5,100	722.00	3,682,200	
堀場製作所	24,200	6,980.00	168,916,000	
アドバンテスト	83,500	1,972.00	164,662,000	
小野測器	6,200	756.00	4,687,200	
エスベック	10,900	1,747.00	19,042,300	
キーエンス	55,400	49,920.00	2,765,568,000	
日置電機	6,500	2,221.00	14,436,500	
シスメックス	95,100	6,360.00	604,836,000	
日本マイクロニクス	21,400	1,147.00	24,545,800	
メガチップス	11,400	2,780.00	31,692,000	
OBARA GROUP	7,200	6,090.00	43,848,000	
イマジカ・ロボットホールディングス	10,300	723.00	7,446,900	
澤藤電機	8,000	560.00	4,480,000	
デンソー	301,300	4,873.00	1,468,234,900	
コーセル	17,100	1,344.00	22,982,400	
イリソ電子工業	5,100	8,960.00	45,696,000	
新日本無線	9,900	707.00	6,999,300	
オプテックスグループ	9,400	3,585.00	33,699,000	
千代田インテグレ	6,500	2,274.00	14,781,000	
アイ・オー・データ機器	4,000	1,207.00	4,828,000	
レーザーテック	26,900	1,563.00	42,044,700	
スタンレー電気	87,200	3,650.00	318,280,000	
岩崎電気	45,000	208.00	9,360,000	
ウシオ電機	74,200	1,433.00	106,328,600	
岡谷電機産業	7,000	400.00	2,800,000	
ヘリオス テクノホールディング	11,800	781.00	9,215,800	
日本セラミック	10,200	2,669.00	27,223,800	
遠藤照明	6,300	1,181.00	7,440,300	

古河電池	9,000	775.00	6,975,000
双信電機	6,500	303.00	1,969,500
山一電機	11,600	1,763.00	20,450,800
図研	8,100	1,528.00	12,376,800
日本電子	45,000	622.00	27,990,000
カシオ計算機	98,300	1,755.00	172,516,500
ファナック	124,000	22,400.00	2,777,600,000
日本シイエムケイ	26,500	977.00	25,890,500
エンプラス	5,500	3,580.00	19,690,000
大真空	4,600	1,806.00	8,307,600
ローム	59,100	9,020.00	533,082,000
浜松ホトニクス	89,000	3,500.00	311,500,000
三井ハイテック	16,200	1,718.00	27,831,600
新光電気工業	46,000	997.00	45,862,000
京セラ	200,600	6,539.00	1,311,723,400
協栄産業	16,000	186.00	2,976,000
太陽誘電	59,500	1,833.00	109,063,500
村田製作所	128,300	16,925.00	2,171,477,500
ユーシン	16,800	785.00	13,188,000
双葉電子工業	19,900	2,035.00	40,496,500
日東電工	92,400	9,814.00	906,813,600
北陸電気工業	51,000	144.00	7,344,000
東海理化電機製作所	32,200	2,159.00	69,519,800
ニチコン	38,500	1,236.00	47,586,000
日本ケミコン	106,000	457.00	48,442,000
K O A	17,000	2,242.00	38,114,000
三井造船	442,000	161.00	71,162,000
日立造船	97,200	560.00	54,432,000
三菱重工業	2,049,000	456.70	935,778,300
川崎重工業	951,000	342.00	325,242,000
I H I	940,000	391.00	367,540,000
名村造船所	36,700	686.00	25,176,200
サノヤスホールディングス	15,300	262.00	4,008,600
日本車輛製造	45,000	285.00	12,825,000
ニチュ三菱フォークリフト	14,500	791.00	11,469,500
近畿車輛	1,900	2,553.00	4,850,700
F P G	43,400	1,188.00	51,559,200
島根銀行	2,800	1,322.00	3,701,600
じもとホールディングス	87,700	201.00	17,627,700
全国保証	34,100	4,825.00	164,532,500
めぶきフィナンシャルグループ	582,400	440.00	256,256,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	17,500	3,115.00	54,512,500
九州フィナンシャルグループ	198,000	734.00	145,332,000
かんぽ生命保険	45,500	2,553.00	116,161,500
ゆうちょ銀行	341,400	1,467.00	500,833,800
富山第一銀行	30,900	521.00	16,098,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	782,400	578.10	452,305,440
西日本フィナンシャルホールディングス	82,000	1,230.00	100,860,000

日産自動車	1,441,900	1,154.50	1,664,673,550	
いすゞ自動車	354,500	1,417.00	502,326,500	
トヨタ自動車	1,486,600	6,263.00	9,310,575,800	*
日野自動車	174,600	1,267.00	221,218,200	
三菱自動車工業	448,400	738.00	330,919,200	
エフテック	6,700	1,468.00	9,835,600	
レシップホールディングス	4,300	897.00	3,857,100	
G M B	2,100	1,192.00	2,503,200	
ファルテック	2,300	1,425.00	3,277,500	
武蔵精密工業	14,300	3,235.00	46,260,500	
日産車体	53,800	1,110.00	59,718,000	
新明和工業	49,000	966.00	47,334,000	
極東開発工業	24,400	1,848.00	45,091,200	
日信工業	27,200	1,850.00	50,320,000	
トビー工業	10,000	3,385.00	33,850,000	
ティラド	48,000	354.00	16,992,000	
曙ブレーキ工業	57,500	372.00	21,390,000	
タチエス	20,800	2,096.00	43,596,800	
N O K	59,200	2,481.00	146,875,200	
フタバ産業	37,500	1,030.00	38,625,000	
K Y B	137,000	605.00	82,885,000	
市光工業	26,000	887.00	23,062,000	
大同メタル工業	15,500	1,035.00	16,042,500	
プレス工業	64,800	538.00	34,862,400	
ミクニ	15,700	500.00	7,850,000	
太平洋工業	27,600	1,535.00	42,366,000	
ケーヒン	28,100	1,655.00	46,505,500	
河西工業	16,600	1,488.00	24,700,800	
アイシン精機	111,900	6,090.00	681,471,000	
富士機工	12,400	738.00	9,151,200	
マツダ	387,200	1,623.50	628,619,200	
今仙電機製作所	11,300	1,291.00	14,588,300	
本田技研工業	1,100,300	3,104.00	3,415,331,200	
スズキ	242,400	5,258.00	1,274,539,200	
S U B A R U	379,600	4,144.00	1,573,062,400	
安永	4,300	1,477.00	6,351,100	
ヤマハ発動機	172,700	2,966.00	512,228,200	
ショーワ	32,000	1,111.00	35,552,000	
小糸製作所	73,300	5,860.00	429,538,000	
T B K	16,200	519.00	8,407,800	
エクセディ	16,400	3,240.00	53,136,000	
ミツバ	22,500	2,122.00	47,745,000	
豊田合成	39,300	2,763.00	108,585,900	
愛三工業	21,500	937.00	20,145,500	
盟和産業	1,800	1,224.00	2,203,200	
ヨロズ	11,400	1,852.00	21,112,800	
エフ・シー・シー	20,000	2,322.00	46,440,000	
新家工業	29,000	193.00	5,597,000	
シマノ	49,300	18,080.00	891,344,000	
テイ・エス テック	28,400	3,375.00	95,850,000	

ジャムコ	7,200	2,643.00	19,029,600
小野建	10,500	1,752.00	18,396,000
はるやまホールディングス	5,700	1,000.00	5,700,000
ノジマ	18,900	1,742.00	32,923,800
佐島電機	9,000	845.00	7,605,000
カップ・クリエイト	17,200	1,265.00	21,758,000
エコートレーディング	3,200	687.00	2,198,400
伯東	8,400	1,477.00	12,406,800
コンドーテック	9,600	1,015.00	9,744,000
中山福	7,300	802.00	5,854,600
ライトオン	9,300	977.00	9,086,100
ナガイレーベン	16,000	2,593.00	41,488,000
ジーンズメイト	4,600	656.00	3,017,600
三菱食品	13,300	3,200.00	42,560,000
良品計画	16,000	27,320.00	437,120,000
三城ホールディングス	14,300	461.00	6,592,300
松田産業	8,800	1,473.00	12,962,400
第一興商	19,600	5,330.00	104,468,000
メディバルホールディングス	120,600	2,068.00	249,400,800
アドヴァン	12,300	1,128.00	13,874,400
S P K	2,800	2,653.00	7,428,400
萩原電気	4,200	2,260.00	9,492,000
アルビス	3,200	4,775.00	15,280,000
アズワン	9,500	5,370.00	51,015,000
スズデン	4,400	1,296.00	5,702,400
尾家産業	4,400	1,228.00	5,403,200
シモジマ	7,400	1,125.00	8,325,000
ドウシシャ	14,200	2,178.00	30,927,600
小津産業	2,800	2,153.00	6,028,400
コナカ	15,500	595.00	9,222,500
高速	7,400	1,074.00	7,947,600
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,555.00	2,643,500
G - 7ホールディングス	3,700	2,155.00	7,973,500
たけびし	4,300	1,440.00	6,192,000
イオン北海道	11,100	608.00	6,748,800
コジマ	18,400	322.00	5,924,800
ヒマラヤ	3,300	876.00	2,890,800
コーナン商事	17,200	2,090.00	35,948,000
黒田電気	16,400	2,164.00	35,489,600
ネットワンシステムズ	52,400	1,152.00	60,364,800
エコス	4,800	1,207.00	5,793,600
ワタミ	14,400	1,326.00	19,094,400
マルシェ	3,100	824.00	2,554,400
リックス	2,900	1,799.00	5,217,100
システムソフト	22,800	162.00	3,693,600
ドンキホーテホールディングス	78,200	4,175.00	326,485,000
丸文	10,400	814.00	8,465,600
西松屋チェーン	21,400	1,165.00	24,931,000
ゼンショーホールディングス	62,600	2,041.00	127,766,600
ハビネット	10,200	1,958.00	19,971,600

幸楽苑ホールディングス	8,000	1,819.00	14,552,000
ハークスレイ	3,000	1,117.00	3,351,000
橋本総業ホールディングス	2,500	1,663.00	4,157,500
日本ライフライン	13,800	4,945.00	68,241,000
サイゼリヤ	17,900	3,305.00	59,159,500
エクセル	5,300	1,435.00	7,605,500
VTホールディングス	41,100	569.00	23,385,900
マルカキカイ	4,000	1,890.00	7,560,000
アルゴグラフィックス	5,600	2,552.00	14,291,200
魚力	3,900	1,238.00	4,828,200
IDOM	32,700	767.00	25,080,900
日本エム・ディ・エム	9,400	950.00	8,930,000
ポブラ	3,500	584.00	2,044,000
フジ・コーポレーション	1,900	1,989.00	3,779,100
ユナイテッドアローズ	16,100	3,455.00	55,625,500
進和	7,100	2,213.00	15,712,300
エスケイジャパン	2,700	294.00	793,800
ダイトロン	5,700	1,484.00	8,458,800
ハイデイ日高	13,200	2,853.00	37,659,600
シークス	8,700	4,515.00	39,280,500
京都きもの友禅	8,100	930.00	7,533,000
コロワイド	40,200	1,886.00	75,817,200
ピーシーデポコーポレーション	16,300	577.00	9,405,100
田中商事	3,900	737.00	2,874,300
オーハシテクニカ	6,800	1,417.00	9,635,600
壱番屋	8,500	3,810.00	32,385,000
白銅	3,100	1,777.00	5,508,700
トップカルチャー	5,000	497.00	2,485,000
PLANT	2,800	1,221.00	3,418,800
スギホールディングス	26,500	5,470.00	144,955,000
島津製作所	157,400	2,243.00	353,048,200
JMS	23,000	327.00	7,521,000
クボテック	2,800	601.00	1,682,800
長野計器	8,500	777.00	6,604,500
ブイ・テクノロジー	2,500	19,340.00	48,350,000
スター精密	21,500	1,928.00	41,452,000
東京計器	43,000	308.00	13,244,000
愛知時計電機	1,700	3,710.00	6,307,000
インターアクション	4,700	814.00	3,825,800
オーバル	12,400	270.00	3,348,000
東京精密	23,600	3,770.00	88,972,000
マニー	14,900	2,712.00	40,408,800
ニコン	212,900	1,865.00	397,058,500
トプコン	61,600	2,050.00	126,280,000
オリンパス	195,200	4,190.00	817,888,000
理研計器	10,800	2,098.00	22,658,400
SCREENホールディングス	25,100	7,760.00	194,776,000
キヤノン電子	11,100	2,274.00	25,241,400
タムロン	10,900	1,997.00	21,767,300
HOYA	251,600	5,823.00	1,465,066,800

シード	1,600	2,480.00	3,968,000
ノーリツ鋼機	12,300	967.00	11,894,100
エー・アンド・デイ	11,400	463.00	5,278,200
キヤノン	658,100	3,769.00	2,480,378,900
リコー	367,400	982.00	360,786,800
シチズン時計	133,400	826.00	110,188,400
リズム時計工業	49,000	235.00	11,515,000
大研医器	10,800	790.00	8,532,000
メニコン	8,400	3,530.00	29,652,000
スノーピーク	1,600	3,190.00	5,104,000
パラマウントベッドホールディングス	11,700	4,980.00	58,266,000
トランザクション	5,600	1,226.00	6,865,600
S H O B I	5,000	451.00	2,255,000
ニホンフラッシュ	5,300	1,508.00	7,992,400
前田工織	12,300	1,658.00	20,393,400
永大産業	16,000	513.00	8,208,000
アートネイチャー	13,200	723.00	9,543,600
ダンロップスポーツ	7,800	1,125.00	8,775,000
バンダイナムコホールディングス	134,900	4,080.00	550,392,000
アイフィスジャパン	2,400	703.00	1,687,200
共立印刷	21,600	340.00	7,344,000
S H O E I	5,600	3,015.00	16,884,000
フランスベッドホールディングス	15,000	996.00	14,940,000
マーベラス	20,600	1,118.00	23,030,800
パイロットコーポレーション	21,300	4,825.00	102,772,500
萩原工業	3,400	2,963.00	10,074,200
エイベックス・グループ・ホールディングス	22,200	1,453.00	32,256,600
トッパン・フォームズ	21,700	1,221.00	26,495,700
フジシールインターナショナル	27,400	3,045.00	83,433,000
タカラトミー	47,700	1,383.00	65,969,100
廣済堂	12,700	361.00	4,584,700
アーク	53,500	113.00	6,045,500
レック	8,100	2,767.00	22,412,700
タカノ	5,700	1,146.00	6,532,200
プロネクサス	11,600	1,250.00	14,500,000
ホクシン	9,700	194.00	1,881,800
ウッドワン	22,000	286.00	6,292,000
大建工業	8,600	2,547.00	21,904,200
きもと	23,400	264.00	6,177,600
凸版印刷	345,000	1,223.00	421,935,000
大日本印刷	345,000	1,269.00	437,805,000
図書印刷	17,000	506.00	8,602,000
共同印刷	38,000	385.00	14,630,000
日本写真印刷	21,100	2,952.00	62,287,200
光村印刷	3,000	245.00	735,000
藤森工業	9,500	3,335.00	31,682,500
ヴィア・ホールディングス	9,400	967.00	9,089,800
宝印刷	6,200	1,649.00	10,223,800
前澤化成工業	8,400	1,228.00	10,315,200

アシックス	121,500	2,061.00	250,411,500
ツツミ	4,600	2,116.00	9,733,600
JSP	5,900	3,340.00	19,706,000
ニチハ	17,000	4,120.00	70,040,000
エフピコ	11,400	6,070.00	69,198,000
小松ウオール工業	4,200	2,086.00	8,761,200
ヤマハ	82,500	4,025.00	332,062,500
河合楽器製作所	4,900	2,309.00	11,314,100
クリナップ	14,300	899.00	12,855,700
ピジョン	74,000	4,105.00	303,770,000
天馬	8,400	2,152.00	18,076,800
兼松サステック	14,000	236.00	3,304,000
キングジム	10,300	1,065.00	10,969,500
リンテック	29,000	2,747.00	79,663,000
信越ポリマー	25,200	907.00	22,856,400
東リ	30,700	368.00	11,297,600
イトーキ	25,900	933.00	24,164,700
任天堂	75,300	36,060.00	2,715,318,000
三菱鉛筆	20,200	3,115.00	62,923,000
松風	6,500	1,333.00	8,664,500
タカラスタANDARD	25,200	1,884.00	47,476,800
コクヨ	63,500	1,505.00	95,567,500
ナカバヤシ	22,000	323.00	7,106,000
ニフコ	22,400	6,300.00	141,120,000
立川ブラインド工業	5,400	1,314.00	7,095,600
グロープライド	6,100	1,919.00	11,705,900
岡村製作所	42,700	1,025.00	43,767,500
日本バルカー工業	10,000	2,413.00	24,130,000
MUTOHホールディングス	16,000	251.00	4,016,000
伊藤忠商事	884,000	1,732.00	1,531,088,000
丸紅	1,187,700	741.40	880,560,780
スクロール	18,600	376.00	6,993,600
高島	21,000	207.00	4,347,000
ヨンドシーホールディングス	12,200	2,642.00	32,232,400
三陽商会	6,900	1,765.00	12,178,500
長瀬産業	72,100	1,743.00	125,670,300
ナイガイ	49,000	68.00	3,332,000
蝶理	7,700	2,081.00	16,023,700
豊田通商	134,400	3,400.00	456,960,000
オンワードホールディングス	83,000	803.00	66,649,000
三共生興	17,000	395.00	6,715,000
兼松	257,000	237.00	60,909,000
美津濃	66,000	657.00	43,362,000
ツカモトコーポレーション	23,000	128.00	2,944,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	53,000	6,380.00	338,140,000
ルック	24,000	273.00	6,552,000
三井物産	1,090,900	1,609.00	1,755,258,100
日本紙パルプ商事	63,000	438.00	27,594,000
東京エレクトロン	81,600	15,670.00	1,278,672,000

日立ハイテクノロジーズ	41,900	4,525.00	189,597,500
カメイ	15,500	1,550.00	24,025,000
東都水産	2,000	1,871.00	3,742,000
OUGホールディングス	20,000	263.00	5,260,000
スターゼン	5,100	4,690.00	23,919,000
セイコーホールディングス	86,000	478.00	41,108,000
山善	46,200	1,129.00	52,159,800
椿本興業	14,000	438.00	6,132,000
住友商事	759,500	1,497.50	1,137,351,250
日本ユニシス	33,500	1,919.00	64,286,500
内田洋行	5,600	2,830.00	15,848,000
三菱商事	905,700	2,378.00	2,153,754,600
第一実業	28,000	632.00	17,696,000
キャノンマーケティングジャパン	34,400	2,550.00	87,720,000
西華産業	38,000	405.00	15,390,000
佐藤商事	10,600	908.00	9,624,800
菱洋エレクトロ	11,100	1,849.00	20,523,900
東京産業	12,500	451.00	5,637,500
ユアサ商事	11,400	3,415.00	38,931,000
神鋼商事	3,100	2,632.00	8,159,200
小林産業	9,400	323.00	3,036,200
阪和興業	121,000	838.00	101,398,000
カナデン	11,600	1,159.00	13,444,400
菱電商事	19,000	795.00	15,105,000
ニプロ	84,800	1,534.00	130,083,200
フルサト工業	6,600	1,683.00	11,107,800
岩谷産業	133,000	710.00	94,430,000
すてきナイスグループ	53,000	159.00	8,427,000
昭光通商	46,000	99.00	4,554,000
ニチモウ	18,000	177.00	3,186,000
極東貿易	19,000	277.00	5,263,000
イワキ	19,000	464.00	8,816,000
兼松エレクトロニクス	7,600	3,575.00	27,170,000
三愛石油	32,200	1,145.00	36,869,000
稲畑産業	28,700	1,496.00	42,935,200
G S Iクレオス	31,000	142.00	4,402,000
明和産業	11,300	442.00	4,994,600
キムラタン	566,000	7.00	3,962,000
ゴールドウイン	5,400	6,830.00	36,882,000
ユニ・チャーム	259,300	2,841.00	736,671,300
デサント	29,100	1,551.00	45,134,100
キング	5,800	417.00	2,418,600
ワキタ	25,700	1,194.00	30,685,800
ヤマトインターナショナル	8,300	439.00	3,643,700
東邦ホールディングス	38,600	2,161.00	83,414,600
サンゲツ	41,100	1,977.00	81,254,700
ミツウロコグループホールディングス	19,200	720.00	13,824,000
シナネンホールディングス	5,100	2,233.00	11,388,300
伊藤忠エネクス	26,200	969.00	25,387,800
サンリオ	37,200	2,194.00	81,616,800

サンワ テクノス	7,300	1,537.00	11,220,100
リョーサン	16,200	4,335.00	70,227,000
新光商事	13,000	1,403.00	18,239,000
トーホー	5,500	3,030.00	16,665,000
三信電気	13,400	1,452.00	19,456,800
東陽テクニカ	14,000	1,094.00	15,316,000
モスフードサービス	15,800	3,370.00	53,246,000
加賀電子	10,900	2,392.00	26,072,800
三益半導体工業	9,700	1,746.00	16,936,200
ソーダニッカ	13,100	527.00	6,903,700
立花エレテック	8,100	1,542.00	12,490,200
木曽路	14,900	2,700.00	40,230,000
サトレストランシステムズ	14,800	907.00	13,423,600
千趣会	21,300	794.00	16,912,200
タカキュー	10,700	197.00	2,107,900
ケーヨー	20,800	836.00	17,388,800
上新電機	28,000	1,551.00	43,428,000
日本瓦斯	22,200	3,605.00	80,031,000
ロイヤルホールディングス	19,800	2,571.00	50,905,800
東天紅	10,000	203.00	2,030,000
いなげや	13,400	1,850.00	24,790,000
島忠	31,100	2,678.00	83,285,800
チヨダ	14,200	3,020.00	42,884,000
ライフコーポレーション	9,100	3,000.00	27,300,000
リンガーハット	13,100	2,429.00	31,819,900
さが美	11,000	122.00	1,342,000
MR MAX	15,300	548.00	8,384,400
テナアライド	12,500	398.00	4,975,000
AOKIホールディングス	23,800	1,457.00	34,676,600
オークワ	17,000	1,261.00	21,437,000
コメリ	18,600	2,889.00	53,735,400
青山商事	25,200	4,015.00	101,178,000
しまむら	14,000	13,630.00	190,820,000
はせがわ	4,800	478.00	2,294,400
高島屋	202,000	1,025.00	207,050,000
松屋	26,400	991.00	26,162,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	61,700	1,942.00	119,821,400
近鉄百貨店	45,000	350.00	15,750,000
パルコ	11,300	1,314.00	14,848,200
丸井グループ	127,100	1,577.00	200,436,700
クレディセゾン	91,700	2,200.00	201,740,000
アクシアル リテイリング	9,300	4,235.00	39,385,500
井筒屋	7,000	432.00	3,024,000
イオン	496,400	1,718.50	853,063,400
イズミ	21,800	6,120.00	133,416,000
東武ストア	1,500	3,065.00	4,597,500
フォーバル	5,500	760.00	4,180,000
平和堂	24,400	2,312.00	56,412,800
フジ	13,400	2,703.00	36,220,200
ヤオコー	13,700	4,740.00	64,938,000

ゼビオホールディングス	16,300	2,025.00	33,007,500
ケースホールディングス	51,000	2,153.00	109,803,000
PALTAC	19,300	3,860.00	74,498,000
三谷産業	12,900	419.00	5,405,100
Olympicグループ	7,300	598.00	4,365,400
日産東京販売ホールディングス	18,000	438.00	7,884,000
新生銀行	1,151,000	192.00	220,992,000
あおぞら銀行	764,000	438.00	334,632,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,146,600	751.40	6,872,755,240
りそなホールディングス	1,412,500	602.30	850,748,750
三井住友トラスト・ホールディングス	251,900	4,027.00	1,014,401,300
三井住友フィナンシャルグループ	966,300	4,378.00	4,230,461,400
第四銀行	148,000	520.00	76,960,000
北越銀行	13,100	2,682.00	35,134,200
千葉銀行	466,000	835.00	389,110,000
群馬銀行	268,400	669.00	179,559,600
武蔵野銀行	19,300	3,435.00	66,295,500
千葉興業銀行	34,100	597.00	20,357,700
筑波銀行	51,400	338.00	17,373,200
七十七銀行	189,000	564.00	106,596,000
青森銀行	94,000	393.00	36,942,000
秋田銀行	77,000	323.00	24,871,000
山形銀行	68,000	499.00	33,932,000
岩手銀行	7,900	4,565.00	36,063,500
東邦銀行	108,000	396.00	42,768,000
東北銀行	65,000	152.00	9,880,000
みちのく銀行	63,000	184.00	11,592,000
ふくおかフィナンシャルグループ	490,000	543.00	266,070,000
静岡銀行	318,000	1,040.00	330,720,000
十六銀行	162,000	370.00	59,940,000
スルガ銀行	123,500	2,796.00	345,306,000
八十二銀行	232,900	734.00	170,948,600
山梨中央銀行	75,000	465.00	34,875,000
大垣共立銀行	165,000	324.00	53,460,000
福井銀行	104,000	272.00	28,288,000
北國銀行	128,000	428.00	54,784,000
清水銀行	4,200	3,630.00	15,246,000
富山銀行	2,400	4,190.00	10,056,000
滋賀銀行	113,000	593.00	67,009,000
南都銀行	12,000	3,205.00	38,460,000
百五銀行	109,000	456.00	49,704,000
京都銀行	216,000	1,079.00	233,064,000
紀陽銀行	45,400	1,995.00	90,573,000
三重銀行	5,500	2,527.00	13,898,500
ほくほくフィナンシャルグループ	80,300	1,871.00	150,241,300
広島銀行	356,000	490.00	174,440,000
山陰合同銀行	71,600	918.00	65,728,800
中国銀行	85,700	1,712.00	146,718,400
鳥取銀行	4,000	1,692.00	6,768,000
伊予銀行	172,300	939.00	161,789,700

百十四銀行	133,000	374.00	49,742,000
四国銀行	94,000	301.00	28,294,000
阿波銀行	103,000	755.00	77,765,000
大分銀行	69,000	427.00	29,463,000
宮崎銀行	81,000	368.00	29,808,000
佐賀銀行	75,000	262.00	19,650,000
十八銀行	75,000	306.00	22,950,000
沖縄銀行	11,700	4,530.00	53,001,000
琉球銀行	25,000	1,631.00	40,775,000
セブン銀行	453,000	418.00	189,354,000
みずほフィナンシャルグループ	16,386,800	205.00	3,359,294,000
高知銀行	47,000	125.00	5,875,000
山口フィナンシャルグループ	113,000	1,367.00	154,471,000
アクリーティブ	10,500	404.00	4,242,000
芙蓉総合リース	13,800	6,500.00	89,700,000
興銀リース	22,600	2,659.00	60,093,400
東京センチュリー	24,200	4,775.00	115,555,000
SBIホールディングス	136,400	1,564.00	213,329,600
日本証券金融	52,800	569.00	30,043,200
アイフル	203,300	395.00	80,303,500
日本アジア投資	12,100	432.00	5,227,200
ポケットカード	9,400	775.00	7,285,000
長野銀行	4,100	1,981.00	8,122,100
名古屋銀行	9,700	4,185.00	40,594,500
北洋銀行	197,200	395.00	77,894,000
愛知銀行	4,100	6,270.00	25,707,000
第三銀行	7,100	1,720.00	12,212,000
中京銀行	5,000	2,312.00	11,560,000
大光銀行	43,000	237.00	10,191,000
愛媛銀行	14,700	1,421.00	20,888,700
トマト銀行	4,900	1,553.00	7,609,700
みなと銀行	11,000	2,111.00	23,221,000
京葉銀行	97,000	483.00	46,851,000
関西アーバン銀行	17,000	1,350.00	22,950,000
栃木銀行	66,800	472.00	31,529,600
北日本銀行	3,900	3,155.00	12,304,500
東和銀行	229,000	124.00	28,396,000
福島銀行	136,000	88.00	11,968,000
大東銀行	65,000	163.00	10,595,000
リコーリース	9,500	3,900.00	37,050,000
イオンフィナンシャルサービス	77,200	2,405.00	185,666,000
アコム	243,300	501.00	121,893,300
ジャックス	67,000	541.00	36,247,000
オリエントコーポレーション	260,900	193.00	50,353,700
日立キャピタル	28,400	2,752.00	78,156,800
アプラスフィナンシャル	60,100	109.00	6,550,900
オリックス	854,700	1,793.00	1,532,477,100
三菱UFJリース	305,900	612.00	187,210,800
ジャフコ	20,200	4,580.00	92,516,000
トモニホールディングス	99,600	539.00	53,684,400

大和証券グループ本社	1,096,000	672.90	737,498,400	
野村ホールディングス	2,468,100	669.80	1,653,133,380	
岡三証券グループ	102,000	745.00	75,990,000	
丸三証券	38,400	931.00	35,750,400	
東洋証券	44,000	254.00	11,176,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	137,800	640.00	88,192,000	
光世証券	30,000	162.00	4,860,000	
水戸証券	38,300	311.00	11,911,300	
いちよし証券	27,100	941.00	25,501,100	
松井証券	68,600	939.00	64,415,400	
SOMPOホールディングス	252,400	4,440.00	1,120,656,000	
だいがく証券ビジネス	6,200	614.00	3,806,800	
日本取引所グループ	375,300	1,988.00	746,096,400	
マネックスグループ	128,300	307.00	39,388,100	
カブドットコム証券	89,600	388.00	34,764,800	
極東証券	16,100	1,635.00	26,323,500	
岩井コスモホールディングス	11,500	1,259.00	14,478,500	
藍澤證券	22,900	679.00	15,549,100	
フィデアホールディングス	120,100	183.00	21,978,300	
池田泉州ホールディングス	128,200	458.00	58,715,600	
アニコムホールディングス	8,300	2,620.00	21,746,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	360,700	3,890.00	1,403,123,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	115,600	2,019.00	233,396,400	
マネーパートナーズグループ	15,800	509.00	8,042,200	
小林洋行	4,300	272.00	1,169,600	
第一生命ホールディングス	727,900	2,067.50	1,504,933,250	
東京海上ホールディングス	486,000	4,807.00	2,336,202,000	
イー・ギャランティ	3,700	2,591.00	9,586,700	
アサックス	2,300	1,663.00	3,824,900	
NECキャピタルソリューション	4,800	1,787.00	8,577,600	
T&Dホールディングス	440,000	1,731.50	761,860,000	
アドバンスクリエイト	3,000	1,961.00	5,883,000	
三井不動産	639,900	2,596.00	1,661,180,400	
三菱地所	897,800	2,045.50	1,836,449,900	
平和不動産	22,900	1,757.00	40,235,300	
東京建物	140,100	1,452.00	203,425,200	
ダイビル	31,100	1,153.00	35,858,300	
京阪神ビルディング	19,800	688.00	13,622,400	
住友不動産	289,000	3,434.00	992,426,000	
太平洋興発	53,000	105.00	5,565,000	
大京	224,000	233.00	52,192,000	
テーオーシー	46,900	1,035.00	48,541,500	
東京楽天地	20,000	596.00	11,920,000	
レオパレス21	152,200	739.00	112,475,800	
スターツコーポレーション	16,400	2,660.00	43,624,000	
フジ住宅	15,600	747.00	11,653,200	
空港施設	14,300	618.00	8,837,400	

明和地所	7,000	827.00	5,789,000
ゴールドクレスト	10,900	2,455.00	26,759,500
リログループ	64,100	2,146.00	137,558,600
日本エスリード	4,900	1,860.00	9,114,000
日神不動産	14,500	590.00	8,555,000
日本エスコン	16,700	490.00	8,183,000
タカラレーベン	52,200	500.00	26,100,000
サンヨーハウジング名古屋	6,400	1,121.00	7,174,400
イオンモール	77,700	2,092.00	162,548,400
ファースト住建	4,500	1,577.00	7,096,500
ランド	64,400	17.00	1,094,800
東祥	3,700	5,220.00	19,314,000
トーセイ	17,000	795.00	13,515,000
穴吹興産	1,400	2,937.00	4,111,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	75,100	1,089.00	81,783,900
サンフロンティア不動産	13,100	1,142.00	14,960,200
エフ・ジェー・ネクスト	10,900	850.00	9,265,000
インテリックス	3,800	840.00	3,192,000
ランドビジネス	8,000	294.00	2,352,000
グランディハウス	11,100	426.00	4,728,600
東武鉄道	653,000	608.00	397,024,000
相鉄ホールディングス	195,000	558.00	108,810,000
東京急行電鉄	664,000	847.00	562,408,000
京浜急行電鉄	335,000	1,331.00	445,885,000
小田急電鉄	195,800	2,219.00	434,480,200
京王電鉄	341,000	932.00	317,812,000
京成電鉄	91,600	2,974.00	272,418,400
富士急行	34,000	1,168.00	39,712,000
新京成電鉄	16,000	417.00	6,672,000
東日本旅客鉄道	236,500	10,885.00	2,574,302,500
西日本旅客鉄道	117,700	8,037.00	945,954,900
東海旅客鉄道	101,700	17,915.00	1,821,955,500
西武ホールディングス	168,900	2,014.00	340,164,600
鴻池運輸	17,400	1,529.00	26,604,600
西日本鉄道	146,000	497.00	72,562,000
ハマキョウレックス	8,000	2,759.00	22,072,000
サカイ引越センター	5,700	4,375.00	24,937,500
近鉄グループホールディングス	1,230,000	431.00	530,130,000
阪急阪神ホールディングス	154,400	4,020.00	620,688,000
南海電気鉄道	259,000	573.00	148,407,000
京阪ホールディングス	274,000	708.00	193,992,000
神戸電鉄	31,000	392.00	12,152,000
名古屋鉄道	446,000	518.00	231,028,000
山陽電気鉄道	45,000	566.00	25,470,000
トランコム	3,600	5,480.00	19,728,000
日本通運	454,000	706.00	320,524,000
ヤマトホールディングス	218,800	2,249.00	492,081,200
山九	160,000	758.00	121,280,000
日新	50,000	539.00	26,950,000
丸運	6,500	286.00	1,859,000

丸全昭和運輸	40,000	458.00	18,320,000
センコーグループホールディングス	56,400	739.00	41,679,600
トナミホールディングス	25,000	444.00	11,100,000
ニッコンホールディングス	41,200	2,555.00	105,266,000
日本石油輸送	1,400	2,685.00	3,759,000
福山通運	73,000	727.00	53,071,000
セイノーホールディングス	86,500	1,510.00	130,615,000
神奈川中央交通	14,000	735.00	10,290,000
日立物流	25,500	2,608.00	66,504,000
丸和運輸機関	3,100	4,010.00	12,431,000
C & F ロジホールディングス	12,800	1,324.00	16,947,200
日本郵船	1,034,000	221.00	228,514,000
商船三井	641,000	360.00	230,760,000
川崎汽船	465,000	281.00	130,665,000
NSユナイテッド海運	56,000	238.00	13,328,000
明治海運	11,400	416.00	4,742,400
飯野海運	63,400	511.00	32,397,400
共栄タンカー	11,000	217.00	2,387,000
九州旅客鉄道	121,600	3,625.00	440,800,000
日本航空	214,800	3,546.00	761,680,800
ANAホールディングス	2,269,000	390.00	884,910,000
パスコ	12,000	399.00	4,788,000
三菱倉庫	80,000	1,464.00	117,120,000
三井倉庫ホールディングス	71,000	310.00	22,010,000
住友倉庫	89,000	710.00	63,190,000
澁澤倉庫	31,000	369.00	11,439,000
ヤマタネ	6,300	1,654.00	10,420,200
東陽倉庫	22,200	299.00	6,637,800
乾汽船	9,200	840.00	7,728,000
日本トランスシティ	28,000	452.00	12,656,000
ケイヒン	23,000	161.00	3,703,000
中央倉庫	7,300	1,076.00	7,854,800
安田倉庫	8,800	751.00	6,608,800
東洋埠頭	37,000	186.00	6,882,000
宇徳	9,800	466.00	4,566,800
上組	146,000	1,188.00	173,448,000
サンリツ	1,700	700.00	1,190,000
キムラユニティー	3,200	1,165.00	3,728,000
キューソー流通システム	3,900	2,790.00	10,881,000
郵船ロジスティクス	11,400	1,009.00	11,502,600
近鉄エクスプレス	21,800	1,892.00	41,245,600
東海運	7,200	426.00	3,067,200
エーアイティー	7,700	1,026.00	7,900,200
内外トランスライン	3,800	1,299.00	4,936,200
東京放送ホールディングス	79,600	1,905.00	151,638,000
日本テレビホールディングス	110,300	1,813.00	199,973,900
朝日放送	11,700	811.00	9,488,700
テレビ朝日ホールディングス	33,100	1,921.00	63,585,100
スカパーJ S A Tホールディングス	78,800	476.00	37,508,800
テレビ東京ホールディングス	10,000	2,232.00	22,320,000

日本BS放送	2,800	1,255.00	3,514,000
ビジョン	2,800	2,515.00	7,042,000
U-NEXT	3,300	1,120.00	3,696,000
ワイヤレスゲート	4,100	1,470.00	6,027,000
コネクシオ	10,700	1,987.00	21,260,900
日本通信	102,900	166.00	17,081,400
クロップス	1,400	596.00	834,400
日本電信電話	968,800	5,305.00	5,139,484,000
KDDI	1,178,900	2,929.00	3,452,998,100
光通信	14,500	11,620.00	168,490,000
NTTドコモ	888,300	2,641.00	2,346,000,300
エムティーアイ	16,500	713.00	11,764,500
GMOインターネット	44,400	1,411.00	62,648,400
カドカワ	35,200	1,406.00	49,491,200
学研ホールディングス	4,100	3,275.00	13,427,500
ゼンリン	16,100	3,250.00	52,325,000
昭文社	6,900	734.00	5,064,600
インプレスホールディングス	11,100	141.00	1,565,100
東京電力ホールディングス	1,037,800	461.00	478,425,800
中部電力	402,800	1,455.00	586,074,000
関西電力	499,200	1,470.00	733,824,000
中国電力	168,500	1,224.00	206,244,000
北陸電力	119,800	990.00	118,602,000
東北電力	305,500	1,501.00	458,555,500
四国電力	110,300	1,295.00	142,838,500
九州電力	270,200	1,322.00	357,204,400
北海道電力	114,500	859.00	98,355,500
沖縄電力	19,900	2,668.00	53,093,200
電源開発	97,300	2,721.00	264,753,300
エフオン	5,300	1,012.00	5,363,600
イーレックス	15,600	1,015.00	15,834,000
東京瓦斯	1,311,000	577.20	756,709,200
大阪瓦斯	1,186,000	446.90	530,023,400
東邦瓦斯	305,000	790.00	240,950,000
北海道瓦斯	31,000	273.00	8,463,000
広島ガス	25,300	355.00	8,981,500
西部瓦斯	137,000	269.00	36,853,000
静岡ガス	37,500	760.00	28,500,000
メタウォーター	6,900	3,090.00	21,321,000
アイネット	7,000	1,334.00	9,338,000
松竹	80,000	1,397.00	111,760,000
東宝	78,900	3,405.00	268,654,500
エイチ・アイ・エス	20,900	3,360.00	70,224,000
東映	45,000	1,077.00	48,465,000
ラックランド	2,200	2,060.00	4,532,000
エヌ・ティ・ティ・データ	373,000	1,244.00	464,012,000
共立メンテナンス	20,700	3,255.00	67,378,500
イチネンホールディングス	13,100	1,221.00	15,995,100
建設技術研究所	8,400	1,151.00	9,668,400
スペース	6,700	1,459.00	9,775,300

アインホールディングス	15,800	8,050.00	127,190,000
燦ホールディングス	2,600	2,154.00	5,600,400
ピー・シー・エー	1,800	1,467.00	2,640,600
スバル興業	10,000	621.00	6,210,000
東京テアトル	52,000	146.00	7,592,000
タナベ経営	2,700	1,406.00	3,796,200
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,060.00	1,802,000
ナガワ	2,300	3,975.00	9,142,500
よみうりランド	25,000	551.00	13,775,000
東京都競馬	8,700	3,080.00	26,796,000
常磐興産	5,000	1,798.00	8,990,000
カナモト	17,800	3,835.00	68,263,000
東京ドーム	51,000	1,042.00	53,142,000
D T S	12,500	3,520.00	44,000,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	46,500	3,650.00	169,725,000
シーイーシー	7,300	2,128.00	15,534,400
カブコン	28,300	2,611.00	73,891,300
西尾レントオール	10,300	3,625.00	37,337,500
アイ・エス・ピー	2,300	1,633.00	3,755,900
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	72,000	37.00	2,664,000
日本空港ビルデング	38,500	4,260.00	164,010,000
トランス・コスモス	15,000	2,674.00	40,110,000
乃村工藝社	27,400	2,370.00	64,938,000
ジャステック	7,900	1,259.00	9,946,100
S C S K	32,900	4,970.00	163,513,000
藤田観光	4,200	3,875.00	16,275,000
K N T - C Tホールディングス	72,000	194.00	13,968,000
日本管財	11,000	1,974.00	21,714,000
トーカイ	5,700	4,605.00	26,248,500
白洋舎	500	3,025.00	1,512,500
セコム	132,800	8,574.00	1,138,627,200
日本システムウエア	4,100	1,755.00	7,195,500
セントラル警備保障	5,700	1,988.00	11,331,600
アイネス	15,300	1,145.00	17,518,500
丹青社	22,300	1,118.00	24,931,400
メイテック	14,800	4,735.00	70,078,000
T K C	11,200	3,245.00	36,344,000
アサツー ディ・ケイ	20,600	2,860.00	58,916,000
富士ソフト	17,900	3,260.00	58,354,000
応用地質	12,200	1,557.00	18,995,400
船井総研ホールディングス	16,300	2,871.00	46,797,300
N S D	25,700	2,054.00	52,787,800
進学会	5,500	577.00	3,173,500
丸紅建材リース	12,000	226.00	2,712,000
オオバ	9,700	516.00	5,005,200
コナミホールディングス	54,500	6,150.00	335,175,000
学究社	3,500	1,604.00	5,614,000
ベネッセホールディングス	42,800	4,405.00	188,534,000

イオンディライト	14,400	3,685.00	53,064,000
ナック	8,000	1,000.00	8,000,000
福井コンピュータホールディングス	3,600	3,810.00	13,716,000
ニチイ学館	22,500	1,126.00	25,335,000
ダイセキ	22,400	2,754.00	61,689,600
ステップ	4,500	1,454.00	6,543,000
日鉄住金物産	10,500	5,680.00	59,640,000
元気寿司	3,200	2,232.00	7,142,400
トラスコ中山	27,700	2,757.00	76,368,900
ヤマダ電機	415,084	564.00	234,107,376
オートバックスセブン	44,500	1,877.00	83,526,500
モリト	9,900	921.00	9,117,900
アークランドサカモト	20,500	1,527.00	31,303,500
ニトリホールディングス	52,200	15,010.00	783,522,000
グルメ杵屋	9,000	1,102.00	9,918,000
愛眼	9,700	213.00	2,066,100
ケーユーホールディングス	6,500	997.00	6,480,500
吉野家ホールディングス	42,200	1,957.00	82,585,400
加藤産業	18,800	2,955.00	55,554,000
イノテック	10,800	665.00	7,182,000
イエローハット	11,400	2,887.00	32,911,800
松屋フーズ	5,900	4,175.00	24,632,500
JBC Cホールディングス	10,500	844.00	8,862,000
J Kホールディングス	12,400	679.00	8,419,600
サガミチェーン	15,300	1,390.00	21,267,000
日伝	5,000	3,895.00	19,475,000
関西スーパーマーケット	10,000	1,512.00	15,120,000
ミロク情報サービス	12,000	2,319.00	27,828,000
北沢産業	11,000	203.00	2,233,000
杉本商事	7,100	1,547.00	10,983,700
因幡電機産業	16,800	4,305.00	72,324,000
王将フードサービス	8,800	4,315.00	37,972,000
プレナス	13,500	2,621.00	35,383,500
ミニストップ	8,900	2,395.00	21,315,500
アークス	22,500	2,373.00	53,392,500
バローホールディングス	26,000	2,516.00	65,416,000
パイテックホールディングス	4,900	1,465.00	7,178,500
ミスミグループ本社	137,600	2,649.00	364,502,400
アルテック	11,200	236.00	2,643,200
ベルク	5,400	5,050.00	27,270,000
大 庄	6,600	1,775.00	11,715,000
タキヒヨー	19,000	466.00	8,854,000
ファーストリテイリング	20,100	36,770.00	739,077,000
ソフトバンクグループ	543,400	9,106.00	4,948,200,400
蔵王産業	2,000	1,454.00	2,908,000
スズケン	54,900	3,700.00	203,130,000
サンドラッグ	46,000	4,080.00	187,680,000
サックスパー ホールディングス	11,600	1,234.00	14,314,400
ジェコス	8,400	1,311.00	11,012,400
ヤマザワ	2,400	1,774.00	4,257,600

やまや	2,500	1,629.00	4,072,500	
ルネサスイーストン	11,200	590.00	6,608,000	
ペルーナ	26,000	1,321.00	34,346,000	
合計	185,080,684		290,122,126,356	

*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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,810,993,822	2,733,939,409
国債証券		322,898,743,100	315,235,633,300
地方債証券		23,972,716,425	23,569,195,453
特殊債券		18,970,399,799	17,537,725,708
社債券		17,116,038,660	17,020,874,690
未収入金		1,722,720,000	1,819,912,000
未収利息		853,274,556	810,514,107
前払費用		16,404,130	14,161,786
流動資産合計		387,361,290,492	378,741,956,453
資産合計		387,361,290,492	378,741,956,453
負債の部			
流動負債			
未払解約金		187,691,000	284,421,000
流動負債合計		187,691,000	284,421,000
負債合計		187,691,000	284,421,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	302,351,149,022	296,867,950,534
剰余金			
剰余金又は欠損金()		84,822,450,470	81,589,584,919
元本等合計		387,173,599,492	378,457,535,453
純資産合計		387,173,599,492	378,457,535,453
負債純資産合計		387,361,290,492	378,741,956,453

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	292,253,585,690円	302,351,149,022円
同期中追加設定元本額	37,966,858,814円	32,910,113,444円
同期中一部解約元本額	27,869,295,482円	38,393,311,932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	10,854,182,784円	13,038,628,817円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	136,287,516円	166,033,507円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	123,830,945円	128,679,191円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	46,215,676円	42,150,616円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	406,021,206円	266,120,041円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	119,424,698円	124,253,065円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	24,093,768円	26,245,887円
たわらノーロード 国内債券	901,143,539円	1,713,963,026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>	12,171,985,997円	12,351,271,983円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,811,241,049円	5,242,052,506円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	6,822,072,744円	7,410,630,126円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,649,526,618円	2,975,711,672円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,641,032,476円	1,753,373,573円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,722,626,088円	1,883,340,225円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	244,923,243円	285,745,922円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	98,797,552円	100,041,145円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,195,866,560円	2,305,194,406円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,978,002円	3,002,910円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	353,017,386円	402,253,149円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	250,995,189円	320,865,483円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	60,859,020円	73,889,276円
投資のソムリエ	8,918,982,259円	11,584,189,540円
クルーズコントロール	4,082,782,511円	4,826,077,677円
投資のソムリエ<DC年金>	263,430,477円	590,952,033円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	1,121,552,998円	1,503,527,064円
DIAM DC バランス・F(成長型)	114,156,112円	163,452,779円
クルーズコントロール<DC年金>	1,612,582円	1,587,420円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	12,066,843円	9,566,746円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	26,868,545円	24,077,080円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	113,106,192円	393,564,580円
ダイナミック・ナビゲーション	462,426円	496,061円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,413,062円	4,024,193,337円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	-円	1,169,865円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	-円	1,169,865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
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,050,583,696円	25,692,996,057円
DIAM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)	720,300,635円	-円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	512,582,948円	513,649,805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)	464,509,485円	392,653,115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)	294,451,872円	266,891,766円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	116,088,208円	106,189,311円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	324,560,165円	295,373,799円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	134,546,633円	127,210,758円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	79,812,989円	73,240,699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)	3,873,885,819円	159,355,831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)	1,486,248,373円	284,854,614円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	7,186,488,246円	6,653,603,488円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	3,535,321,999円	3,433,169,919円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	6,415,378,240円	6,226,075,124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)	751,554,552円	709,120,313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)	2,297,736,149円	1,103,862,832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)	4,381,704,478円	4,134,495,677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)	5,754,159,456円	5,402,651,790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)	812,385,968円	586,191,715円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	5,909,722,696円	2,779,451,418円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	6,745,903,203円	5,788,368,005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)	89,058,950,692円	88,405,762,905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)	1,234,322,032円	1,193,010,313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)	7,560,187,206円	7,538,718,182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)	28,217,510,574円	28,291,502,052円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	94,990,409円	80,114,698円
D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	2,469,333円	9,253,393円
D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	9,097,607円	8,522,575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)	31,637,535,869円	31,583,739,591円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	562,537,512円	503,333,943円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	140,361,156円	139,072,724円
D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	657,286,245円	616,595,295円
D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	453,278円	468,148円
D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)	349,123円	363,993円
計	302,351,149,022円	296,867,950,534円

2 . 受益権の総数	302,351,149,022口	296,867,950,534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7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,960,142,200	727,487,800
地方債証券	126,766,942	121,555,380
特殊債証券	131,484,282	81,351,955
社債証券	123,096,030	84,452,780
合計	1,578,794,946	1,014,847,915

(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29年1月11日まで及び平成29年2月15日から平成29年7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2805円	1.2748円
(1万口当たり純資産額)	(12,805円)	(12,748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7月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	369回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,640,000	
	370回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,820,000	
	371回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,990,000	
	372回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,170,000	
	373回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,505,025,000	
	375回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,690,000	
	376回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,007,720,000	
	377回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,506,060,000	
	114回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,517,080,000	
	116回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,218,438,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,020,560,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,721,164,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,509,210,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,007,880,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,519,215,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,018,800,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,518,025,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,290,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,519,880,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,700,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,018,330,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,522,750,000	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,020,670,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,525,480,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	808,242,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	810,294,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,082,816,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,038,096,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	887,866,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	965,848,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,001,268,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,032,044,000	
	10回 利付国庫債券(40年)	200,000,000	189,210,000	
	296回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,038,200,000	
	297回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,349,680,000	
	299回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	921,339,000	
	301回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,990,045,000	
	303回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,342,484,000	
	305回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,584,275,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,559,520,000	

308回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	832,376,000
309回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,034,580,000
310回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,378,269,000
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,295,502,000
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,150,660,000
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,574,265,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,048,270,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,044,070,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,576,380,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,569,705,000
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,622,650,000
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,082,580,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,085,720,000
326回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,247,376,000
328回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,920,000
329回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,306,524,000
330回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,784,711,000
332回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,557,945,000
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,079,520,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,185,869,000
335回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,551,675,000
336回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,035,260,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,326,533,000
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,055,940,000
339回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,364,561,000
340回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,085,620,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,570,525,000
342回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,012,080,000
343回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,509,310,000
344回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,507,980,000
345回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,007,480,000
346回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,005,760,000
347回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,501,470,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	131,249,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,055,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,994,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,020,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,876,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,160,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	384,489,000
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	363,678,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	479,340,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	378,405,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	374,034,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	655,895,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,988,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	532,956,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,486,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,067,623,600
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,544,000

20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	401,709,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	652,485,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	630,627,200	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	806,190,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	403,287,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	523,844,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	930,013,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	944,601,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,216,899,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,202,283,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,451,857,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,172,790,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,593,012,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,647,022,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,573,680,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,651,299,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,781,192,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,877,400,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,230,100,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,003,024,000	
40回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	984,944,000	
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	966,608,000	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	966,832,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	967,056,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	967,264,000	
45回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,160,100,000	
46回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,391,964,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,185,370,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,248,929,000	
49回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,362,072,000	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	982,800,000	
51回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	939,840,000	
52回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	993,685,000	
53回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,019,634,000	
54回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,074,227,000	
55回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	487,630,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	740,570,400	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	836,520,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	916,097,800	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	959,796,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	533,465,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,018,656,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	544,040,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	836,386,200	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	648,552,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	599,544,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	769,888,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	888,019,200	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,238,129,700	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	660,006,000	

60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,066,824,000	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	846,440,000	
62回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	838,736,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	670,758,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,234,552,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,140,597,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,457,087,500	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,436,637,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,364,489,700	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,621,564,000	
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,662,715,000	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,622,642,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,639,778,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,646,036,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,437,660,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,432,716,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,545,986,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	828,765,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	954,840,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,461,912,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,697,388,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,687,504,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,584,427,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,741,754,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,579,825,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,072,776,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,918,224,000	
111回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,980,000,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,842,405,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,846,995,000	
116回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,242,584,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,223,130,000	
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,078,191,000	
121回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,819,485,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,111,638,000	
125回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,262,942,000	
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	853,251,000	
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,084,950,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,809,900,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,268,106,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,088,343,000	
135回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	956,184,000	
137回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,032,979,000	
140回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,914,272,000	
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,274,015,000	
143回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,482,914,000	
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,677,690,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,037,552,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,011,542,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,751,220,000	

	149回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,217,452,000	
	150回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,956,105,000	
	151回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,010,150,000	
	152回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,450,202,000	
	153回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,150,192,000	
	154回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,670,880,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,724,864,000	
	156回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,455,705,000	
	157回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,397,970,000	
	158回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,670,743,000	
	159回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,697,042,000	
	160回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,825,254,000	
	161回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	397,520,000	
国債証券 合計		288,620,000,000	315,235,633,300	
地方債証券	667回 東京都公募公債	300,000,000	307,830,000	
	680回 東京都公募公債	200,000,000	207,222,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	515,780,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	205,600,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	520,220,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	726,572,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	519,550,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	313,458,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	415,468,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	114,808,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	239,662,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	357,981,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	206,558,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	208,462,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	308,616,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,971,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	308,370,000	
	319回 大阪府公募公債	200,000,000	204,272,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	207,570,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	312,054,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	208,482,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	310,407,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	314,448,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	358,001,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,138,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	319,518,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	202,787,860	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	206,164,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	208,278,000	
	1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	116,145,000	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	101,882,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	206,750,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	523,160,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	312,900,000	
	22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	207,496,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,818,000	

23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	208,490,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	412,860,000	
21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	206,402,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	207,278,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	206,000,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	310,152,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	208,688,000	
65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,772,000	
80回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,046,000	
94回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	520,405,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	729,813,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,871,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	522,635,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	727,076,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,995,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,935,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	827,140,593	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,155,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,951,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,465,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,650,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,510,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,968,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,568,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,570,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	464,017,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	120,843,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	206,986,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	208,050,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	468,472,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	418,324,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	208,024,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	104,606,000	
21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	206,398,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	209,680,000	
地方債証券 合計	22,640,900,000	23,569,195,453	
特殊債券			
48回 高速道路機構債	700,000,000	720,230,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	726,859,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	103,447,000	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,945,000	
18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	326,895,000	
66回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	165,013,200	
67回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	409,541,300	
71回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	612,504,000	

78回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	718,053,000	
82回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,008,000	
89回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,733,000	
149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	416,912,000	
180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,037,000,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,890,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	524,445,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	346,836,600	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	512,620,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	797,296,000	
8回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	669,560,010	
3回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,212,810	
5回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	515,865,000	
8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,939,000	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	517,500,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,124,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,435,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,007,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,444,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	417,172,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,315,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,489,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	309,180,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	52,368,000	55,505,890	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,688,000	38,882,676	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	55,077,000	58,445,509	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,059,000	62,051,717	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,928,000	24,857,363	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	121,560,000	125,496,112	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,293,000	34,817,339	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,791,000	21,069,102	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,796,000	79,539,562	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,620,000	58,906,029	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,900,000	103,147,440	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,095,000	204,496,492	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	344,544,000	365,316,557	
い第769号 利付商工債	200,000,000	200,826,000	
い第779号 利付商工債	200,000,000	200,922,000	

	760号 利附農林債	300,000,000	301,380,000	
	764号 利附農林債	500,000,000	502,540,000	
	293回 利附信金中金債	400,000,000	401,648,000	
	302回 利附信金中金債	300,000,000	301,221,000	
	325回 利附信金中金債	400,000,000	399,196,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	204,470,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	519,520,000	
特殊債券 合計		17,010,719,000	17,537,725,708	
社債券	337回 東京交通債	200,000,000	215,416,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,084,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	309,663,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	103,415,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,402,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	103,251,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	102,019,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,970,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,428,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	103,593,000	
	30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,390,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,234,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	101,483,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	100,929,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	208,584,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,600,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	104,133,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	103,662,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	102,812,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,059,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	104,379,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	222,018,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	209,390,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	207,368,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,536,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	315,561,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,940,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,928,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	208,034,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	105,253,000	
	12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,849,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,946,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	103,575,000	
	20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	208,226,000	
	22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	207,854,000	
	23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	419,224,000	
	14回 みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	208,634,000	
	15回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	209,864,000	
	47回 日立キャピタル社債	200,000,000	205,632,000	
	164回 オリックス社債	100,000,000	101,834,000	

14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	102,770,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,186,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	205,770,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,632,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	207,010,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	113,543,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	205,704,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	101,467,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	323,667,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,155,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,609,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	342,186,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	306,942,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	219,998,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	334,080,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,320,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,232,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	315,771,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	223,092,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,198,000	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	207,036,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	142,101,600	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	311,220,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	204,724,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	516,040,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	198,908,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	307,674,000	
492回	関西電力社債	200,000,000	201,564,000	
493回	関西電力社債	200,000,000	201,638,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	420,124,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	106,172,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,838,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,572,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	420,660,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	304,419,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	102,654,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	208,488,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	203,606,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	211,008,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	418,076,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,728,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	166,424,090	
13回	電源開発社債	200,000,000	225,320,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	312,474,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	314,382,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	106,896,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,624,000	
社債券 合計		16,281,000,000	17,020,874,690	
合計		344,552,619,000	373,363,429,151	

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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		416,711,515	349,177,937
投資証券		29,785,016,500	28,262,159,300
未収配当金		244,430,214	214,920,471
前払金		-	24,320,000
差入委託証拠金		-	5,350,400
流動資産合計		30,446,158,229	28,855,928,108
資産合計		30,446,158,229	28,855,928,108
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	23,865,344
未払金		346,446,495	-
未払解約金		10,447,000	1,816,000
流動負債合計		356,893,495	25,681,344
負債合計		356,893,495	25,681,344
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,468,770,229	17,361,587,502
剰余金			
剰余金又は欠損金()		13,620,494,505	11,468,659,262
元本等合計		30,089,264,734	28,830,246,764
純資産合計		30,089,264,734	28,830,246,764
負債純資産合計		30,446,158,229	28,855,928,108

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>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,431,805,489円	16,468,770,229円
同期中追加設定元本額	5,275,030,189円	4,339,836,344円
同期中一部解約元本額	2,238,065,449円	3,447,019,071円
元本の内訳 ファンド名		
MITO ラップ型ファンド （安定型）	557,314円	455,340円
MITO ラップ型ファンド （中立型）	1,611,236円	1,094,959円
MITO ラップ型ファンド （積極型）	3,753,394円	3,035,728円
グローバル8資産ラップファン ド（安定型）	1,659,417円	738,955円
グローバル8資産ラップファン ド（中立型）	1,554,325円	1,062,060円
グローバル8資産ラップファン ド（積極型）	1,957,290円	1,890,746円
たわらノーロード 国内リート	477,367,537円	712,383,155円
たわらノーロード 国内リート <ラップ向け>	58,995,435円	131,035,021円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	14,829,308円	15,496,536円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	335,652,444円	353,991,004円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,962,722円	2,667,331円
DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国10）	13,096,570円	15,884,130円

DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	33,814,651円	46,630,090円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	76,095,479円	101,183,554円
投資のソムリエ	1,043,453,876円	1,585,499,146円
投資のソムリエ<DC年金>	30,812,192円	80,699,348円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	40,650,681円	59,506,421円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	8,656,798円	53,487,067円
ダイナミック・ナビゲーション	164,273円	180,735円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	188,090円	545,265,589円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	-円	289,470円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	-円	289,470円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 10(適格機関投資家限定)	977,920,018円	960,132,857円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	1,052,894,526円	95,829,464円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	1,888,734,682円	1,854,507,521円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	8,041,376,195円	7,846,318,726円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	57,813,260円	41,595,106円
DIAM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)	909,317,488円	1,272,087,242円
DIAM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)	1,354,403,360円	1,578,350,731円
DIAM リスクコントロール J-REITファンド(適格機 関投資家限定)	37,477,668円	-円
計	16,468,770,229円	17,361,587,502円
2. 受益権の総数	16,468,770,229口	17,361,587,502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7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	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、不動産投信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、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	137,177,093	1,808,037,848
合計	137,177,093	1,808,037,848

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引 不動産投信指数先物 取引 買 建	-	-	-	-	441,958,400	-	418,176,000	23,782,400
合計	-	-	-	-	441,958,400	-	418,176,000	23,782,400

（注）1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.8270円	1.6606円
（1万口当たり純資産額）	（18,270円）	（16,606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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	6,705	791,860,500	
	MCUBS MidCity投資法人	775	247,225,000	
	Oneリート投資法人	419	88,492,800	
	いちごオフィスリート投資法人	2,965	201,916,500	
	いちごホテルリート投資法人	605	67,276,000	
	さくら総合リート投資法人	921	75,061,500	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,655	743,095,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,546	955,292,400	
	イオンリート投資法人	3,360	408,912,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2,142	218,055,600	
	インヴィンシブル投資法人	8,539	397,063,500	
	オリックス不動産投資法人	7,389	1,197,018,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	615	226,935,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,119	655,734,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	869	234,630,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,393	319,972,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,397	314,464,700	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	665	56,857,500	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	211	30,742,700	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,053	847,765,100	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,429	423,138,600	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,620	1,987,380,000	
	スターアジア不動産投資法人	795	83,475,000	
	スターツプロシード投資法人	603	87,615,900	
	トーセイ・リート投資法人	481	50,312,600	
	ヒューリックリート投資法人	2,456	417,765,600	
	フロンティア不動産投資法人	1,303	586,350,000	
	プレミア投資法人	3,459	365,962,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	472	47,624,800	
	マリモ地方創生リート投資法人	214	19,581,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	8,446	1,323,488,200	
	ラサールロジポート投資法人	2,889	316,056,600	
	阪急リート投資法人	1,569	209,147,700	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	619	195,913,500	
産業ファンド投資法人	1,040	528,320,000		
森トラスト・ホテルリート投資法人	829	122,692,000		
森トラスト総合リート投資法人	2,737	481,985,700		
森ヒルズリート投資法人	4,114	557,447,000		
星野リゾート・リート投資法人	476	269,892,000		

積水ハウス・リート投資法人	2,402	313,461,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	2,904	329,023,200	
大江戸温泉リート投資法人	487	41,979,400	
大和ハウスリート投資法人	3,939	1,007,990,100	
大和証券オフィス投資法人	826	448,518,000	
投資法人みらい	487	84,543,200	
東急リアル・エステート投資法人	2,568	341,800,800	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,273	554,391,500	
日本ビルファンド投資法人	3,709	2,099,294,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,418	940,602,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,480	1,062,208,000	
日本ヘルスケア投資法人	186	31,080,600	
日本リート投資法人	1,029	302,628,900	
日本リテールファンド投資法人	7,367	1,505,814,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,433	545,235,300	
日本賃貸住宅投資法人	4,308	342,486,000	
福岡リート投資法人	1,859	307,664,500	
平和不動産リート投資法人	2,385	201,771,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	10,987	1,649,148,700	
投資証券 合計	151,941	28,262,159,300	
合計	151,941	28,262,159,300	

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

「(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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,450,881,435	1,373,181,531
コール・ローン		136,302,820	295,463,571
株式		263,044,401,726	266,449,034,455
投資信託受益証券		833,914,594	782,539,781
投資証券		6,182,633,954	6,208,747,500
派生商品評価勘定		29,766,443	8,351,358
未収入金		2,788,032	3,907,831,834
未収配当金		330,630,621	354,801,614
差入委託証拠金		1,428,687,077	1,509,869,771
流動資産合計		276,440,006,702	280,889,821,415
資産合計		276,440,006,702	280,889,821,415
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		880,817	18,229,577
未払金		-	72,542,744
未払解約金		229,401,000	286,716,000
流動負債合計		230,281,817	377,488,321
負債合計		230,281,817	377,488,321
純資産の部			
元本等			
元本	1	92,727,414,724	87,299,647,391
剰余金			
剰余金又は欠損金()		183,482,310,161	193,212,685,703
元本等合計		276,209,724,885	280,512,333,094
純資産合計		276,209,724,885	280,512,333,094
負債純資産合計		276,440,006,702	280,889,821,415

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額 元本の内訳 ファンド名	102,470,324,899円 5,887,330,395円 15,630,240,570円	92,727,414,724円 8,240,138,339円 13,667,905,672円

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,946,959,402円	1,723,540,607円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,434,740円	4,289,933円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	12,888,567円	9,294,293円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	29,749,544円	25,738,997円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	13,210,663円	6,875,628円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	12,430,317円	8,976,791円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	15,508,554円	16,029,732円
たわらノーロード 先進国株式	2,079,682,896円	3,464,692,368円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	425,695円	425,349円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	61,132,652円	230,220,421円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	35,568,884,895円	35,942,932,402円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 1 安定型	179,962,215円	162,797,612円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 2 安定・成長型	953,771,814円	862,560,792円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 3 成長型	1,115,778,433円	1,037,287,668円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	153,484,704円	140,609,685円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	427,386,666円	403,652,231円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	346,239,329円	332,027,035円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	42,363,606円	36,832,323円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	938,046,218円	842,667,252円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	228,756,848円	202,455,387円
D I A M DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	26,508,121円	28,341,632円
D I A M DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	51,983,023円	62,916,427円
D I A M DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	104,518,603円	119,245,111円
投資のソムリエ	826,420,611円	745,556,085円
クルーズコントロール	827,877,963円	828,472,858円
投資のソムリエ<DC年金>	24,426,190円	38,054,738円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	87,168,309円	106,638,286円
D I A M DC バランス・F (成長型)	42,666,319円	56,800,596円

クルーズコントロール<DC年金>	325,530円	272,914円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,117,616円	4,112,941円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	13,598,018円	10,345,941円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,348,013円	16,927,745円
ダイナミック・ナビゲーション	1,595,132円	1,126,359円
リスク抑制世界8資産バランス	49,988円	173,010,152円
ファンド		
ワールドアセットバランス(基本コース)	-円	217,116,974円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	-円	455,792,253円
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	255,225円
イヤー2045)		
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	255,225円
イヤー2055)		
DIAM外国株式インデックス	173,737,690円	131,042,986円
ファンドVA(適格機関投資家		
専用)		
DIAM外国株式パッシブ私募	3,216,630,874円	3,044,620,874円
ファンド(適格機関投資家向		
け)		
DIAMアクティブアロケー	172,145,175円	-円
ション私募ファンド(適格機関		
投資家限定)		
DIAM先進国株式パッシブ	392,000円	161,378,648円
ファンド(適格機関投資家限		
定)		
外国株式パッシブ・ファンド2	-円	129,110,721円
(適格機関投資家限定)		
DIAMワールドバランス25	29,023,964円	27,183,643円
VA(適格機関投資家限定)		
DIAMグローバル・バランス	168,073,193円	132,896,884円
ファンド25VA(適格機関投		
資家限定)		
DIAMグローバル・バランス	320,310,030円	271,266,779円
ファンド50VA(適格機関投		
資家限定)		
DIAM国際分散バランスファ	21,588,870円	18,479,680円
ンド30VA(適格機関投資家		
限定)		
DIAM国際分散バランスファ	140,963,619円	119,986,899円
ンド50VA(適格機関投資家		
限定)		
DIAM国内重視バランスファ	11,674,565円	10,326,645円
ンド30VA(適格機関投資家		
限定)		

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)	17,327,751円	14,871,644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)	1,121,411,686円	43,147,185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)	645,440,187円	115,710,354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)	779,496,270円	675,183,876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)	895,242,912円	813,318,475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)	2,786,274,684円	2,529,121,106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)	1,077,755,283円	958,009,943円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	1,185,802,464円	534,497,016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)	1,269,093,076円	1,118,385,732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)	831,466,203円	731,975,233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)	13,494,600円	8,099,193円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	3,822,906,387円	1,685,356,781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)	1,523,731,124円	1,161,795,649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)	9,666,114,191円	8,974,479,105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)	536,552,271円	484,609,008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)	1,642,532,401円	1,530,544,524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)	6,133,183,873円	5,744,710,526円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	25,699,340円	20,339,477円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	1,714,626円	6,008,433円

	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	14,483,642円	12,714,130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)	8,250,573,365円	7,695,764,078円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	85,433,865円	75,131,291円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	169,337円	164,106円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	274,012円	268,799円
	計	92,727,414,724円	87,299,647,391円
2.	受益権の総数	92,727,414,724口	87,299,647,391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7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	45,803,894,661	9,559,918,823
投資信託受益証券	57,863,895	23,772,019
投資証券	572,776,282	65,176,451
合計	46,434,534,838	9,601,323,255

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	968,141,605	-	968,068,200	73,405	1,246,742,268	-	1,246,404,200	338,068
アメリカ・ドル	643,540,875	-	643,522,500	18,375	601,858,400	-	601,837,700	20,700
イギリス・ポンド	74,870,980	-	74,867,800	3,180	82,372,640	-	82,370,400	2,240
オーストラリア・ドル	40,968,420	-	40,978,200	9,780	39,957,530	-	39,966,500	8,970
カナダ・ドル	38,533,800	-	38,522,000	11,800	33,658,348	-	33,656,600	1,748
シンガポール・ドル	-	-	-	-	57,834,700	-	57,715,000	119,700
スイス・フラン	-	-	-	-	130,264,640	-	130,009,000	255,640
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	64,315,000	-	64,362,500	47,500
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	20,125,000	-	20,125,000	-
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	14,352,450	-	14,374,500	22,050
ユーロ	170,227,530	-	170,177,700	49,830	175,689,000	-	175,689,000	-
香港・ドル	-	-	-	-	26,314,560	-	26,298,000	16,560
買 建	-	-	-	-	354,307,333	-	354,246,900	60,433
イギリス・ポンド	-	-	-	-	45,652,646	-	45,597,900	54,746
カナダ・ドル	-	-	-	-	10,631,568	-	10,628,400	3,168
ユーロ	-	-	-	-	298,023,119	-	298,020,600	2,519
合計	968,141,605	-	968,068,200	73,405	1,601,049,601	-	1,600,651,100	277,635

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,114,184,278	-	5,142,996,499	28,812,221	6,121,614,687	-	6,111,458,833	10,155,854
合計	5,114,184,278	-	5,142,996,499	28,812,221	6,121,614,687	-	6,111,458,833	10,155,854

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.9787円 (29,787円)	3.2132円 (32,132円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	28,806	996.470	28,704,314.820	
	ABBOTT LABORATORIES	123,985	48.230	5,979,796.550	
	AES CORP	45,579	10.940	498,634.260	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	63,896	153.420	9,802,924.320	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	13.810	822,095.490	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,564	143.340	5,097,743.760	
	CHUBB LTD	33,654	145.280	4,889,253.120	
	AGCO CORP	5,610	69.300	388,773.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14,622	143.500	2,098,257.000	
	ALLEGHANY CORP	1,054	595.050	627,182.700	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	62,324	82.570	5,146,092.680	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	72.420	340,591.260	
	ALLSTATE CORP	25,754	88.850	2,288,242.900	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,100	134.690	7,017,349.000	
	AMGEN INC	52,031	172.200	8,959,738.200	
	HESS CORP	20,421	42.460	867,075.660	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,985	84.300	4,635,235.500	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	68.890	2,401,436.510	
	AFLAC INC	28,218	77.650	2,191,127.700	
	AMERICAN INTL GROUP	69,779	63.070	4,400,961.530	
	AMERCO	551	354.400	195,274.400	
	ANALOG DEVICES	24,884	78.730	1,959,117.320	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	43.590	1,787,320.770	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	123.760	1,982,016.400	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	65,521	43.380	2,842,300.980	
	TIME WARNER	54,692	100.550	5,499,280.600	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	126.570	356,674.260	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	68.090	2,186,029.450	
	APACHE CORP	28,309	47.110	1,333,636.990	
	ANSYS INC	5,619	122.240	686,866.560	
	APPLE INC	372,766	145.060	54,073,435.960	
	APPLIED MATERIALS INC	78,309	44.210	3,462,040.890	
	ALBEMARLE CORP	7,904	111.340	880,031.360	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	41,382	40.810	1,688,799.420	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	84.200	659,370.200		
AMEREN CORP	17,312	53.950	933,982.400		
ARROW ELECTRONICS INC	5,756	78.360	451,040.160		

AUTOLIV INC	6,197	115.370	714,947.890	
AUTODESK INC	14,259	103.740	1,479,228.660	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,355	103.660	3,250,259.300	
AUTOZONE INC	2,015	507.540	1,022,693.100	
AVERY DENNISON CORP	6,262	91.430	572,534.660	
AVNET INC	10,288	38.740	398,557.120	
BALL CORP	24,324	42.160	1,025,499.840	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	88,195	170.250	15,015,198.750	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	74,205	51.880	3,849,755.400	
CR BARD INC	5,309	318.040	1,688,474.360	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	60.550	2,111,741.800	
BED BATH & BEYOND INC	10,744	28.840	309,856.960	
BECTON DICKINSON & CO	15,808	197.500	3,122,080.000	
AMETEK INC	16,775	61.700	1,035,017.500	
VERIZON COMM INC	288,233	43.200	12,451,665.600	
WR BERKLEY CORP	8,134	69.000	561,246.000	
BEST BUY CO INC	21,033	54.230	1,140,619.590	
YUM! BRANDS INC	23,738	73.540	1,745,692.520	
FIRSTENERGY CORP	30,796	29.310	902,630.760	
H&R BLOCK INC	16,114	31.330	504,851.620	
BOEING CO	41,187	203.960	8,400,500.520	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	49.390	402,923.620	
BORGWARNER INC	14,648	45.080	660,331.840	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	95,499	27.560	2,631,952.440	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	68.230	675,067.620	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	593.000	1,089,934.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	120,268	55.930	6,726,589.240	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	172.710	654,225.480	
INGREDION INC	5,305	116.020	615,486.100	
ONEOK INC	28,473	51.000	1,452,123.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,405	101.370	446,534.850	
UNITED RENTALS INC	6,332	113.540	718,935.280	
SEMPRA ENERGY	16,912	110.770	1,873,342.240	
FEDEX CORP	17,735	218.870	3,881,659.450	
VERISIGN INC	6,321	95.290	602,328.090	
AMPHENOL CORP	21,490	73.770	1,585,317.300	
BROWN-FORMAN CORP	13,612	47.350	644,528.200	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,337	58.760	1,312,522.120	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.340	678,671.280	
CSX CORP	66,444	54.890	3,647,111.160	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	24.670	795,878.870	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	50.960	715,988.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	38.390	892,145.210	

CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	193.820	2,372,356.800	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	76.680	1,696,545.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	65.840	1,640,469.440	
CATERPILLAR INC	42,279	107.840	4,559,367.360	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	111.850	1,099,709.200	
CELGENE CORP	54,870	131.930	7,238,999.100	
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	103.740	374,708.880	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	79.930	870,917.280	
CENTURYLINK INC	39,384	23.470	924,342.480	
CERNER CORP	20,809	65.340	1,359,660.060	
JPMORGAN CHASE & CO	254,203	93.190	23,689,177.570	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	52.310	984,578.820	
CIGNA CORP	18,074	169.570	3,064,808.180	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	72.150	792,351.300	
CINTAS CORP	6,282	126.540	794,924.280	
CISCO SYSTEMS INC	353,746	30.980	10,959,051.080	
CLOROX COMPANY	9,331	133.500	1,245,688.500	
COCA-COLA CO/THE	289,822	44.380	12,862,300.360	
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,959	73.080	4,381,803.720	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,366	100.710	2,353,189.860	
COMERICA INC	12,068	75.130	906,668.840	
COMCAST CORP-CL A	335,266	38.760	12,994,910.160	
CA INC	22,732	34.300	779,707.600	
CONAGRA BRANDS INC	31,942	33.230	1,061,432.660	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	80.370	1,748,047.500	
CMS ENERGY CORP	22,372	45.590	1,019,939.480	
COOPER COS INC	3,794	244.140	926,267.160	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	85.610	1,186,126.550	
CORNING INC	65,641	30.540	2,004,676.140	
WR GRACE & CO	3,589	70.600	253,383.400	
SEALED AIR CORP	13,870	45.840	635,800.800	
CUMMINS INC	11,239	165.080	1,855,334.120	
DR HORTON INC	24,498	37.170	910,590.660	
DANAHER CORP	44,764	82.560	3,695,715.840	
MOODY'S CORP	11,719	123.030	1,441,788.570	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,287	67.280	2,912,349.360	
TARGET CORP	37,486	50.180	1,881,047.480	
DEERE & CO	19,364	128.140	2,481,302.960	
MORGAN STANLEY	98,304	45.990	4,521,000.960	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	64.340	1,117,907.500	
COSTAR GROUP INC	2,278	273.880	623,898.640	
THE WALT DISNEY CO	111,666	103.590	11,567,480.940	
DOLLAR TREE INC	17,493	66.390	1,161,360.270	
DOVER CORP	10,736	83.330	894,630.880	
DOW CHEMICAL	86,616	64.520	5,588,464.320	

OMNICOM GROUP	16,993	81.100	1,378,132.300	
DTE ENERGY CO	13,122	104.930	1,376,891.460	
DUKE ENERGY CORP	49,907	83.190	4,151,763.330	
FLOWSERVE CORP	8,406	46.380	389,870.280	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	89.250	842,163.000	
EBAY INC	73,800	35.040	2,585,952.000	
BANK OF AMERICA CORP	711,506	24.890	17,709,384.340	
CITIGROUP INC	196,346	67.650	13,282,806.900	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	84.640	862,735.520	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	38.680	724,863.200	
EATON CORP PLC	32,234	80.400	2,591,613.600	
EATON VANCE CORP	9,184	47.910	440,005.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	33.900	707,730.300	
DISH NETWORK CORP	16,150	64.300	1,038,445.000	
ECOLAB INC	19,009	132.050	2,510,138.450	
ELECTRONIC ARTS INC	21,596	107.840	2,328,912.640	
SALESFORCE.COM INC	47,199	88.500	4,177,111.500	
EMERSON ELECTRIC CO	45,639	59.740	2,726,473.860	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	83.370	685,384.770	
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	3.730	262,741.200	
ENERGY CORP	13,984	75.310	1,053,135.040	
EOG RESOURCES INC	39,819	89.620	3,568,578.780	
EQUIFAX INC	8,495	139.000	1,180,805.000	
EQT CORP	11,135	59.900	666,986.500	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	94.270	1,520,952.180	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	11,457	57.160	654,882.120	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	42,945	61.830	2,655,289.350	
EXXON MOBIL CORP	294,326	80.160	23,593,172.160	
FMC CORP	8,970	75.870	680,553.900	
NEXTERA ENERGY INC	33,404	141.030	4,710,966.120	
ASSURANT INC	4,089	104.930	429,058.770	
FASTENAL CO	21,654	43.750	947,362.500	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	26.340	1,374,236.820	
M&T BANK CORP	9,799	164.360	1,610,563.640	
FISERV INC	15,880	122.800	1,950,064.000	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	35.740	415,406.020	
MACY'S INC	24,512	21.080	516,712.960	
FORD MOTOR CO	263,347	11.340	2,986,354.980	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,859	45.540	1,040,998.860	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	12.520	1,212,086.240	
FLEX LTD	35,913	16.430	590,050.590	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	57.460	699,632.960	
GAP INC/THE	18,295	21.210	388,036.950	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	64.240	1,122,722.480	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,563	201.070	3,732,462.410	
GENERAL MILLS INC	40,614	53.400	2,168,787.600	
GENUINE PARTS CO	11,094	85.100	944,099.400	
GILEAD SCIENCES INC	93,706	69.290	6,492,888.740	
GARTNER INC	5,570	126.220	703,045.400	

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	35.650	645,158.050	
MCKESSON CORP	15,054	164.710	2,479,544.340	
NVIDIA CORP	38,827	153.700	5,967,709.900	
GENERAL ELECTRIC CO	618,326	26.040	16,101,209.040	
WW GRAINGER INC	3,832	178.070	682,364.240	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	17.450	388,018.200	
HALLIBURTON CO	61,429	42.320	2,599,675.280	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	50.510	1,491,156.220	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,232	225.840	5,698,394.880	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	52.490	677,173.490	
HARRIS CORP	8,954	113.900	1,019,860.600	
HASBRO INC	7,736	112.130	867,437.680	
HENRY SCHEIN INC	5,713	180.620	1,031,882.060	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	53.290	384,380.770	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	104.970	1,063,556.040	
HP INC	122,725	17.870	2,193,095.750	
F5 NETWORKS INC	4,874	127.880	623,287.120	
CROWN HOLDINGS INC NPR	8,582	59.810	513,289.420	
REYNOLDS AMERICAN INC	60,772	63.940	3,885,761.680	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	130.950	451,384.650	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	29.200	810,008.000	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	27.320	379,420.160	
HOLOGIC INC	17,500	44.810	784,175.000	
UNUM GROUP	16,000	47.640	762,240.000	
HOME DEPOT INC	86,252	151.180	13,039,577.360	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	89.800	1,157,252.600	
HORMEL FOODS CORP	19,345	32.650	631,614.250	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.270	871,331.040	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	184.700	431,643.900	
HUMANA INC	10,468	239.040	2,502,270.720	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	92.730	549,610.710	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	13.690	1,028,954.090	
RED HAT INC	12,101	97.250	1,176,822.250	
BIOGEN INC	15,451	273.580	4,227,084.580	
IDEX CORP	4,479	113.940	510,337.260	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,278	146.240	3,257,934.720	
INTUIT INC	17,739	131.870	2,339,241.930	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	161.510	1,010,245.050	
INGERSOLL-RAND PLC	17,817	93.730	1,669,987.410	
INTEL CORP	334,562	33.650	11,258,011.300	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	131.690	734,566.820	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	57.240	1,624,185.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	24.820	723,676.740	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	54.780	434,460.180	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,312	103.830	447,714.960	
INCYTE CORP	12,360	129.560	1,601,361.600	
JOHNSON & JOHNSON	192,938	131.550	25,380,993.900	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	52.870	1,349,771.100	
ENBRIDGE INC	50,819	39.780	2,021,579.820	
KLA-TENCOR CORP	11,724	95.630	1,121,166.120	
DEVON ENERGY CORP	34,184	29.730	1,016,290.320	
WESTAR ENERGY INC	9,911	50.410	499,613.510	
KELLOGG CO	18,922	65.870	1,246,392.140	
EAST WEST BANCORP INC	9,098	58.990	536,691.020	
KEYCORP	74,115	19.290	1,429,678.350	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,358	127.010	3,220,719.580	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,646	436.240	3,771,731.040	
KOHL'S CORP	11,357	36.630	416,006.910	
KROGER CO	66,588	22.610	1,505,554.680	
LAM RESEARCH CORP	11,522	150.840	1,737,978.480	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	112.460	692,416.220	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	49.650	626,682.300	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	52.440	502,794.720	
LENNAR CORP	14,850	54.600	810,810.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	26.610	571,103.820	
ELI LILLY & CO	71,610	82.280	5,892,070.800	
L BRANDS INC	16,262	44.150	717,967.300	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,014	70.630	1,060,438.820	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	48,473	110.210	5,342,209.330	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	59.860	1,452,562.760	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,908	285.570	5,399,557.560	
LOEWS CORP	21,346	47.150	1,006,463.900	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	21.770	298,183.690	
LOWE'S COS INC	61,047	76.920	4,695,735.240	
DOMINION ENERGY INC	45,131	75.600	3,411,903.600	
SCANA CORP	10,902	63.750	695,002.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	31.180	1,003,933.640	
MCCORMICK & CO INC	7,476	94.970	709,995.720	
MCDONALD'S CORPORATION	59,065	155.520	9,185,788.800	
S&P GLOBAL INC	18,409	148.800	2,739,259.200	
EVEREST RE GROUP LTD	2,675	265.580	710,426.500	
MANPOWERGROUP INC	4,257	115.850	493,173.450	
MARKEL CORPORATION	989	971.110	960,427.790	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	117.530	1,854,153.280	
MARSH & MCLENNAN COS	36,298	78.090	2,834,510.820	
MASCO CORP	23,043	38.740	892,685.820	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	224.740	985,934.380	
MATTEL INC	24,003	20.920	502,142.760	
METLIFE INC	65,073	56.050	3,647,341.650	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	46.030	936,342.260	
MEDTRONIC PLC	97,255	87.200	8,480,636.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,233	58.510	2,939,132.830	
CVS HEALTH CORP	73,660	78.140	5,755,792.400	
MERCK & CO. INC.	195,588	62.830	12,288,794.040	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	151.520	1,087,307.520	
MICROSOFT CORP	521,733	69.980	36,510,875.340	
MICRON TECH INC	76,146	30.500	2,322,453.000	
MIDDLEBY CORP	4,100	119.230	488,843.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,176	78.760	1,195,261.760	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	16.120	426,583.560	
3M CO	42,366	210.490	8,917,619.340	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,188	246.640	1,032,928.320	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,150	87.230	972,614.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	104.670	758,543.490	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	24.600	306,097.800	
MYLAN NV	31,344	37.720	1,182,295.680	
ILLUMINA INC	10,453	169.000	1,766,557.000	
XCEL ENERGY INC	37,554	45.560	1,710,960.240	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	32.600	878,178.800	
NETAPP INC	20,641	38.570	796,123.370	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	26.360	362,186.400	
NEWELL BRANDS INC	32,324	53.400	1,726,101.600	
NEWMONT MINING CORP	38,093	32.530	1,239,165.290	
NVR INC	229	2,526.920	578,664.680	
NIKE INC-CL B	94,835	58.730	5,569,659.550	
NOBLE ENERGY INC	31,005	27.730	859,768.650	
NORDSTROM INC	9,487	46.220	438,489.140	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,367	123.000	2,505,141.000	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	59.910	1,383,022.350	
NISOURCE INC	22,198	25.210	559,611.580	
COACH INC	19,175	47.570	912,154.750	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	98.550	1,585,669.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,954	261.780	3,129,318.120	
WELLS FARGO & CO	338,228	55.590	18,802,094.520	
NUCOR CORP	23,780	58.710	1,396,123.800	
MONSANTO CO	30,927	117.760	3,641,963.520	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	47.480	756,213.960	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,190	82.050	2,805,289.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,049	58.770	3,176,459.730	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.210	548,317.880	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	173.170	1,103,958.750	
ORACLE CORP	218,122	49.620	10,823,213.640	
PACCAR INC	24,366	68.480	1,668,583.680	
EXELON CORP	65,213	35.760	2,332,016.880	
PARKER HANNIFIN CORP	9,025	163.350	1,474,233.750	
PATTERSON COS INC	7,169	44.000	315,436.000	

PAYCHEX INC	23,141	57.840	1,338,475.440	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	64.120	418,447.120	
MEDNAX INC	5,672	57.780	327,728.160	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	151.580	796,552.900	
PPL CORPORATION	49,957	37.940	1,895,368.580	
PEPSICO INC	101,417	114.270	11,588,920.590	
PENTAIR PLC	11,775	66.860	787,276.500	
PFIZER INC	422,273	33.410	14,108,140.930	
CONOCOPHILLIPS	87,671	43.240	3,790,894.040	
PVH CORP	5,387	112.000	603,344.000	
PG&E CORP	37,651	65.060	2,449,574.060	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	158.470	1,926,678.260	
ALTRIA GROUP INC	137,960	73.690	10,166,272.400	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,864	127.200	4,434,700.800	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	88.960	445,689.600	
GARMIN LTD	7,795	50.260	391,776.700	
AETNA INC	25,247	154.040	3,889,047.880	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	45.370	445,578.770	
PPG INDUSTRIES INC	17,934	110.980	1,990,315.320	
PRAXAIR INC	20,519	133.340	2,736,003.460	
COSTCO WHOLESALE CORP	31,576	151.000	4,767,976.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	16,193	77.050	1,247,670.650	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	108.590	1,126,947.020	
PROCTER & GAMBLE CO	181,616	87.090	15,816,937.440	
PROGRESSIVE CORP	41,336	45.000	1,860,120.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	41.970	1,557,716.550	
PULTE GROUP INC	21,209	25.070	531,709.630	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	13.100	398,082.800	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	88.650	954,671.850	
QUALCOMM INC	106,032	55.640	5,899,620.480	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	82.400	839,408.800	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	140.920	498,152.200	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	499.910	2,828,990.690	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	130.150	604,156.300	
AUTONATION INC	5,772	40.340	232,842.480	
RESMED INC	9,394	76.820	721,647.080	
US BANCORP	122,040	52.310	6,383,912.400	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	51.280	375,215.760	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	95.470	828,106.780	
ROSS STORES INC	28,189	54.800	1,544,757.200	
ROLLINS INC	5,357	40.820	218,672.740	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,021	234.740	1,648,109.540	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,689	164.690	1,430,991.410	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	109.190	1,342,272.670	
RAYTHEON COMPANY	21,099	166.040	3,503,277.960	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	256.040	985,241.920	
ACCENTURE PLC-CL A	44,729	124.060	5,549,079.740	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	109,427	43.050	4,710,832.350	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	146.210	1,293,812.290	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	107.620	1,300,695.320	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	125.770	2,484,586.350	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	23,052	87.300	2,012,439.600	
PRICELINE GROUP INC	3,537	1,921.820	6,797,477.340	
SCHLUMBERGER LTD	99,838	65.350	6,524,413.300	
SCHWAB (CHARLES) CORP	84,325	43.630	3,679,099.750	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	127.400	1,805,895.000	
BUNGE LTD	10,334	76.470	790,240.980	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	54.460	604,887.220	
ANTHEM INC	18,623	192.120	3,577,850.760	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	92.490	1,133,649.930	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	65.360	1,401,449.120	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	351.930	2,096,798.940	
CENTENE CORP	12,713	81.130	1,031,405.690	
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	180.920	627,430.560	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	57.200	547,118.000	
VCA INC	5,491	92.400	507,368.400	
ACUITY BRANDS INC	3,087	198.430	612,553.410	
SNAP-ON INC	3,932	154.140	606,078.480	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,741	111.340	3,422,702.940	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	101.170	533,469.410	
EDISON INTERNATIONAL	24,139	76.440	1,845,185.160	
SOUTHERN CO	70,176	47.280	3,317,921.280	
BB&T CORP	56,160	45.350	2,546,856.000	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	63.130	716,651.760	
AT&T INC	435,529	36.830	16,040,533.070	
CHEVRON CORP	134,175	103.040	13,825,392.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,629	145.880	1,550,558.520	
STAPLES INC	52,662	10.090	531,359.580	
STATE STREET CORP	27,099	91.520	2,480,100.480	
STARBUCKS CORP	103,002	57.810	5,954,545.620	
STEEL DYNAMICS INC	15,309	36.350	556,482.150	
STRYKER CORP	23,732	140.560	3,335,769.920	
NETFLIX INC	30,997	152.670	4,732,311.990	
STERICYCLE INC	6,853	75.390	516,647.670	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	57.550	2,000,207.800	
SYMANTEC CORP	46,581	29.000	1,350,849.000	
SYNOPSIS INC	10,656	73.500	783,216.000	
SYSCO CORP	35,926	49.370	1,773,666.620	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,837	947.250	2,687,348.250	

TELEFLEX INC	3,203	208.480	667,761.440	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	31.170	1,990,298.010	
TESORO CORP	9,395	96.120	903,047.400	
TEXAS INSTRUMENTS INC	71,769	78.780	5,653,961.820	
TEXTRON INC	19,076	48.520	925,567.520	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,346	177.670	5,036,233.820	
TIFFANY & CO	8,733	91.330	797,584.890	
TOLL BROTHERS INC	9,526	40.950	390,089.700	
TORCHMARK CORP	7,699	77.860	599,444.140	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	58.890	664,220.310	
DAVITA INC	9,983	62.340	622,340.220	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	50.660	469,922.160	
TRIMBLE INC	20,073	36.740	737,482.020	
TYSON FOODS INC	21,621	59.280	1,281,692.880	
UGI CORP	12,068	48.150	581,074.200	
MARATHON OIL CORP	66,702	11.520	768,407.040	
UNION PACIFIC CORP	58,542	108.500	6,351,807.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	55,039	123.060	6,773,099.340	
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,346	186.950	12,777,284.700	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	121.750	773,234.250	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	103.060	705,754.880	
VF CORP	24,309	56.530	1,374,187.770	
CBS CORP	26,212	63.700	1,669,704.400	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	128.660	2,282,685.720	
VULCAN MATERIALS CO	9,977	125.920	1,256,303.840	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66,096	77.160	5,099,967.360	
WAL-MART STORES INC	109,408	73.230	8,011,947.840	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	73.980	2,383,339.680	
WATERS CORP	5,963	180.390	1,075,665.570	
ALLERGAN PLC	24,096	241.170	5,811,232.320	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	114.410	1,001,659.550	
VAIL RESORTS INC	2,598	203.050	527,523.900	
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	89.270	1,831,463.320	
WABTEC CORP	5,497	90.500	497,478.500	
WHIRLPOOL CORP	5,553	192.830	1,070,784.990	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	100.050	1,353,576.450	
WYNN RESORTS LTD	6,279	134.950	847,351.050	
WHOLE FOODS MARKET INC	22,675	41.850	948,948.750	
NASDAQ INC	9,132	71.340	651,476.880	
CME GROUP INC	23,934	124.110	2,970,448.740	
WILLIAMS COS INC	61,081	30.440	1,859,305.640	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	37.020	277,242.780	
LKQ CORP	22,948	31.730	728,140.040	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	39.560	648,111.480	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	60.820	1,405,975.940	

FOOT LOCKER INC	9,476	48.400	458,638.400	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	44.840	835,414.040	
CARMAX INC	13,513	64.200	867,534.600	
XEROX CORP	17,455	28.880	504,100.400	
XILINX INC	18,777	67.180	1,261,438.860	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	92.220	645,816.660	
TJX COMPANIES INC	46,499	68.680	3,193,551.320	
ZIONS BANCORP	12,690	44.660	566,735.400	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	7.510	711,197.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	64.100	1,006,370.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	41.900	716,490.000	
SIGNATURE BANK	4,171	141.640	590,780.440	
CBRE GROUP INC	20,976	36.770	771,287.520	
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	31.720	509,835.560	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	14.750	1,246,168.500	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	211.620	689,034.720	
T-MOBILE US INC	21,188	60.800	1,288,230.400	
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	62.170	1,764,819.790	
MOSAIC CO/THE	26,525	23.800	631,295.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	30,914	27.840	860,645.760	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	28.280	2,130,615.200	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	76.600	419,231.800	
CELANESE CORP	10,766	96.150	1,035,150.900	
DEXCOM INC	6,161	70.960	437,184.560	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	26.250	273,603.750	
EXPEDIA INC	8,709	149.980	1,306,175.820	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	29.720	549,077.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	132.850	1,405,287.300	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	30.710	1,284,230.780	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	65.500	2,756,567.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	20.600	302,737.600	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	34.000	836,808.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	407.550	736,442.850	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	78.260	484,507.660	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	270.610	1,031,565.320	
MASTERCARD INC	67,554	122.730	8,290,902.420	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	23.780	702,247.180	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	101.370	753,787.320	
HANESBRANDS INC	27,619	22.910	632,751.290	
WESTERN UNION CO	35,222	18.700	658,651.400	

LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	52.070	485,396.540	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	47.490	550,219.140	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	21.750	393,653.250	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	74.770	622,834.100	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,440	17.790	328,047.600	
DELTA AIR LINES INC	14,611	54.810	800,828.910	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	30.770	195,512.580	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	61.100	1,660,514.700	
TE CONNECTIVITY LTD	25,036	79.430	1,988,609.480	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	121.570	1,282,806.640	
WABCO HOLDING INC	3,176	128.220	407,226.720	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	58.680	392,158.440	
VMWARE INC	5,491	88.340	485,074.940	
MERCADOLIBRE INC	2,861	259.820	743,345.020	
ULTA BEAUTY INC	4,332	268.820	1,164,528.240	
INVESCO LTD	29,824	36.470	1,087,681.280	
MSCI INC	6,462	102.990	665,521.380	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	110,255	118.160	13,027,730.800	
VISA INC	131,981	95.090	12,550,073.290	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	89.210	1,121,548.120	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	77.870	933,817.040	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	67.310	443,236.350	
SIGNET JEWELERS LTD	4,205	60.930	256,210.650	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,085	25.470	409,684.950	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	54.080	1,983,275.840	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	66.450	772,414.800	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	123.400	225,328.400	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	140,475	19.080	2,680,263.000	
XYLEM INC	11,630	54.610	635,114.300	
ALKERMES PLC	12,053	58.100	700,279.300	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,129	84.200	2,031,661.800	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	193.280	672,421.120	
SPLUNK INC	10,674	57.620	615,035.880	
HCA HEALTHCARE INC	21,493	85.880	1,845,818.840	
VERISK ANALYTICS INC	10,203	83.450	851,440.350	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	153.140	610,569.180	

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	144.780	947,440.320	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,555	103.430	1,091,703.650	
CIT GROUP INC	9,287	48.910	454,227.170	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	109.320	2,476,316.640	
TARGA RESOURCES CORP	12,532	43.840	549,402.880	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.450	182,520.000	
LEAR CORP	5,132	147.270	755,789.640	
CBOE HOLDINGS INC	6,176	92.690	572,453.440	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	38.770	412,241.410	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	69.490	1,344,978.950	
FORTINET INC	11,399	38.500	438,861.500	
AON PLC	19,411	135.300	2,626,308.300	
TESLA INC	9,357	316.050	2,957,279.850	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	44.120	502,615.040	
GENERAL MOTORS CO	93,036	35.190	3,273,936.840	
VANTIV INC	12,141	62.010	752,863.410	
TRIPADVISOR INC	9,263	36.190	335,227.970	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	20.800	653,307.200	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	35.890	427,916.470	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	37.230	503,535.750	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,069	90.930	1,733,944.170	
PHILLIPS 66	30,976	82.460	2,554,280.960	
FACEBOOK INC	167,244	153.500	25,671,954.000	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,051	88.270	887,201.770	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	88.030	620,963.620	
SERVICENOW INC	11,473	108.190	1,241,263.870	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	137.570	969,593.360	
TESARO INC	2,646	132.650	350,991.900	
WORKDAY INC	8,710	98.410	857,151.100	
ABBVIE INC	112,765	71.830	8,099,909.950	
ZOETIS INC	34,481	62.470	2,154,028.070	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	54.030	660,462.720	
COTY INC	38,871	18.430	716,392.530	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.150	397,958.450	
MALLINCKRODT PLC	7,835	41.860	327,973.100	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	30.490	393,046.590	
CDW CORP	9,877	62.630	618,596.510	
SPRINT CORP	63,882	8.230	525,748.860	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	52.660	537,079.340	
ARCONIC INC	27,513	23.830	655,634.790	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	60.840	528,821.280	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.840	204,445.040	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	40.590	542,607.120	

XL GROUP LTD	20,259	45.010	911,857.590	
BROADCOM LTD	28,323	241.770	6,847,651.710	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	61.500	927,051.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	19.130	294,793.300	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	37.230	1,057,480.920	
TECHNIPFMC LTD	32,556	27.170	884,546.520	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	21.290	280,240.270	
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	62.150	433,807.000	
TWITTER INC	43,692	18.080	789,951.360	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	26.260	205,799.620	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	38.110	492,381.200	
ALLEGION PLC	5,646	81.530	460,318.380	
PERRIGO CO PLC	8,553	72.010	615,901.530	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	62.200	920,311.200	
ARAMARK	17,307	40.090	693,837.630	
SABRE CORP	17,624	21.330	375,919.920	
NAVIENT CORP	22,636	16.390	371,004.040	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	27.370	477,715.980	
ARISTA NETWORKS INC	3,158	149.350	471,647.300	
IHS MARKIT LTD	26,741	43.720	1,169,116.520	
FNF GROUP	17,760	44.660	793,161.600	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	29.130	1,674,538.050	
MOBILEYE NV	14,001	63.000	882,063.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	37.050	1,291,007.250	
CDK GLOBAL INC	8,309	62.320	517,816.880	
QORVO INC	8,784	65.000	570,960.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	30.050	342,239.450	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	86.590	676,960.620	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	32.430	477,045.300	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	37.500	1,006,500.000	
WESTROCK CO	17,744	58.290	1,034,297.760	
KRAFT HEINZ CO	43,818	82.770	3,626,815.860	
FORTIVE CORP	21,275	64.600	1,374,365.000	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	64.990	1,226,946.210	
ALPHABET INC-CL A	21,047	951.000	20,015,697.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	16.740	2,035,416.600	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,567	54.940	4,426,350.980	
FIRST DATA CORP	22,035	18.280	402,799.800	
DXC TECHNOLOGY CO	21,001	77.850	1,634,927.850	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	46.150	375,384.100	
ALPHABET INC-CL C	22,237	928.800	20,653,725.600	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	170.040	1,001,875.680	
ATHENE HOLDING LTD	4,651	49.640	230,875.640	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,531	336.600	5,227,734.600	
アメリカ・ドル 小計	22,454,952		1,519,469,562.090	

				(173,553,813,382)	
イギリス・ボンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	3.063	218,517.480	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	8.240	213,457.200	
	ASHTAD GROUP	35,233	15.670	552,101.110	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	21.900	326,244.300	
	BHP BILLITON PLC	153,323	12.635	1,937,236.100	
	BARCLAYS PLC	1,187,723	2.077	2,466,900.670	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.915	382,594.030	
	BT GROUP PLC	586,659	2.884	1,691,924.550	
	SKY PLC	72,210	9.960	719,211.600	
	BUNZL PLC	22,241	22.440	499,088.040	
	EASYJET PLC	13,628	14.140	192,699.920	
	CAPITA PLC	54,894	6.530	358,457.820	
	AVIVA PLC	285,738	5.360	1,531,555.680	
	CRODA INTERNATIONAL	8,407	38.490	323,585.430	
	DIAGEO PLC	180,700	22.840	4,127,188.000	
	SCHRODERS PLC	7,188	32.250	231,813.000	
	DCC PLC	5,936	69.450	412,255.200	
	NATIONAL GRID PLC	222,404	9.311	2,070,803.640	
	GKN PLC	134,180	3.269	438,634.420	
	KINGFISHER PLC	165,680	3.065	507,809.200	
	BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.300	1,418,608.800	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	23.300	279,297.100	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	132,002	52.100	6,877,304.200	
	COBHAM PLC	142,739	1.294	184,704.260	
	NEXT PLC	9,731	36.930	359,365.830	
	IMPERIAL BRANDS PLC	66,645	34.350	2,289,255.750	
	IMI PLC	21,218	12.190	258,647.420	
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	27.750	347,624.250	
	ANGLO AMERICAN PLC	93,573	10.680	999,359.640	
	COMPASS GROUP PLC	115,111	15.810	1,819,904.910	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,411,039	7.383	10,417,700.930	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.641	1,118,857.000	
	CENTRICA PLC	392,766	2.067	811,847.320	
	UNILEVER PLC	90,618	42.045	3,810,033.810	
	MEGGITT PLC	62,181	4.886	303,816.360	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.428	377,995.890	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	8.640	480,375.360	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.430	519,955.520	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	29.660	750,635.280	
	PEARSON PLC	65,009	6.905	448,887.140	
PERSIMMON PLC	23,150	23.750	549,812.500		
PRUDENTIAL PLC	185,764	17.985	3,340,965.540		
RIO TINTO PLC	86,280	33.985	2,932,225.800		
VODAFONE GROUP PLC	1,906,649	2.199	4,192,721.150		

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	46,978	76.710	3,603,682.380	
RELX PLC	80,689	16.350	1,319,265.150	
OLD MUTUAL PLC	339,296	1.914	649,412.540	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	9.320	1,090,123.120	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.564	716,489.280	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.940	488,154.960	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.700	299,247.900	
SSE PLC	73,043	14.700	1,073,732.100	
BP PLC	1,387,131	4.437	6,154,700.240	
SHIRE PLC	65,457	41.865	2,740,357.300	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.760	576,431.960	
SMITHS GROUP PLC	31,720	16.240	515,132.800	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	8.124	1,929,718.090	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,092,030	0.665	3,386,199.950	
TATE & LYLE PLC	39,915	6.680	266,632.200	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.800	455,439.600	
TESCO PLC	562,988	1.710	962,709.480	
3I GROUP PLC	66,784	9.040	603,727.360	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.030	861,999.650	
GLAXOSMITHKLINE PLC	347,104	16.160	5,609,200.640	
WEIR GROUP	18,336	17.880	327,847.680	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	37.310	816,641.280	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	8.645	184,155.790	
WPP PLC	90,628	15.670	1,420,140.760	
WOLSELEY PLC	18,238	47.000	857,186.000	
ASTRAZENECA PLC	90,970	51.300	4,666,761.000	
WHITBREAD PLC	12,159	38.140	463,744.260	
CARNIVAL PLC	13,153	51.250	674,091.250	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.390	407,783.100	
INTERTEK GROUP PLC	10,500	42.230	443,415.000	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	16.200	484,266.600	
INVESTEC PLC	50,655	5.755	291,519.520	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	42.930	530,700.660	
ITV PLC	247,210	1.775	438,797.750	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.461	269,258.010	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	67.650	473,414.700	
G4S PLC	122,250	3.270	399,757.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.200	321,038.600	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	33.300	357,175.800	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	313,896	20.410	6,406,617.360	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	265,581	20.590	5,468,312.790	
INMARSAT PLC	34,127	7.395	252,369.160	
PETROFAC LTD	21,809	4.372	95,348.940	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	13.880	159,023.160	

	TUI AG-DI	30,153	11.340	341,935.020	
	STANDARD LIFE PLC	130,178	4.079	530,996.060	
	EXPERIAN PLC	63,310	15.730	995,866.300	
	MONDI PLC	24,061	20.210	486,272.810	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	12.850	273,576.500	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	14.300	223,637.700	
	GLENCORE PLC	857,521	3.010	2,581,138.210	
	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	2.780	235,296.420	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.637	409,868.070	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	7.210	220,741.360	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	22.290	298,819.740	
	CONVATEC GROUP PLC	73,187	3.042	222,634.850	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	4.145	228,223.700	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.733	236,825.120	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.690	281,724.120	
	WORLDPAY GROUP PLC	112,202	3.730	418,513.460	
イギリス・ボンド	小計	21,761,073		131,589,771.960 (19,356,855,454)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	78,428	24.740	1,940,308.720	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	17.270	2,146,142.900	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.896	1,109,804.080	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	439.800	774,048.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	246.000	639,600.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	16.370	808,858.070	
	NICE LTD	4,035	276.000	1,113,660.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	65.410	683,142.040	
イスラエル・シュケル	小計	459,178		9,215,563.810 (296,648,999)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	72.500	805,837.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	206,758	28.740	5,942,224.920	
	AMCOR LTD	80,741	16.090	1,299,122.690	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	241,541	30.870	7,456,370.670	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	11.810	361,019.890	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	5.090	580,896.250	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	4.360	1,189,926.840	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.220	437,737.080	
	AMP LTD	200,498	5.200	1,042,589.600	
	ASX LTD	11,408	52.740	601,657.920	
	BHP BILLITON LTD	232,053	24.520	5,689,939.560	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	31.260	654,771.960	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	14.890	566,415.600	

CSL LIMITED	32,094	133.320	4,278,772.080	
REA GROUP LTD	4,119	63.350	260,938.650	
TRANSURBAN GROUP	149,591	11.320	1,693,370.120	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.730	424,286.730	
COCHLEAR LTD	3,992	153.140	611,334.880	
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	6.900	839,874.900	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	121,935	82.810	10,097,437.350	
BORAL LIMITED	86,101	6.930	596,679.930	
RIO TINTO LIMITED	28,604	65.100	1,862,120.400	
APA GROUP	73,253	8.930	654,149.290	
ARISTOCRAT LEISU	44,406	21.750	965,830.500	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.860	1,176,291.060	
TPG TELECOM LTD	28,719	5.570	159,964.830	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	19.680	704,347.200	
ORICA LTD	25,308	20.630	522,104.040	
CIMIC GROUP LTD	8,709	38.490	335,209.410	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.050	519,021.050	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.880	585,694.400	
MACQUARIE GROUP LTD	21,869	87.790	1,919,879.510	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	14.800	1,379,078.800	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	30.060	5,798,032.920	
NEWCREST MINING LTD	51,533	19.920	1,026,537.360	
OIL SEARCH LTD	93,715	6.470	606,336.050	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.290	448,841.540	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	12.280	1,171,389.200	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.880	588,706.160	
SANTOS LTD	133,862	2.910	389,538.420	
SONIC HEALTHCARE	26,192	22.690	594,296.480	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.290	303,629.040	
WESFARMERS LTD	81,021	40.870	3,311,328.270	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.040	376,610.520	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,421	29.410	1,482,881.610	
WOOLWORTHS LTD	89,626	25.770	2,309,662.020	
SEEK LTD	25,899	16.940	438,729.060	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	51.450	235,692.450	
TATTS GROUP LTD	109,937	4.040	444,145.480	
AUSNET SERVICES	165,066	1.680	277,310.880	
AGL ENERGY LTD	46,315	25.000	1,157,875.000	
BRAMBLES LTD	115,255	9.510	1,096,075.050	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.210	401,232.810	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	5.360	746,026.240	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	12.580	638,925.620	

	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.130	317,470.110	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.860	506,723.360	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	2.720	998,395.040	
オーストラリア・ドル 小計		5,356,593		81,881,286.300 (7,115,483,779)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	57.320	925,202.120	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	59.310	1,822,477.680	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	20.370	1,703,909.760	
	ATCO LTD	7,193	50.210	361,160.530	
	BANK OF MONTREAL	45,599	96.080	4,381,151.920	
	BANK OF NOVA SCOTIA	86,583	78.490	6,795,899.670	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	55.080	1,308,480.480	
	BCE INC	11,568	57.970	670,596.960	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,043	50.120	3,259,955.160	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	21.490	554,850.310	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.370	359,327.550	
	SAPUTO INC	14,101	40.300	568,270.300	
	BLACKBERRY LTD	39,652	12.710	503,976.920	
	CGI GROUP INC	15,228	66.040	1,005,657.120	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	61.980	702,853.200	
	CAE INC	23,000	22.760	523,480.000	
	CAMECO CORP	32,627	12.380	403,922.260	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	61.450	1,595,672.150	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	27,976	106.100	2,968,253.600	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	36.950	2,934,569.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	144.700	703,531.400	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	41.120	374,973.280	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,387	106.470	5,790,583.890	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.840	226,513.280	
	AGRIUM INC	9,382	123.330	1,157,082.060	
	YAMANA GOLD INC	67,520	2.990	201,884.800	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	39.850	555,110.500	
	OPEN TEXT CORP	19,756	40.540	800,908.240	
	EMPIRE CO LTD	15,093	22.150	334,309.950	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	5.150	513,666.150	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	25.300	250,267.600	
	FORTIS INC	29,002	44.710	1,296,679.420	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	11.700	646,963.200	
	TELUS CORP	18,945	44.650	845,894.250	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	35.770	688,500.960		
IMPERIAL OIL LTD	21,542	36.170	779,174.140		
ENBRIDGE INC	63,110	51.300	3,237,543.000		
IGM FINANCIAL INC	8,426	40.510	341,337.260		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.460	304,462.700		

MANULIFE FINANCIAL CORP	136,891	24.920	3,411,323.720	
LINAMAR CORP	3,827	65.530	250,783.310	
LOBLAW CO LTD	15,354	71.040	1,090,748.160	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	57.680	376,304.320	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	60.330	1,528,701.870	
SUN LIFE FINANCIAL INC	41,631	47.060	1,959,154.860	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,805	570.480	1,029,716.400	
METRO INC	14,275	42.470	606,259.250	
HUSKY ENERGY INC	28,749	13.630	391,848.870	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.230	369,126.160	
METHANEX CORP	7,381	55.660	410,826.460	
ONEX CORP	6,646	103.370	686,997.020	
GOLDCORP INC	56,071	16.410	920,125.110	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	22.130	1,351,611.880	
POWER CORP OF CANADA	25,052	30.450	762,833.400	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	33.920	593,057.280	
ROYAL BANK OF CANADA	106,285	94.900	10,086,446.500	
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,789	57.280	503,433.920	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	209.680	2,224,075.760	
SHAW COMM INC-B	27,548	27.770	765,007.960	
SUNCOR ENERGY INC	120,732	36.530	4,410,339.960	
ENCANA CORP	69,257	11.280	781,218.960	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	23.650	970,028.400	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	58.810	1,203,781.890	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	133,609	65.310	8,726,003.790	
TRANSCANADA CORP	62,895	62.300	3,918,358.500	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	60.660	345,519.360	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	115.690	359,217.450	
INTACT FINANCIAL CORP	8,301	97.090	805,944.090	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	25.020	849,253.860	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	659.060	984,635.640	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	12,129	91.760	1,112,957.040	
CI FINANCIAL CORP	20,695	27.700	573,251.500	
VERESEN INC	24,982	18.270	456,421.140	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	26.280	414,672.120	
KEYERA CORP	13,728	40.000	549,120.000	
ALTAGAS LTD	12,538	29.300	367,363.400	
PEMBINA PIPELINE CORP	30,719	42.690	1,311,394.110	
DOLLARAMA INC	7,504	122.030	915,713.120	
CENOVUS ENERGY INC W/I	59,124	9.080	536,845.920	
VERMILION ENERGY INC	8,291	39.510	327,577.410	
ARC RESOURCES LTD	22,997	16.720	384,509.840	

	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	22.530	326,527.290	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	9.160	280,579.960	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	24.650	593,645.950	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	27.940	418,010.340	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	20.840	359,094.040	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	79.870	1,226,244.110	
	SHOPIFY INC	5,021	117.460	589,766.660	
	HYDRO ONE LTD	16,612	22.700	377,092.400	
カナダ・ドル 小計		2,944,381		116,192,523.230 (10,292,333,707)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.650	456,250.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	3.150	256,410.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.160	390,892.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.375	259,552.500	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	125,200	21.000	2,629,200.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	10.820	313,780.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	43.630	259,336.720	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.080	214,884.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.380	508,482.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.520	677,300.800	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.075	447,630.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	6.420	765,906.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.280	405,612.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	10.800	2,434,892.400	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.900	2,308,495.800	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.060	477,850.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	23.310	2,202,795.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.320	305,440.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	2.870	493,927.000		
シンガポール・ドル 小計		3,423,074		15,808,636.220 (1,303,580,143)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	171,488	14.630	2,508,869.440	
	NESTLE SA-REGISTERED	221,371	82.900	18,351,655.900	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	78.300	2,931,395.400	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	49,851	241.200	12,024,061.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	202.000	572,670.000	
	SIKA INHABER	151	6,230.000	940,730.000	

SGS SA-REG	405	2,320.000	939,600.000	
NOVARTIS AG-REG SHS	158,500	79.500	12,600,750.000	
BALOISE HOLDING AG -R	4,127	152.200	628,129.400	
BARRY CALLEBAUT AG	144	1,319.000	189,936.000	
SWISSCOM AG-REG	1,795	465.200	835,034.000	
ABB LTD	137,622	23.800	3,275,403.600	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	73.350	905,212.350	
GEBERIT AG	2,801	448.600	1,256,528.600	
LONZA GROUP AG-REG	5,096	209.800	1,069,140.800	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,465.000	409,875.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	6	65,380.000	392,280.000	
GIVAUDAN-REG	692	1,905.000	1,318,260.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,594	289.200	3,063,784.800	
LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	56.250	1,838,025.000	
SONOVA HOLDING AG	3,410	157.300	536,393.000	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	159.500	588,076.500	
STRAUMANN HOLDING AG	600	543.500	326,100.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	352.300	688,746.500	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	69.200	317,766.400	
SCHINDLER NAMEN	1,663	198.500	330,105.500	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	342.100	761,172.500	
VIFOR PHARMA AG	3,050	105.300	321,165.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	697.000	385,441.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	88.200	528,318.000	
DUFREY GROUP	2,390	158.800	379,532.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	602.000	765,744.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	51.800	788,758.600	
SWISS RE LTD	23,838	91.050	2,170,449.900	
UBS GROUP AG	257,538	16.940	4,362,693.720	
スイス・フラン 小計	1,177,998		79,301,804.110 (9,372,680,228)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	328.000	15,867,656.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	292.700	8,534,253.900	
ERICSSON LM-B SHS	221,748	61.550	13,648,589.400	
GETINGE AB-B SHS	13,153	164.800	2,167,614.400	
SKF AB-B SHS	24,866	175.400	4,361,496.400	
SANDVIK AB	75,199	135.000	10,151,865.000	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	103,683	103.800	10,762,295.400	
SKANSKA AB-B SHS	21,179	205.000	4,341,695.000	
SWEDBANK AB	66,507	212.500	14,132,737.500	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	124.300	13,472,628.400	
VOLVO AB-B SHS	113,672	149.000	16,937,128.000	
SWEDISH MATCH AB	11,481	292.400	3,357,044.400	
TELE2 AB-B SHS	26,976	90.050	2,429,188.800	
NORDEA AB	218,620	109.400	23,917,028.000	
INDUSTRIVARDEN C	11,403	200.800	2,289,722.400	

	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	282.300	5,417,619.300	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	140.200	3,378,539.600	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	406.400	13,578,636.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	208.500	13,854,408.000	
	ASSA ABLOY AB-B	68,613	182.600	12,528,733.800	
	TELIA CO AB	184,927	38.440	7,108,593.880	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	161.300	2,708,227.000	
	BOLIDEN AB	21,855	229.000	5,004,795.000	
	ALFA LAVAL AB	17,754	178.900	3,176,190.600	
	KINNEVIK AB-B	18,310	254.500	4,659,895.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	506.500	2,700,658.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	311.000	1,841,120.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	84.600	2,850,343.200	
	HEXAGON AB	16,702	402.300	6,719,214.600	
	ESSITY AB-B	41,080	237.000	9,735,960.000	
スウェーデン・クローナ 小計		1,668,533		241,633,877.780 (3,274,139,044)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	675.500	4,951,415.000	
	A P MOLLER A/S	481	13,710.000	6,594,510.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	12,940.000	3,532,620.000	
	DANSKE BANK A/S	52,545	256.800	13,493,556.000	
	GENMAB A/S	3,848	1,386.000	5,333,328.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	279.000	4,437,216.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	130,001	274.000	35,620,274.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	618.500	9,777,248.000	
	TDC A/S	68,939	37.500	2,585,212.500	
	COLOPLAST-B	8,286	543.000	4,499,298.000	
	DSV A/S	13,040	396.300	5,167,752.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	169.000	1,104,753.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	395.500	1,914,220.000	
	TRYG A/S	11,107	140.500	1,560,533.500	
	PANDORA A/S	8,251	658.500	5,433,283.500	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	491.100	3,785,398.800	
	ISS A/S	11,125	256.300	2,851,337.500	
DONG ENERGY A/S	11,600	293.000	3,398,800.000		
デンマーク・クローネ 小計		377,623		116,040,755.800 (2,030,713,226)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.915	677,614.680	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	7.810	587,944.610	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.805	799,662.600	
ニュージーランド・ドル 小計		383,434		2,065,221.890 (171,082,982)	
ノルウェー・ク ローネ	MARINE HARVEST	24,816	141.200	3,504,019.200	
	DNB ASA	70,426	141.600	9,972,321.600	

	NORSK HYDRO ASA	91,879	49.450	4,543,416.550	
	TELENOR ASA	53,178	138.400	7,359,835.200	
	SCHIBSTED ASA	9,131	209.200	1,910,205.200	
	ORKLA ASA	61,421	85.750	5,266,850.750	
	STATOIL ASA	81,414	137.500	11,194,425.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	310.500	3,502,129.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	144.700	2,414,030.100	
	ノルウェー・クロネ 小計	420,227		49,667,233.100 (680,441,093)	
ユーロ	CRH PLC	57,980	31.420	1,821,731.600	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	90.750	566,824.500	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	75.600	875,145.600	
	UMICORE	7,660	60.610	464,272.600	
	AIR LIQUIDE	26,982	107.950	2,912,706.900	
	AIRBUS SE	40,559	74.360	3,015,967.240	
	AXA	139,550	25.175	3,513,171.250	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	19.175	663,876.850	
	ADIDAS AG	13,503	175.050	2,363,700.150	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.050	1,294,224.750	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	41,829	16.360	684,322.440	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,228.250	192,835.250	
	DANONE	40,735	65.750	2,678,326.250	
	SAFRAN SA	22,050	82.000	1,808,100.000	
	INTESA SANPAOLO	934,915	2.860	2,673,856.900	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.648	135,519.340	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	21,987	81.620	1,794,578.940	
	ACCOR SA	10,385	40.540	421,007.900	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	28.095	212,482.480	
	BOUYGUES	13,996	37.025	518,201.900	
	BNP PARIBAS	80,741	65.560	5,293,379.960	
	RELX NV	70,826	17.665	1,251,141.290	
	THALES SA	8,128	94.860	771,022.080	
	CAPGEMINI SA	11,481	92.260	1,059,237.060	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	50.900	217,037.600	
	CHRISTIAN DIOR SE	3,940	241.900	953,086.000	
	INGENICO GROUP	4,334	83.150	360,372.100	
	UNICREDIT SPA	142,664	17.520	2,499,473.280	
	NATIXIS	70,166	6.109	428,644.090	
	KONINKLIJKE DSM NV	12,285	62.970	773,586.450	
	COMMERZBANK AG	72,573	11.145	808,826.080	
	EIFFAGE	4,777	79.570	380,105.890	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	74.840	2,256,875.040	
	UNITED INTERNET	9,882	48.415	478,437.030	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	48.570	269,369.220	
	PUBLICIS GROUPE	15,068	63.000	949,284.000	
	MAN SE	3,396	94.780	321,872.880	
	IBERDROLA SA	400,533	6.724	2,693,183.890	

ENI SPA	175,406	13.000	2,280,278.000	
IMERYS SA	2,256	78.180	176,374.080	
JERONIMO MARTINS	19,517	17.460	340,766.820	
KBC GROUPE	18,378	67.750	1,245,109.500	
HANNOVER RUECK SE	3,642	108.850	396,431.700	
WARTSILA OYJ	11,645	54.000	628,830.000	
L'OREAL	18,067	180.050	3,252,963.350	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	19,644	216.800	4,258,819.200	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	26.810	257,376.000	
GEA GROUP AG	14,635	37.875	554,300.620	
BOLLORE	71,347	3.985	284,317.790	
MEDIOBANCA SPA	42,404	8.870	376,123.480	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	119.250	1,445,071.500	
CONTINENTAL AG	7,776	191.400	1,488,326.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	33.145	2,318,293.880	
GAMESA	14,426	17.910	258,369.660	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	37.420	351,710.580	
AXEL SPRINGER SE	3,067	51.170	156,938.390	
OMV AG	9,766	45.035	439,811.810	
PERNOD-RICARD	14,983	116.000	1,738,028.000	
PEUGEOT SA	32,906	18.470	607,773.820	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,066	51.390	620,071.740	
RENAULT SA	12,442	80.950	1,007,179.900	
REPSOL SA	80,153	13.475	1,080,061.670	
REMY COINTREAU	1,860	99.620	185,293.200	
MERCK KGAA	9,551	102.050	974,679.550	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	47.330	1,689,964.980	
SAIPEM	46,575	3.356	156,305.700	
RWE AG	39,183	17.770	696,281.910	
SEB SA	1,405	157.650	221,498.250	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	51.350	595,762.700	
SOCIETE GENERALE-A	53,720	49.185	2,642,218.200	
VINCI S.A.	35,769	74.850	2,677,309.650	
SODEXO	6,286	102.950	647,143.700	
SOLVAY SA	5,036	120.700	607,845.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	38,992	67.640	2,637,418.880	
VIVENDI SA	69,780	19.760	1,378,852.800	
SAP SE	69,528	91.310	6,348,601.680	
TELEFONICA S.A	322,715	9.014	2,908,953.010	
TOTAL SA	166,329	42.765	7,113,059.680	
VALEO	17,731	61.840	1,096,485.040	
E.ON SE	142,688	8.426	1,202,289.080	
VOEST-ALPINE AG	9,875	41.700	411,787.500	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	23.750	362,947.500	
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	104.500	786,362.500	
METRO AG	10,774	28.995	312,392.130	
SIEMENS AG-REG	53,859	121.050	6,519,631.950	
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	25.500	941,383.500	

ING GROEP NV-CVA	278,212	15.595	4,338,716.140
BAYER AG	58,421	110.400	6,449,678.400
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	11.420	483,100.260
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,925	119.600	1,426,230.000
DAIMLER AG	68,940	63.360	4,368,038.400
BASF SE	65,856	81.470	5,365,288.320
BEIERSDORF AG	6,780	91.810	622,471.800
HOCHTIEF AG	1,707	156.250	266,718.750
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	87.560	963,948.040
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	83.900	1,262,527.200
ORANGE	141,819	14.045	1,991,847.850
SAMPO OYJ-A SHS	30,747	46.600	1,432,810.200
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	50.570	394,142.580
ALLIANZ SE	32,809	180.000	5,905,620.000
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.857	545,955.550
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	16.670	1,524,071.420
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	33.945	597,499.890
HERMES INTL	1,529	442.400	676,429.600
ENDESA S.A.	21,037	19.935	419,372.590
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	20.410	403,056.680
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	35.080	818,205.920
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,346	180.750	2,050,789.500
ARCELOR MITTAL (NL)	43,582	20.550	895,610.100
SOCIETE BIC SA	2,478	103.100	255,481.800
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	78.200	700,750.200
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,742	33.790	498,132.180
HEINEKEN NV	17,373	85.200	1,480,179.600
AKZO NOBEL	18,209	77.250	1,406,645.250
ASML HOLDING NV	26,185	117.700	3,081,974.500
AEGON NV	120,404	4.835	582,153.340
BANKINTER S.A.	57,960	8.261	478,807.560
VOLKSWAGEN AG	2,794	140.800	393,395.200
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	138.650	1,821,029.100
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	469,350	7.522	3,530,450.700
KERING	5,479	302.000	1,654,658.000
CNP ASSURANCES	13,987	20.465	286,243.950
FORTUM OYJ	29,739	13.990	416,048.610
AGEAS	12,993	37.595	488,471.830
UCB SA	8,747	59.730	522,458.310
THYSSENKRUPP AG	24,170	26.150	632,045.500
UNILEVER NV-CVA	117,106	48.465	5,675,542.290
CARREFOUR SA	39,144	21.190	829,461.360
GAS NATURAL SDG SA	29,010	20.365	590,788.650
ATOS SE	7,050	123.750	872,437.500
NOKIA OYJ	417,248	5.485	2,288,605.280

KONINKLIJKE PHILIPS NV	65,961	31.350	2,067,877.350	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	36.715	754,786.970	
SANOFI	82,189	83.900	6,895,657.100	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	13.425	615,751.050	
ELISA OYJ	9,517	33.920	322,816.640	
BANCO SANTANDER SA	1,047,057	5.809	6,082,354.110	
METSO OYJ	8,585	30.980	265,963.300	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.085	625,668.660	
QIAGEN N.V.	13,642	29.150	397,664.300	
LINDE AG	13,375	169.050	2,261,043.750	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	16.580	2,474,465.520	
BMW VORZUG	4,116	70.920	291,906.720	
K & S	14,982	23.040	345,185.280	
ENEL SPA	551,867	4.798	2,647,857.860	
COLRUYT NV	4,673	44.980	210,191.540	
VOPAK (KON.)	5,364	41.325	221,667.300	
GEDI GRUPPO EDITORIALE SPA	3,393	0.735	2,493.850	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	234,611	15.695	3,682,219.640	
LEONARDO SPA	26,269	15.050	395,348.450	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	18.645	1,524,676.230	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.871	657,364.250	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	495.350	393,307.900	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.000	183,984.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	95.480	1,321,825.120	
EURAZEO	2,427	68.010	165,060.270	
BANCO SABADELL	367,753	1.842	677,401.020	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	85.370	496,341.180	
FRAPORT AG	3,149	77.000	242,473.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	80.260	643,203.640	
INDITEX	79,821	33.745	2,693,559.640	
JC DECAUX SA	6,058	28.230	171,017.340	
ANDRITZ AG	6,265	53.060	332,420.900	
MAPFRE SA	84,474	3.198	270,147.850	
ESSILOR INTL	14,632	112.000	1,638,784.000	
SNAM SPA	158,419	3.846	609,279.470	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	14.660	1,254,676.100	
ENAGAS	18,095	23.660	428,127.700	
WENDEL	2,220	128.500	285,270.000	
TENARIS SA	38,237	13.600	520,023.200	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.791	626,600.930	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.632	314,480.670	
ATLANTIA SPA	27,920	24.600	686,832.000	
ILIAD SA	2,102	207.400	435,954.800	
PROXIMUS	8,922	30.800	274,797.600	
SES FDR	24,585	19.745	485,430.820	
TERNA SPA	117,108	4.790	560,947.320	
GRIFOLS SA	18,800	24.300	456,840.000	

FERROVIAL SA	36,193	18.705	676,990.060	
LANXESS AG	6,856	66.980	459,214.880	
NESTE OYJ	10,692	35.580	380,421.360	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	22.690	218,754.290	
RECORDATI SPA	6,859	35.240	241,711.160	
KONE OYJ	23,717	45.770	1,085,527.090	
ENGIE	118,752	13.160	1,562,776.320	
ALSTOM	12,046	30.545	367,945.070	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	54.810	199,179.540	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	22.175	278,118.850	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	8.640	300,291.840	
IPSEN SA	2,487	114.400	284,512.800	
DEUTSCHE WOHNEN AG	26,714	33.005	881,695.570	
ARKEMA SA	4,241	96.460	409,086.860	
LEGRAND SA	19,920	61.350	1,222,092.000	
ADP	2,313	139.500	322,663.500	
ORION OYJ	8,051	55.200	444,415.200	
RTL GROUP SA	3,446	64.900	223,645.400	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	13.090	496,385.890	
SYMRISE AG	7,926	60.940	483,010.440	
SCOR SE	13,875	37.040	513,930.000	
REXEL SA	23,245	13.695	318,340.270	
PRYSMIAN SPA	14,925	26.620	397,303.500	
CAIXABANK	262,372	4.269	1,120,066.060	
BUREAU VERITAS SA	21,480	19.330	415,208.400	
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	9.421	354,662.960	
SUEZ SA	25,406	16.135	409,925.810	
AMADEUS IT GROUP SA	30,169	53.670	1,619,170.230	
BRENTAG AG	9,600	50.170	481,632.000	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.154	320,120.030	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	5.268	254,470.740	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	28.820	333,591.500	
EDENRED	13,195	22.300	294,248.500	
BANKIA SA	63,197	4.590	290,074.230	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.270	262,780.070	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	61.660	321,741.880	
OSRAM LICHT AG	7,017	70.780	496,663.260	
GEMALTO	6,103	54.790	334,383.370	
VONOVIA SE	30,967	34.430	1,066,193.810	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.400	542,323.800	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	35.860	576,987.400	
FERRARI NV	8,338	77.900	649,530.200	

	IBERDROLA SA-RTS	400,533	0.146	58,477.810	
	INNOGY SE	9,769	35.435	346,164.510	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	10.370	815,548.650	
	ACS ACTIVIDADES DE CONS Y SERV-RTS	14,736	0.699	10,300.460	
	NN GROUP NV	21,965	32.890	722,428.850	
	ZALANDO SE	6,674	39.500	263,623.000	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	9.825	688,830.750	
	AENA SA	5,256	167.300	879,328.800	
	BANCO SANTANDER SA-RTS	1,047,057	0.096	100,517.470	
	ABN AMRO GROUP NV	19,363	24.070	466,067.410	
	EXOR NV	9,441	48.980	462,420.180	
	REPSOL SA-RTS	80,138	0.400	32,055.200	
	ALTICE NV-A	33,913	19.990	677,920.870	
	COVESTRO AG	5,966	64.580	385,284.280	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	54,813	98.300	5,388,117.900	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.080	243,291.200	
	SCHAEFFLER AG	12,644	12.350	156,153.400	
	UNIPER SE	16,058	16.910	271,540.780	
ユーロ	小計	15,332,320		273,533,076.860 (35,597,594,622)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	106.800	1,772,880.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.840	3,253,760.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	32.850	2,505,141.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	81.650	9,757,175.000	
	PCCW LTD	331,000	4.320	1,429,920.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	2.860	1,522,664.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	65.800	3,224,200.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	82,940	199.900	16,579,706.000	
	MTR CORP	118,500	44.100	5,225,850.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	30.500	1,921,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	163.200	9,139,200.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	43.400	3,638,829.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	68.150	6,576,475.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	64.350	6,161,512.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	610,046	14.640	8,931,073.440	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	36.750	1,837,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	46.400	7,609,600.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	33,000	26.450	872,850.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	249,000	37.200	9,262,800.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	32.400	1,636,200.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	9.920	4,377,358.720	
	SINO LAND CO	255,400	12.680	3,238,472.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	115.900	11,937,700.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	75.800	2,274,000.000	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	36.500	4,142,750.000	
	WHEELOCK & CO LTD	56,000	56.800	3,180,800.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	17.560	2,184,464.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	16.440	1,065,312.000	
	AIA GROUP LTD	865,227	56.250	48,669,018.750	
	HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.060	2,836,920.000	
	SANDS CHINA LTD	169,200	34.400	5,820,480.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	26.350	2,745,670.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.180	1,651,400.000	
	WH GROUP LTD	530,500	7.790	4,132,595.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	98.250	19,584,369.000	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	198,832	60.900	12,108,868.800	
香港・ドル	小計	6,809,497		232,809,014.810 (3,403,667,796)	
合計		82,568,883		266,449,034,455 (266,449,034,455)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	63,819.000	599,898.600	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	965,654.860	
		GPT GROUP	144,955.000	694,334.450	
		LENLEASE GROUP	37,363.000	645,632.640	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	624,102.130	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,546,262.640	
		STOCKLAND	193,279.000	827,234.120	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	681,516.360	
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,104,876.150	
	オーストラリア・ドル	小計	1,650,984.000	7,689,511.950 (668,218,589)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	522,095.600	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	66,100.000	113,031.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	392,030.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	359,227.000	
シンガポール・ドル	小計	658,006.000	1,386,383.600 (114,321,192)		
投資信託受益証券	合計		2,308,990	782,539,781 (782,539,781)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	552,144.450	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,587.000	654,852.270	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,027,228.530	

ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	946,616.880	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,412.000	1,758,538.080	
BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,317,600.640	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	389,616.750	
CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	531,962.400	
COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	564,505.960	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	25,678.000	2,546,487.260	
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,787.000	1,297,277.220	
DUKE REALTY TRUST	24,470.000	671,456.800	
EQUINIX INC	5,241.000	2,238,352.480	
EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,752,241.100	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,144,979.160	
EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	608,621.160	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,505.000	562,043.800	
GGP INC	43,463.000	982,263.800	
HCP INC	34,130.000	1,054,275.700	
HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	916,554.240	
IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	644,606.900	
KIMCO REALTY	32,980.000	601,225.400	
LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	471,900.990	
MID AMERICA	8,123.000	817,417.490	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	399,406.720	
PROLOGIS INC	38,966.000	2,231,972.480	
PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,267,778.870	
REALTY INCOME CORP	17,181.000	920,901.600	
REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	693,903.360	
SBA COMMUNICATIONS CORP	8,151.000	1,096,227.990	
SIMON PROPERTY GROUP INC	22,664.000	3,522,892.160	
SL GREEN	6,342.000	638,766.240	
THE MACERICH COMPANY	9,014.000	514,338.840	
UDR INC	17,458.000	660,436.140	
VENTAS INC	25,041.000	1,676,244.540	
VEREIT INC	72,429.000	577,983.420	
VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	1,141,850.610	
WELLTOWER INC	26,516.000	1,923,205.480	
WEYERHAEUSER CO	52,691.000	1,697,704.020	
アメリカ・ドル 小計	881,526.000	47,016,381.930 (5,370,211,144)	
イギリス・ポンド			
BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	437,694.390	
HAMMERSON PLC	58,616.000	337,042.000	
INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	200,153.440	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	50,519.000	515,293.800	
	SEGR0 PLC	61,113.000	295,175.790	
イギリス・ボンド 小計		316,831.000	1,785,359.420 (262,626,371)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	236,133.560	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	233,651.250	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,582.000	81,487.920	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	551,272.730 (48,831,739)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	192,992.910	
	GECINA SA	3,212.000	432,656.400	
	ICADE	2,234.000	162,880.940	
	KLEPIERRE	17,042.000	601,838.230	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,542,044.550	
ユーロ 小計		32,052.000	2,932,413.030 (381,624,231)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	9,948,975.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	9,948,975.000 (145,454,015)	
投資証券 合計		1,416,914	6,208,747,500 (6,208,747,500)	
合計			6,991,287,281 (6,991,287,281)	

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 607銘柄	61.87%	-%	-%	65.43%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	1.91%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	6.90%	-%	-%	7.18%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.09%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	2.54%	-%	-%	2.85%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.24%	-%	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.67%	-%	-%	3.78%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 19銘柄	0.46%	-%	-%	0.52%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 35銘柄	3.34%	-%	-%	3.43%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.17%	-%	-%	1.20%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.72%	-%	-%	0.74%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
ユーロ	株式 238銘柄	12.69%	-%	-%	13.16%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 36銘柄	1.21%	-%	-%	1.30%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		118,148,434	214,449,614
コール・ローン		56,903,374	101,613,435
投資信託受益証券		3,992,465,480	5,156,727,541
投資証券		32,056,893,880	41,283,524,269
派生商品評価勘定		4,380	8,740
未収入金		227,989,108	-
未収配当金		168,213,526	196,088,598
流動資産合計		36,620,618,182	46,952,412,197
資産合計		36,620,618,182	46,952,412,197
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,085	-
未払金		271,160,938	79,530,191
未払解約金		30,410,000	73,668,000
流動負債合計		301,572,023	153,198,191
負債合計		301,572,023	153,198,191
純資産の部			
元本等			
元本	1	30,797,163,241	39,739,190,368
剰余金			
剰余金又は欠損金()		5,521,882,918	7,060,023,638
元本等合計		36,319,046,159	46,799,214,006
純資産合計		36,319,046,159	46,799,214,006
負債純資産合計		36,620,618,182	46,952,412,197

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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	30,438,313,343円	30,797,163,241円
同期中追加設定元本額	10,808,500,845円	17,522,576,569円
同期中一部解約元本額	10,449,650,947円	8,580,549,442円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	109,705,308円	188,646,569円
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	32,710,640円	59,946,843円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	9,243,698円	7,447,983円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	27,008,013円	18,169,674円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	62,645,962円	50,367,273円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,539,180円	11,978,241円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,049,440円	17,549,618円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	32,662,026円	31,367,575円
たわらノーロード 先進国リート	1,048,687,394円	1,332,002,390円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	92,960,487円	196,216,700円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	- 円	67,670,644円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,182,932円	24,575,512円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	535,960,685円	556,327,742円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	65,018,582円	44,488,175円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	20,292,719円	22,824,903円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	52,151,631円	67,034,035円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	117,262,106円	144,244,280円
投資のソムリエ	1,450,999,269円	4,706,179,039円
投資のソムリエ<DC年金>	42,813,620円	238,614,267円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	66,829,184円	85,513,232円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	17,460,669円	45,170,711円
ダイナミック・ナビゲーション	254,314円	272,679円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	385,174円	458,338,478円
ワールドアセットバランス(基本コース)	- 円	577,906,826円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	- 円	1,212,764,932円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	- 円	844,952円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	- 円	844,952円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,464,781,548円	1,236,222,443円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	10,551,392円	13,698,252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)	624,304,901円	- 円
DIAM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)	138,121,629円	- 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)	4,222,058,627円	3,905,433,532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	34,702,295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)	12,251,558,343円	11,938,366,018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)	3,059,696,034円	3,442,465,922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)	4,551,175,471円	4,278,862,586円
P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	- 円	4,161,300,139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)	561,607,513円	560,830,956円
計	30,797,163,241円	39,739,190,368円
2 . 受益権の総数	30,797,163,241口	39,739,190,368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7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	62,005,197	236,330,290
投資証券	579,946,476	1,390,184,301
合計	641,951,673	1,626,514,591

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	43,419,880	-	43,415,500	4,380	13,888,240	-	13,879,500	8,740
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	13,888,240	-	13,879,500	8,740
買 建	35,945,585	-	35,944,500	1,085	-	-	-	-
アメリカ・ドル	35,945,585	-	35,944,500	1,085	-	-	-	-
合計	79,365,465	-	79,360,000	3,295	13,888,240	-	13,879,500	8,740

（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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1793円	1.1777円
(1万口当たり純資産額)	(11,793円)	(11,777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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	360 CAPITAL GROUP LTD	62,283.000	61,348.750	
		ABACUS PROPERTY GROUP	108,030.000	328,411.200	
		ALE PROPERTY GROUP	60,500.000	281,325.000	
		ARENA REIT	80,130.000	174,683.400	
		ASPEN GROUP	31,613.000	36,829.140	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	17,500.000	111,475.000	
		BWP TRUST	179,430.000	523,935.600	
		CHARTER HALL GROUP	170,260.000	919,404.000	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	54,900.000	228,384.000	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	122,520.000	496,206.000	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	478,050.000	444,586.500	
		DEXUS	374,500.000	3,520,300.000	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	81,940.000	219,599.200	
		GDI PROPERTY GROUP	173,070.000	175,666.050	
		GENERATION HEALTHCARE REIT	49,490.000	112,342.300	
		GOODMAN GROUP	590,560.000	4,689,046.400	
		GPT GROUP	666,260.000	3,191,385.400	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	96,240.000	306,043.200	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	56,730.000	169,622.700	
		INDUSTRIA REIT	43,830.000	99,494.100	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	73,368.000	190,756.800	
		INVESTA OFFICE FUND	225,710.000	1,002,152.400	
		MIRVAC GROUP	1,375,870.000	2,903,085.700	
		NATIONAL STORAGE REIT	194,630.000	296,810.750	
		PROPERTYLINK GROUP	209,180.000	176,757.100	
		SCENTRE GROUP	1,972,610.000	7,949,618.300	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	267,310.000	574,716.500	
		STOCKLAND	892,300.000	3,819,044.000	
		VICINITY CENTRES	1,212,930.000	3,056,583.600	
		VIVA ENERGY REIT	153,400.000	348,218.000	
WESTFIELD CORP	708,610.000	5,590,932.900			

オーストラリア・ドル 小計		10,783,754.000	41,998,763.990 (3,649,692,591)	
カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	13,280.000	163,609.600	
カナダ・ドル 小計		13,280.000	163,609.600 (14,492,539)	
シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	200,095.000	295,140.120	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	313,000.000	256,660.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	903,060.000	2,347,956.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	447,015.000	518,537.400	
	CACHE LOGISTICS TRUST	306,000.000	284,580.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	786,010.000	1,344,077.100	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,003,060.000	1,976,028.200	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	269,080.000	438,600.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	257,600.000	408,296.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS-RTS	45,400.000	13,166.000	
	ESR REIT	425,000.000	252,875.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	326,000.000	213,530.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	187,000.000	248,710.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	213,000.000	440,910.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	205,480.000	290,754.200	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	391,000.000	410,550.000	
	KEPPEL DC REIT	296,000.000	380,360.000	
	KEPPEL REIT	664,000.000	763,600.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	737,000.000	327,965.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	656,000.000	1,029,920.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	681,000.000	732,075.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	439,020.000	812,187.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	574,020.000	683,083.800	
	OUE COMMERCIAL REIT	195,500.000	140,760.000	
	OUE HOSPITALITY TRUST	449,020.000	336,765.000	
	PARKWAY LIFE REIT	145,000.000	377,000.000	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	335,900.000	152,834.500		

		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	236,000.000	172,280.000	
		SPH REIT	274,000.000	272,630.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	515,000.000	401,700.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	950,090.000	1,776,668.300	
	シンガポール・ドル	小計	13,425,350.000	18,100,199.020 (1,492,542,411)	
投資信託受益証券 合計			24,222,384	5,156,727,541 (5,156,727,541)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	30,880.000	848,273.600	
		AGREE REALTY CORP	10,630.000	484,940.600	
		ALEXANDER'S INC.	1,290.000	539,877.900	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	33,770.000	3,958,181.700	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	15,130.000	578,722.500	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	49,780.000	2,291,373.400	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	87,320.000	1,957,714.400	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	58,290.000	2,482,571.100	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	58,200.000	1,066,224.000	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	15,260.000	194,259.800	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	10,900.000	107,365.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	29,770.000	175,940.700	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	51,030.000	9,534,445.200	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	9,570.000	119,242.200	
		BOSTON PROPERTIES INC	56,990.000	6,723,680.200	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	63,850.000	1,080,342.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	97,460.000	1,727,965.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	32,520.000	2,752,492.800	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	30,630.000	772,488.600	
		CARETRUST REIT INC	26,490.000	474,965.700	
		CBL & ASSOCIATES	62,450.000	515,212.500	
		CEDAR REALTY TRUST INC	25,410.000	126,287.700	
		CHATHAM LODGING TRUST	13,280.000	261,483.200	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	21,930.000	535,969.200	
		CITY OFFICE REIT INC	8,100.000	100,440.000	
		COLONY NORTHSTAR INC	204,320.000	2,934,035.200	
		COLONY STARWOOD HOMES	46,430.000	1,567,476.800	

COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	44,610.000	976,959.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4,370.000	110,735.800	
CORECIVIC INC	44,010.000	1,189,590.300	
CORESITE REALTY CORP	12,730.000	1,314,754.400	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	37,020.000	1,265,713.800	
COUSINS PROPERTIES INC	155,910.000	1,343,944.200	
CUBESMART	67,000.000	1,536,980.000	
CYRUSONE INC	29,040.000	1,598,942.400	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	34,170.000	1,793,241.600	
DDR CORP	114,950.000	1,031,101.500	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	72,990.000	813,838.500	
DIGITAL REALTY TRUST INC	59,190.000	6,514,451.400	
DOUGLAS EMMETT INC	54,550.000	2,019,986.500	
DUKE REALTY TRUST	131,860.000	3,618,238.400	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	28,930.000	1,717,284.800	
EAST GROUP	12,640.000	1,031,676.800	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	9,250.000	185,092.500	
EDUCATION REALTY TRUST INC	26,660.000	1,000,816.400	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	45,720.000	906,627.600	
EPR PROPERTIES	23,820.000	1,677,404.400	
EQUITY COMMONWEALTH	46,160.000	1,432,344.800	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,300.000	2,562,774.000	
EQUITY RESIDENTIAL	135,980.000	8,801,985.400	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,300.000	6,150,087.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	46,690.000	3,490,544.400	
FARMLAND PARTNERS INC	10,050.000	86,731.500	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,790.000	3,342,320.400	
FELCOR LODGING TR INC	47,100.000	329,700.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	43,680.000	1,237,454.400	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	21,540.000	239,309.400	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	81,260.000	1,906,359.600	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	21,910.000	542,272.500	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	40,400.000	436,724.000	

GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	72,630.000	2,688,762.600	
GEO GROUP INC	46,320.000	1,344,206.400	
GETTY REALTY CORP	9,900.000	248,292.000	
GGP INC	215,880.000	4,878,888.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,670.000	182,416.800	
GLOBAL NET LEASE INC	20,870.000	446,618.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	35,000.000	615,650.000	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	56,470.000	1,670,382.600	
HCP INC	173,630.000	5,363,430.700	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	43,320.000	1,414,831.200	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	71,060.000	2,098,401.800	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,450.000	260,822.500	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	37,910.000	1,869,342.100	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	61,060.000	1,751,811.400	
HOST HOTELS & RESORTS INC	274,150.000	4,912,768.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	57,980.000	1,842,604.400	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	21,790.000	212,670.400	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	46,330.000	277,980.000	
INVITATION HOMES INC	28,310.000	606,683.300	
IRON MOUNTAIN INC	91,120.000	3,048,875.200	
ISTAR INC	26,390.000	314,832.700	
KILROY REALTY CORP	36,470.000	2,608,334.400	
KIMCO REALTY	157,930.000	2,879,063.900	
KITE REALTY GROUP TRUST	30,490.000	557,967.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	42,160.000	1,237,396.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	78,850.000	767,999.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	54,660.000	2,214,276.600	
LIFE STORAGE INC	17,310.000	1,221,912.900	
LTC PROPERTIES INC	14,430.000	718,181.100	
MACK CALI	32,740.000	858,770.200	
MANULIFE US REIT	206,000.000	188,490.000	
MEEQUITIES REALTY TRUST INC	7,390.000	90,453.600	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	135,310.000	1,664,313.000	
MID AMERICA	42,100.000	4,236,523.000	

MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	26,520.000	400,717.200	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	60,930.000	723,848.400	
NATIONAL HEALTH INVS INC	15,270.000	1,175,331.900	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	55,390.000	2,098,173.200	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	16,180.000	352,076.800	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	31,180.000	309,305.600	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,900.000	143,370.000	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	20,960.000	263,886.400	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	73,060.000	2,352,532.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,680.000	131,492.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	53,540.000	1,437,013.600	
PARKWAY INC	16,170.000	368,837.700	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	25,350.000	810,439.500	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	25,550.000	287,182.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	65,300.000	1,202,826.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	54,170.000	1,095,317.400	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	10,210.000	154,579.400	
PROLOGIS INC	196,360.000	11,247,500.800	
PS BUSINESS PARKS	7,130.000	922,835.900	
PUBLIC STORAGE	55,360.000	11,258,563.200	
QTS REALTY TRUST INC	17,450.000	892,044.000	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	34,140.000	597,791.400	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	29,010.000	368,136.900	
REALTY INCOME CORP	101,180.000	5,423,248.000	
REGENCY CENTERS CORP	54,250.000	3,333,120.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	40,000.000	754,000.000	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	86,280.000	1,036,222.800	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	24,300.000	659,988.000	
RLJ LODGING TRUST	45,420.000	877,514.400	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,030.000	1,202,505.700	

SABRA HEALTH CARE REIT INC	23,820.000	539,284.800	
SAUL CENTERS INC	4,070.000	236,955.400	
SELECT INCOME REIT	23,160.000	539,396.400	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	88,290.000	1,711,943.100	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	9,060.000	380,067.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	115,570.000	17,964,200.800	
SL GREEN	37,760.000	3,803,187.200	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	180,160.000	1,318,771.200	
STAG INDUSTRIAL INC	32,330.000	872,586.700	
STORE CAPITAL CORP	63,770.000	1,386,997.500	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,000.000	685,900.000	
SUN COMMUNITIES INC	26,260.000	2,259,410.400	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	82,070.000	1,285,216.200	
TANGER FACTORY OUTLET	35,140.000	904,503.600	
TAUBMAN CENTERS INC	22,590.000	1,311,123.600	
TERRENO REALTY CORP	18,230.000	605,236.000	
THE MACERICH COMPANY	44,200.000	2,522,052.000	
TIER REIT INC	18,120.000	332,320.800	
UDR INC	99,150.000	3,750,844.500	
UMH PROPERTIES INC	10,850.000	182,171.500	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,730.000	385,305.800	
URBAN EDGE PROPERTIES	36,050.000	866,281.500	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10,310.000	206,096.900	
VENTAS INC	131,430.000	8,797,924.200	
VEREIT INC	361,430.000	2,884,211.400	
VORNADO REALTY TRUST	63,820.000	5,967,808.200	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	67,630.000	559,300.100	
WASHINGTON REIT	27,980.000	876,053.800	
WEINGARTEN REALTY INVST	43,970.000	1,302,831.100	
WELLTOWER INC	135,590.000	9,834,342.700	
WHEELER REIT INC	3,490.000	37,308.100	
WHITESTONE REIT	13,920.000	169,267.200	
WP CAREY INC	39,530.000	2,596,725.700	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	38,930.000	758,745.700	
アメリカ・ドル 小計	8,229,020.000	291,126,681.600 (33,252,489,572)	
イギリス・ポンド			
ASSURA PLC	671,000.000	432,795.000	
BIG YELLOW GROUP PLC	54,530.000	427,787.850	

	BRITISH LAND CO PLC	379,570.000	2,311,581.300	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	183,460.000	102,187.220	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	72,808.000	77,686.130	
	DERWENT LONDON PLC	41,220.000	1,094,391.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	168,530.000	187,910.950	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	119,540.000	717,240.000	
	HAMMERSON PLC	294,510.000	1,693,432.500	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	274,250.000	340,070.000	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	48,480.000	50,419.200	
	INTU PROPERTIES PLC	335,530.000	898,884.870	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	293,160.000	2,990,232.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	254,450.000	423,404.800	
	LXI REIT PLC	44,440.000	46,439.800	
	MCKAY SECURITIES PLC	37,280.000	85,072.960	
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	20,463.000	105,384.450	
	NEWRIVER REIT PLC	88,060.000	308,210.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	220,980.000	246,834.660	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	447,860.000	171,978.240	
	REGIONAL REIT LTD	97,870.000	101,784.800	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	78,850.000	333,377.800	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	201,070.000	127,679.450	
	SEGro PLC	369,070.000	1,782,608.100	
	SHAFTESBURY PLC	103,410.000	1,005,662.250	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	498,600.000	719,978.400	
	UNITE GROUP PLC	89,000.000	578,055.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	43,830.000	379,129.500	
	イギリス・ポンド 小計	5,531,821.000	17,740,218.230 (2,609,586,101)	
	イスラエル・シケル REIT 1 LTD	61,110.000	818,262.900	
	イスラエル・シケル 小計	61,110.000	818,262.900 (26,339,883)	
	カナダ・ドル			
	AGELLAN COMMERCIAL REIT	4,900.000	51,009.000	
	ALLIED PROPERTIES REIT	15,460.000	590,262.800	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,130.000	362,314.400	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,590.000	398,833.700	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	24,660.000	799,970.400	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	13,350.000	601,150.500	

	CHOICE PROPERTIES REIT	16,320.000	216,729.600	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	33,740.000	437,945.200	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	16,770.000	227,065.800	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,277.000	158,780.160	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,140.000	263,367.400	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	8,770.000	75,597.400	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	19,090.000	371,491.400	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,660.000	441,227.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51,950.000	1,141,341.500	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,700.000	107,134.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,120.000	92,534.400	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	10,620.000	150,379.200	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	9,570.000	197,046.300	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,840.000	156,858.800	
	ONEREIT	9,828.000	36,167.040	
	PLAZA RETAIL REIT	19,360.000	85,184.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	49,970.000	333,799.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	58,590.000	1,414,948.500	
	SLATE OFFICE REIT	11,022.000	86,412.480	
	SLATE RETAIL REIT	7,890.000	104,858.100	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,680.000	747,340.800	
	カナダ・ドル 小計	520,997.000	9,649,749.480 (854,774,809)	
	ニュージーランド・ドル			
	ARGOSY PROPERTY LTD	318,000.000	324,360.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	377,360.000	462,266.000	
	INVESTORE PROPERTY LTD	65,120.000	87,912.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	523,100.000	724,493.500	
	PRECINCT PROPERTIES	356,480.000	434,905.600	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	171,890.000	280,180.700	
	STRIDE STAPLED GROUP	139,730.000	238,938.300	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	115,500.000	256,987.500	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,067,180.000	2,810,043.600 (232,784,012)	

ユーロ	AEDIFICA	6,610.000	495,750.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	38,170.000	446,970.700	
	ALTAREA	1,282.000	248,067.000	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	23,940.000	361,853.100	
	BEFIMMO	8,380.000	432,575.600	
	BENI STABILI SPA	382,100.000	244,544.000	
	COFINIMMO SA	7,700.000	827,365.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	17,980.000	614,466.500	
	FONCIERE DES REGIONS	19,720.000	1,624,336.400	
	GECINA SA	14,950.000	2,013,765.000	
	GREEN REIT PLC	254,670.000	359,339.370	
	HAMBORNER REIT AG	30,120.000	271,200.480	
	HIBERNIA REIT PLC	253,020.000	349,673.640	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	39,770.000	579,448.900	
	ICADE	16,730.000	1,219,784.300	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	112,110.000	90,809.100	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5,170.000	113,378.100	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	133,630.000	180,400.500	
	KLEPIERRE	76,870.000	2,714,664.050	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	33,570.000	265,538.700	
	MERCIALYS	20,160.000	344,131.200	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	174,150.000	1,948,738.500	
	MONTEA SCA	2,231.000	106,887.210	
	NSI NV	6,860.000	219,760.100	
	RETAIL ESTATES	2,330.000	183,487.500	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	36,770.000	7,852,233.500	
VASTNED RETAIL	7,250.000	263,537.500		
WAREHOUSES DE PAUW	5,930.000	554,573.600		
WERELDHAVE BELGIUM	780.000	77,493.000		
WERELDHAVE NV	14,810.000	628,610.450		
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,014.000	73,521.070		
ユーロ 小計		1,749,777.000	25,706,904.070 (3,345,496,495)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	794,070.000	4,184,748.900	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	504,000.000	4,757,760.000	
	LINK REIT	820,020.000	49,898,217.000	
	PROSPERITY REIT	418,000.000	1,371,040.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	261,000.000	605,520.000	
	SPRING REIT	306,000.000	1,034,280.000	

	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	389,000.000	1,945,000.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	408,000.000	2,007,360.000	
	香港・ドル 小計	3,900,090.000	65,803,925.900 (962,053,397)	
投資証券 合計		22,059,995	41,283,524,269 (41,283,524,269)	
合計			46,440,251,810 (46,440,251,810)	

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 158銘柄	-%	71.05%	71.60%
イギリス・ポンド	投資証券 28銘柄	-%	5.58%	5.62%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.06%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	7.80%	-%	7.86%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.03%	-%	1.87%
	投資証券 27銘柄	-%	1.83%	
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	3.19%	-%	3.21%
ニュージーランド・ドル	投資証券 8銘柄	-%	0.50%	0.50%
ユーロ	投資証券 31銘柄	-%	7.15%	7.20%
香港・ドル	投資証券 8銘柄	-%	2.06%	2.07%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,168,485,077	2,068,902,709
コール・ローン		2,304,683,303	2,287,988,514
国債証券		158,064,463,129	175,308,851,837
派生商品評価勘定		981,610,002	9,667,041
未収入金		1,452,761,375	-
未収利息		1,177,754,150	1,266,895,038
前払費用		101,152,220	112,247,186
流動資産合計		166,250,909,256	181,054,552,325
資産合計		166,250,909,256	181,054,552,325
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		70,791,468	2,685,300,671
未払金		3,563,088,335	1,975,717,730
未払解約金		49,903,000	67,514,000
流動負債合計		3,683,782,803	4,728,532,401
負債合計		3,683,782,803	4,728,532,401
純資産の部			
元本等			
元本	1	122,533,641,088	132,887,156,620
剰余金			
剰余金又は欠損金()		40,033,485,365	43,438,863,304
元本等合計		162,567,126,453	176,326,019,924
純資産合計		162,567,126,453	176,326,019,924
負債純資産合計		166,250,909,256	181,054,552,325

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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	114,155,950,265円	122,533,641,088円
同期中追加設定元本額	34,705,515,698円	32,760,053,419円
同期中一部解約元本額	26,327,824,875円	22,406,537,887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>	140,213,756円	556,138,349円
投資のソムリエ	7,180,183,835円	11,111,915,078円
投資のソムリエ<DC年金>	212,124,776円	566,683,373円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	126,887,049円	511,853,984円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	2,712,426円	5,236,388,897円
ワールドアセットバランス（基本コース）	- 円	2,767,417,934円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	- 円	5,869,881,531円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2045）	- 円	1,854,462円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2055）	- 円	1,854,462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）	2,679,868,690円	2,676,088,257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)	21,456,684,775円	21,173,093,056円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	1,189,951,882円	1,143,320,379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)	7,288,597,632円	7,224,773,317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)	34,010,101,198円	33,893,424,008円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	34,168,975円	28,675,816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)	30,501,046,644円	30,268,549,399円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	189,760,127円	177,016,571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)	3,186,640,914円	2,945,681,231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)	2,771,576,680円	2,712,061,726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)	11,093,950,653円	3,563,285,139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)	469,171,076円	457,199,651円
計	122,533,641,088円	132,887,156,620円
2 . 受益権の総数	122,533,641,088口	132,887,156,620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7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	5,309,812,827	2,922,194,981
合計	5,309,812,827	2,922,194,981

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	160,694,427,864	-	159,783,609,330	910,818,534	174,856,879,612	-	177,532,513,242	2,675,633,630
アメリカ カ・ドル	71,328,448,038	-	70,954,077,492	374,370,546	76,701,394,398	-	77,981,541,810	1,280,147,412
イギリ ス・ボン ド	11,664,890,307	-	11,439,766,174	225,124,133	12,460,719,383	-	12,557,789,456	97,070,073
オースト ラリア・ ドル	3,276,057,504	-	3,314,717,764	38,660,260	3,761,509,218	-	3,792,739,428	31,230,210
カナダ・ ドル	3,449,017,176	-	3,473,207,500	24,190,324	3,622,641,154	-	3,709,011,550	86,370,396
シンガ ポール・ ドル	558,889,051	-	559,117,440	228,389	653,839,859	-	660,541,504	6,701,645
スウェー デン・ク ローナ	717,164,027	-	713,517,365	3,646,662	828,018,973	-	841,899,440	13,880,467
デンマー ク・ク ローネ	996,048,724	-	992,124,801	3,923,923	1,038,066,622	-	1,053,575,250	15,508,628
ノー ウェー・ クローネ	393,404,901	-	392,057,712	1,347,189	444,902,824	-	454,388,897	9,486,073
ポーラン ド・ズロ チ	905,756,432	-	908,871,542	3,115,110	1,146,769,930	-	1,162,833,360	16,063,430

マレーシ ア・リン ギット メキシ コ・ペソ	655,312,174	-	657,336,700	2,024,526	666,825,080	-	674,842,000	8,016,920
ユーロ 南アフリ カ・ラン ド	1,218,235,790	-	1,144,460,289	73,775,501	1,516,687,903	-	1,556,043,765	39,355,862
	64,686,787,347	-	64,397,746,540	289,040,807	71,092,236,820	-	72,173,706,375	1,081,469,555
	844,416,393	-	836,608,011	7,808,382	923,267,448	-	913,600,407	9,667,041
合計	160,694,427,864	-	159,783,609,330	910,818,534	174,856,879,612	-	177,532,513,242	2,675,633,630

(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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3267円	1.3269円
(1万口当たり純資産額)	(13,267円)	(13,269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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.75 07/15/19	11,000,000.000	10,859,420.000	
		US T N/B 0.75 08/15/19	7,000,000.000	6,904,520.000	
		US T N/B 0.75 08/31/18	10,000,000.000	9,939,400.000	
		US T N/B 0.875 04/15/19	3,300,000.000	3,271,752.000	
		US T N/B 0.875 05/15/19	6,200,000.000	6,144,014.000	
		US T N/B 0.875 06/15/19	5,000,000.000	4,952,500.000	
		US T N/B 0.875 09/15/19	3,500,000.000	3,459,120.000	
		US T N/B 1.0 09/15/18	10,800,000.000	10,761,120.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	10,700,000.000	10,602,095.000	
		US T N/B 1.0 11/15/19	10,000,000.000	9,896,400.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	9,400,000.000	9,300,454.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	8,000,000.000	7,917,440.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,746,000.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	8,500,000.000	8,430,215.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	4,700,000.000	4,692,433.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,998,312.000	
		US T N/B 1.25 10/31/18	12,500,000.000	12,488,250.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	9,000,000.000	8,964,090.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,239,915.000	
		US T N/B 1.25 11/30/18	13,500,000.000	13,482,585.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	12,000,000.000	11,859,360.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,860,100.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,160,000.000	3,143,947.200	
		US T N/B 1.5 02/28/19	8,500,000.000	8,518,530.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	5,900,000.000	5,915,399.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	9,119,292.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	7,100,000.000	7,117,750.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	7,700,000.000	7,280,658.000	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,567,936.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	6,000,000.000	5,658,240.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	7,900,000.000	7,777,787.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	6,380,000.000	6,259,864.600	
		US T N/B 1.75 02/28/22	7,500,000.000	7,452,525.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	7,270,000.000	7,214,893.400	
		US T N/B 1.75 05/15/23	6,000,000.000	5,895,000.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	7,600,000.000	7,513,284.000	
US T N/B 1.875 03/31/22	8,200,000.000	8,187,126.000			
US T N/B 2.0 02/15/22	7,000,000.000	7,038,780.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	6,000,000.000	5,987,760.000			
US T N/B 2.0 02/15/25	6,600,000.000	6,481,860.000			

US T N/B 2.0 05/31/21	8,060,000.000	8,131,734.000	
US T N/B 2.0 07/31/20	4,600,000.000	4,655,338.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,000,000.000	4,891,400.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	10,200,000.000	10,274,052.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	7,660,000.000	7,748,549.600	
US T N/B 2.0 11/15/21	8,900,000.000	8,960,431.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	6,900,000.000	6,690,792.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,900,000.000	5,837,283.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	7,680,000.000	7,799,347.200	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,916,326.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,000,000.000	12,130,200.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	6,000,000.000	6,034,200.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	13,400,000.000	13,482,678.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	4,400,000.000	4,353,228.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	5,920,000.000	6,028,632.000	
US T N/B 2.25 07/31/18	6,100,000.000	6,160,756.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	3,600,000.000	3,117,636.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	6,600,000.000	6,610,824.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,700,000.000	7,663,887.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	6,100,000.000	6,165,270.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	6,410,000.000	6,485,573.900	
US T N/B 2.375 12/31/20	11,950,000.000	12,225,328.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	4,133,655.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,650,000.000	3,343,144.500	
US T N/B 2.5 05/15/24	5,990,000.000	6,115,370.700	
US T N/B 2.5 05/15/46	3,550,000.000	3,249,634.500	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,856,981.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	9,350,000.000	9,635,923.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	12,236,080.600	
US T N/B 2.75 02/15/19	3,700,000.000	3,783,509.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	4,630,000.000	4,800,893.300	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	3,136,956.200	
US T N/B 2.75 11/15/23	11,100,000.000	11,516,250.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,309,662.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,800,000.000	2,783,368.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	3,970,000.000	3,930,300.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,000,000.000	3,957,800.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,000,000.000	5,075,350.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,810,000.000	1,847,032.600	
US T N/B 3.0 05/15/45	3,550,000.000	3,603,250.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,200,000.000	1,217,052.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	3,800,000.000	3,861,446.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	4,300,000.000	4,360,802.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,260,000.000	1,314,721.800	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,800,000.000	2,915,052.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,642,515.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	105,066.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,460,000.000	4,642,547.800	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,850,000.000	1,930,789.500	

US T N/B 3.375 05/15/44	4,500,000.000	4,899,015.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,200,000.000	1,338,372.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	8,000,000.000	8,432,800.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,170,000.000	4,735,535.400	
US T N/B 3.625 08/15/19	6,200,000.000	6,483,588.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	3,100,000.000	3,514,129.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,340,000.000	1,547,378.400	
US T N/B 3.75 11/15/43	3,400,000.000	3,940,804.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,650,000.000	1,938,090.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,090,000.000	1,348,362.700	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,650,000.000	2,046,643.500	
US T N/B 4.375 02/15/38	610,000.000	768,075.400	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,060,000.000	2,595,435.200	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,600,000.000	2,023,744.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,300,000.000	1,635,764.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,750,000.000	2,233,700.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	700,000.000	895,503.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,080,000.000	1,381,384.800	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,120,000.000	2,759,964.400	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,530,000.000	2,033,217.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	690,000.000	935,860.800	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,064,665.900	
US T N/B 5.25 11/15/28	700,000.000	895,342.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,400,000.000	1,866,648.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	630,000.000	818,502.300	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,032,680.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,275,593.500	
US T N/B 6.25 05/15/30	900,000.000	1,273,428.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,489,212.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	674,960.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,641,401.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	3,900,000.000	4,444,596.000	
アメリカ・ドル 小計	667,990,000.000 (76,297,817,800)	676,533,140.700 (77,273,615,331)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,800,000.000	1,786,320.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	1,950,000.000	1,969,305.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	450,000.000	446,265.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,500,000.000	2,593,575.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,250,000.000	2,309,400.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,450,000.000	1,318,630.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,150,000.000	4,272,259.000	

UK TREASURY 1.75 07/22/57	950,000.000	942,970.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,720,000.000	2,873,408.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	600,000.000	586,140.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	2,150,000.000	2,255,221.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,150,000.000	2,309,917.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,850,000.000	2,011,690.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,370,000.000	1,716,007.200	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,400,000.000	1,578,164.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,290,000.000	2,909,216.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,150,000.000	2,867,240.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,460,000.000	2,339,942.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,530,000.000	2,289,339.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	1,170,000.000	1,257,867.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	1,850,000.000	2,047,395.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,200,000.000	1,363,188.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,360,000.000	2,275,824.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,200,000.000	1,391,640.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	2,912,910.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,450,000.000	1,949,235.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,340,000.000	1,910,572.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,500,000.000	1,934,850.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,600,000.000	2,308,160.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,580,000.000	2,406,340.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,430,000.000	2,256,969.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,600,000.000	2,696,000.000	

	UK TREASURY 4.5 03/07/19	1,200,000.000	1,283,880.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,000,000.000	2,814,200.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,830,000.000	2,782,881.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,800,000.000	2,012,760.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,250,000.000	1,736,625.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,500,000.000	2,267,100.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,550,000.000	2,012,210.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,000,000.000	1,491,400.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,968,400.000	
	イギリス・ポンド 小計	68,200,000.000 (10,032,220,000)	84,455,414.200 (12,423,391,429)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,200,000.000	2,351,162.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,000,000.000	2,116,120.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	2,600,000.000	2,950,012.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,700,000.000	2,673,999.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,200,000.000	1,190,820.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,650,000.000	1,570,965.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	2,510,000.000	2,553,222.200	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	730,000.000	685,097.700	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	2,700,000.000	2,753,811.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,950,000.000	1,949,746.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,250,000.000	1,243,787.500	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	800,000.000	716,408.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,700,000.000	2,828,952.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,450,000.000	1,511,074.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	450,000.000	440,977.500	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	1,100,000.000	1,122,330.000	

	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	950,000.000	1,014,942.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,950,000.000	3,319,340.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,070,000.000	1,266,024.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,750,000.000	3,236,392.500	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,550,000.000	2,983,882.500	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,250,000.000	2,621,520.000	
オーストラリア・ドル 小計		40,510,000.000 (3,520,319,000)	43,100,585.400 (3,745,440,871)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	350,000.000	542,927.000	
	CANADA 0.5 02/01/19	1,900,000.000	1,881,760.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	1,000,000.000	956,800.000	
	CANADA 0.5 08/01/18	2,400,000.000	2,385,456.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	900,000.000	880,254.000	
	CANADA 0.75 05/01/19	1,000,000.000	992,900.000	
	CANADA 0.75 08/01/19	300,000.000	297,300.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	1,700,000.000	1,670,675.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	1,800,000.000	1,751,076.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,400,000.000	1,289,050.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	1,950,000.000	1,953,588.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,250,000.000	2,265,277.500	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,300,000.000	1,293,344.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,220,000.000	1,188,463.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	400,000.000	404,072.000	
	CANADA 1.75 09/01/19	2,000,000.000	2,023,260.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,250,000.000	1,296,762.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,250,000.000	1,317,737.500	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,959,168.500	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,030,000.000	1,142,888.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	510,000.000	588,310.500	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,400,000.000	1,498,588.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,430,000.000	1,520,418.900	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,540,000.000	1,930,374.600	
	CANADA 3.75 06/01/19	1,350,000.000	1,414,759.500	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,470,000.000	1,935,828.300	
CANADA 5.0 06/01/37	1,280,000.000	1,851,276.800		
CANADA 5.75 06/01/29	990,000.000	1,380,139.200		
CANADA 5.75 06/01/33	1,200,000.000	1,786,272.000		
カナダ・ドル 小計		38,420,000.000 (3,403,243,600)	41,398,726.800 (3,667,099,220)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	791,440.000	
	SINGAPORE 1.625 10/01/19	500,000.000	503,350.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	300,000.000	306,450.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	250,000.000	261,677.500	

	SINGAPORE 2.75 04/01/42	420,000.000	440,580.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	211,600.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	388,315.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,240,000.000	1,322,460.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	600,000.000	642,000.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,034,880.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	270,000.000	302,130.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	740,000.000	821,111.400	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	830,000.000	856,394.000	
シンガポール・ドル 小計		7,500,000.000 (618,450,000)	7,882,387.900 (649,981,706)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,000,000.000	2,951,520.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,600,000.000	4,730,088.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	7,400,000.000	7,994,886.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,500,000.000	6,359,650.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,210,000.000	6,946,857.700	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	9,580,000.000	11,249,123.400	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	9,580,000.000	10,376,098.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	9,240,000.000	10,933,692.000	
スウェーデン・クローナ 小計		54,110,000.000 (733,190,500)	61,541,915.100 (833,892,950)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	1,000,000.000	1,011,420.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	6,570,000.000	7,136,991.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	7,300,000.000	8,102,489.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,830,000.000	10,052,513.500	
	DENMARK 4.0 11/15/19	11,310,000.000	12,506,145.600	
	DENMARK 4.5 11/15/39	12,300,000.000	20,216,772.000	
デンマーク・クローネ 小計		47,310,000.000 (827,925,000)	59,026,331.100 (1,032,960,794)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	3,000,000.000	2,982,480.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,600,000.000	1,611,344.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,100,000.000	3,157,567.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	5,600,000.000	5,839,792.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	4,400,000.000	4,857,072.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	6,560,000.000	7,257,328.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,200,000.000	6,646,400.000	
ノルウェー・クローネ 小計		30,460,000.000 (417,302,000)	32,351,983.000 (443,222,167)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	1,500,000.000	1,480,500.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,000,000.000	1,948,400.000	
	POLAND 10/25/18	1,500,000.000	1,469,325.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	2,500,000.000	2,467,500.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,500,000.000	3,308,375.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	1,600,000.000	1,490,160.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	5,800,000.000	5,968,200.000	

	POLAND 3.25 07/25/25	3,600,000.000	3,628,980.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,570,000.000	2,732,809.500	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,159,360.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,110,000.000	2,272,470.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	900,000.000	1,121,400.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,874,494.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	1,780,000.000	2,014,960.000	
ポーランド・ズロチ 小計		35,620,000.000 (1,094,246,400)	36,936,933.500 (1,134,702,597)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.48 03/15/23	2,190,000.000	2,127,891.600	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,580,000.000	1,493,495.000	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	2,170,000.000	2,176,596.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	340,000.000	315,356.800	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,126,310.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	3,960,000.000	4,007,520.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	690,000.000	695,175.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	5,760,000.000	5,867,596.800	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,508,120.000	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,820,000.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,720,000.000	1,752,680.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,614,221.200	
マレーシア・リンギット 小計		25,370,000.000 (674,842,000)	25,504,963.200 (678,432,021)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	9,880,000.000	12,769,900.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	25,720,000.000	30,629,433.600	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	13,000,000.000	12,542,140.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	10,000,000.000	9,335,000.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	7,500,000.000	7,466,100.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	35,860,000.000	35,774,294.600	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	12,000,000.000	12,615,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	13,940,000.000	14,839,130.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,880,000.000	22,080,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	3,000,000.000	3,194,580.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	20,000,000.000	20,768,600.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	12,500,000.000	13,366,250.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	9,000,000.000	10,161,000.000	

	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,820,000.000	13,462,980.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	24,000,000.000	24,550,560.000	
メキシコ・ペソ 小計		229,100,000.000 (1,459,367,000)	243,556,168.200 (1,551,452,791)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	730,000.000	741,899.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,590,000.000	1,597,520.700	
	AUSTRIA 07/15/23	750,000.000	742,800.000	
	AUSTRIA 1.15 10/19/18	420,000.000	429,080.400	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	830,000.000	876,197.800	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	360,000.000	346,125.600	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	930,000.000	1,016,564.400	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	830,000.000	913,249.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	770,000.000	806,829.100	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	630,000.000	744,855.300	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	650,000.000	874,620.500	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	980,000.000	1,158,614.800	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,390,000.000	1,605,450.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	900,000.000	1,061,055.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	360,000.000	580,388.400	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,350,000.000	1,524,217.500	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,120,000.000	1,668,800.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,030,000.000	1,114,810.200	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	950,000.000	1,300,037.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	760,000.000	1,172,436.800	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	360,000.000	359,064.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	300,000.000	301,026.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,650,000.000	1,680,690.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	1,000,000.000	989,960.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,400,000.000	1,433,152.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,090,000.000	1,054,149.900	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	350,000.000	343,175.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	480,000.000	449,971.200	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	700,000.000	740,887.000	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	440,000.000	433,752.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,250,000.000	1,406,625.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/57	200,000.000	208,492.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	1,500,000.000	1,731,660.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	580,000.000	725,174.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,130,000.000	1,217,857.500	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	830,000.000	1,188,211.400	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	2,000,000.000	2,266,320.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	580,000.000	625,518.400	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	1,830,000.000	2,186,648.700	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	710,000.000	975,703.300	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,670,000.000	2,528,463.500		
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,450,000.000	1,723,615.000		
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,550,000.000	1,895,619.000		

BELGIUM 4.5 03/28/26	850,000.000	1,132,506.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,850,000.000	2,919,522.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,000,000.000	2,953,800.000	
BUNDESUBL 0.25 10/11/19	2,300,000.000	2,342,849.000	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	1,700,000.000	1,739,525.000	
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	1,750,000.000	1,785,280.000	
BUNDESUBL 04/08/22	900,000.000	909,000.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,250,000.000	2,282,625.000	
BUNDESUBL 04/17/20	2,250,000.000	2,283,817.500	
BUNDESUBL 1.0 02/22/19	1,200,000.000	1,232,808.000	
BUNDESUBL 1.0 10/12/18	1,050,000.000	1,072,323.000	
BUNDESUBL 10/08/21	2,600,000.000	2,633,280.000	
BUNDESSCHAT 09/14/18	3,100,000.000	3,125,265.000	
BUNDESSCHAT 12/14/18	2,000,000.000	2,018,760.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,450,000.000	2,382,919.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,170,000.000	2,215,114.300	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,400,000.000	2,423,736.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,320,000.000	2,224,508.800	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,750,000.000	1,856,610.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,450,000.000	2,587,886.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,800,000.000	1,958,868.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,970,000.000	2,147,792.500	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,500,000.000	1,642,440.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,500,000.000	1,628,460.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,850,000.000	2,055,905.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,450,000.000	2,686,376.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,000,000.000	2,205,600.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,800,000.000	2,020,194.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	1,900,000.000	2,065,300.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,600,000.000	1,772,960.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,300,000.000	2,537,360.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,100,000.000	2,665,236.000	

DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,060,000.000	2,634,843.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	1,400,000.000	1,548,120.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,520,800.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	1,700,000.000	1,947,010.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,420,000.000	2,027,547.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	1,410,000.000	1,525,930.200	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	2,400,000.000	2,558,856.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,260,000.000	3,417,617.200	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,310,000.000	2,096,235.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,200,000.000	1,721,316.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,910,000.000	3,033,576.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,550,000.000	2,666,883.500	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,690,000.000	2,699,335.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,300,000.000	1,963,962.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,652,920.400	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	850,000.000	1,407,328.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,170,000.000	1,849,524.300	
FINLAND 0.375 09/15/20	380,000.000	389,070.600	
FINLAND 0.5 04/15/26	430,000.000	426,843.800	
FINLAND 0.75 04/15/31	400,000.000	384,404.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	520,000.000	535,646.800	
FINLAND 04/15/22	450,000.000	452,160.000	
FINLAND 09/15/23	490,000.000	484,806.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	330,000.000	336,943.200	
FINLAND 1.5 04/15/23	450,000.000	486,720.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	450,000.000	488,515.500	
FINLAND 2.0 04/15/24	500,000.000	558,095.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	420,000.000	532,043.400	
FINLAND 2.75 07/04/28	440,000.000	529,416.800	
FINLAND 3.375 04/15/20	730,000.000	807,496.800	
FINLAND 3.5 04/15/21	560,000.000	639,945.600	
FINLAND 4.0 07/04/25	470,000.000	601,961.900	
FINLAND 4.375 07/04/19	460,000.000	505,328.400	

FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,197,874.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	2,800,000.000	2,850,596.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,400,000.000	4,169,308.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,050,000.000	3,035,207.500	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,500,000.000	2,446,900.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	3,700,000.000	3,780,660.000	
FRANCE OAT 02/25/19	3,150,000.000	3,176,775.000	
FRANCE OAT 05/25/20	3,700,000.000	3,738,924.000	
FRANCE OAT 05/25/21	3,200,000.000	3,222,720.000	
FRANCE OAT 05/25/22	2,600,000.000	2,600,078.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	3,570,000.000	3,669,995.700	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	3,800,000.000	3,880,256.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,500,000.000	3,600,800.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,900,000.000	1,802,150.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,210,000.000	3,309,895.200	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,850,000.000	4,207,203.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,140,000.000	1,031,859.600	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	960,000.000	976,560.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,200,000.000	3,498,976.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,400,000.000	3,838,668.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,000,000.000	2,232,660.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,300,000.000	3,820,773.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	2,900,000.000	3,171,063.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,950,000.000	4,650,967.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	3,600,000.000	4,126,140.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,350,000.000	3,076,385.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	3,600,000.000	4,125,420.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,000,000.000	3,326,040.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,870,000.000	3,550,764.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	3,050,000.000	3,513,996.500	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	2,460,000.000	2,698,497.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,380,000.000	2,114,022.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,250,000.000	1,963,025.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,500,000.000	3,599,800.000	

FRANCE OAT 4.25 04/25/19	1,990,000.000	2,160,344.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,560,000.000	4,460,929.200	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,150,000.000	4,895,131.500	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,500,000.000	3,809,450.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,750,000.000	4,106,712.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,950,000.000	4,777,230.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,300,000.000	3,319,958.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	1,785,146.400	
IRISH 0.8 03/15/22	640,000.000	663,072.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,000,000.000	1,008,390.000	
IRISH 1.7 05/15/37	350,000.000	343,927.500	
IRISH 2.0 02/18/45	630,000.000	634,057.200	
IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	969,581.200	
IRISH 3.4 03/18/24	770,000.000	919,356.900	
IRISH 3.9 03/20/23	550,000.000	664,427.500	
IRISH 4.4 06/18/19	690,000.000	754,087.200	
IRISH 4.5 04/18/20	1,070,000.000	1,212,128.100	
IRISH 4.5 10/18/18	490,000.000	520,326.100	
IRISH 5.0 10/18/20	780,000.000	914,862.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,020,000.000	1,378,713.600	
IRISH 5.9 10/18/19	740,000.000	845,028.200	
ITALY BTPS 0.1 04/15/19	5,100,000.000	5,122,593.000	
ITALY BTPS 0.3 10/15/18	1,200,000.000	1,209,216.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	1,100,000.000	1,102,189.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	3,100,000.000	3,056,104.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,740,250.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,300,000.000	2,197,075.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	2,300,000.000	2,329,670.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,200,000.000	2,170,300.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	4,800,000.000	4,908,864.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,800,000.000	1,667,304.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,200,000.000	3,266,944.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,350,000.000	1,377,594.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,000,000.000	1,944,440.000	
ITALY BTPS 1.5 08/01/19	2,500,000.000	2,578,325.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,000,000.000	1,923,000.000	

ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,000,000.000	1,762,060.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,100,000.000	2,102,415.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,500,000.000	1,491,750.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,400,000.000	1,258,880.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	700,000.000	665,609.000	
ITALY BTPS 2.5 05/01/19	1,000,000.000	1,046,950.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,050,000.000	2,150,962.500	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,250,000.000	1,092,625.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,250,000.000	1,028,625.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.000	1,568,416.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,680,000.000	2,937,762.400	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,450,000.000	2,742,456.500	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,500,000.000	2,802,250.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	2,000,000.000	2,251,000.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,157,887.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,400,000.000	2,745,840.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	1,560,000.000	1,740,336.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	2,520,000.000	2,692,972.800	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,100,000.000	2,323,230.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	1,820,000.000	2,020,564.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	2,700,000.000	2,906,226.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,000,000.000	2,368,160.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,550,000.000	1,853,800.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	3,069,274.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,100,000.000	2,518,320.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,200,000.000	2,568,500.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,200,000.000	2,690,512.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,750,000.000	2,165,397.500	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,200,000.000	2,612,720.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,000,000.000	2,452,660.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,370,000.000	3,033,837.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,900,000.000	2,444,920.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,080,000.000	2,646,800.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,230,000.000	2,865,773.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,360,000.000	2,886,563.200	

ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,700,000.000	2,084,540.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,600,000.000	2,189,760.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,850,000.000	3,941,265.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,600,000.000	3,598,140.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	900,000.000	1,291,950.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,848,104.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	1,550,000.000	1,581,248.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,500,000.000	1,479,480.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,500,000.000	1,488,300.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	1,000,650.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,830,000.000	1,843,981.200	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	1,500,000.000	1,542,960.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,550,000.000	1,705,465.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,350,000.000	1,514,403.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,660,000.000	1,856,245.200	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,250,000.000	1,514,637.500	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,170,000.000	1,550,905.200	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,450,000.000	1,657,350.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,540,000.000	1,724,877.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,090,000.000	1,314,213.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,440,000.000	2,185,732.800	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,430,000.000	2,144,714.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	1,040,000.000	1,089,088.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,170,000.000	1,278,693.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,220,000.000	1,812,920.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	1,000,000.000	998,330.000	
SPAIN 0.25 01/31/19	2,600,000.000	2,620,774.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,100,000.000	2,101,260.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	2,300,000.000	2,357,339.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	1,900,000.000	1,970,015.000	

	SPAIN 1.3 10/31/26	1,990,000.000	1,950,080.600	
	SPAIN 1.4 01/31/20	3,100,000.000	3,219,722.000	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,050,000.000	2,017,815.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,900,000.000	1,952,478.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	2,100,000.000	2,187,360.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,840,000.000	1,815,675.200	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,160,000.000	2,290,075.200	
	SPAIN 2.35 07/30/33	600,000.000	596,700.000	
	SPAIN 2.75 04/30/19	2,500,000.000	2,634,050.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,000,000.000	2,229,900.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,070,000.000	1,058,968.300	
	SPAIN 3.45 07/30/66	600,000.000	621,486.000	
	SPAIN 3.75 10/31/18	2,300,000.000	2,425,005.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,950,000.000	2,310,262.500	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,070,000.000	2,305,462.500	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,900,000.000	2,385,184.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	1,720,000.000	1,896,231.200	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,070,000.000	2,529,291.600	
	SPAIN 4.6 07/30/19	1,810,000.000	1,987,470.500	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,950,000.000	2,450,194.500	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,500,000.000	2,017,800.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,980,000.000	2,475,613.800	
	SPAIN 4.85 10/31/20	1,400,000.000	1,623,062.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,520,000.000	2,082,400.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,100,000.000	2,784,390.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,080,000.000	1,537,725.600	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,900,000.000	2,401,562.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,000,000.000	2,409,700.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,900,000.000	2,769,801.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,550,000.000	1,941,297.500	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,340,000.000	1,839,391.200	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,800,000.000	2,570,976.000	
ユーロ 小計		477,200,000.000 (62,102,808,000)	545,693,326.500 (71,016,529,511)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	24,940,000.000	27,516,302.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	12,410,000.000	8,702,140.200	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,780,000.000	5,380,259.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	16,150,000.000	15,580,712.500	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	8,690,000.000	7,051,935.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	6,020,000.000	5,419,806.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,000,000.000	5,376,300.000	

	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	5,100,000.000	4,508,757.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	13,000,000.000	11,515,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	11,460,000.000	10,143,016.800	
	南アフリカ・ランド 小計	111,550,000.000 (945,944,000)	101,194,628.500 (858,130,450)	
国債証券 合計		162,127,675,300 (162,127,675,300)	175,308,851,837 (175,308,851,837)	
合計		162,127,675,300 (162,127,675,300)	175,308,851,837 (175,308,851,837)	

- (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 121銘柄	43.82%	44.08%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	7.05%	7.09%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	2.12%	2.14%
カナダ・ドル	国債証券 29銘柄	2.08%	2.09%
シンガポール・ドル	国債証券 13銘柄	0.37%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.47%	0.48%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.59%	0.59%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.25%	0.25%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.64%	0.65%
マレーシア・リングgit	国債証券 12銘柄	0.38%	0.39%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.88%	0.88%
ユーロ	国債証券 275銘柄	40.28%	40.51%
南アフリカ・ランド	国債証券 10銘柄	0.49%	0.49%

(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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,415,085,713	2,490,836,127
コール・ローン		36,818,327	168,912,074
株式		38,892,263,440	45,981,585,810
投資信託受益証券		237,553,412	340,807,963
投資証券		93,373,243	112,116,936
派生商品評価勘定		19,708,307	8,392,310
未収入金		269,818	1,025,737
未収配当金		35,348,958	282,265,682
差入委託証拠金		593,122,646	675,669,586
流動資産合計		41,323,543,864	50,061,612,225
資産合計		41,323,543,864	50,061,612,225
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	995,427
未払金		7,137	19,635
未払解約金		17,413,000	18,958,000
流動負債合計		17,420,137	19,973,062
負債合計		17,420,137	19,973,062
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,090,393,658	44,737,444,562
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	784,269,931	5,304,194,601
元本等合計		41,306,123,727	50,041,639,163
純資産合計		41,306,123,727	50,041,639,163
負債純資産合計		41,323,543,864	50,061,612,225

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	43,354,457,363円	42,090,393,658円
同期中追加設定元本額	7,916,578,101円	10,966,220,714円
同期中一部解約元本額	9,180,641,806円	8,319,169,810円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM新興国株式インデック スファンド<DC年金>	1,586,101,353円	2,178,754,076円
DIAM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)	123,401,986円	192,151,872円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	5,258,828円	7,466,381円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	17,811,790円	18,186,641円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	27,031,131円	21,895,403円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	15,666,314円	11,946,529円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	17,178,142円	17,565,953円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,966,414円	13,629,484円
たわらノーロード 新興国株式	860,025,858円	1,806,128,062円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	302,701,465円	522,994,736円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	514,845,440円	469,930,799円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	40,980,588円	40,732,199円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	105,968,606円	120,195,891円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	239,780,908円	257,059,652円
投資のソムリエ	2,342,354,016円	3,222,414,209円
クルーズコントロール	2,326,917,948円	2,416,961,015円
投資のソムリエ<DC年金>	69,207,042円	164,563,985円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	129,816,015円	153,252,738円
クルーズコントロール<DC年 金>	916,238円	696,689円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	34,356,782円	23,987,502円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	76,409,693円	60,486,233円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	11,904,041円	105,554,913円
ダイナミック・ナビゲーション	624,782円	1,767,449円

	リスク抑制世界8資産バランス ファンド	260,124円	1,081,167,527円
	ワールドアセットバランス(基 本コース)	- 円	904,388,986円
	ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	- 円	1,915,470,465円
	投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	- 円	734,148円
	投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	- 円	734,148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)	6,552,597,287円	5,835,758,551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)	189,946,132円	- 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)	2,135,654,775円	2,132,245,988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)	14,887,853,093円	12,825,644,398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)	9,460,856,867円	8,212,977,940円
	計	42,090,393,658円	44,737,444,562円
2 .	受益権の総数	42,090,393,658口	44,737,444,562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7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,210,152,396	2,208,717,114
投資信託受益証券	28,280,754	20,784,849
投資証券	14,817,383	3,617,682
合計	2,223,615,767	2,233,119,645

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	510,195,400	-	510,180,000	15,400	821,294,840	-	821,222,500	72,340
アメリカ・ドル	510,195,400	-	510,180,000	15,400	797,171,840	-	797,116,000	55,840
香港・ドル	-	-	-	-	24,123,000	-	24,106,500	16,500
買 建	-	-	-	-	138,283,000	-	138,342,580	59,580
アメリカ・ドル	-	-	-	-	138,283,000	-	138,342,580	59,580
合計	510,195,400	-	510,180,000	15,400	959,577,840	-	959,565,080	131,920

(注) 時価の算定方法

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,523,154,893	-	1,542,847,800	19,692,907	2,750,710,574	-	2,757,975,537	7,264,963
合計	1,523,154,893	-	1,542,847,800	19,692,907	2,750,710,574	-	2,757,975,537	7,264,963

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.9814円	1.1186円
(1万口当たり純資産額)	(9,814円)	(11,186円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRIIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	32,800	54.300	1,781,040.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	21,773	11.560	251,695.880	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	65,400	4.745	310,323.000	
	CREDICORP LTD	6,049	182.340	1,102,974.660	
	SINA CORP	5,100	86.890	443,139.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	49,625	7.920	393,030.000	
	NETEASE INC-ADR	6,900	301.000	2,076,900.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,680	35.790	239,077.200	
	LUKOIL SPON ADR	38,000	47.240	1,795,120.000	
	GAZPROM PAO ADR	474,700	4.041	1,918,262.700	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	101,712	4.550	462,789.600	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	79,280	1.587	125,817.360	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	26,843	2.520	67,644.360	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	76,317	4.236	323,278.810	
	SISTEMA PJSC GDR	15,837	4.110	65,090.070	
	NOVATEK PJSC GDR	8,400	108.300	909,720.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	23,600	182.930	4,317,148.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,285	19.850	243,857.250	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	49,394	14.205	701,641.770	
	ROSTELECOM SPON ADR	22,558	6.600	148,882.800	
	ROSNEFT OIL CO GDR	112,737	5.240	590,741.880	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,000	74.650	895,800.000	
	SEVERSTAL GDR	16,907	13.120	221,819.840	
	TATNEFT ADR	23,600	36.310	856,916.000	
	VTB BANK OJSC GDR	243,997	2.074	506,049.770	
	DP WORLD LTD	13,696	21.100	288,985.600	
	MAGNIT PJSC GDR	28,200	34.060	960,492.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	37,700	10.060	379,262.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	128,960	1.265	163,134.400	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	4,300	129.550	557,065.000	
	SBERBANK ADR	238,600	10.720	2,557,792.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,464	13.500	181,764.000	
YY INC-ADR	3,100	57.980	179,738.000		
58.COM INC ADR	7,500	47.170	353,775.000		
AUTOHOME INC ADR	4,400	46.830	206,052.000		

	WEIBO CORP ADR	3,160	68.760	217,281.600	
	JD.COM INC ADR	57,500	40.420	2,324,150.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	98,400	143.810	14,150,904.000	
	MOMO INC SPON ADR	7,300	40.740	297,402.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	34,200	37.320	1,276,344.000	
アメリカ・ドル 小計		2,212,974		44,842,901.550 (5,121,956,216)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	101,220	5.620	568,856.400	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	143,415	17.450	2,502,591.750	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	197,247	6.960	1,372,839.120	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	116,628	10.200	1,189,605.600	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	316,029	7.740	2,446,064.460	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	274,203	2.330	638,892.990	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.450	436,506.700	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	272,783	0.739	201,586.630	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	3.430	652,506.050	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,789,926		10,009,449.700 (311,794,358)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	112,800	1,492.850	168,393,480.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	42,425	664.650	28,197,776.250	
	ASIAN PAINTS LTD	24,369	1,127.750	27,482,139.750	
	EICHER MOTORS LTD	1,122	27,931.300	31,338,918.600	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	26,800	1,255.450	33,646,060.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	33,400	1,367.400	45,671,160.000	
	SHREE CEMENT LTD	709	18,250.450	12,939,569.050	
	ICICI BANK LTD	209,770	291.450	61,137,466.500	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	34,292	512.600	17,578,079.200	
	STATE BANK OF INDIA LTD	154,587	285.550	44,142,317.850	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,657	1,200.250	4,389,314.250	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	24,616	743.200	18,294,611.200	
	TATA STEEL LTD	25,328	559.350	14,167,216.800	
	TATA MOTORS LTD	140,000	446.950	62,573,000.000	
	JSW STEEL LTD	65,122	218.050	14,199,852.100	
	TATA POWER CO LTD	91,986	83.450	7,676,231.700	
	NESTLE INDIA LTD	1,963	6,805.500	13,359,196.500	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	137.650	6,758,477.350	
	GAIL INDIA LTD	49,700	366.000	18,190,200.000	
	VEDANTA LTD	98,078	260.700	25,568,934.600	
AXIS BANK LTD	146,900	509.950	74,911,655.000		

TITAN COMPANY LTD	25,302	536.750	13,580,848.500	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	109,841	162.400	17,838,178.400	
LUPIN LTD	18,320	1,148.850	21,046,932.000	
ACC LTD	5,800	1,628.100	9,442,980.000	
BAJAJ FINANCE LTD	13,840	1,412.800	19,553,152.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	131,000	1,638.850	214,689,350.000	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	47,419	505.750	23,982,159.250	
INFOSYS LTD	159,700	957.050	152,840,885.000	
WIPRO LTD	103,022	268.250	27,635,651.500	
INDIAN OIL CORP LTD	49,407	383.450	18,945,114.150	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	53,674	1,096.250	58,840,122.500	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	9,000	1,248.850	11,239,650.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	50,300	849.650	42,737,395.000	
DABUR INDIA LTD	44,319	303.850	13,466,328.150	
HERO MOTOCORP LTD	4,116	3,731.000	15,356,796.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,467	2,726.200	25,808,935.400	
BHARTI AIRTEL LTD	100,658	405.700	40,836,950.600	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	2,637.950	14,360,999.800	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	84,525	563.700	47,646,742.500	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,500	7,430.450	70,589,275.000	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,618	677.300	7,868,871.400	
AUROBINDO PHARMA LTD	25,500	709.400	18,089,700.000	
HAVELLS INDIA LTD	20,340	474.500	9,651,330.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	54,280	312.500	16,962,500.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	12,785	1,055.500	13,494,567.500	
CIPLA LTD/INDIA	28,876	549.200	15,858,699.200	
LARSEN & TOUBRO LTD	28,700	1,732.150	49,712,705.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,446	4,135.150	30,790,326.900	
ASHOK LEYLAND LTD	97,960	105.150	10,300,494.000	
BOSCH LTD	629	23,890.000	15,026,810.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	41,200	2,434.950	100,319,940.000	
NTPC LTD	140,454	160.050	22,479,662.700	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,590	2,901.450	19,120,555.500	
YES BANK LTD	30,500	1,512.900	46,143,450.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	50,174	254.400	12,764,265.600	
BHARAT FORGE LTD	8,786	1,120.500	9,844,713.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	98,773	195.800	19,339,753.400	
ITC LTD	298,700	333.300	99,556,710.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	33,000	850.800	28,076,400.000	

	SIEMENS INDIA LTD	6,219	1,364.550	8,486,136.450	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	20,144	974.650	19,633,349.600	
	TECH MAHINDRA LTD	43,655	384.100	16,767,885.500	
	CAIRN INDIA LTD	37,231	285.350	10,623,865.850	
	IDEA CELLULAR LTD	133,167	87.200	11,612,162.400	
	MARICO LTD	38,600	323.000	12,467,800.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	51,530	126.700	6,528,851.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	68,449	374.950	25,664,952.550	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	59,932	187.000	11,207,284.000	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,305	4,103.000	13,560,415.000	
	BAJAJ AUTO LTD	7,213	2,730.650	19,696,178.450	
	COAL INDIA LTD	52,177	258.800	13,503,407.600	
	TATA MOTORS LTD	31,568	268.150	8,464,959.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	366.400	8,689,176.000	
	BHARTI INFRA TEL LTD	47,337	410.300	19,422,371.100	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	28,736	1,069.450	30,731,715.200	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	519.600	9,428,661.600	
	IDFC BANK LTD	114,421	65.200	7,460,249.200	
	インド・ルピー 小計	4,153,233		2,390,404,977.350 (4,254,920,860)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	6,300.000	947,520,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	142,301	27,625.000	3,931,065,125.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	375,500	8,600.000	3,229,300,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	126,300	46,725.000	5,901,367,500.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,782,600	8,775.000	15,642,315,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,467,200	4,570.000	20,415,104,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,900	3,230.000	2,005,507,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	40,500	76,500.000	3,098,250,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	782,000	3,790.000	2,963,780,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	156,900	17,600.000	2,761,440,000.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	870,500	1,210.000	1,053,305,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	4,840.000	1,405,613,440.000	
	BANK MANDIRI	829,000	13,100.000	10,859,900,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	199,400	12,350.000	2,462,590,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	979,500	14,725.000	14,423,137,500.000	

	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,350.000	2,500,635,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	636,800	6,850.000	4,362,080,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,748,400	1,585.000	2,771,214,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	241,600	10,000.000	2,416,000,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	831,000	18,300.000	15,207,300,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	3,130.000	909,891,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,560,300	710.000	1,107,813,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	1,725.000	808,162,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	5,200.000	1,040,650,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	1,805.000	1,070,004,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,223,000	1,595.000	1,950,685,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	625.000	1,195,500,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	182,600	8,500.000	1,552,100,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	7,400.000	1,337,920,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	2,250.000	882,000,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,350.000	1,201,555,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		23,850,242		131,413,704,065.000 (1,130,157,855)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	11,462	68.100	780,562.200	
	QATAR NATIONAL BANK	19,229	127.000	2,442,083.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	16,651	29.650	493,702.150	
	OOREDOO QSC	6,737	91.000	613,067.000	
	DOHA BANK QSC	10,679	29.800	318,234.200	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,406	187.000	449,922.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	13,442	95.000	1,276,990.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,054	89.000	449,806.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	36,300	18.000	653,400.000	
	MASRAF AL RAYAN	37,100	39.850	1,478,435.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	32.450	256,874.200	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	66,339	12.070	800,711.730	
	DOHA BANK QSC-RTS	1,284	4.710	6,047.640	
カタール・リアル 小計		234,599		10,019,835.120 (306,105,963)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	46,600	13,480.000	628,168,000.000	
	ECOPETROL SA	413,049	1,355.000	559,681,395.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	39,320.000	398,626,160.000	

	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	247,861	1,280.000	317,262,080.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	54,300	11,560.000	627,708,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	27,199	21,120.000	574,442,880.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,700	31,900.000	564,630,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,285	33,740.000	1,291,735,900.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	19,160	40,500.000	775,980,000.000	
コロンビア・ペソ	小計	874,292		5,738,234,415.000 (214,036,144)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	193.500	3,811,950.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	20.200	1,741,240.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	100,100	46.750	4,679,675.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	293,900	18.800	5,525,320.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	39,400	57.000	2,245,800.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	159,600	154.500	24,658,200.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	863,055	6.050	5,221,482.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	49,000	196.000	9,604,000.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.260	2,282,600.000	
	IRPC PCL NVDR	863,400	5.200	4,489,680.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	169,100	15.800	2,671,780.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	20,700	212.000	4,388,400.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	229,000	24.700	5,656,300.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	97,500	180.000	17,550,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	523,520	9.600	5,025,792.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	86.250	3,812,250.000	
	PTT PCL	93,400	374.000	34,931,600.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	164,100	20.700	3,396,870.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,650	504.000	5,871,600.000	
	KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	24,900	106.000	2,639,400.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	355,000	48.500	17,217,500.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	22,700	506.000	11,486,200.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	105,700	202.000	21,351,400.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	113,600	70.000	7,952,000.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	323,800	19.800	6,411,240.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	171.000	5,181,300.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	185,310	40.250	7,458,727.500	

	THAI OIL PCL NVDR	70,200	78.500	5,510,700.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	77.750	3,234,400.000	
	CP ALL PCL NVDR	435,700	62.000	27,013,400.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	8.500	4,630,800.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	115,245	84.500	9,738,202.500	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	69,622	37.750	2,628,230.500	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	37.750	2,073,720.750	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	182,908	70.000	12,803,560.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	93,000	34.000	3,162,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	578,400	7.450	4,309,080.000	
タイ・パーツ 小計		8,185,243		302,366,401.000 (1,012,927,443)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,600	934.100	7,099,160.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	280.200	1,590,695.400	
	CEZ	13,560	395.800	5,367,048.000	
	MONETA MONEY BANK AS	55,000	77.300	4,251,500.000	
チェコ・コルナ 小計		81,837		18,308,403.400 (91,358,933)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,514,000	42.930	279,646,020.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,083	37,718.000	116,284,594.000	
	BANCO DE CHILE	2,049,363	90.430	185,323,896.090	
	EMPRESAS CMPC SA	103,149	1,603.700	165,420,051.300	
	EMPRESAS COPEC SA	41,000	7,660.200	314,068,200.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	12,454	8,667.200	107,941,308.800	
	ENTEL CHILE SA	12,543	7,255.500	91,005,736.500	
	ENEL GENERACION CHILE SA	275,680	515.440	142,096,499.200	
	ENEL AMERICAS SA	2,450,054	133.310	326,616,698.740	
	COLBUN SA	955,000	146.090	139,515,950.000	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	393.520	88,194,128.320	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,899.800	61,997,724.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	27,396	7,679.200	210,379,363.200	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,047	23,699.000	190,705,853.000	
	SACI FALABELLA	50,696	5,617.900	284,805,058.400	
	ITAU CORPBANCA	17,593,000	6.189	108,883,077.000	
	CENCOSUD SA	117,984	1,780.700	210,094,108.800	
	AES GENER SA	257,135	232.290	59,729,889.150	
ENEL CHILE SA	1,664,838	74.660	124,296,805.080		
チリ・ペソ 小計		32,380,918		3,207,004,961.580 (549,359,950)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	183,772	9.910	1,821,180.520	

	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	16,570	21.120	349,958.400	
	ARCELIK	20,062	25.580	513,185.960	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	21.560	381,116.120	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	112,625	7.300	822,162.500	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	41.900	233,969.600	
	KOC HOLDING AS	63,206	16.280	1,028,993.680	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	80,700	6.060	489,042.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	96,200	4.740	455,988.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	10,370	29.300	303,841.000	
	TURK HAVA YOLLARI	71,400	8.670	619,038.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	74,860	11.710	876,610.600	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	192,990	9.940	1,918,320.600	
	TURKIYE IS BANKASI	166,000	7.530	1,249,980.000	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,559	100.300	1,059,067.700	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	20.940	274,753.740	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	73,599	4.580	337,083.420	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	79,625	10.750	855,968.750	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	40.260	259,717.260	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,094	64.100	1,159,825.400	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	6.610	420,448.880	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	19.310	265,222.850	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	51,480	13.300	684,684.000	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	39,975	6.110	244,247.250	
	トルコ・リラ 小計	1,482,263		16,624,406.230 (526,328,701)	
ハンガリー・フォ ロント	RICHTER GEDEON NYRT	12,249	6,900.000	84,518,100.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	4,400	21,095.000	92,818,000.000	
	OTP BANK NYRT	22,000	9,575.000	210,650,000.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	38,649		387,986,100.000 (163,846,530)	
パキスタン・ル ビー	ENGRO CORP LTD	23,000	339.880	7,817,240.000	
	LUCKY CEMENT LTD	9,900	781.770	7,739,523.000	
	MCB BANK LTD	39,000	212.080	8,271,120.000	

	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	42,300	143.970	6,089,931.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	216.280	11,116,792.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	254.500	13,844,800.000	
パキスタン・ルビー 小計		220,000		54,879,406.000 (59,818,552)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	611,900	39.900	24,414,810.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	210,370	75.000	15,777,750.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	59,486	103.400	6,150,852.400	
	AYALA CORP	24,913	855.000	21,300,615.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	340,600	14.000	4,768,400.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	14.520	5,108,862.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,036.000	5,670,260.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	101.000	4,108,680.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	238,790	78.350	18,709,196.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	36,030	208.000	7,494,240.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	47,451	94.150	4,467,511.650	
	BDO UNIBANK INC	165,213	123.900	20,469,890.700	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.520	4,348,240.000	
	PLDT INC	7,900	1,701.000	13,437,900.000	
	ROBINSONS LAND CORP	172,400	24.100	4,154,840.000	
	SECURITY BANK CORP	9,450	221.000	2,088,450.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	722,075	32.950	23,792,371.250	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	72,860	162.500	11,839,750.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,988	790.000	15,790,520.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	809,000	5.700	4,611,300.000	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,712,100	6.700	11,471,070.000		
ABOITIZ POWER CORP	122,900	40.150	4,934,435.000		
GT CAPITAL HOLDINGS INC	7,440	1,195.000	8,890,800.000		
フィリピン・ペソ 小計		6,748,181		243,800,744.500 (548,551,676)	
ブラジル・リアル	BRF SA	40,192	37.330	1,500,367.360	
	VALE SA	108,327	29.710	3,218,395.170	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	26.000	208,468.000	
	VALE SA-PREF A	171,096	27.630	4,727,382.480	
	RAIA DROGASIL SA	19,500	70.000	1,365,000.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	10.020	698,394.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	18.110	352,239.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	24,500	15.250	373,625.000	
	BANCO DO BRASIL SA	76,600	26.910	2,061,306.000	

INVESTIMENTOS ITAU SA	341,386	9.050	3,089,543.300	
LOJAS AMERICANAS SA	61,874	14.590	902,741.660	
LOJAS AMERICANAS SA	14,670	12.180	178,680.600	
GERDAU SA	84,430	11.020	930,418.600	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	13,106	65.620	860,015.720	
PETROLEO BRASILEIRO SA	256,810	12.700	3,261,487.000	
PETROLEO BRASILEIRO SA	342,312	11.980	4,100,897.760	
KROTON EDUCACIONAL SA	121,468	14.930	1,813,517.240	
CCR SA	110,820	16.900	1,872,858.000	
WEG SA	47,940	18.420	883,054.800	
BANCO BRADESCO SA PREF	268,696	28.160	7,566,479.360	
BANCO BRADESCO SA	77,235	27.700	2,139,409.500	
NATURA COSMETICOS SA	14,800	25.340	375,032.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	50,506	7.270	367,178.620	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	13.550	425,470.000	
CPFL ENERGIA SA	22,674	26.590	602,901.660	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	281,698	36.450	10,267,892.100	
PORTO SEGURO SA	9,400	29.330	275,702.000	
FIBRIA CELULOSE SA	21,490	32.610	700,788.900	
BRASKEM SA	17,030	34.490	587,364.700	
ENGIE BRASIL SA	13,970	34.800	486,156.000	
LOCALIZA RENT A CAR	13,760	45.870	631,171.200	
TELEFONICA BRASIL S.A.	41,228	45.000	1,855,260.000	
LOJAS RENNER SA	59,870	27.900	1,670,373.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,064	14.450	376,624.800	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,852	76.150	2,425,529.800	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	14,000	33.350	466,900.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	16,700	54.800	915,160.000	
EMBRAER SA	55,960	15.700	878,572.000	
M DIAS BRANCO SA	8,400	46.800	393,120.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	16,300	22.960	374,248.000	
ODONTOPREV SA	22,300	11.550	257,565.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	69,965	12.090	845,876.850	
JBS SA	69,100	6.460	446,386.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	64,349	8.520	548,253.480	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	29,398	32.300	949,555.400	

	MULTIPLAN EMPREENHIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,380	66.000	487,080.000	
	DURATEX SA	27,734	7.810	216,602.540	
	SUL AMERICA SA	17,869	17.540	313,422.260	
	HYPERMARCAS SA	29,800	27.960	833,208.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	184,316	19.470	3,588,632.520	
	QUALICORP SA	17,800	30.710	546,638.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	34,900	25.650	895,185.000	
	CIELO SA	108,407	24.280	2,632,121.960	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	59,000	27.650	1,631,350.000	
	AMBEV SA	409,495	18.310	7,497,853.450	
	KLABIN SA	46,700	16.050	749,535.000	
	RUMO SA	68,700	8.810	605,247.000	
ブラジル・リアル	小計	4,292,445		89,224,238.290 (3,129,986,279)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	52,647	7.240	381,164.280	
	MBANK	1,260	458.800	578,088.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	66.890	173,646.440	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,956	107.650	1,394,713.400	
	BANK PEKAO SA	13,110	126.200	1,654,482.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.050	295,930.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,078	111.500	2,907,697.000	
	LPP SA	112	6,701.000	750,512.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	3,200	354.100	1,133,120.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	83,700	34.650	2,900,205.000	
	CCC SA	2,638	234.900	619,666.200	
	SYNTHOS SA	46,508	4.560	212,076.480	
	EUROCASH SA	9,500	33.050	313,975.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,746	52.990	410,460.540	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	146,377	6.490	949,986.730	
	CYFROWY POLSAT SA	16,740	25.070	419,671.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	63.230	243,625.190	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	81,100	12.060	978,066.000	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	89,318	3.670	327,797.060	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	55,000	43.950	2,417,250.000	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,403	72.720	320,186.160	
	ALIOR BANK SA	7,434	62.500	464,625.000	

ポーランド・ズロチ 小計		724,876		19,846,944.280 (609,698,128)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	138,900	5.010	695,889.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.940	247,244.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	296,700	6.530	1,937,451.000	
	DIGI.COM BHD	289,900	4.980	1,443,702.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	8.470	585,446.400	
	RHB BANK BHD	68,080	5.070	345,165.600	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	54,700	9.000	492,300.000	
	GAMUDA BHD	194,800	5.420	1,055,816.000	
	GENTING BHD	220,900	9.030	1,994,727.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.460	540,214.600	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	34,656	16.680	578,062.080	
	HONG LEONG BANK BHD	48,008	16.000	768,128.000	
	IJM CORP BHD	239,360	3.500	837,760.000	
	IOI CORP BHD	189,613	4.490	851,362.370	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	39,900	24.720	986,328.000	
	MALAYAN BANKING BHD	295,275	9.620	2,840,545.500	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	86,100	3.840	330,624.000	
	MISC BHD	108,880	7.390	804,623.200	
	PPB GROUP BHD	40,000	16.760	670,400.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	23.880	417,900.000	
	PETRONAS GAS BHD	58,700	18.900	1,109,430.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	302,000	5.610	1,694,220.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	42.260	481,764.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.490	616,550.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	284,050	14.120	4,010,786.000	
	UMW HOLDINGS BHD	39,000	5.500	214,500.000	
	DIALOG GROUP BHD	243,444	1.910	464,978.040	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	241,330	20.320	4,903,825.600	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.430	208,584.090	
	AIRASIA BHD	107,200	3.150	337,680.000	
	SIME DARBY BERHAD	232,700	9.540	2,219,958.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	57,600	6.750	388,800.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	225,100	4.690	1,055,719.000	
MAXIS BHD	154,200	5.510	849,642.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	196,300	6.890	1,352,507.000		
SAPURA ENERGY BHD	319,200	1.630	520,296.000		
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	235,500	2.530	595,815.000		
IHH HEALTHCARE BHD	177,700	5.910	1,050,207.000		

	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	126,400	1.650	208,560.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	83,500	3.670	306,445.000	
	UMW OIL & GAS CORP BHD	40,216	0.410	16,488.560	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	2.150	375,278.200	
マレーシア・リングット 小計		6,375,953		41,405,722.240 (1,101,392,212)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	256,100	25.500	6,530,550.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	42,300	153.310	6,485,013.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	15,600	142.020	2,215,512.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	152,500	35.080	5,349,700.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	215,000	93.040	20,003,600.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	138,100	45.360	6,264,216.000	
	GRUMA SAB DE CV	20,805	234.930	4,887,718.650	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,845	212.210	3,786,887.450	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,900	75.080	2,845,532.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	219,600	120.770	26,521,092.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	87,625	48.730	4,269,966.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,700	422.400	6,209,280.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	130,300	37.740	4,917,522.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,600	376.610	6,628,336.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	338,852	53.620	18,169,244.240	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,927,878	14.980	43,859,612.440	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	193,600	30.480	5,900,928.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	37,300	136.610	5,095,553.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	448,700	41.820	18,764,634.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	30,000	202.010	6,060,300.000	
OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	26.340	1,849,068.000		
GENTERA SAB DE CV	84,900	26.550	2,254,095.000		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	45,500	94.020	4,277,910.000		
GRUPO LALA SAB DE CV	50,400	34.770	1,752,408.000		
メキシコ・ペソ 小計		5,593,305		214,898,678.030 (1,368,904,579)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	500,000	0.229	114,500.000	
	ALPHA BANK A.E.	100,000	2.200	220,000.000	

	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.360	1,439.280	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	25.490	89,673.820	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	10.490	104,941.960	
	FF GROUP	3,130	21.570	67,514.100	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	1.010	1,646.300	
	OPAP SA	8,501	10.200	86,710.200	
	JUMBO SA	5,623	15.600	87,718.800	
ユーロ 小計		636,404		774,144.460 (100,747,161)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	18,800.000	133,423,600.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,142	86,100.000	98,326,200.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,205	106,500.000	341,332,500.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,577	291,000.000	749,907,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,192	75,600.000	316,915,200.000	
	COWAY CO LTD	4,482	104,000.000	466,128,000.000	
	KT&G CORP	10,264	113,500.000	1,164,964,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,579	97,600.000	154,110,400.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	50,000.000	149,850,000.000	
	CJ CORP	1,224	188,500.000	230,724,000.000	
	KAKAO CORP	3,122	102,000.000	318,444,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,658	255,500.000	423,619,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,356	89,100.000	209,919,600.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	30,731	10,750.000	330,358,250.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,593	378,500.000	602,950,500.000	
	LG UPLUS CORP	11,086	15,600.000	172,941,600.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	21,400.000	86,670,000.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	8,516	8,040.000	68,468,640.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	22,300.000	80,280,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	820	918,000.000	752,760,000.000	
	LG CHEM LTD	4,068	291,500.000	1,185,822,000.000	
	LG CHEM LTD	641	198,000.000	126,918,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	177	585,000.000	103,545,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	37,671	49,400.000	1,860,947,400.000	
	HYUNDAI DEVELOPMENT CO	4,815	48,450.000	233,286,750.000	
	S-OIL CORP	3,768	100,000.000	376,800,000.000	
	HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	31,650.000	245,952,150.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,530	39,750.000	219,817,500.000	

LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,295	347,000.000	449,365,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	52,500.000	155,137,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,790	171,500.000	478,485,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,968	243,000.000	1,450,224,000.000	
SK HYNIX INC	50,844	67,300.000	3,421,801,200.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,478	47,150.000	352,587,700.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,907	103,000.000	196,421,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,584	148,000.000	2,010,432,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,668	61,300.000	408,748,400.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,903	14,750.000	352,569,250.000	
KCC CORP	483	404,500.000	195,373,500.000	
KIA MOTORS CORP	23,300	36,700.000	855,110,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	718	460,000.000	330,280,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,755	41,800.000	909,359,000.000	
HANWHA CORP	3,785	48,500.000	183,572,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	3,652	36,600.000	133,663,200.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	86,600.000	129,900,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	591	178,500.000	105,493,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,423	74,000.000	105,302,000.000	
KT CORP	2,048	33,100.000	67,788,800.000	
LG ELECTRONICS INC	9,553	70,800.000	676,352,400.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	430	195,000.000	83,850,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	47	1,607,000.000	75,529,000.000	
HANSSEM CO LTD	869	185,500.000	161,199,500.000	
LG CORP	7,950	72,600.000	577,170,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,951	14,150.000	225,706,650.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	31,700.000	125,056,500.000	
NAVER CORP	2,436	813,000.000	1,980,468,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,187	109,500.000	129,976,500.000	
DONGSUH CO INC	2,798	29,050.000	81,281,900.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,287	68,600.000	225,488,200.000	
OTTOGI CORP	112	749,000.000	83,888,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,412	120,500.000	290,646,000.000	
KANGWON LAND INC	9,890	34,000.000	336,260,000.000	
POSCO	6,483	300,000.000	1,944,900,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,954	176,000.000	871,904,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,716	99,300.000	468,298,800.000	

SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,522	2,433,000.000	20,734,026,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	23,331	12,100.000	282,305,100.000	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,141	43,450.000	136,476,450.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,534	1,918,000.000	2,942,212,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	233,500.000	156,211,500.000	
HYOSUNG CORP	1,781	163,500.000	291,193,500.000	
ORION HOLDINGS	1,022	30,500.000	31,171,000.000	
YUHAN CORP	733	246,500.000	180,684,500.000	
HANON SYSTEMS	18,967	10,400.000	197,256,800.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,281	43,600.000	230,251,600.000	
GS HOLDINGS CORP	4,279	69,500.000	297,390,500.000	
LG DISPLAY CO LTD	20,470	35,700.000	730,779,000.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	6,180.000	63,530,400.000	
CELLTRION INC	7,226	113,000.000	816,538,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	26,500	46,450.000	1,230,925,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,753	151,000.000	264,703,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,058	290,000.000	306,820,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,770	123,000.000	709,710,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,882	281,500.000	811,283,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	179,500.000	134,984,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	39,000.000	112,203,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,728	160,000.000	916,480,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	669	352,500.000	235,822,500.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	5,370.000	98,781,150.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	45,050.000	82,216,250.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,196	157,000.000	187,772,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,854	271,000.000	773,434,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	35,133	57,400.000	2,016,634,200.000	
MEDY-TOX INC	365	574,000.000	209,510,000.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,454	64,700.000	94,073,800.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,721	58,300.000	333,534,300.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	21,890	10,800.000	236,412,000.000	
HANMI PHARM CO LTD	556	369,500.000	205,442,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	16,882	7,560.000	127,627,920.000	
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,537	76,000.000	116,812,000.000	
E-MART CO LTD	1,752	238,500.000	417,852,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	17,915	11,650.000	208,709,750.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	49,850.000	123,727,700.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,262	64,800.000	405,777,600.000	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	550	407,500.000	224,125,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,967	88,000.000	173,096,000.000	

	NETMARBLE GAMES CORP	1,466	151,000.000	221,366,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	1,876	100,000.000	187,600,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,914	188,500.000	549,289,000.000	
	WOORI BANK	28,579	18,900.000	540,143,100.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,624	145,500.000	963,792,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,333	291,000.000	387,903,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,980	35,200.000	104,896,000.000	
韓国・ウォン 小計		764,132		72,638,253,910.000 (7,220,242,439)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	100,000	12.500	1,250,000.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	11.140	1,136,280.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	6.250	1,012,500.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	532,000	80.750	42,959,000.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	101,000	27.600	2,787,600.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,000	39.050	1,640,100.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	5.430	1,943,940.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	3.690	1,018,440.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	158,000	7.000	1,106,000.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	63,500	59.200	3,759,200.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	67,020	10.000	670,200.000	
	CNOOC LTD	1,561,000	8.520	13,299,720.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	278,000	14.460	4,019,880.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	394,000	11.580	4,562,520.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	343,120	23.350	8,011,852.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	252,888	22.550	5,702,624.400	
	CITIC LTD	521,000	11.500	5,991,500.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	126,000	11.600	1,461,600.000	
	LENOVO GROUP LTD	588,000	4.790	2,816,520.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,816,000	4.770	8,662,320.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	534,742	10.840	5,796,603.280	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	131,790	19.660	2,590,991.400	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,219,200	5.790	12,849,168.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	92,000	22.600	2,079,200.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	68,000	51.950	3,532,600.000		

KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	270,000	7.040	1,900,800.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	130,000	9.100	1,183,000.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	124,000	21.650	2,684,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	326,000	4.170	1,359,420.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	17.000	1,326,000.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	140,000	17.340	2,427,600.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	430,000	17.240	7,413,200.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	76,000	28.200	2,143,200.000	
BYD CO LTD	53,000	48.050	2,546,650.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,210,000	3.640	4,404,400.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	146,000	6.290	918,340.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,170,000	1.270	1,485,900.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	201,000	9.320	1,873,320.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	415,192	14.820	6,153,145.440	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	164,000	4.780	783,920.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	165,200	15.060	2,487,912.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	260,000	10.440	2,714,400.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	652,000	23.950	15,615,400.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	583,000	2.510	1,463,330.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	6.020	963,200.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	240,200	8.500	2,041,700.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	169,440	7.260	1,230,134.400	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	4.250	1,262,250.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	43,000	22.900	984,700.000	
TINGYI HOLDING CORP	164,000	9.340	1,531,760.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	34.150	1,024,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	232,000	10.300	2,389,600.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	137,333	18.940	2,601,087.020	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	10.340	1,199,440.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	376,000	6.740	2,534,240.000	

CHINA MENGNIU DAIRY CO	234,000	14.740	3,449,160.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	494,700	271.600	134,360,520.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	456,500	54.800	25,016,200.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	406,000	5.990	2,431,940.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	970,240	0.930	902,323.200	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	2.750	748,000.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	7.530	1,219,860.000	
ZTE CORP	58,488	18.460	1,079,688.480	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.640	910,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	297,000	16.920	5,025,240.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	732,205	5.490	4,019,805.450	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	146,000	12.240	1,787,040.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	60,500	99.350	6,010,675.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,287,530	5.940	43,287,928.200	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	47,000	51.700	2,429,900.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	9.450	2,154,600.000	
MINTH GROUP LTD	56,000	33.200	1,859,200.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	167,000	10.560	1,763,520.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	238,000	4.620	1,099,560.000	
BANK OF CHINA LTD	6,903,200	3.590	24,782,488.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	102,000	14.040	1,432,080.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	84,400	12.320	1,039,808.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	344,470	22.950	7,905,586.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,399,235	4.870	31,164,274.450	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	199,600	4.180	834,328.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	407,000	9.950	4,049,650.000	
CHINA COAL ENERGY CO	162,000	3.730	604,260.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	21.800	1,177,200.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	46,100	38.700	1,784,070.000	

HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	19.820	2,081,100.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	448,142	9.170	4,109,462.140	
CHINA CITIC BANK-H	747,800	4.750	3,552,050.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	528,000	6.130	3,236,640.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	65,000	69.550	4,520,750.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	90,000	26.450	2,380,500.000	
FOSUN INTERNATIONAL	215,528	11.760	2,534,609.280	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	316,000	3.040	960,640.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	249,500	3.900	973,050.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	4.050	720,900.000	
KINGSOFT CORP LTD	67,000	19.480	1,305,160.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,096,000	0.850	931,600.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	376,000	6.180	2,323,680.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	161,000	10.220	1,645,420.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	420,000	5.230	2,196,600.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	235,800	31.700	7,474,860.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	349,000	15.260	5,325,740.000	
CRRC CORP LTD - H	387,450	6.870	2,661,781.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	104,000	12.520	1,302,080.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	200,500	6.060	1,215,030.000	
SINOPHARM GROUP CO	111,600	34.100	3,805,560.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	177,805	15.480	2,752,421.400	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	212,000	5.290	1,121,480.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	266,000	5.510	1,465,660.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	56,800	22.500	1,278,000.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	2.460	841,320.000	
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	3.200	1,040,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	163,000	14.800	2,412,400.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	121,500	17.440	2,118,960.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	65,700	41.200	2,706,840.000	

	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	454,880	7.610	3,461,636.800	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.580	920,060.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,306,000	3.410	7,863,460.000	
	FAR EAST HORIZON LTD	166,000	6.640	1,102,240.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	192,500	15.760	3,033,800.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD	273,600	12.360	3,381,696.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	595,000	3.440	2,046,800.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	41,500	28.450	1,180,675.000	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	107,500	6.920	743,900.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	282,500	6.790	1,918,175.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.420	135,660.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	745,000	2.810	2,093,450.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	137,000	14.480	1,983,760.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	99,561	22.700	2,260,034.700	
	CGN POWER CO LTD	900,000	2.180	1,962,000.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	575,000	3.170	1,822,750.000	
	GF SECURITIES CO LTD	133,200	15.440	2,056,608.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	27.800	1,212,080.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	139,000	14.520	2,018,280.000	
	3SBIO INC	90,000	10.280	925,200.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	536,000	3.040	1,629,440.000	
香港・ドル	小計	64,275,759		652,237,673.040 (9,535,714,780)	
台湾・ドル	ACER INC	248,532	15.700	3,901,952.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	61,554	293.500	18,066,099.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	37,616	110.500	4,156,568.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	585,806	38.700	22,670,692.200	
	ASIA CEMENT CORP	260,928	26.350	6,875,452.800	
	TAIWAN BUSINESS BANK	326,380	8.430	2,751,383.400	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	58,000	41.000	2,378,000.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	55.000	4,290,000.000	

MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,000	71.600	4,081,200.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,312	76.500	3,542,868.000	
QUANTA COMPUTER INC	222,858	72.000	16,045,776.000	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	68,070	50.300	3,423,921.000	
EVA AIRWAYS CORP	153,555	15.300	2,349,391.500	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	58,760	370.000	21,741,200.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	411,196	17.350	7,134,250.600	
CHINA AIRLINES	232,156	9.240	2,145,121.440	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	159,169	65.000	10,345,985.000	
CHINA STEEL CORP	1,092,058	25.300	27,629,067.400	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	338,162	32.950	11,142,437.900	
ADVANTECH CO LTD	28,889	211.000	6,095,579.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	357,304	20.650	7,378,327.600	
DELTA ELECTRONICS INC	168,663	160.000	26,986,080.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	57,000	55.300	3,152,100.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	335,327	108.500	36,382,979.500	
AU OPTRONICS CORP	733,194	12.750	9,348,223.500	
TAIWAN MOBILE CO LTD	133,800	113.000	15,119,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	16.500	2,646,468.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	266,824	24.800	6,617,235.200	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	131.500	3,921,987.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,022	368.000	5,528,096.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	49,285	123.000	6,062,055.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	367,633	92.200	33,895,762.600	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	65,000	31.250	2,031,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	244,594	89.900	21,989,000.600	
TRANSCEND INFORMATION INC	22,897	93.400	2,138,579.800	
GIANT MANUFACTURING	23,151	171.000	3,958,821.000	
MEDIATEK INC	132,507	247.000	32,729,229.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	558,936	46.450	25,962,577.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	613,632	17.550	10,769,241.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	22,000	371.500	8,173,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	134,000	77.000	10,318,000.000	

YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,017,141	13.400	13,629,689.400	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	729,920	48.900	35,693,088.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,278,403	8.510	10,879,209.530	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	702,951	18.650	13,110,036.150	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,359,532	115.500	157,025,946.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	997,495	25.300	25,236,623.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	5,090.000	41,839,800.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	889,748	13.900	12,367,497.200	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	694,724	8.100	5,627,264.400	
INVENTEC CO LTD	207,005	26.200	5,423,531.000	
HTC CORPORATION	56,832	71.200	4,046,438.400	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	179,845	49.900	8,974,265.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	834,332	9.320	7,775,974.240	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,558,048	19.950	31,083,057.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	752,282	20.200	15,196,096.400	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	16,950	161.500	2,737,425.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	55,560	95.000	5,278,200.000	
NAN YA PLASTICS CORP	425,828	74.600	31,766,768.800	
WISTRON CORP	209,110	30.150	6,304,666.500	
POU CHEN CORP	183,990	40.850	7,515,991.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	435,297	60.100	26,161,349.700	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,392	271.000	12,843,232.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,480	103.000	11,276,440.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	361.500	4,575,867.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	33.500	2,530,824.500	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,715	43.800	2,089,917.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	76,588	91.300	6,992,484.400	
SILICONWARE PRECISION INDS	163,743	49.800	8,154,401.400	
STANDARD FOODS CORP	49,653	79.800	3,962,309.400	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	114,899	34.050	3,912,310.950	
TAIWAN CEMENT CORP	327,874	35.000	11,475,590.000	

	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	156,000	28.350	4,422,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,138,083	206.000	440,445,098.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	987,525	14.300	14,121,607.500	
	YULON MOTOR CO	65,149	26.850	1,749,250.650	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	142,000	25.050	3,557,100.000	
	INNOLUX CORPORATION	821,345	15.350	12,607,645.750	
	WPG HOLDINGS CO LTD	122,526	40.750	4,992,934.500	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	17,216	200.000	3,443,200.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	183.000	2,379,000.000	
	PEGATRON CORP	162,554	97.100	15,783,993.400	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	112,076	84.900	9,515,252.400	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.250	1,927,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	70.400	2,420,704.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	643,523	16.200	10,425,072.600	
	OBI PHARMA INC	9,000	226.500	2,038,500.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	218.000	2,834,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	12,000	341.000	4,092,000.000	
	台湾・ドル 小計	28,272,131		1,528,116,614.010 (5,715,156,137)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	28,101	156.310	4,392,467.310	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	36,673	69.270	2,540,338.710	
	DISCOVERY LTD	30,162	129.240	3,898,136.880	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	417,547	10.330	4,313,260.510	
	MASSMART HOLDINGS LTD	7,992	105.790	845,473.680	
	GOLD FIELDS LTD	78,154	47.610	3,720,911.940	
	REMGRO LTD	48,000	212.000	10,176,000.000	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	139.790	2,418,506.790	
	MMI HOLDINGS LTD	82,706	20.250	1,674,796.500	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	173,291	24.470	4,240,430.770	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,985	96.200	1,922,557.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	788.000	2,508,992.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	14,449	112.400	1,624,067.600	
	MTN GROUP LTD	148,900	116.300	17,317,070.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,366	130.720	4,753,763.520	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	63.600	1,286,437.200	
	FIRSTRAND LTD	299,300	48.110	14,399,323.000	
	PSG GROUP LTD	8,084	242.690	1,961,905.960	
	NASPERS LTD	38,000	2,517.500	95,665,000.000	

CORONATION FUND MANAGERS LTD	19,000	65.940	1,252,860.000	
NEDBANK GROUP LTD	18,726	207.350	3,882,836.100	
NETCARE LTD	105,400	25.120	2,647,648.000	
PICK'N PAY STORES LTD	30,212	59.600	1,800,635.200	
RMB HOLDINGS LTD	60,439	59.630	3,603,977.570	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	299.030	1,570,206.530	
SAPPI LTD	46,860	90.570	4,244,110.200	
SASOL LTD	48,500	366.980	17,798,530.000	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,938	196.600	6,868,810.800	
MR PRICE GROUP LTD	20,254	156.480	3,169,345.920	
BRAIT SE	28,931	61.730	1,785,910.630	
STANDARD BANK GROUP LTD	113,800	146.500	16,671,700.000	
SPAR GROUP LTD/THE	16,126	154.010	2,483,565.260	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	80,018	60.000	4,801,080.000	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,278	160.880	2,136,164.640	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	32,472	288.490	9,367,847.280	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	56,403	141.770	7,996,253.310	
TIGER BRANDS LTD	15,100	368.000	5,556,800.000	
SANLAM LTD	127,600	65.810	8,397,356.000	
INVESTEC LTD	30,200	98.370	2,970,774.000	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	57,577	36.040	2,075,075.080	
PIIONEER FOODS LTD	10,707	131.100	1,403,687.700	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	18,685	176.140	3,291,175.900	
MONDI LTD	9,985	345.880	3,453,611.800	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	109,804	24.920	2,736,315.680	
RMI HOLDINGS	52,887	39.240	2,075,285.880	
VODACOM GROUP PTY LTD	43,506	168.000	7,309,008.000	
SIBANYE GOLD LTD	72,004	15.200	1,094,460.800	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	17.000	1,342,099.000	
FORTRESS INCOME FUND LTD	65,113	36.000	2,344,068.000	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	260,000	68.530	17,817,800.000	
BID CORP LTD	29,582	317.240	9,384,593.680	
南アフリカ・ランド 小計	3,220,727		342,993,032.330 (2,908,580,914)	
合計	196,408,089		45,981,585,810 (45,981,585,810)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,299,375.000	23,440,725.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	170,900.000	30,061,310.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,470,275.000	53,502,035.000 (340,807,963)	
投資信託受益証券 合計			1,470,275	340,807,963 (340,807,963)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	475,183.280	
	トルコ・リラ 小計		162,734.000	475,183.280 (15,044,302)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	216,100.000	7,371,171.000	
	メキシコ・ペソ 小計		216,100.000	7,371,171.000 (46,954,359)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,095.000	2,371,210.000	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	3,538,964.000	
南アフリカ・ランド 小計		48,695.000	5,910,174.000 (50,118,275)		
投資証券 合計			427,529	112,116,936 (112,116,936)	
合計				452,924,899 (452,924,899)	

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 40銘柄	10.24%	-%	-%	11.03%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.62%	-%	-%	0.67%
インド・ルピー	株式 78銘柄	8.50%	-%	-%	9.16%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.26%	-%	-%	2.43%
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.61%	-%	-%	0.66%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.43%	-%	-%	0.46%
タイ・バーツ	株式 37銘柄	2.02%	-%	-%	2.18%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.18%	-%	-%	0.20%
チリ・ペソ	株式 19銘柄	1.10%	-%	-%	1.18%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.05% -%	-% -%	-% 0.03%	1.17%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.33%	-%	-%	0.35%
パキスタン・ルピー	株式 6銘柄	0.12%	-%	-%	0.13%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.10%	-%	-%	1.18%
ブラジル・レアル	株式 57銘柄	6.25%	-%	-%	6.74%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.22%	-%	-%	1.31%
マレーシア・リンギット	株式 42銘柄	2.20%	-%	-%	2.37%
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	2.74% -% -%	-% 0.68% -%	-% -% 0.09%	3.78%
ユーロ	株式 9銘柄	0.20%	-%	-%	0.22%
韓国・ウォン	株式 113銘柄	14.43%	-%	-%	15.55%
香港・ドル	株式 136銘柄	19.06%	-%	-%	20.54%
台湾・ドル	株式 89銘柄	11.42%	-%	-%	12.31%
南アフリカ・ランド	株式 51銘柄 投資証券 2銘柄	5.81% -%	-% -%	-% 0.10%	6.37%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,392,947,346	2,743,713,216
コール・ローン		40,367,352	95,513,339
国債証券		59,705,345,865	92,763,068,659
派生商品評価勘定		15,050	71,100
未収入金		799,207,916	-
未収利息		889,379,035	1,340,424,208
前払費用		212,084,575	261,933,792
流動資産合計		63,039,347,139	97,204,724,314
資産合計		63,039,347,139	97,204,724,314
負債の部			
流動負債			
未払金		449,924,800	231,633,591
未払解約金		8,724,000	24,098,000
流動負債合計		458,648,800	255,731,591
負債合計		458,648,800	255,731,591
純資産の部			
元本等			
元本	1	34,034,697,085	51,535,631,842
剰余金			
剰余金又は欠損金()		28,546,001,254	45,413,360,881
元本等合計		62,580,698,339	96,948,992,723
純資産合計		62,580,698,339	96,948,992,723
負債純資産合計		63,039,347,139	97,204,724,314

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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	30,853,888,560円	34,034,697,085円
同期中追加設定元本額	14,679,295,389円	24,799,810,371円
同期中一部解約元本額	11,498,486,864円	7,298,875,614円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM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）	107,754,586円	162,717,269円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	62,904,586円	77,504,014円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	21,415,594円	24,163,020円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	56,453,241円	70,957,604円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	127,202,886円	152,040,199円
投資のソムリエ	2,270,942,339円	4,107,030,378円
クルーズコントロール	1,232,756,282円	1,367,148,340円
投資のソムリエ<DC年金>	67,005,956円	209,788,209円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	68,279,113円	90,528,248円
クルーズコントロール<DC年金>	484,717円	450,343円
DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）	9,088,948円	6,785,171円

D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	20,186,811円	17,089,532円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	5,239,965円	62,149,758円
ダイナミック・ナビゲーション	161,183円	172,264円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	113,191円	636,779,072円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	-円	367,568,621円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	-円	771,903,890円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	-円	807,798円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	-円	807,798円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	6,452,299,432円	15,959,293,077円
エマージング債券パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	3,492,792,856円	3,377,799,990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)	7,824,353,289円	7,590,587,891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)	4,959,932,756円	4,858,868,638円
D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	2,913,975,455円	3,739,653,302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)	4,341,353,899円	4,657,598,002円
P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	-円	3,225,439,414円
計	34,034,697,085円	51,535,631,842円
2 . 受益権の総数	34,034,697,085口	51,535,631,842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7月12日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成29年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用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29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	2,083,575,977	757,915,371
合計	2,083,575,977	757,915,371

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成29年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	498,600,050	-	498,585,000	15,050	765,193,600	-	765,140,000	53,600
アメリカ・ドル	498,600,050	-	498,585,000	15,050	765,193,600	-	765,140,000	53,600
買 建	-	-	-	-	39,956,000	-	39,973,500	17,500
アメリカ・ドル	-	-	-	-	39,956,000	-	39,973,500	17,500
合計	498,600,050	-	498,585,000	15,050	805,149,600	-	805,113,500	71,100

（注）時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成29年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.8387円	1.8812円
(1万口当たり純資産額)	(18,387円)	(18,812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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	6,200,000.000	5,766,000.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	13,900,000.000	13,639,375.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	8,600,000.000	9,042,900.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,000,000.000	8,701,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	6,900,000.000	6,606,750.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	4,400,000.000	4,169,000.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	7,900,000.000	8,371,235.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	8,000,000.000	8,620,000.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	6,100,000.000	6,938,750.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	5,000,000.000	6,153,500.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,200,000.000	2,759,460.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	2,600,000.000	2,966,470.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,700,000.000	3,603,800.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,500,000.000	6,734,000.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	6,400,000.000	6,806,400.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,600,000.000	5,910,072.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	12,400,000.000	12,344,200.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	7,600,000.000	8,208,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	7,400,000.000	8,454,500.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	7,500,000.000	8,184,375.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	5,600,000.000	7,140,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,500,000.000	3,158,625.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	4,400,000.000	4,798,332.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,200,000.000	4,699,926.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	3,300,000.000	3,648,150.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	5,200,000.000	5,714,852.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	6,000,000.000	6,518,700.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	3,800,000.000	3,922,322.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	5,500,000.000	6,102,140.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	3,600,000.000	4,041,900.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	7,800,000.000	8,894,808.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	4,700,000.000	5,131,178.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	8,400,000.000	9,427,320.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,000,000.000	4,421,370.000	
INDONESIA 11.625 03/04/19	6,400,000.000	7,383,744.000			
INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,516,785.000			
INDONESIA 3.75 04/25/22	4,800,000.000	4,930,128.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	7,800,000.000	8,021,598.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	3,000,000.000	3,115,350.000			

INDONESIA 4.625 04/15/43	3,800,000.000	3,839,140.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	6,600,000.000	7,043,058.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	7,100,000.000	7,633,849.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	4,800,000.000	5,082,144.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	3,800,000.000	4,091,232.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	5,500,000.000	5,914,700.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,700,000.000	1,885,606.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	5,600,000.000	6,366,584.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,000,000.000	3,519,420.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	4,900,000.000	6,303,164.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	4,900,000.000	6,747,398.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,000,000.000	5,132,500.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	4,600,000.000	4,703,500.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	6,000,000.000	6,495,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	8,000,000.000	10,194,400.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,200,000.000	5,340,300.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,100,000.000	6,047,500.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,000,000.000	5,442,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	10,600,000.000	12,710,990.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,000,000.000	6,484,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	8,800,000.000	11,449,680.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	4,600,000.000	4,543,144.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,200,000.000	5,322,252.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	4,800,000.000	5,089,056.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	3,800,000.000	4,117,034.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,200,000.000	3,740,640.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,000,000.000	3,571,620.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,800,000.000	3,630,060.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	5,000,000.000	6,644,350.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	891,400.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	4,900,000.000	7,001,757.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	3,100,000.000	3,487,221.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	5,200,000.000	8,285,368.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	3,300,000.000	3,703,920.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	5,400,000.000	5,703,642.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,400,000.000	2,599,416.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	2,800,000.000	3,468,668.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	7,300,000.000	8,423,543.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	8,800,000.000	9,309,872.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	29,542,500.000	35,423,525.470	

RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	10,000,000.000	10,133,200.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	5,600,000.000	5,902,736.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,000,000.000	10,360,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,200,000.000	8,742,020.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	8,600,000.000	9,226,596.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	3,600,000.000	3,969,612.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	5,400,000.000	4,955,526.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,200,000.000	4,197,816.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,400,000.000	2,167,320.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	2,400,000.000	2,286,864.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	4,200,000.000	4,434,444.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,254,700.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	5,400,000.000	5,718,870.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	5,500,000.000	5,925,645.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	4,500,000.000	6,994,350.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	6,500,000.000	6,052,995.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	4,400,000.000	4,128,476.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	8,500,000.000	7,332,100.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	8,600,000.000	8,354,814.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	3,700,000.000	3,808,669.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	4,300,000.000	4,538,521.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	7,100,000.000	7,440,729.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	6,300,000.000	6,312,537.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,800,000.000	3,027,696.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	7,300,000.000	7,831,367.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	6,900,000.000	7,519,827.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	7,600,000.000	8,355,440.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	6,100,000.000	6,493,633.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	8,700,000.000	9,479,085.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	2,400,000.000	2,759,016.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	8,300,000.000	9,462,000.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	4,000,000.000	4,369,800.000	
TURKEY 8.0 02/14/34	4,100,000.000	5,003,886.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	3,200,000.000	3,339,200.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,400,000.000	7,479,180.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	7,300,000.000	7,610,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	9,900,000.000	10,345,005.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,200,000.000	8,500,940.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	5,600,000.000	5,221,440.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,400,000.000	8,151,360.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	12,400,000.000	12,338,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	7,000,000.000	7,584,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	8,600,000.000	9,556,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	7,600,000.000	7,828,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	8,900,000.000	10,435,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	5,000,000.000	6,263,500.000	
	アメリカ・ドル 小計	742,442,500.000 (84,801,782,350)	812,143,833.470 (92,763,068,659)	
国債証券 合計		84,801,782,350 (84,801,782,350)	92,763,068,659 (92,763,068,659)	
合計		84,801,782,350 (84,801,782,350)	92,763,068,659 (92,763,068,659)	

(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 125銘柄	95.68%	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7月31日現在

資産総額	64,696,878,764円
負債総額	779,698,514円
純資産総額(-)	63,917,180,250円
発行済数量	56,933,277,105口
1口当たり純資産額(/)	1.1227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7月31日現在

資産総額	295,720,022,189円
負債総額	732,802,912円
純資産総額(-)	294,987,219,277円
発行済数量	121,806,094,710口
1口当たり純資産額(/)	2.4218円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産総額	380,790,019,865円
負債総額	3,004,519,000円
純資産総額(-)	377,785,500,865円
発行済数量	295,440,649,549口
1口当たり純資産額(/)	1.2787円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産総額	30,061,411,667円
負債総額	211,868,750円
純資産総額(-)	29,849,542,917円
発行済数量	17,277,537,089口
1口当たり純資産額(/)	1.7277円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産総額	275,225,124,821円
負債総額	345,940,472円
純資産総額(-)	274,879,184,349円
発行済数量	86,646,671,455口
1口当たり純資産額(/)	3.1724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7月31日現在

資産総額	47,743,783,786円
負債総額	102,708,005円
純資産総額(-)	47,641,075,781円
発行済数量	40,340,400,606口
1口当たり純資産額(/)	1.1810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7月31日現在

資産総額	181,866,540,317円
負債総額	1,028,557,310円
純資産総額(-)	180,837,983,007円
発行済数量	135,622,318,928口
1口当たり純資産額(/)	1.3334円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産総額	51,213,835,670円
負債総額	428,650,864円
純資産総額(-)	50,785,184,806円
発行済数量	44,526,780,671口
1口当たり純資産額(/)	1.1406円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産総額	95,351,926,308円
負債総額	4,157,150円
純資産総額(-)	95,347,769,158円
発行済数量	51,610,440,144口
1口当たり純資産額(/)	1.8475円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成29年7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7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. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、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】

「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7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	1,168,722,685,027
追加型株式投資信託	862	11,823,622,172,099
単位型公社債投資信託	57	303,337,802,496
単位型株式投資信託	125	828,610,960,565
合計	1,082	14,124,293,620,187

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

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株式会社に変更いたしました。

委託会社の財務諸表に引き続き、D I A Mアセットマネジメント株式会社の第32期中間会計期間の中間財務諸表、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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

（単位：千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
（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	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	-	17,124,479
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	24,580,000
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	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

(単位:千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	営業外収益			
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
時効成立後支払分配金・償還金		-		39
時効後支払損引当金繰入額		-		209,210
営業外費用計		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

(3)【株主資本等変動計算書】

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			利益準備金	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		その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
当期変動額									
剰余金の配当									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
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
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
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	-	-			-
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)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期(自平成28年4月1日至平成29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	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	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
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	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

重要な会計方針

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. 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。 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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 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っております。</p>
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、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。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 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、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分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、退職一時金制度及び確定給付型企業年金制度（キャッシュバランスタイプ）について、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 過去勤務費用については、そ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年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、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年または10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しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>(5) 時効後支払損引当金は、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。</p> <p>(6) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</p>
6. 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き方式によっております。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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）を当事業年度に適用し、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。

この結果、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42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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）を当事業年度から適用しております。

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。

これに伴い、当事業年度末日までに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。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	-	942,315
旧本社不動産賃借料	-	418,583
賃貸借契約解約損	-	150,723

(株主資本等変動計算書関係)

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) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

（注）普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29年6月21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29年6月21日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種 類株式					

(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、短期的な預金等に限定してあります。

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、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っている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。当該デリバティブ取引は、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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（為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

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、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。

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。

(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

預金の預入先については、余資運用規程に従い、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。

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把握する体制としています。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、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（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り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) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期（平成29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	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

(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) 未収委託者報酬及び(4) 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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

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、「(5) 有価証券及び投資有価証券 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。

(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) 現金・預金	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

第32期(平成29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) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)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

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
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	-	-	-
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。

第32期(平成29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	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)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「其他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却した其他有価証券

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)
株式	5,927	3,377	-

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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)
投資信託	717,905	2	79,146

(注) 投資信託の「売却額」、「売却の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(其他有価証券)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、確定給付型の制度として確定給付企業年金制度(積立型制度であります)及び退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。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。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、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(複数事業主制度を含む)

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の発生額	-	1,894
事業主からの拠出額	-	37,402
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
年金資産の期末残高	-	1,363,437

(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

(千円)

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	1,275,346
年金資産	-	1,363,437
	-	88,090
非積立型制度の退職給付債務	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
前払年金費用	-	325,140
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(5) 年金資産に関する事項

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。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
株式	-	31.5%
債券	-	29.0%
共同運用資産	-	24.1%
生命保険一般勘定	-	10.5%
現金及び預金	-	4.6%
合計	-	100.0%

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

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(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

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
退職給付引当金の期末残高	-	300,927

(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

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	789,261
年金資産	-	1,150,443
		361,181
非積立型制度の退職給付債務	-	60,254
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927
退職給付引当金	-	60,254
前払年金費用	-	361,181
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927

(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 - 千円 当事業年度22,562千円

4. 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44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

(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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
繰延税金負債		
前払年金費用	-	210,151
その他有価証券評価差額金	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

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。

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」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しております。

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. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（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、MHFG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。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM （存続会社）	MHAM （消滅会社）
合併比率（*）	1	0.0154

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 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MHFG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。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 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MHFG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。

10. 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しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千円が含まれております。

(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、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。

2. 関連情報

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、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

営業収益

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

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%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

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

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

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せん。

(2) 子会社及び関連会社等

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	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	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、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	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言 金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払費 用 未払金	292,861 7,581
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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				
親会社 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	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	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	-	-	投資一任契 約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

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) 当社預り資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、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4) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注5) 運用受託報酬は、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6) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれておりません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 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)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株主及び普通株主と同等の 株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の 株式に係る当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(参考)DIAMアセットマネジメント株式会社の経理状況

1. 委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という。)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)、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. 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。

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、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) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(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

<p>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>
<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

<p>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>
<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 その他有価証券	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 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、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A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) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(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	<u>4,716,474</u>	<u>4,716,474</u>
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	<u>17,872,927</u>	<u>19,042,177</u>
自己株式	-	377,863
株主資本合計	<u>24,635,002</u>	<u>25,426,389</u>
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	<u>726,935</u>	<u>137,791</u>
純資産合計	<u>25,361,937</u>	<u>25,564,180</u>
負債純資産合計	<u>29,973,099</u>	<u>29,654,112</u>

(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						株主資本 合計
	利益 準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		その他利益剰余金					
	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							自己株式	株主資本合計
	利益剰余金						利益剰余金合計		
	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、配当の効力発効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おります。

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、定期的な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おります。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 その他有価証券」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 その他有価証券のうち 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 その他有価証券のうち 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 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 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					
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計
		その他利益剰余金				
	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 其他有価証券	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
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 福村 寛

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. XBR 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、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) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(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		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(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	164,657
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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
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まいります。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、主にその他有価証券（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 その他有価証券	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 その他有価証券	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 その他有価証券」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	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(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	当事業年度
	(平成27年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(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いません。

(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。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成29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。
株式会社青森銀行	19,562	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。
株式会社岩手銀行	12,089	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。
株式会社七十七銀行	24,658	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。
株式会社千葉銀行	145,069	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉興業銀行	62,120	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。
株式会社北陸銀行	140,409	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。
株式会社清水銀行	8,670	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十六銀行	36,839	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。
株式会社仙台銀行	22,485	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。

株式会社京葉銀行	49,759	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。
株式会社東京スター銀行	26,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	5,191	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。
株式会社愛知銀行	18,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第三銀行	37,461	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社関西アーバン銀行	47,039	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社徳島銀行	11,036	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社長崎銀行	6,121	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	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	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	48,323	「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	3,000	「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。
七十七証券株式会社	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。
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。
フィデリティ証券株式会社	8,157	「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29年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成29年6月7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、アセットマネジメントOne株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年8月30日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwC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29年1月12日から平成29年7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7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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

(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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。