

【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28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 恵正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	クルーズコントロール
【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】

クルーズコントロール

（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」に記載の振替機関およ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。
（当ファンドの略称：クルーズコン）

(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】

継続申込期間：平成28年10月12日から平成29年10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。

継続申込期間は、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】

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】

振替機関は下記の通りです。

・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なります。

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

国内外の6資産に分散投資することにより、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。

●国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。

- ・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
- ・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
- ・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

●マザーファンドのほか、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)、短期金融資産等へ投資する場合があります。

●実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。

●各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

2

基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標とします。

●資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。

●資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。

●下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。)を設け、改定日における基準価額から-2.0%の水準とします。ただし、当該水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。

●上記の運用目標は、現金等^(**)を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(***)を機動的に変更することで行います。

(*)基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります)。

(**)現金等とは、短期国債、コールローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

(***)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

※各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

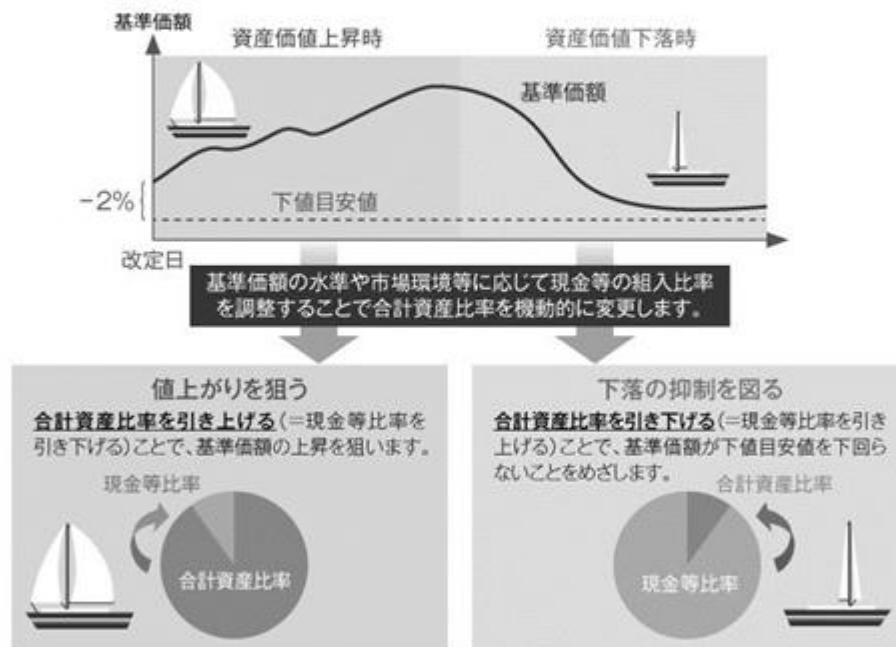
当ファンドの合計資産比率の変更(イメージ)

- 資産価値上昇時は、合計資産比率*¹を増加(=現金等*²比率の減少)させることで値上がり益の獲得をめざします。
- 一方、資産価値下落時は、機動的に合計資産比率を減少(=現金等比率の増加)させることで基準価額下落の抑制をめざします。

*1 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

*2 現金等とは、短期国債、コールローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

※合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

※ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、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。)等の全額を対象として、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。

- ・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。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「資産複合(投資信託証券(債券、株式)、先物、ETF、短期金融資産)資産配分変更型」とは目論見書または投資信託約款において、複数資産(投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産)を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行な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。

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

「なし」とは目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

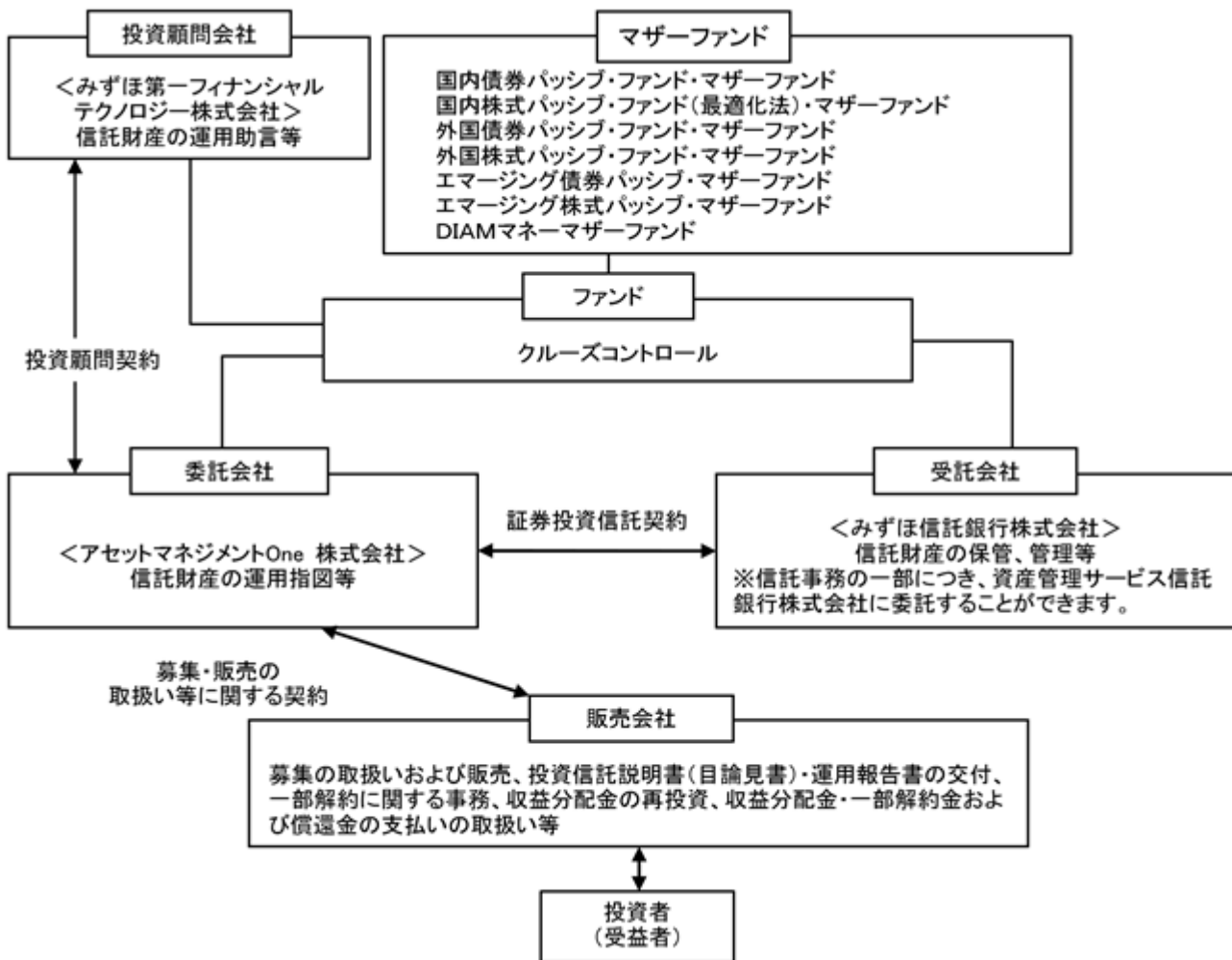
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)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、ファンドの設定、ファンドの運用開始
平成25年 5月17日	投資対象、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、ファンドの設定時に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、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

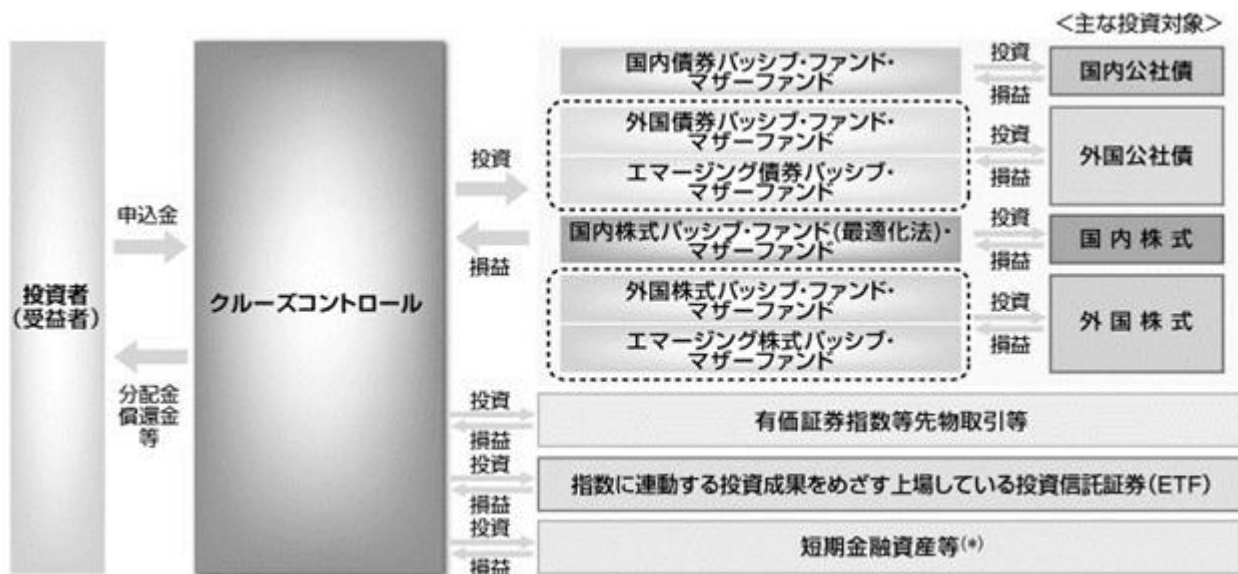
・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

「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マザーファンドにて行う仕組みです。



(*)DIAMマネーマザーファンドを通じてまたは直接投資を行います。

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28年10月1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28年10月1日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

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、「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、「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目指す上場している投資信託証券（ETF）、「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

以下のマザーファンドへの投資を通じて、国内外の株式、公社債に実質的に分散投資を行います。

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

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

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

（上記それぞれおよびD I A Mマネーマザーファンドを「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。）

・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（E T F）、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合もあります。

・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。

・経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の下落を一定水準（下値目安値^(*)）までに抑えることを目標とします。

・資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。

・資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。

・下値目安値は、四半期毎に、委託会社の判断により基準価額から一定の水準に設定します。

・上記の運用目標は、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更することで行います。

(*)基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません（相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります）。

(**)合計資産比率とは、「D I A Mマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

・各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

・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。

< 運用プロセス >

・基本配分比率の決定

委託会社は、年に一度、統計的手法を用いて現金等を除く各資産への基本配分比率を決定します。

・下値目安値の決定

委託会社は、3ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の98%の水準を翌3ヵ月間の下値目安値とします。

・リバランスの実施

委託会社は、各資産の上昇益を享受しつつも基準価額が下値目安値を下回らないことを目標として、基準価額と下値目安値の水準、市況などを基に、日々の合計資産比率の推奨値を決定します。ファンドの合計資産比率と推奨値との乖離が一定以上となった場合にはリバランスを実施します。6資産への投資比率は、基本配分比率と合計資産比率から決定します。

・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

(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。

- a.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項で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係る権利(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す。)
 - ハ.金銭債権
 - ニ.約束手形
- b.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、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、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、DIAMマネー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、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を指図することができます。

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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"><p>NOMURA - B P I 総合は、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p></div>

運用プロセス

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

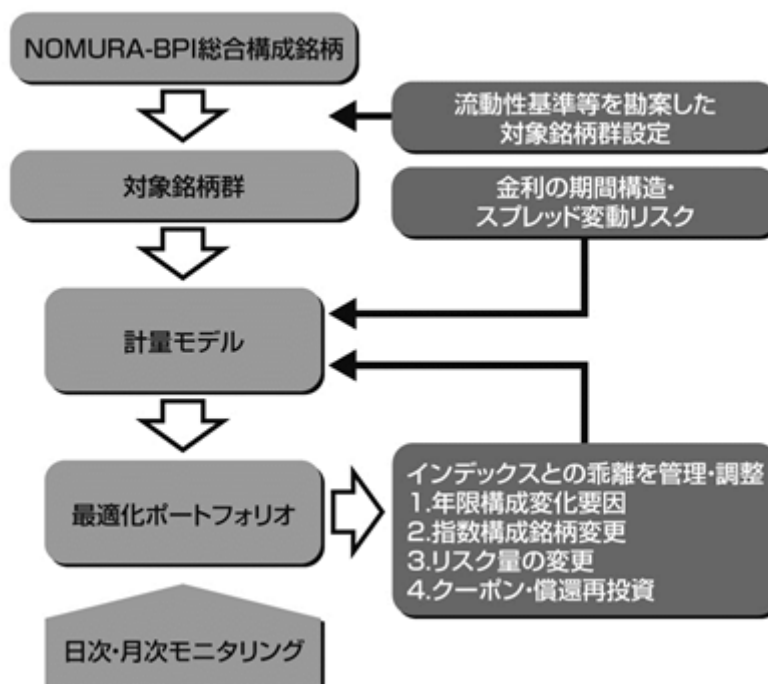
1)、2)が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

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。

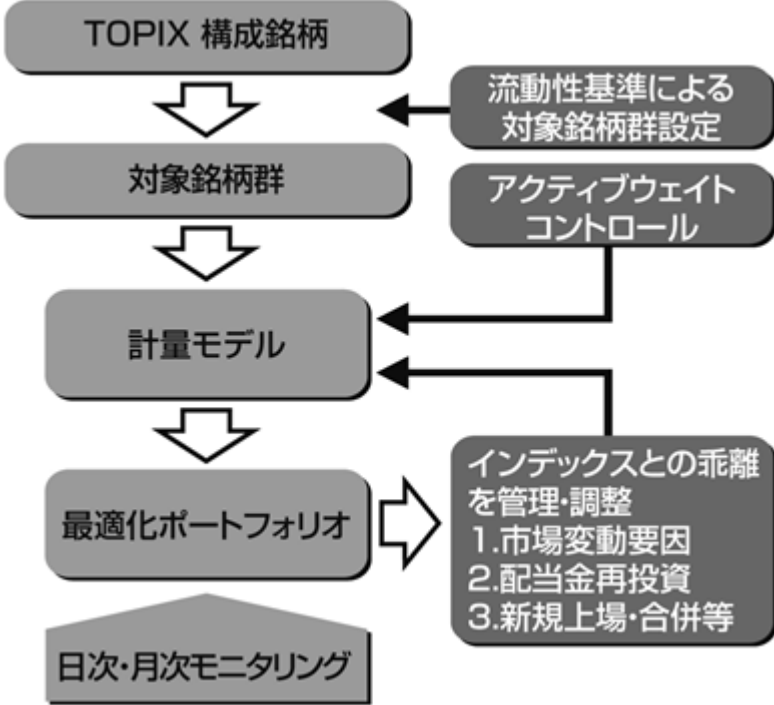
- ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資



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

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。</p><p>㈱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>㈱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>㈱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㈱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、㈱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>㈱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>㈱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、㈱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。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	1. 株式への投資割合には、制限を設けません。

ファンド名	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標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。

<p>投資態度</p>	<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.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;"> 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。 </div>
<p>運用プロセス</p>	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、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。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[金利期間構造為替リスク] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] F --> G[日次・月次モニタリング] F --> H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限・通貨構成変化要因 2.指数構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] </pre> </div>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 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。 2. 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。 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、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. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
--------	--

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	<ol style="list-style-type: none"> 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。 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。 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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
主な投資制限	<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。

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>
	<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>
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] E[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B F[金利期間構造] --> C D --> G[日次・月次モニタリング] H[インデックスとの乖離を管理・調整] --> D 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 </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>

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。</p> <p>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> <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <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] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D F[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[日次・月次モニタリング] --> D </pre> </div>
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにC D、C P、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<p>国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がA A -格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のC D、C Pを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R & I、J C R、M o o d y 's、S & Pとします。</p> <p>国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建て資産への投資は行いません。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

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28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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) 信託財産から生じ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>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

・資産配分リスク

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

当ファンドは現金等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行います。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追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の価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券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。

・為替リスク

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため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。

・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、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

・カントリーリスク

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

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

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

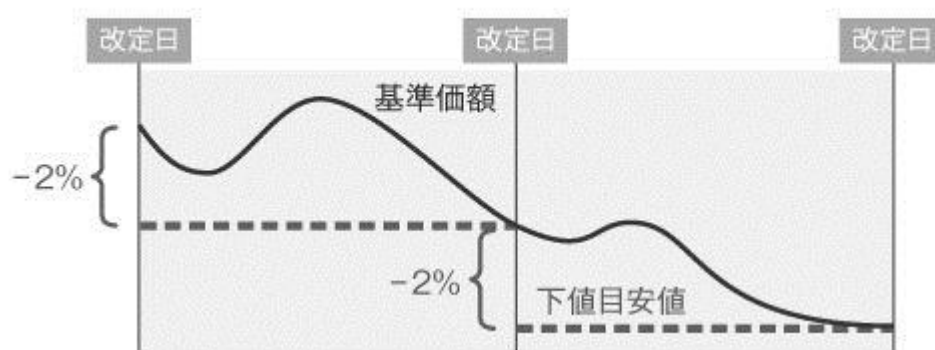
当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

当ファンドは下値目安値を改定日の基準価額をもとに決定し、損失の抑制をめざして合計資産比率をコントロールします。ただし損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

<ケース> 下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月（四半期）毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、当ファンドの基準価額は長期的に2%以上下落する場合があります。

<基準価額の推移(イメージ)>

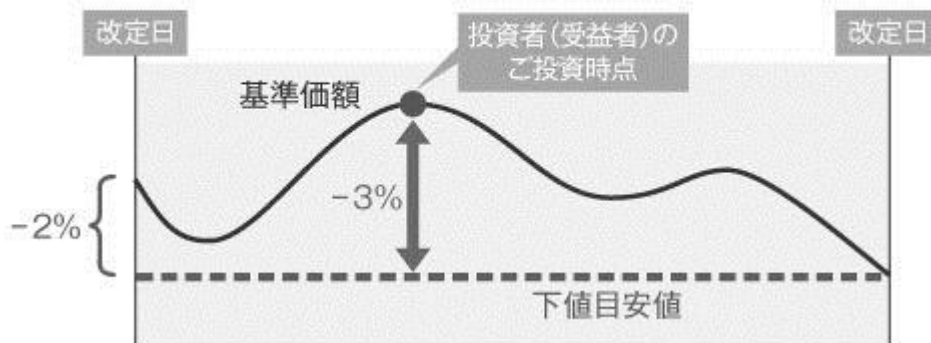


<ケース> 四半期途中の投資について

当ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点でお客さまが当ファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2%以上となる場合があります。した

がって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。

<基準価額の推移(イメージ)>



下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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。

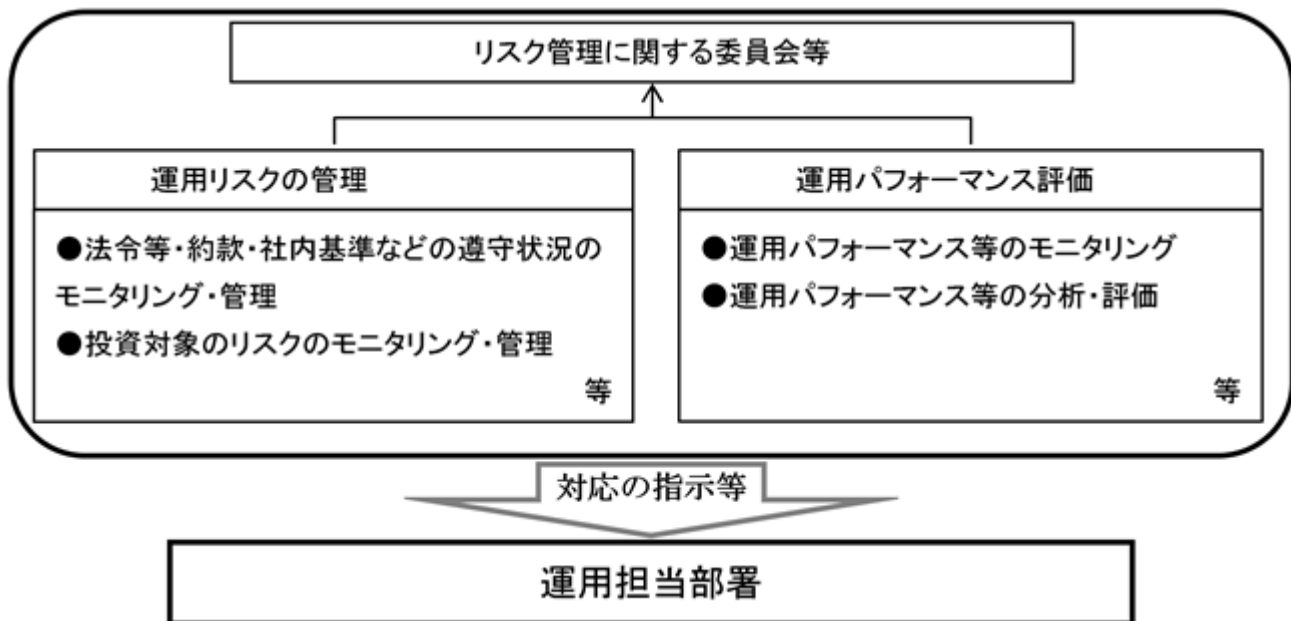
注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に債券および株式等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。
- ロ．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。
- ハ．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。
- ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

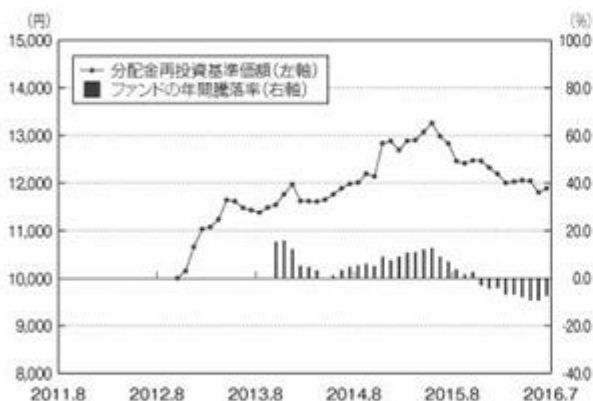
委託会社における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下の通りです。

- ・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。



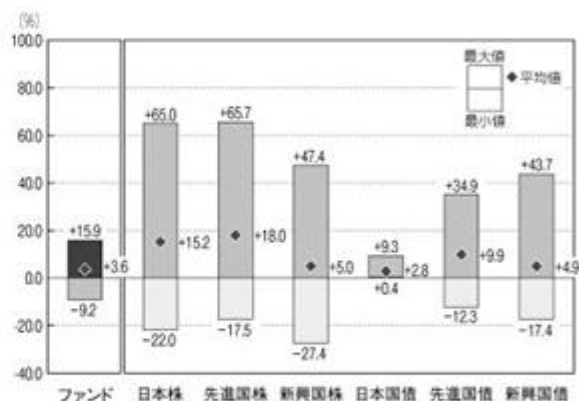
上記体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

*ファンド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。

ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

ファンド：2013年10月～2016年7月

代表的な資産クラス：2011年8月～2016年7月

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株……MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

●「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

●「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

●「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、当ファンドにかかる投資顧問報酬が含まれます。

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】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. 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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【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のいずれかを選択することもできます。

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」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。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

上記は、平成28年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	6,308,985,490	20.32
内 日本	6,308,985,490	20.32
親投資信託受益証券	14,349,255,177	46.21
内 日本	14,349,255,177	46.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,392,589,545	33.47
純資産総額	31,050,830,212	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。

（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28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	277,175,488,620	97.94
内 日本	277,175,488,620	97.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,834,222,745	2.06
純資産総額	283,009,711,365	100.00

その他資産の投資状況

平成28年7月29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）	5,938,395,000	2.10
内 日本	5,938,395,000	2.10

（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28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	322,071,257,000	82.90
内 日本	322,071,257,000	82.90
地方債証券	24,707,867,774	6.36
内 日本	24,707,867,774	6.36
特殊債券	21,295,465,693	5.48
内 日本	21,295,465,693	5.48
社債券	18,726,857,290	4.82
内 日本	18,426,220,290	4.74
内 オランダ	201,234,000	0.05
内 イギリス	99,403,000	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,687,404,585	0.43
純資産総額	388,488,852,342	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。

D I A Mマネーマザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	190,340,642	18.20
内 日本	190,340,642	18.20
特殊債券	697,765,790	66.73
内 日本	697,765,790	66.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	157,568,874	15.07
純資産総額	1,045,675,306	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	249,682,972,832	96.13
内 アメリカ	154,111,187,000	59.33
内 イギリス	18,724,655,788	7.21
内 スイス	10,068,470,156	3.88
内 カナダ	9,892,199,020	3.81
内 フランス	9,066,026,536	3.49
内 ドイツ	9,063,982,216	3.49
内 オーストラリア	6,843,559,192	2.63
内 オランダ	4,457,508,022	1.72
内 アイルランド	4,337,413,806	1.67
内 スペイン	3,034,836,947	1.17
内 スウェーデン	2,781,750,841	1.07
内 香港	2,478,799,804	0.95
内 デンマーク	2,045,201,001	0.79
内 シンガポール	1,810,313,593	0.70

内 イタリア	1,769,740,271	0.68
内 ジャージー	1,548,575,073	0.60
内 ベルギー	1,354,809,745	0.52
内 バミューダ	1,047,572,762	0.40
内 フィンランド	1,013,210,882	0.39
内 オランダ領キュラソー	934,571,535	0.36
内 イスラエル	727,932,764	0.28
内 ケイマン諸島	690,127,971	0.27
内 ノルウェー	625,155,558	0.24
内 ルクセンブルグ	275,140,608	0.11
内 オーストリア	182,536,908	0.07
内 ニュージーランド	179,002,181	0.07
内 パナマ	163,815,871	0.06
内 ポルトガル	152,657,520	0.06
内 リベリア	103,756,628	0.04
内 イギリス領バージン諸島	78,747,419	0.03
内 パプアニューギニア	64,971,421	0.03
内 マン島	35,475,446	0.01
内 モーリシャス	19,268,347	0.01
投資信託受益証券	909,304,945	0.35
内 オーストラリア	786,816,070	0.30
内 シンガポール	122,488,875	0.05
投資証券	6,525,691,430	2.51
内 アメリカ	5,626,773,180	2.17
内 フランス	403,122,982	0.16
内 イギリス	297,763,218	0.11
内 香港	142,033,958	0.05
内 カナダ	55,998,092	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,615,076,319	1.01
純資産総額	259,733,045,526	100.00

その他資産の投資状況

平成28年7月29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）	23,036,600	0.01
-	23,036,600	0.01
株価指数先物取引（買建）	2,540,671,710	0.98
内 アメリカ	1,695,284,805	0.65
内 ドイツ	450,037,269	0.17
内 イギリス	193,042,609	0.07
内 オーストラリア	108,353,880	0.04
内 カナダ	93,953,147	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	256,280,776,808	96.93
内 アメリカ	111,806,507,022	42.29
内 フランス	26,028,361,985	9.84
内 イタリア	25,006,274,968	9.46
内 イギリス	19,930,387,687	7.54
内 ドイツ	19,366,682,179	7.33
内 スペイン	14,248,290,268	5.39
内 ベルギー	6,573,030,730	2.49
内 オランダ	6,176,300,262	2.34
内 カナダ	5,098,335,326	1.93
内 オーストラリア	4,942,650,470	1.87
内 オーストリア	3,928,902,111	1.49
内 メキシコ	2,041,058,113	0.77
内 アイルランド	1,958,567,890	0.74
内 デンマーク	1,638,364,466	0.62
内 フィンランド	1,464,859,677	0.55
内 ポーランド	1,379,327,066	0.52
内 スウェーデン	1,153,083,228	0.44
内 マレーシア	1,100,515,559	0.42
内 南アフリカ	1,068,323,726	0.40
内 シンガポール	829,427,989	0.31
内 ノルウェー	541,526,086	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,108,225,838	3.07
純資産総額	264,389,002,646	100.00

その他資産の投資状況

平成28年7月29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)	243,005,450	0.09
-	243,005,450	0.09

(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28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	36,214,391,467	95.45
内 韓国	5,405,388,625	14.25
内 台湾	4,455,404,004	11.74
内 ケイマン諸島	3,876,655,333	10.22
内 中国	3,718,323,657	9.80
内 インド	3,093,209,062	8.15
内 ブラジル	2,690,953,723	7.09
内 南アフリカ	2,494,633,816	6.58
内 香港	1,591,946,926	4.20
内 ロシア	1,293,905,758	3.41
内 メキシコ	1,118,224,727	2.95
内 マレーシア	1,030,385,938	2.72
内 インドネシア	1,015,769,537	2.68
内 タイ	842,697,207	2.22
内 フィリピン	559,589,154	1.47
内 チリ	438,913,877	1.16
内 トルコ	423,160,795	1.12
内 ポーランド	401,418,739	1.06
内 バミューダ	393,678,221	1.04
内 カタール	337,424,630	0.89
内 アラブ首長国連邦	324,101,245	0.85
内 オランダ	169,081,472	0.45
内 コロンビア	160,423,170	0.42
内 ハンガリー	104,854,577	0.28
内 ギリシャ	67,518,213	0.18
内 チェコ	63,757,440	0.17
内 エジプト	47,059,576	0.12
内 マルタ	27,327,927	0.07
内 ペルー	26,999,143	0.07
内 マン島	21,246,131	0.06
内 アメリカ	20,338,844	0.05
投資信託受益証券	252,129,109	0.66
内 メキシコ	252,129,109	0.66
投資証券	111,966,643	0.30
内 メキシコ	49,407,919	0.13
内 南アフリカ	47,442,559	0.13
内 トルコ	15,116,165	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,361,201,821	3.59
純資産総額	37,939,689,040	100.00

その他資産の投資状況

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	1,353,938,957	3.57
内 アメリカ	1,353,938,957	3.57

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	52,084,043,044	96.60
内 トルコ	7,260,409,784	13.47
内 メキシコ	7,113,570,209	13.19
内 ロシア	6,587,185,246	12.22
内 インドネシア	5,608,935,225	10.40
内 ブラジル	5,150,649,633	9.55
内 フィリピン	4,433,900,204	8.22
内 コロンビア	4,084,954,778	7.58
内 ハンガリー	2,763,978,601	5.13
内 ベルギー	2,271,172,590	4.21
内 パナマ	2,000,610,973	3.71
内 南アフリカ	1,905,828,415	3.53
内 クロアチア	1,569,217,493	2.91
内 ルーマニア	1,333,629,893	2.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,831,918,503	3.40
純資産総額	53,915,961,547	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。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年7月29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	7回 政保地方公共団体金融 機構債券 6年 日本	特殊債券	5,000,000,000	100.67 5,033,950,000	100.46 5,023,400,000	0.250000 2018/10/29	16.18%
2	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,957,525,335	1.6677 3,264,611,078	1.7040 3,335,623,170	- -	10.74%
3	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	2,432,858,038	1.3262 3,226,623,522	1.3139 3,196,532,176	- -	10.29%
4	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信 託受益証 券	1,403,720,711	1.8669 2,620,618,793	1.9372 2,719,287,761	- -	8.76%
5	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,616,411,741	0.8185 1,323,190,598	0.8706 1,407,248,061	- -	4.53%
6	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	535,205,160	2.4568 1,314,898,148	2.5595 1,369,857,607	- -	4.41%
7	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	769,168,454	1.6974 1,305,642,110	1.7168 1,320,508,401	- -	4.25%
8	D I A Mマネーマザーファン ド 日本	親投資信 託受益証 券	990,000,991	1.0107 1,000,693,001	1.0103 1,000,198,001	- -	3.22%
9	885回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	400,000,000	103.25 413,012,000	103.01 412,044,000	1.700000 2018/5/22	1.33%
10	3回 政保地方公共団体金融 機構債券 6年 日本	特殊債券	200,000,000	100.69 201,394,000	100.54 201,088,000	0.400000 2018/1/30	0.65%
11	19回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	200,000,000	100.40 200,810,000	100.30 200,614,000	1.800000 2016/9/29	0.65%
12	14回 政保西日本高速道路 債券 日本	特殊債券	100,000,000	103.24 103,248,000	103.00 103,006,000	1.700000 2018/5/21	0.33%
13	56回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	102.56 102,567,000	102.35 102,351,000	1.400000 2018/4/20	0.33%
14	27回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	101.17 101,176,000	101.04 101,046,000	1.800000 2017/2/28	0.33%

15	12回 政保中日本高速道路 債券 日本	特殊債券	100,000,000	100.99 100,992,000	100.87 100,874,000	1.800000 2017/1/23	0.32%
16	9回 政保西日本高速道路債 券 日本	特殊債券	33,000,000	101.87 33,618,750	101.71 33,565,290	1.900000 2017/6/27	0.11%
17	886回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	30,000,000	103.58 31,074,300	103.32 30,997,200	1.800000 2018/6/19	0.10%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
特殊債券	20.32%
親投資信託受益証券	46.21%
合計	66.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(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28年7月29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	1,761,400	6,486.54 11,425,399,245	5,894.00 10,381,691,600	- -	3.67%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	11,214,900	534.86 5,998,455,918	522.00 5,854,177,800	- -	2.07%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,080,500	5,282.81 5,708,076,661	4,881.00 5,273,920,500	- -	1.86%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	792,000	5,150.50 4,079,197,434	5,703.00 4,516,776,000	- -	1.60%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,382,800	3,195.64 4,418,936,889	3,145.00 4,348,906,000	- -	1.54%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,119,200	3,397.39 3,802,363,731	3,308.00 3,702,313,600	- -	1.31%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,274,500	3,106.46 3,959,193,600	2,841.50 3,621,491,750	- -	1.28%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	879,400	4,635.41 4,076,388,197	4,025.00 3,539,585,000	- -	1.25%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	19,881,200	180.16 3,581,862,284	167.10 3,322,148,520	- -	1.17%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	999,400	2,584.05 2,582,507,576	3,282.00 3,280,030,800	- -	1.16%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,044,500	2,834.82 2,960,978,696	2,749.50 2,871,852,750	- -	1.01%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,609,900	1,658.53 2,670,073,678	1,721.50 2,771,442,850	- -	0.98%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	590,800	5,780.65 3,415,209,710	4,588.00 2,710,590,400	- -	0.96%
14	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	584,700	5,108.70 2,987,060,804	4,303.00 2,515,964,100	- -	0.89%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	143,600	16,400.39 2,355,096,206	17,325.00 2,487,870,000	- -	0.88%
16	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	258,900	10,802.28 2,796,710,396	9,485.00 2,455,666,500	- -	0.87%
17	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	126,800	22,228.54 2,818,579,524	19,220.00 2,437,096,000	- -	0.86%
18	キーエンス 日本	株式 電気機器	32,100	58,581.30 1,880,459,996	72,920.00 2,340,732,000	- -	0.83%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	566,300	3,927.24 2,224,001,260	4,040.00 2,287,852,000	- -	0.81%
20	キヤノン 日本	株式 電気機器	762,400	3,349.96 2,554,014,116	2,935.00 2,237,644,000	- -	0.79%

21	花王 日本	株式 化学	376,700	6,189.12 2,331,444,652	5,553.00 2,091,815,100	- -	0.74%
22	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,039,000	2,236.36 2,323,583,200	1,929.00 2,004,231,000	- -	0.71%
23	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,930,500	1,075.90 2,077,026,483	1,012.00 1,953,666,000	- -	0.69%
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	149,400	13,863.72 2,071,239,782	12,825.00 1,916,055,000	- -	0.68%
25	信越化学工業 日本	株式 化学	266,000	5,982.11 1,591,241,686	7,064.00 1,879,024,000	- -	0.66%
26	任天堂 日本	株式 その他製品	87,200	17,229.54 1,502,416,552	21,505.00 1,875,236,000	- -	0.66%
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,048,800	1,871.61 1,962,954,713	1,778.50 1,865,290,800	- -	0.66%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	206,200	7,741.00 1,596,195,040	9,012.00 1,858,274,400	- -	0.66%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,511,000	1,146.04 1,731,681,480	1,217.50 1,839,642,500	- -	0.65%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	500,600	4,104.80 2,054,863,140	3,601.00 1,802,660,600	- -	0.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
株式	97.94%
合計	97.94%

(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28年7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.73%
輸送用機器		9.39%
情報・通信業		8.25%
銀行業		7.37%
化学		6.12%
医薬品		5.64%
食料品		4.98%
小売業		4.79%
機械		4.72%
陸運業		4.49%
卸売業		3.98%
サービス業		3.78%
建設業		3.25%
不動産業		2.56%
保険業		2.36%
電気・ガス業		1.85%
その他製品		1.75%
精密機器		1.48%
その他金融業		1.24%
鉄鋼		1.13%
証券、商品先物取引業		0.98%
ガラス・土石製品		0.91%
非鉄金属		0.85%
ゴム製品		0.85%
繊維製品		0.73%
金属製品		0.65%
空運業		0.58%
石油・石炭製品		0.46%
鉱業		0.28%
パルプ・紙		0.26%
海運業	0.21%	
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.10%	
合計		97.94%

(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28年7月29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	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	101.02 4,546,125,000	101.41 4,563,495,000	0.100000 2020/6/20	1.17%
2	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	101.22 4,555,260,000	0.100000 2019/12/20	1.17%
3	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.54 4,524,705,000	100.53 4,524,030,000	0.200000 2017/9/20	1.16%
4	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	101.11 4,246,830,000	0.200000 2018/12/20	1.09%
5	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.35 4,134,275,000	105.73 4,229,200,000	0.400000 2025/9/20	1.09%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	102.02 4,081,115,000	102.89 4,115,800,000	0.100000 2026/3/20	1.06%
7	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.06 4,042,440,000	101.48 4,059,320,000	0.100000 2020/9/20	1.04%
8	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	101.23 4,049,240,000	0.200000 2019/3/20	1.04%
9	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	103.36 3,617,600,000	102.81 3,598,595,000	0.100000 2026/6/20	0.93%
10	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,650,000	101.35 3,547,250,000	0.200000 2019/6/20	0.91%
11	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,210,000	101.31 3,546,165,000	0.100000 2020/3/20	0.91%
12	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.21 3,542,420,000	0.300000 2018/9/20	0.91%
13	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.64 3,321,285,000	100.65 3,321,516,000	0.200000 2017/12/20	0.85%
14	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.03 3,297,024,000	102.45 3,278,400,000	1.500000 2017/12/20	0.84%
15	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,044,000	101.57 3,250,336,000	0.100000 2020/12/20	0.84%

16	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	107.26 3,217,800,000	1.300000 2021/3/20	0.83%
17	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	103.25 3,097,560,000	105.71 3,171,360,000	0.400000 2025/6/20	0.82%
18	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	103.34 3,100,200,000	104.83 3,144,930,000	0.300000 2025/12/20	0.81%
19	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	101.57 3,047,255,000	101.66 3,049,890,000	0.100000 2021/3/20	0.79%
20	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	105.09 3,047,755,000	1.500000 2019/6/20	0.78%
21	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	105.22 2,946,188,000	1.000000 2020/9/20	0.76%
22	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	106.22 2,655,660,000	106.67 2,666,850,000	0.800000 2022/9/20	0.69%
23	143回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	125.56 2,636,844,000	1.600000 2033/3/20	0.68%
24	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	105.30 2,632,675,000	1.300000 2019/12/20	0.68%
25	149回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	2,100,000,000	113.46 2,382,670,000	124.70 2,618,784,000	1.500000 2034/6/20	0.67%
26	365回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.84 2,521,025,000	100.67 2,516,875,000	0.100000 2018/6/15	0.65%
27	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	105.26 2,421,080,000	106.96 2,460,149,000	0.600000 2024/6/20	0.63%
28	141回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	1,900,000,000	117.81 2,238,435,000	126.91 2,411,404,000	1.700000 2032/12/20	0.62%
29	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	104.41 2,401,614,000	103.95 2,390,988,000	1.400000 2018/12/20	0.62%
30	125回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	1,800,000,000	125.51 2,259,324,000	132.37 2,382,822,000	2.200000 2031/3/20	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28年7月29日現在

種類	投資比率
国債証券	82.90%
地方債証券	6.36%
特殊債券	5.48%
社債券	4.82%
合計	99.57%

（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。

DIAMマネーマザーファンド

平成28年7月29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	23回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	140,000,000	101.22 141,720,600	100.70 140,987,000	1.700000 2016/12/28	13.48%
2	34回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	128,000,000	101.91 130,451,200	101.38 129,774,080	1.700000 2017/5/26	12.41%
3	10回 政保東日本高速道路 債券 日本	特殊債券	66,000,000	102.53 67,673,100	102.03 67,345,080	1.500000 2017/12/21	6.44%
4	866回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	45,000,000	100.73 45,329,400	100.11 45,049,500	2.000000 2016/8/18	4.31%
5	19回 政保国民生活債券 日本	特殊債券	39,000,000	101.18 39,462,930	100.66 39,259,350	1.700000 2016/12/19	3.75%
6	13回 政保中日本高速道路 債券 日本	特殊債券	33,000,000	101.88 33,621,060	101.35 33,446,490	1.700000 2017/5/19	3.20%
7	19年度2回 北海道公募公 債 日本	地方債証 券	30,000,000	101.87 30,563,100	101.48 30,444,600	1.840000 2017/5/31	2.91%
8	6回 政保西日本高速道路債 券 日本	特殊債券	30,000,000	101.59 30,479,700	101.04 30,312,300	1.800000 2017/2/27	2.90%
9	20回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	30,000,000	101.01 30,305,700	100.46 30,140,400	1.800000 2016/10/31	2.88%
10	2回 政保西日本高速道路債 券 日本	特殊債券	29,000,000	100.99 29,287,100	100.43 29,125,570	1.800000 2016/10/25	2.79%
11	188回 政保中小企業債券 日本	特殊債券	29,000,000	100.80 29,232,000	100.29 29,085,840	1.800000 2016/9/16	2.78%
12	868回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	22,000,000	100.97 22,213,620	100.41 22,091,080	1.800000 2016/10/21	2.11%
13	6回 政保東日本高速道路債 券 日本	特殊債券	21,000,000	101.13 21,238,560	100.58 21,122,010	1.800000 2016/11/24	2.02%
14	14回 政保中日本高速道路 債券 日本	特殊債券	20,000,000	102.25 20,450,400	101.65 20,331,600	1.900000 2017/6/16	1.94%
15	877回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	19,000,000	102.41 19,458,850	101.81 19,345,230	1.900000 2017/7/18	1.85%
16	2回 政保首都高速道路会社 債券 日本	特殊債券	15,000,000	100.84 15,127,350	100.29 15,043,800	1.800000 2016/9/26	1.44%
17	26年度4回 静岡県公募公 債 日本	地方債証 券	14,810,000	100.49 14,883,605	100.36 14,864,056	0.209000 2019/6/24	1.42%

18	8回 政保西日本高速道路債券 日本	特殊債券	14,000,000	101.88 14,263,480	101.35 14,189,420	1.700000 2017/5/19	1.36%
19	25年度6回 静岡県公募公債 日本	地方債証券	13,250,000	100.68 13,340,232	100.53 13,321,152	0.342000 2018/8/23	1.27%
20	23年度1回 北九州市公募公債 5年 日本	地方債証券	12,500,000	100.13 12,516,875	100.05 12,506,625	0.360000 2016/9/28	1.20%
21	24年度 京都府京都みらい債 日本	地方債証券	12,000,000	100.01 12,001,680	100.02 12,003,000	0.200000 2017/9/4	1.15%
22	873回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	11,000,000	101.59 11,175,120	101.06 11,117,040	1.700000 2017/3/17	1.06%
23	640回 東京都公募公債 日本	地方債証券	10,200,000	101.19 10,321,482	100.68 10,270,176	1.790000 2016/12/20	0.98%
24	639回 東京都公募公債 日本	地方債証券	10,000,000	100.78 10,078,000	100.26 10,026,000	1.830000 2016/9/20	0.96%
25	23年度2回 あいち県民債 日本	地方債証券	9,900,000	100.11 9,911,088	100.12 9,912,078	0.380000 2017/2/28	0.95%
26	26年度 京都府京都みらい債 日本	地方債証券	9,200,000	100.18 9,216,560	99.91 9,192,180	0.160000 2019/9/2	0.88%
27	24年度8回 福岡県公募公債 日本	地方債証券	7,300,000	100.28 7,320,440	100.10 7,307,519	0.260000 2017/12/21	0.70%
28	11回 京都市京都浪漫債 日本	地方債証券	7,040,000	100.14 7,049,856	100.07 7,044,928	0.380000 2016/12/12	0.67%
29	23年度7回 福岡県公募公債 日本	地方債証券	7,000,000	100.16 7,011,200	100.08 7,006,230	0.410000 2016/12/22	0.67%
30	23年度2回 大阪市みおつくし債 日本	地方債証券	6,500,000	100.15 6,509,750	100.09 6,506,370	0.420000 2016/12/27	0.62%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
地方債証券	18.20%
特殊債券	66.73%
合計	84.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	451,881	9,821.62 4,438,205,508	10,895.18 4,923,326,098	- -	1.90%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	612,102	5,275.61 3,229,216,344	5,869.44 3,592,700,982	- -	1.38%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	338,336	8,511.88 2,879,877,928	9,418.68 3,186,679,869	- -	1.23%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	224,831	10,701.59 2,406,051,031	12,996.11 2,921,929,126	- -	1.12%
5	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	32,610	53,792.62 1,754,177,662	78,587.53 2,562,739,555	- -	0.99%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	759,940	2,962.01 2,250,950,848	3,263.12 2,479,779,212	- -	0.95%
7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	187,037	10,762.75 2,013,032,555	13,052.49 2,441,300,442	- -	0.94%
8	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	500,479	3,826.90 1,915,283,777	4,446.20 2,225,231,531	- -	0.86%
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	259,635	7,679.49 1,993,866,245	8,231.83 2,137,272,739	- -	0.82%
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	298,701	6,019.21 1,797,946,284	6,693.32 1,999,301,974	- -	0.77%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	25,346	71,369.06 1,808,920,323	77,887.92 1,974,147,276	- -	0.76%
12	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	392,807	4,936.21 1,938,979,107	5,025.73 1,974,143,731	- -	0.76%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	220,116	8,472.08 1,864,840,792	8,855.86 1,949,316,523	- -	0.75%
14	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	503,036	3,088.61 1,553,685,860	3,829.08 1,926,165,791	- -	0.74%
15	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	23,841	73,886.71 1,761,533,291	79,969.01 1,906,541,234	- -	0.73%

16	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	331,408	5,253.10 1,740,922,599	5,728.48 1,898,464,497	- -	0.73%
17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	153,421	9,006.19 1,381,738,987	10,628.91 1,630,698,277	- -	0.63%
18	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	185,580	7,619.75 1,414,073,974	8,562.38 1,589,008,150	- -	0.61%
19	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	334,562	4,507.19 1,507,936,522	4,557.93 1,524,911,180	- -	0.59%
20	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	57,289	26,080.80 1,494,142,977	26,177.66 1,499,692,250	- -	0.58%
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	103,213	12,251.37 1,264,501,010	14,405.78 1,486,864,101	- -	0.57%
22	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	97,101	13,454.74 1,306,469,672	15,080.33 1,464,315,744	- -	0.56%
23	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	198,378	5,957.75 1,181,887,827	7,085.94 1,405,694,843	- -	0.54%
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	385,003	3,011.90 1,159,591,866	3,630.68 1,397,824,001	- -	0.54%
25	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	226,173	5,152.35 1,165,322,988	6,101.26 1,379,940,413	- -	0.53%
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	117,564	10,309.65 1,212,044,488	11,290.93 1,327,407,435	- -	0.51%
27	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	410,147	2,633.15 1,079,981,609	3,186.89 1,307,096,818	- -	0.50%
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	125,945	9,340.03 1,176,331,051	10,348.02 1,303,281,630	- -	0.50%
29	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	156,281	7,365.73 1,151,124,634	8,269.01 1,292,290,683	- -	0.50%
30	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	840,771	1,250.85 1,051,685,208	1,532.88 1,288,805,758	- -	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28年7月29日現在

種類	投資比率
株式	96.13%
投資信託受益証券	0.35%
投資証券	2.51%
合計	98.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	7.90%
医薬品		6.75%
石油・ガス・消耗燃料		6.29%
保険		3.87%
ソフトウェア		3.34%
各種電気通信サービス		2.90%
インターネットソフトウェア・サービス		2.87%
メディア		2.78%
情報技術サービス		2.66%
化学		2.57%
バイオテクノロジー		2.53%
飲料		2.45%
食品		2.44%
コンピュータ・周辺機器		2.39%
半導体・半導体製造装置		2.34%
食品・生活必需品小売り		2.10%
航空宇宙・防衛		2.07%
ヘルスケア機器・用品		2.03%
電力		1.99%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.98%
専門小売り		1.96%
コングロマリット		1.94%
資本市場		1.84%
ホテル・レストラン・レジャー		1.83%
タバコ		1.64%
家庭用品		1.57%
各種金融サービス		1.48%
インターネット販売・カタログ販売		1.45%
金属・鉱業		1.44%
機械		1.36%
総合公益事業		1.21%
繊維・アパレル・贅沢品		1.19%
自動車		0.95%
通信機器		0.85%
陸運・鉄道		0.85%
電気設備		0.74%
パーソナル用品		0.71%
エネルギー設備・サービス		0.71%

航空貨物・物流サービス	0.59%
不動産管理・開発	0.58%
自動車部品	0.54%
消費者金融	0.50%
複合小売り	0.49%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.49%
専門サービス	0.47%
家庭用耐久財	0.46%
商業サービス・用品	0.46%
無線通信サービス	0.39%
電子装置・機器・部品	0.39%
建設資材	0.35%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.31%
容器・包装	0.30%
建設関連製品	0.28%
運送インフラ	0.24%
ガス	0.23%
旅客航空輸送業	0.13%
水道	0.10%
販売	0.10%
レジャー用品	0.09%
紙製品・林産品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
海運業	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	96.13%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	2,140,610,000	101.46 2,172,007,527	101.36 2,169,872,138	1.375000 2018/9/30	0.82%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,879,560,000	109.69 2,061,783,342	109.50 2,058,118,200	3.625000 2020/2/15	0.78%
3	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,983,980,000	99.98 1,983,583,204	100.10 1,986,063,179	0.750000 2017/12/31	0.75%
4	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	1,879,560,000	101.71 1,911,838,310	101.44 1,906,794,824	1.875000 2017/9/30	0.72%
5	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,879,560,000	99.70 1,874,052,889	99.91 1,877,868,396	0.500000 2017/7/31	0.71%
6	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,722,930,000	106.17 1,829,252,010	106.45 1,834,179,590	2.625000 2020/8/15	0.69%
7	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,775,140,000	101.72 1,805,778,916	101.77 1,806,613,232	1.500000 2018/12/31	0.68%
8	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	105.93 1,659,228,579	104.29 1,633,588,248	4.750000 2017/8/15	0.62%
9	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	103.65 1,623,510,673	103.19 1,616,280,633	2.375000 2018/6/30	0.61%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	101.82 1,594,806,660	103.00 1,613,335,989	1.750000 2022/5/15	0.61%
11	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	102.58 1,606,850,462	102.78 1,609,858,803	1.750000 2023/5/15	0.61%
12	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	100.54 1,574,808,141	102.25 1,601,541,750	1.625000 2022/8/15	0.61%
13	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,461,880,000	109.57 1,601,781,916	109.42 1,599,720,665	3.500000 2020/5/15	0.61%
14	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,461,880,000	105.34 1,540,046,723	104.30 1,524,857,790	3.500000 2018/2/15	0.58%
15	US T N/B 1.875 08/31/17 アメリカ	国債証券	1,461,880,000	101.71 1,486,936,623	101.34 1,481,513,048	1.875000 2017/8/31	0.56%
16	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,409,670,000	102.29 1,442,036,023	104.33 1,470,779,194	2.000000 2025/2/15	0.56%
17	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,357,460,000	106.89 1,451,097,590	106.54 1,446,265,033	3.125000 2019/5/15	0.55%
18	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,357,460,000	104.20 1,414,496,292	106.47 1,445,369,109	2.250000 2025/11/15	0.55%
19	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,409,670,000	100.85 1,421,666,291	101.53 1,431,252,047	1.375000 2020/5/31	0.54%
20	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,330,205,000	108.38 1,441,746,043	106.89 1,421,949,238	4.500000 2018/2/1	0.54%
21	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,409,670,000	99.95 1,409,064,364	100.08 1,410,924,606	0.750000 2018/2/28	0.53%
22	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,326,134,000	104.09 1,380,412,664	105.03 1,392,851,801	2.125000 2021/12/31	0.53%
23	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,357,460,000	101.06 1,371,957,672	101.53 1,378,351,309	1.375000 2019/2/28	0.52%

24	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,326,134,000	101.79 1,349,930,691	101.60 1,347,365,405	1.500000 2018/8/31	0.51%
25	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	108.00 1,353,283,200	106.82 1,338,597,571	4.000000 2018/8/15	0.51%
26	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	105.27 1,319,194,246	105.06 1,316,519,006	2.750000 2019/2/15	0.50%
27	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	101.92 1,277,186,080	104.31 1,307,071,084	2.000000 2025/8/15	0.49%
28	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	103.48 1,296,746,035	104.29 1,306,870,598	2.000000 2021/5/31	0.49%
29	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	100.88 1,264,079,282	101.55 1,272,512,241	1.375000 2020/4/30	0.48%
30	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,200,830,000	104.38 1,253,450,892	105.35 1,265,182,479	2.250000 2021/3/31	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
国債証券	96.93%
合計	96.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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28年7月29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	503,800	2,236.18 1,126,591,510	2,543.94 1,281,636,972	- -	3.38%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	9,061	121,480.88 1,100,738,289	140,301.69 1,271,273,703	- -	3.35%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,197,083	520.84 1,144,334,965	575.38 1,264,179,587	- -	3.33%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	88,400	8,398.08 742,390,279	8,679.39 767,258,111	- -	2.02%
5	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	548,000	1,208.92 662,492,915	1,313.02 719,536,604	- -	1.90%
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	39,052	15,897.44 620,827,114	16,554.04 646,468,502	- -	1.70%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,506,530	68.22 512,152,952	70.93 532,469,700	- -	1.40%
8	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	24,200	19,332.78 467,853,496	17,295.08 418,541,047	- -	1.10%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,582,235	58.42 384,567,853	59.62 392,484,192	- -	1.03%
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,255,120	269.92 338,791,043	290.13 364,160,516	- -	0.96%
11	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	7,098,200	43.50 308,781,582	43.34 307,644,505	- -	0.81%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	134,064	1,750.05 234,619,548	2,187.35 293,245,426	- -	0.77%
13	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	164,374	1,832.14 301,157,566	1,680.89 276,296,256	- -	0.73%
14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	257,808	1,042.17 268,680,602	1,051.14 270,992,919	- -	0.71%
15	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	420,995	602.30 253,569,138	615.85 259,273,643	- -	0.68%

16	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	539,379	458.72 247,428,106	429.68 231,764,845	- -	0.61%
17	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	466,500	506.76 236,406,005	496.67 231,698,421	- -	0.61%
18	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	246,884	792.67 195,699,653	891.74 220,158,016	- -	0.58%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	249,015	830.40 206,782,752	871.20 216,941,868	- -	0.57%
20	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,586,000	130.91 207,632,384	128.67 204,082,673	- -	0.54%
21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,637	100,341.00 164,258,229	114,699.19 187,762,590	- -	0.49%
22	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	116,614	1,656.67 193,191,810	1,601.10 186,711,375	- -	0.49%
23	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	39,101	4,397.02 171,928,216	4,483.27 175,300,445	- -	0.46%
24	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,293,200	71.58 164,168,013	76.31 175,012,896	- -	0.46%
25	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	42,296	3,934.89 166,430,330	4,086.02 172,822,724	- -	0.46%
26	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,807,678	74.26 208,515,276	60.99 171,257,127	- -	0.45%
27	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV オランダ	株式 家庭用耐久財	259,114	656.52 170,113,914	652.53 169,081,472	- -	0.45%
28	NAVER CORP 韓国	株式 インターネッ トソフトウェア・サービス	2,510	62,888.49 157,850,121	66,101.00 165,913,510	- -	0.44%
29	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	12,836	14,014.31 179,887,789	12,661.59 162,524,297	- -	0.43%
30	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	665,000	263.54 175,258,614	242.01 160,937,182	- -	0.42%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
株式	95.45%
投資信託受益証券	0.66%
投資証券	0.30%
合計	96.41%

（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28年7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	15.23%
インターネットソフトウェア・サービス		7.55%
石油・ガス・消耗燃料		6.90%
半導体・半導体製造装置		4.98%
コンピュータ・周辺機器		4.98%
無線通信サービス		4.35%
保険		3.19%
金属・鉱業		2.97%
自動車		2.57%
メディア		2.39%
電子装置・機器・部品		2.33%
不動産管理・開発		2.28%
食品		2.08%
コングロマリット		2.04%
各種電気通信サービス		2.04%
情報技術サービス		1.94%
化学		1.93%
食品・生活必需品小売り		1.91%
各種金融サービス		1.65%
医薬品		1.60%
電力		1.36%
飲料		1.14%
パーソナル用品		1.09%
資本市場		1.06%
運送インフラ		1.05%
建設・土木		0.93%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.92%
インターネット販売・カタログ販売		0.90%
家庭用耐久財		0.84%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.83%
建設資材		0.82%
自動車部品		0.81%
タバコ		0.80%
複合小売り		0.77%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.62%
機械		0.57%
繊維・アパレル・贅沢品		0.56%
ホテル・レストラン・レジャー		0.48%

ガス	0.46%
家庭用品	0.44%
専門小売り	0.42%
各種消費者サービス	0.37%
紙製品・林産品	0.31%
水道	0.29%
バイオテクノロジー	0.26%
不動産投資信託	0.26%
消費者金融	0.25%
旅客航空輸送業	0.24%
航空宇宙・防衛	0.23%
電気設備	0.23%
ソフトウェア	0.17%
陸運・鉄道	0.17%
商業サービス・用品	0.15%
海運業	0.11%
総合公益事業	0.10%
航空貨物・物流サービス	0.09%
レジャー用品	0.08%
容器・包装	0.07%
商社・流通業	0.07%
エネルギー設備・サービス	0.07%
建設関連製品	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
販売	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03%
通信機器	0.02%
合計	95.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	2,000,008,470	122.06 2,441,359,896	122.19 2,443,830,349	7.500000 2030/3/31	4.53%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	950,222,000	94.77 900,583,342	98.37 934,780,892	4.250000 2025/1/7	1.73%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	814,476,000	104.13 848,161,892	106.50 867,416,940	4.750000 2044/3/8	1.61%
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	574,310,000	122.10 701,271,667	125.87 722,912,712	6.050000 2040/1/11	1.34%
5	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 メキシコ	国債証券	647,404,000	103.83 672,208,971	104.75 678,155,690	3.600000 2025/1/30	1.26%
6	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	428,122,000	153.92 658,994,620	158.11 676,946,506	8.750000 2033/11/21	1.26%
7	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	616,078,000	106.77 657,825,116	107.75 663,824,045	4.000000 2023/10/2	1.23%
8	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	365,470,000	171.29 626,045,933	178.16 651,121,352	12.750000 2028/6/24	1.21%
9	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	542,984,000	115.32 626,170,193	119.62 649,544,610	5.550000 2045/1/21	1.20%
10	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	532,542,000	121.45 646,790,010	119.61 637,026,740	7.375000 2025/2/5	1.18%
11	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	553,426,000	114.35 632,847,852	113.85 630,075,501	7.375000 2019/3/18	1.17%
12	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	542,984,000	113.85 618,196,681	114.60 622,286,813	6.375000 2021/3/29	1.15%
13	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	584,752,000	102.81 601,208,592	105.90 619,252,368	4.875000 2021/1/22	1.15%
14	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	355,028,000	173.49 615,965,644	173.32 615,355,831	9.500000 2030/2/2	1.14%
15	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	480,332,000	119.41 573,589,502	126.60 608,100,312	5.625000 2050/11/18	1.13%
16	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	668,288,000	83.36 557,132,910	90.00 601,459,200	5.000000 2045/1/27	1.12%
17	RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア	国債証券	563,868,000	105.15 592,947,716	106.42 600,119,073	4.500000 2022/4/4	1.11%
18	TURKEY 6.625 02/17/45 トルコ	国債証券	511,658,000	118.04 604,000,260	116.81 597,713,759	6.625000 2045/2/17	1.11%
19	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	542,984,000	105.35 572,075,412	109.75 595,924,940	5.625000 2044/2/26	1.11%

20	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	501,216,000	117.36 588,265,733	117.69 589,886,122	11.000000 2018/7/24	1.09%
21	BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル	国債証券	532,542,000	109.40 582,600,948	109.50 583,133,490	5.875000 2019/1/15	1.08%
22	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	469,890,000	118.80 558,240,388	119.57 561,847,473	6.750000 2022/2/7	1.04%
23	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	375,912,000	145.49 546,936,297	148.00 556,357,278	6.375000 2034/10/23	1.03%
24	RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 ロシア	国債証券	542,984,000	101.42 550,721,730	102.44 556,238,239	3.500000 2019/1/16	1.03%
25	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	501,216,000	106.99 536,290,678	110.25 552,590,640	5.750000 2110/10/12	1.02%
26	TURKEY 6.75 04/03/18 トルコ	国債証券	522,100,000	107.82 562,959,963	105.52 550,946,025	6.750000 2018/4/3	1.02%
27	INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア	国債証券	438,564,000	124.91 547,813,425	123.91 543,446,580	11.625000 2019/3/4	1.01%
28	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	344,586,000	156.48 539,233,129	156.79 540,293,618	7.750000 2031/1/14	1.00%
29	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	396,796,000	129.69 514,613,086	135.08 536,031,716	6.700000 2036/1/26	0.99%
30	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	459,448,000	109.27 502,051,360	114.75 527,216,580	6.125000 2041/1/18	0.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
国債証券	96.60%
合計	96.60%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(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28年7月29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 2809月	買建	447	5,718,043,428	5,938,395,000	2.10%

(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。

DIAMマネーマザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29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 2016年08月	売建	150,000	15,701,820	15,660,000	0.01%
		ユーロ売/円買 201 6年08月	売建	40,000	4,633,520	4,626,400	0.00%
		イギリス・ポンド売/ 円買 2016年08月	売建	20,000	2,769,200	2,750,200	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 500 F U T U R E S e p 1 6	買建	30	1,652,472,605	1,695,284,805	0.65%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 S e p 1 6	買建	131	435,213,001	450,037,269	0.17%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 6	買建	21	189,973,627	193,042,609	0.07%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S S e p 1 6	買建	10	103,394,780	108,353,880	0.04%
	モントリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 6	買建	7	92,093,365	93,953,147	0.04%

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

(注2) 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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29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2016年08月	買建	1,051,000	121,705,898	121,558,660	0.05%
		アメリカ・ドル買/円売2016年08月	買建	888,000	92,954,774	92,707,200	0.04%
		イギリス・ポンド買/円売2016年08月	買建	209,000	28,742,098	28,739,590	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 16	買建	296	1,305,397,232	1,353,938,957	3.57%

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成28年7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記特定期間又は計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成25年1月11日)	54	54	1.0953	1.0953
第2特定期間末 (平成25年7月11日)	57	57	1.1501	1.1501
第4計算期間末 (平成26年1月14日)	836	836	1.1801	1.1801
第5計算期間末 (平成26年7月11日)	4,833	4,833	1.1888	1.1888
第6計算期間末 (平成27年1月13日)	7,664	7,664	1.2660	1.2660
第7計算期間末 (平成27年7月13日)	16,373	16,373	1.2816	1.2816
第8計算期間末 (平成28年1月12日)	29,373	29,373	1.2200	1.2200
第9計算期間末 (平成28年7月11日)	30,524	30,524	1.1796	1.1796
平成27年7月末日	17,546	-	1.2838	-
8月末日	19,007	-	1.2467	-
9月末日	21,347	-	1.2420	-
10月末日	23,163	-	1.2480	-
11月末日	25,339	-	1.2472	-
12月末日	28,461	-	1.2327	-
平成28年1月末日	29,589	-	1.2196	-
2月末日	29,897	-	1.2012	-
3月末日	31,103	-	1.2035	-
4月末日	31,315	-	1.2065	-
5月末日	31,532	-	1.2049	-
6月末日	30,543	-	1.1806	-
7月末日	31,050	-	1.1896	-

【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	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	9.5
第2特定期間	5.0
第4計算期間	2.6
第5計算期間	0.7
第6計算期間	6.5
第7計算期間	1.2
第8計算期間	4.8
第9計算期間	3.3

(注) 各特定期間又は計算期間の収益率は、特定期間又は計算期間末の基準価額(分配落の額)に当該特定期間又は計算期間の分配金を加算し、当該特定期間又は計算期間の直前の特定期間又は計算期間末の基準価額(分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1特定期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円(1万口当たり)を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	50,000,000	0
第2特定期間	0	0
第4計算期間	719,575,072	60,468,768
第5計算期間	3,546,694,011	190,033,935
第6計算期間	3,178,106,719	1,190,093,443
第7計算期間	8,113,284,548	1,391,102,184
第8計算期間	12,475,200,872	1,174,643,755
第9計算期間	4,218,169,651	2,417,079,166

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

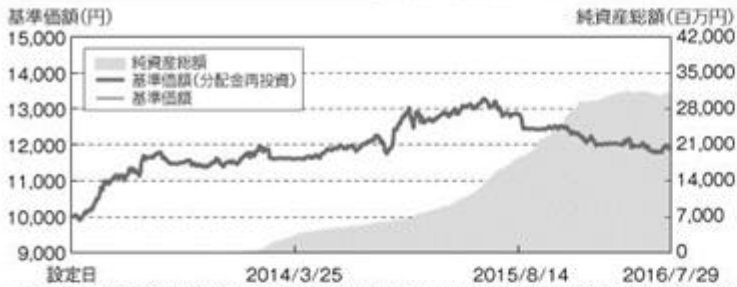
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日：2016年7月29日

⚙️ 基準価額・純資産の推移

(設定日(2012年10月26日)~2016年7月29日)



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

⚙️ 分配の推移(税引前)

第5期	(2014.07.11)	0円
第6期	(2015.01.13)	0円
第7期	(2015.07.13)	0円
第8期	(2016.01.12)	0円
第9期	(2016.07.11)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

⚙️ 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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(%)
特殊債券	20.32
内 日本	20.32
親投資信託受益証券	46.21
内 日本	46.21
コールローン、その他の資産(負債控除後)	33.47
純資産総額	100.00

組入上位10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	7回 政保地方公共団体金融機構債券 6年	特殊債券	日本	0.250000	2018/10/29	16.18%
2	外国債券バシブ・ファンドマザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	10.74%
3	国内債券バシブ・ファンドマザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	10.29%
4	国内株式バシブ・ファンド(公募化法)マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	8.76%
5	エマージング株式バシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	4.53%
6	外国株式バシブ・ファンドマザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	4.41%
7	エマージング債券バシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	4.25%
8	DIAMマネーマザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	3.22%
9	885回 政保公営企業債券	特殊債券	日本	1.700000	2018/5/22	1.33%
10	3回 政保地方公共団体金融機構債券 6年	特殊債券	日本	0.400000	2018/1/30	0.65%

■国内債券バシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	82.90
内 日本	82.90
地方債証券	6.36
内 日本	6.36
特殊債券	5.48
内 日本	5.48
社債券	4.82
内 日本	4.74
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.03
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.43
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	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.17%
2	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.17%
3	108回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.16%
4	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.09%
5	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	1.09%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2016年7月29日

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.94
内 日本	97.94
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.06
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.10

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.67%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.07%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.86%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.60%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.54%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.73%
2	輸送用機器	9.39%
3	情報・通信業	8.25%
4	銀行業	7.37%
5	化学	6.12%

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	96.93
内 アメリカ	42.29
内 フランス	9.84
内 イタリア	9.46
内 イギリス	7.54
内 ドイツ	7.33
内 その他	20.47
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.07
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N B 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	0.82%
2	US T N B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.78%
3	US T N B 0.75 12/31/17	国債証券	アメリカ	0.750000	2017/12/31	0.75%
4	US T N B 1.875 09/30/17	国債証券	アメリカ	1.875000	2017/9/30	0.72%
5	US T N B 0.5 07/31/17	国債証券	アメリカ	0.500000	2017/7/31	0.71%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.09

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	96.13
内 アメリカ	59.33
内 イギリス	7.21
内 スイス	3.88
内 カナダ	3.81
内 フランス	3.49
内 その他	18.41
投資信託受益証券	0.35
内 オーストラリア	0.30
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.51
内 アメリカ	2.17
内 フランス	0.16
内 イギリス	0.11
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)	1.01
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	1.90%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.38%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.23%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.12%
5	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売/カタログ販売	0.99%

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)	△0.01
株価指数先物取引(買建)	0.98

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	7.90%
2	医薬品	6.75%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.29%
4	保険	3.87%
5	ソフトウェア	3.34%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2016年7月29日

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	96.60
内 トルコ	13.47
内 メキシコ	13.19
内 ロシア	12.22
内 インドネシア	10.40
内 ブラジル	9.55
内 その他	37.77
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.40
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	4.53%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.73%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.61%
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.050000	2040/1/11	1.34%
5	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	メキシコ	3.600000	2025/1/30	1.26%

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.45
内 韓国	14.25
内 台湾	11.74
内 ケイマン諸島	10.22
内 中国	9.80
内 インド	8.15
内 その他	41.29
投資信託受益証券	0.66
内 メキシコ	0.66
投資証券	0.30
内 メキシコ	0.13
内 南アフリカ	0.13
内 トルコ	0.04
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.59
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	3.38%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ周辺機器	3.35%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体半導体製造装置	3.33%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェアサービス	2.02%
5	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.90%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.57

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	15.23%
2	インターネットソフトウェアサービス	7.55%
3	石油ガス消耗燃料	6.90%
4	半導体半導体製造装置	4.98%
5	コンピュータ周辺機器	4.98%

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

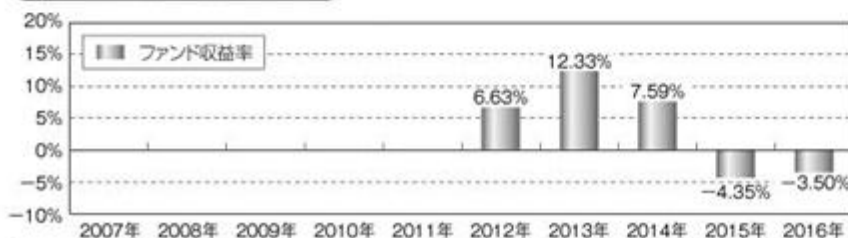
ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
地方債証券	18.20
内 日本	18.20
特殊債券	66.73
内 日本	66.73
コールローン、その他の資産(負債控除後)	15.07
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	23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	1.700000	2016/12/28	13.48%
2	34回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	1.700000	2017/5/26	12.41%
3	10回 政保東日本高速道路債券	特殊債券	日本	1.500000	2017/12/21	6.44%
4	866回 政保公営企業債券	特殊債券	日本	2.000000	2016/8/18	4.31%
5	19回 政保国民生活債券	特殊債券	日本	1.700000	2016/12/19	3.75%

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2012年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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」に従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、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.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。

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。

海外休業日には、解約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、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求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。

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
株式	国内株式 原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。 外国株式 原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。 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

公社債等	次に掲げるいずれかの価額で評価します。 (1)日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） (2)金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。） (3)価格情報会社の提供する価額
------	---

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

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

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)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、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、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、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事

項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の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ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、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であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- 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。
- j. 上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

八. 関係法人との契約の更改

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

収益分配金受領権

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

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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、委託会社は原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金を販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間その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、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または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（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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、解約の請求をすることができます。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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9期計算期間(平成28年1月13日から平成28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】

クルーズコントロール

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第8期 平成28年1月12日現在	第9期 平成28年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,403,588,402	20,396,810,670
国債証券	5,941,253,000	-
特殊債券	5,978,397,600	6,321,842,050
親投資信託受益証券	4,257,662,017	4,098,277,250
未収利息	13,825,204	10,108,026
前払費用	6,960,866	29,589
流動資産合計	29,601,687,089	30,827,067,585
資産合計	29,601,687,089	30,827,067,585
負債の部		
流動負債		
未払解約金	57,830,202	72,539,595
未払受託者報酬	6,050,181	8,172,372
未払委託者報酬	163,355,941	220,654,822
その他未払費用	574,682	752,857
流動負債合計	227,811,006	302,119,646
負債合計	227,811,006	302,119,646
純資産の部		
元本等		
元本	1 24,076,519,137	1 25,877,609,622
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,297,356,946	4,647,338,317
(分配準備積立金)	321,906,102	292,838,400
元本等合計	29,373,876,083	30,524,947,939
純資産合計	29,373,876,083	30,524,947,939
負債純資産合計	29,601,687,089	30,827,067,585

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期		第9期	
	自 至	平成27年7月14日 平成28年1月12日	自 至	平成28年1月13日 平成28年7月11日
営業収益				
受取利息		58,366,964		51,648,874
有価証券売買等損益		1,018,061,563		843,996,487
営業収益合計		959,694,599		792,347,613
営業費用				
支払利息		-		2,162,179
受託者報酬		6,050,181		8,172,372
委託者報酬		163,355,941		220,654,822
その他費用		585,482		760,737
営業費用合計		169,991,604		231,750,110
営業利益又は営業損失()		1,129,686,203		1,024,097,723
経常利益又は経常損失()		1,129,686,203		1,024,097,723
当期純利益又は当期純損失()		1,129,686,203		1,024,097,723
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()		28,599,443		49,386,533
期首剰余金又は期首欠損金()		3,597,340,369		5,297,356,946
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,123,065,093		852,772,173
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,123,065,093		852,772,173
剰余金減少額又は欠損金増加額		321,961,756		528,079,612
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		321,961,756		528,079,612
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		5,297,356,946		4,647,338,317

(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	<p>国債証券及び特殊債券 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。</p> <p>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。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成28年1月12日としております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 平成28年1月12日現在	第9期 平成28年7月11日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	12,775,962,020円 12,475,200,872円 1,174,643,755円	24,076,519,137円 4,218,169,651円 2,417,079,166円
2. 受益権の総数	24,076,519,137口	25,877,609,622口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期 自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12日	第9期 自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（5,542,796,863円）及び分配準備積立金（321,906,102円）より分配対象収益は5,864,702,965円（1万口当たり2,435.86円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（6,011,486,656円）及び分配準備積立金（292,838,400円）より分配対象収益は6,304,325,056円（1万口当たり2,436.21円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(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8期	第9期
	自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12日	自 平成28年1月13日 至 平成28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（親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む）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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 平成28年1月12日現在	第9期 平成28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	第8期 平成28年1月12日現在	第9期 平成28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	47,962,000	-
特殊債券	12,218,300	5,721,280
親投資信託受益証券	282,594,805	120,118,761
合計	342,775,105	114,397,481

（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）

	第8期 平成28年1月12日現在	第9期 平成28年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2200円	1.1796円
（1万口当たり純資産額）	(12,200円)	(11,796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28年7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
特殊債券	19回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	200,810,000	
	27回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,176,000	
	56回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,567,000	
	885回 政保公営企業債券	400,000,000	413,012,000	
	886回 政保公営企業債券	30,000,000	31,074,300	
	3回 政保地方公共団体金融機構債券 6年	200,000,000	201,394,000	
	7回 政保地方公共団体金融機構債券 6年	5,000,000,000	5,033,950,000	
	12回 政保中日本高速道路債券	100,000,000	100,992,000	
	9回 政保西日本高速道路債券	33,000,000	33,618,750	
	14回 政保西日本高速道路債券	100,000,000	103,248,000	
特殊債券 合計		6,263,000,000	6,321,842,050	
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	339,669,799	624,618,793	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	603,930,416	802,623,522	
	DIAMマネーマザーファンド	990,000,991	1,000,693,001	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	126,776,777	304,898,148	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	454,750,989	748,611,078	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	379,160,098	302,190,598	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	187,812,398	314,642,110	
親投資信託受益証券 合計		3,082,101,468	4,098,277,250	
合計		9,345,101,468	10,420,119,300	

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

該当事項はありません。

（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、「DIAMマネーマザーファンド」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、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,393,222,349	1,828,226,218
株式	2	276,342,361,426	269,406,635,500
派生商品評価勘定		-	50,151,548
未収配当金		375,847,721	377,127,537
前払金		167,729,000	31,495,000
流動資産合計		280,279,160,496	271,693,635,803
資産合計		280,279,160,496	271,693,635,803
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		260,639,956	61,296
未払金		37,223,144	-
未払解約金		173,697,000	134,055,000
流動負債合計		471,560,100	134,116,296
負債合計		471,560,100	134,116,296
純資産の部			
元本等			
元本	1	137,895,802,136	147,673,783,029
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		141,911,798,260	123,885,736,478
元本等合計		279,807,600,396	271,559,519,507
純資産合計		279,807,600,396	271,559,519,507
負債純資産合計		280,279,160,496	271,693,635,803

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年1月12日現在	平成28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	138,587,667,315円	137,895,802,136円
同期中追加設定元本額	21,290,618,106円	29,768,712,440円
同期中一部解約元本額	21,982,483,285円	19,990,731,547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	5,243,119,200円	6,375,520,105円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,434,903,894円	1,517,074,465円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	6,372,306円	9,129,781円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,241,995円	18,120,418円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	33,085,052円	38,387,875円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,617,096円	19,030,231円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	10,949,401円	16,030,252円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,175,343円	15,535,935円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	37,229,466,103円	38,875,576,225円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	753,957,603円	919,699,441円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,677,160,685円	3,081,394,557円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,838,691,583円	3,096,646,645円

DIAM DC バランス30 インデックスファンド	360,300,606円	408,716,759円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	1,205,856,079円	1,309,764,939円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	1,077,747,976円	1,144,685,427円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	59,990,854円	64,694,612円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,225,789,571円	1,345,850,624円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	26,328,141円	30,643,797円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国10)	23,879,309円	30,983,724円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国20)	46,943,703円	64,287,197円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国30)	101,897,155円	125,235,921円
投資のソムリエ	1,437,588,833円	1,071,677,253円
クルーズコントロール	411,063,743円	339,669,799円
投資のソムリエ<DC年金>	25,711,338円	24,728,210円
DIAM 8資産 balan スファンドN<DC年金>	68,146,669円	107,114,949円
DIAM DC バランス・F (成長型)	50,706,467円	78,510,194円
クルーズコントロール<DC年 金>	65,644円	91,475円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	5,635,268円	3,858,249円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	7,643,548円	6,868,427円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	378,598円	3,612,277円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	433,022円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	290,705,619円	250,610,082円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	106,160,395円	124,900,758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)	576,396,892円	295,019,238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)	464,365,370円	479,199,961円
DIAM国際分散バランスマ ンダ30VA(適格機関投資家 限定)	40,121,091円	37,607,363円
DIAM国際分散バランスマ ンダ50VA(適格機関投資家 限定)	164,133,734円	149,336,920円

D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家 限定)	39,392,533円	39,191,992円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	59,164,711円	54,896,174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)	5,310,699,991円	3,943,186,781円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	2,014,996,367円	1,395,832,066円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,925,294,426円	1,986,426,285円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,534,659,208円	1,621,942,721円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,028,185,938円	4,256,723,178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)	313,152,279円	351,862,082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)	814,928,278円	890,989,010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)	953,342,133円	1,034,171,932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)	3,906,961,067円	4,234,272,836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)	41,880,337円	46,003,219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)	1,304,865,632円	1,490,614,509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)	5,298,661,400円	5,637,233,765円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	19,928,952,130円	22,802,924,565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)	764,217,632円	834,560,866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)	2,257,945,180円	2,618,968,856円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	12,639,527,962円	14,367,734,306円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	34,355円	8,463,623円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	9,206,801円	3,687,271円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	15,369,659円	1,287,419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)	11,341,448,728円	12,955,028,403円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	106,482,768円	117,577,546円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	40,013,403円	46,345,852円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	23,270,239円	49,758,274円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	38,722,783円	85,470円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	117,038円	134,219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)	670,998,289円	729,123,003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)	1,887,540,594円	1,971,158,603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)	2,485,634,300円	2,597,804,800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)	94,839,111円	105,546,296円
	計	137,895,802,136円	147,673,783,029円
2.	受益権の総数	137,895,802,136口	147,673,783,029口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,377,500,000円	株式 2,650,500,000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27年7月14日 至 平成28年1月12日	自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年1月12日現在	平成28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28年1月12日現在	平成28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	5,214,721,901	25,475,911,220
合計	5,214,721,901	25,475,911,220

（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27年2月10日から平成28年1月12日まで及び平成28年2月9日から平成28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28年1月12日 現在				平成28年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買建	3,312,334,000	-	3,051,765,000	260,569,000	3,433,095,000	-	3,483,275,000	50,180,000
合計	3,312,334,000	-	3,051,765,000	260,569,000	3,433,095,000	-	3,483,275,000	50,180,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.0291円	1.8389円
（1万口当たり純資産額）	（20,291円）	（18,389円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	71,000	264.00	18,744,000	
日本水産	187,100	514.00	96,169,400	
マルハニチロ	33,200	2,718.00	90,237,600	
ハウスイ	12,000	108.00	1,296,000	
カネコ種苗	5,700	1,358.00	7,740,600	
サカタのタネ	24,000	2,263.00	54,312,000	
ホクト	16,600	1,872.00	31,075,200	
ホクリヨウ	1,800	852.00	1,533,600	
ショーボンドホールディングス	17,100	4,750.00	81,225,000	
ミライト・ホールディングス	50,000	1,071.00	53,550,000	
タマホーム	12,900	432.00	5,572,800	
サンヨーホームズ	3,400	478.00	1,625,200	
住石ホールディングス	49,400	80.00	3,952,000	
日鉄鉱業	45,000	330.00	14,850,000	
三井松島産業	107,000	97.00	10,379,000	
国際石油開発帝石	855,400	766.40	655,578,560	
日本海洋掘削	4,900	2,170.00	10,633,000	
石油資源開発	25,700	1,998.00	51,348,600	
K&Oエナジーグループ	11,000	1,305.00	14,355,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,018.00	3,868,400	
安藤・間	108,400	581.00	62,980,400	
東急建設	52,800	958.00	50,582,400	
コムシスホールディングス	69,900	1,718.00	120,088,200	
ミサワホーム	19,300	694.00	13,394,200	
ピーアールホールディングス	6,600	399.00	2,633,400	
高松コンストラクショングループ	12,300	2,471.00	30,393,300	
東建コーポレーション	6,700	8,220.00	55,074,000	
ヤマウラ	8,000	534.00	4,272,000	
大成建設	843,000	863.00	727,509,000	
大林組	487,000	1,098.00	534,726,000	
清水建設	497,000	986.00	490,042,000	
飛島建設	130,500	173.00	22,576,500	
長谷工コーポレーション	189,400	983.00	186,180,200	
松井建設	17,900	1,131.00	20,244,900	
銭高組	23,000	332.00	7,636,000	
鹿島建設	761,000	731.00	556,291,000	
不動テトラ	115,100	161.00	18,531,100	
大末建設	6,200	915.00	5,673,000	
鉄建建設	99,000	305.00	30,195,000	
西松建設	188,000	497.00	93,436,000	
三井住友建設	622,500	88.00	54,780,000	
大豊建設	63,000	492.00	30,996,000	
前田建設工業	100,000	840.00	84,000,000	

佐田建設	11,400	372.00	4,240,800
ナカノフドー建設	12,500	401.00	5,012,500
奥村組	154,000	580.00	89,320,000
東鉄工業	19,500	3,045.00	59,377,500
イチケン	18,000	260.00	4,680,000
浅沼組	52,000	214.00	11,128,000
戸田建設	189,000	466.00	88,074,000
熊谷組	238,000	302.00	71,876,000
青木あすなる建設	11,000	648.00	7,128,000
北野建設	35,000	245.00	8,575,000
植木組	19,000	210.00	3,990,000
三井ホーム	20,000	434.00	8,680,000
矢作建設工業	22,200	859.00	19,069,800
ピーエス三菱	19,500	378.00	7,371,000
日本ハウスホールディングス	33,300	316.00	10,522,800
大東建託	59,700	16,720.00	998,184,000
新日本建設	19,300	783.00	15,111,900
N I P P O	38,000	1,763.00	66,994,000
東亜道路工業	31,000	269.00	8,339,000
前田道路	51,000	1,830.00	93,330,000
日本道路	48,000	395.00	18,960,000
東亜建設工業	142,000	164.00	23,288,000
若築建設	94,000	147.00	13,818,000
東洋建設	51,100	446.00	22,790,600
五洋建設	180,300	552.00	99,525,600
大林道路	19,100	638.00	12,185,800
世紀東急工業	25,600	498.00	12,748,800
福田組	26,000	1,048.00	27,248,000
日本ドライケミカル	1,900	2,127.00	4,041,300
住友林業	111,800	1,480.00	165,464,000
日本基礎技術	18,200	346.00	6,297,200
日成ビルド工業	45,000	592.00	26,640,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	84,000	71.00	5,964,000
巴コーポレーション	20,700	334.00	6,913,800
パナホーム	61,000	822.00	50,142,000
大和ハウス工業	479,600	2,862.00	1,372,615,200
ライト工業	31,300	1,108.00	34,680,400
積水ハウス	542,800	1,674.00	908,647,200
日特建設	18,100	405.00	7,330,500
北陸電気工事	8,100	714.00	5,783,400
ユアテック	26,000	703.00	18,278,000
西部電気工業	12,000	408.00	4,896,000
四電工	6,000	384.00	2,304,000
中電工	23,500	2,093.00	49,185,500
関電工	65,000	875.00	56,875,000
きんでん	98,300	1,162.00	114,224,600
東京エネシス	18,000	1,039.00	18,702,000
トーエネック	23,000	579.00	13,317,000
住友電設	12,900	1,174.00	15,144,600
日本電設工業	26,500	1,787.00	47,355,500

協和エクシオ	63,700	1,322.00	84,211,400
新日本空調	13,800	1,051.00	14,503,800
日本工営	51,000	324.00	16,524,000
N D S	26,000	257.00	6,682,000
九電工	29,700	3,095.00	91,921,500
三機工業	36,200	838.00	30,335,600
日揮	163,100	1,504.00	245,302,400
中外炉工業	49,000	218.00	10,682,000
ヤマト	14,800	542.00	8,021,600
太平電業	24,000	1,074.00	25,776,000
高砂熱学工業	48,500	1,239.00	60,091,500
三晃金属工業	16,000	290.00	4,640,000
N E C ネットズエスアイ	18,000	1,911.00	34,398,000
朝日工業社	16,000	512.00	8,192,000
明星工業	29,900	476.00	14,232,400
大気社	20,000	2,532.00	50,640,000
ダイダン	20,000	767.00	15,340,000
日比谷総合設備	19,600	1,631.00	31,967,600
東芝プラントシステム	26,400	1,658.00	43,771,200
日本製粉	104,000	808.00	84,032,000
日清製粉グループ本社	178,100	1,694.00	301,701,400
日東富士製粉	8,000	334.00	2,672,000
昭和産業	67,000	462.00	30,954,000
鳥越製粉	13,400	670.00	8,978,000
中部飼料	15,300	693.00	10,602,900
フィード・ワン	99,900	116.00	11,588,400
東洋精糖	28,000	102.00	2,856,000
日本甜菜製糖	85,000	187.00	15,895,000
三井製糖	64,000	484.00	30,976,000
塩水港精糖	18,200	225.00	4,095,000
日新製糖	7,000	1,406.00	9,842,000
ネクスト	42,700	894.00	38,173,800
ジェイエイシーリクルートメント	9,300	1,506.00	14,005,800
日本M & A センター	23,400	6,810.00	159,354,000
ノバレーゼ	4,000	816.00	3,264,000
アコーディア・ゴルフ	42,000	1,070.00	44,940,000
中広	1,400	605.00	847,000
タケエイ	13,200	864.00	11,404,800
トラスト・テック	6,100	1,355.00	8,265,500
パソナグループ	13,100	767.00	10,047,700
C D S	3,500	762.00	2,667,000
リンクアンドモチベーション	30,400	213.00	6,475,200
G C A サヴィアン	13,400	851.00	11,403,400
エス・エム・エス	18,800	2,215.00	41,642,000
テンブホールディングス	106,100	1,731.00	183,659,100
リニカル	8,900	1,540.00	13,706,000
クックパッド	33,700	1,437.00	48,426,900
エスクリ	6,600	574.00	3,788,400
アイ・ケイ・ケイ	8,200	563.00	4,616,600
森永製菓	146,000	699.00	102,054,000

中村屋	35,000	477.00	16,695,000
江崎グリコ	37,500	6,320.00	237,000,000
名糖産業	7,600	1,336.00	10,153,600
不二家	95,000	196.00	18,620,000
山崎製パン	119,000	2,945.00	350,455,000
第一屋製パン	28,000	110.00	3,080,000
モロゾフ	24,000	427.00	10,248,000
亀田製菓	9,100	6,000.00	54,600,000
寿スピリッツ	11,500	3,365.00	38,697,500
カルビー	60,200	4,400.00	264,880,000
森永乳業	146,000	754.00	110,084,000
六甲バター	7,300	2,361.00	17,235,300
ヤクルト本社	87,100	5,040.00	438,984,000
明治ホールディングス	96,200	10,760.00	1,035,112,000
雪印メグミルク	38,200	3,660.00	139,812,000
プリマハム	103,000	320.00	32,960,000
日本ハム	119,000	2,612.00	310,828,000
林兼産業	54,000	87.00	4,698,000
丸大食品	84,000	486.00	40,824,000
S Foods	10,200	2,845.00	29,019,000
伊藤ハム米久ホールディングス	97,000	1,073.00	104,081,000
学情	5,600	1,392.00	7,795,200
スタジオアリス	7,000	2,454.00	17,178,000
シミックホールディングス	7,700	1,625.00	12,512,500
システナ	13,900	1,504.00	20,905,600
N J S	3,200	1,110.00	3,552,000
デジタルアーツ	7,000	2,975.00	20,825,000
新日鉄住金ソリューションズ	23,800	1,643.00	39,103,400
総合警備保障	50,500	4,835.00	244,167,500
キューブシステム	6,200	703.00	4,358,600
いちごグループホールディングス	158,200	388.00	61,381,600
日本駐車場開発	172,300	132.00	22,743,600
コア	6,000	919.00	5,514,000
カカクコム	108,700	2,059.00	223,813,300
アイロムグループ	4,300	968.00	4,162,400
ルネサンス	7,800	1,136.00	8,860,800
ディップ	16,700	2,991.00	49,949,700
S B Sホールディングス	14,300	729.00	10,424,700
オプトホールディング	9,500	802.00	7,619,000
新日本科学	14,200	658.00	9,343,600
ツクイ	17,900	1,716.00	30,716,400
キャリアデザインセンター	4,100	966.00	3,960,600
エムスリー	131,100	3,750.00	491,625,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,100	724.00	8,036,400
アウトソーシング	7,100	4,255.00	30,210,500
ウェルネット	11,300	2,078.00	23,481,400
ディー・エヌ・エー	67,800	2,566.00	173,974,800
博報堂DYホールディングス	209,800	1,174.00	246,305,200
ぐるなび	17,500	3,000.00	52,500,000
エスアールジータカミヤ	16,300	413.00	6,731,900

ジャパンベストレスキューシステム	19,500	216.00	4,212,000
ファンコミュニケーションズ	34,900	852.00	29,734,800
ジェイコムホールディングス	3,100	2,555.00	7,920,500
WDBホールディングス	5,500	864.00	4,752,000
ティア	7,300	629.00	4,591,700
バリューコマース	14,000	340.00	4,760,000
インフォマート	29,200	1,013.00	29,579,600
サッポロホールディングス	49,700	2,997.00	148,950,900
アサヒグループホールディングス	304,700	3,467.00	1,056,394,900
麒麟ホールディングス	658,100	1,802.50	1,186,225,250
宝ホールディングス	117,800	966.00	113,794,800
オエノンホールディングス	46,000	201.00	9,246,000
養命酒製造	5,200	1,711.00	8,897,200
コカ・コーラウエスト	55,000	2,940.00	161,700,000
コカ・コーライーストジャパン	57,500	1,996.00	114,770,000
サントリー食品インターナショナル	111,300	4,715.00	524,779,500
ダイドードリンコ	8,300	5,530.00	45,899,000
伊藤園	48,200	3,985.00	192,077,000
キーコーヒー	14,500	1,914.00	27,753,000
ユニカフェ	4,500	874.00	3,933,000
ジャパンフーズ	2,600	1,169.00	3,039,400
日清オイリオグループ	86,000	489.00	42,054,000
不二製油グループ本社	43,400	2,089.00	90,662,600
J・オイルミルズ	69,000	349.00	24,081,000
ローソン	54,200	8,250.00	447,150,000
サンエー	9,700	5,260.00	51,022,000
ダイユーエイト	4,000	640.00	2,560,000
カワチ薬品	11,100	2,321.00	25,763,100
エービーシー・マート	18,600	6,630.00	123,318,000
ハードオフコーポレーション	6,900	1,203.00	8,300,700
高千穂交易	5,500	886.00	4,873,000
アスクル	17,400	3,555.00	61,857,000
ゲオホールディングス	23,900	1,386.00	33,125,400
アダストリア	26,300	3,250.00	85,475,000
ジーフット	8,700	715.00	6,220,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	20,000	73.00	1,460,000
伊藤忠食品	3,300	4,135.00	13,645,500
くらコーポレーション	8,400	6,070.00	50,988,000
キャンドウ	7,700	1,665.00	12,820,500
エレマテック	6,700	2,060.00	13,802,000
パル	8,300	2,377.00	19,729,100
JALUX	4,600	1,637.00	7,530,200
エディオン	60,500	873.00	52,816,500
あらた	6,500	2,225.00	14,462,500
サーラコーポレーション	20,200	588.00	11,877,600
ワッツ	6,200	1,098.00	6,807,600
トーメンデバイス	1,900	1,806.00	3,431,400
ハローズ	4,700	2,060.00	9,682,000
J Pホールディングス	37,500	299.00	11,212,500
あみやき亭	2,800	4,115.00	11,522,000

東京エレクトロン デバイス	5,300	1,516.00	8,034,800
ひらまつ	19,700	638.00	12,568,600
フィールズ	12,500	1,228.00	15,350,000
双日	900,800	246.00	221,596,800
ゲンキー	2,900	3,895.00	11,295,500
アルフレッサ ホールディングス	179,800	2,192.00	394,121,600
サッポロドラッグストア	1,900	2,062.00	3,917,800
大黒天物産	3,400	4,860.00	16,524,000
ハニーズ	12,600	1,378.00	17,362,800
ファーマライズホールディングス	3,300	512.00	1,689,600
キッコーマン	123,000	3,915.00	481,545,000
味の素	341,500	2,560.00	874,240,000
キュービー	82,600	3,350.00	276,710,000
ハウス食品グループ本社	55,500	2,463.00	136,696,500
カゴメ	58,300	2,720.00	158,576,000
焼津水産化学工業	8,300	989.00	8,208,700
アリアケジャパン	13,300	6,070.00	80,731,000
ピエトロ	1,700	1,669.00	2,837,300
エバラ食品工業	3,900	1,858.00	7,246,200
ニチレイ	173,000	970.00	167,810,000
横浜冷凍	35,700	1,081.00	38,591,700
東洋水産	79,900	4,245.00	339,175,500
イートアンド	1,900	1,972.00	3,746,800
日清食品ホールディングス	68,700	5,620.00	386,094,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,232.00	8,624,000
一正蒲鉾	5,800	1,067.00	6,188,600
フジッコ	15,800	2,991.00	47,257,800
ロック・フィールド	17,000	1,592.00	27,064,000
日本たばこ産業	959,900	4,313.00	4,140,048,700
ケンコーマヨネーズ	5,300	3,275.00	17,357,500
わらべや日洋	8,800	2,149.00	18,911,200
なとり	8,300	1,547.00	12,840,100
北の達人コーポレーション	3,100	465.00	1,441,500
ユーグレナ	52,000	1,406.00	73,112,000
片倉工業	19,100	1,141.00	21,793,100
ゲンゼ	123,000	287.00	35,301,000
ヒューリック	298,100	1,018.00	303,465,800
神栄	20,000	111.00	2,220,000
山下医科器械	1,200	1,655.00	1,986,000
ラサ商事	6,800	482.00	3,277,600
アルペン	12,800	1,667.00	21,337,600
ラクーン	5,900	496.00	2,926,400
クオール	14,500	1,378.00	19,981,000
アルコニックス	8,200	1,499.00	12,291,800
神戸物産	9,200	2,109.00	19,402,800
ジェイアイエヌ	9,700	4,315.00	41,855,500
ビックカメラ	82,100	1,004.00	82,428,400
D C Mホールディングス	70,300	931.00	65,449,300
MonotaRO	50,600	3,240.00	163,944,000
東京一番フーズ	2,400	550.00	1,320,000

ダイヤモンドダイニング	3,100	971.00	3,010,100
あい ホールディングス	25,500	2,289.00	58,369,500
ディー・ブイエックス	5,100	1,287.00	6,563,700
きちり	3,900	596.00	2,324,400
アークランドサービスホールディングス	4,500	2,992.00	13,464,000
J.フロント リテイリング	180,900	1,075.00	194,467,500
ドトール・日レスホールディングス	25,100	1,818.00	45,631,800
マツモトキヨシホールディングス	29,500	4,665.00	137,617,500
ブロンコビリー	7,500	3,540.00	26,550,000
スタートトゥデイ	43,500	5,310.00	230,985,000
トレジャー・ファクトリー	4,100	995.00	4,079,500
物語コーポレーション	3,800	5,350.00	20,330,000
ココカラファイン	14,900	4,750.00	70,775,000
三越伊勢丹ホールディングス	284,400	950.00	270,180,000
東洋紡	601,000	205.00	123,205,000
ユニチカ	442,000	59.00	26,078,000
富士紡ホールディングス	74,000	254.00	18,796,000
日清紡ホールディングス	80,400	948.00	76,219,200
倉敷紡績	153,000	175.00	26,775,000
ダイワボウホールディングス	130,000	225.00	29,250,000
シキボウ	94,000	103.00	9,682,000
日東紡績	100,000	366.00	36,600,000
トヨタ紡織	50,700	2,045.00	103,681,500
マクニカ・富士エレホールディングス	25,700	1,052.00	27,036,400
ウエルシアホールディングス	12,400	7,020.00	87,048,000
クリエイトSDホールディングス	21,100	2,656.00	56,041,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,900	999.00	24,875,100
八洲電機	10,800	526.00	5,680,800
UKCホールディングス	9,200	1,558.00	14,333,600
丸善CHIホールディングス	16,900	388.00	6,557,200
OCHIホールディングス	3,300	1,009.00	3,329,700
TOKAIホールディングス	62,900	678.00	42,646,200
ミサワ	1,800	505.00	909,000
エー・ピーカンパニー	2,300	831.00	1,911,300
三洋貿易	7,900	1,181.00	9,329,900
チムニー	3,500	2,816.00	9,856,000
シュッピン	5,400	1,028.00	5,551,200
ウイン・パートナーズ	5,200	1,444.00	7,508,800
ネクステージ	2,200	889.00	1,955,800
ジョイフル本田	23,200	2,369.00	54,960,800
鳥貴族	3,500	2,130.00	7,455,000
麒麟堂ホールディングス	4,600	817.00	3,758,200
ホットランド	5,000	911.00	4,555,000
すかいらく	43,800	1,327.00	58,122,600
綿半ホールディングス	5,400	1,521.00	8,213,400
日本毛織	46,700	717.00	33,483,900
大東紡織	24,000	63.00	1,512,000
トーア紡コーポレーション	6,900	463.00	3,194,700

ガイドーリミテッド	17,500	424.00	7,420,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	47,500	1,002.00	47,595,000
三栄建築設計	5,700	1,087.00	6,195,900
野村不動産ホールディングス	94,800	1,722.00	163,245,600
三重交通グループホールディングス	25,500	361.00	9,205,500
サムティ	10,300	928.00	9,558,400
ディア・ライフ	9,600	313.00	3,004,800
エー・ディー・ワークス	130,000	37.00	4,810,000
日本商業開発	6,300	1,453.00	9,153,900
プレサンスコーポレーション	4,900	3,880.00	19,012,000
ユニゾホールディングス	8,900	3,550.00	31,595,000
日本管理センター	9,400	1,309.00	12,304,600
サンセイランディック	3,300	761.00	2,511,300
エストラスト	2,400	522.00	1,252,800
フージャースホールディングス	19,800	542.00	10,731,600
オープンハウス	20,600	2,621.00	53,992,600
東急不動産ホールディングス	345,900	587.00	203,043,300
飯田グループホールディングス	132,400	2,061.00	272,876,400
ムゲンエステート	4,000	844.00	3,376,000
帝国繊維	15,900	1,350.00	21,465,000
ブックオフコーポレーション	8,300	842.00	6,988,600
日本コークス工業	124,300	61.00	7,582,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,000	974.00	3,896,000
ミタチ産業	3,800	542.00	2,059,600
あさひ	10,600	1,593.00	16,885,800
日本調剤	3,600	4,640.00	16,704,000
コスモス薬品	7,200	20,410.00	146,952,000
シップヘルスケアホールディングス	29,000	3,195.00	92,655,000
トーエル	7,000	797.00	5,579,000
一六堂	3,600	321.00	1,155,600
ソフトクリエイイトホールディングス	6,900	978.00	6,748,200
セブン&アイ・ホールディングス	598,300	4,284.00	2,563,117,200
薬王堂	2,700	5,600.00	15,120,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	38,400	970.00	37,248,000
明治電機工業	4,600	973.00	4,475,800
ツルハホールディングス	32,900	11,820.00	388,878,000
デリカフーズ	3,300	963.00	3,177,900
スターティア	2,600	491.00	1,276,600
サンマルクホールディングス	11,300	3,045.00	34,408,500
フェリシモ	4,200	1,020.00	4,284,000
トリドール	17,500	3,120.00	54,600,000
クスリのアオキ	12,700	4,890.00	62,103,000
帝人	620,000	373.00	231,260,000
東レ	1,101,000	924.00	1,017,324,000
クラレ	239,500	1,244.00	297,938,000
旭化成	947,000	723.60	685,249,200
サカイオーベックス	40,000	138.00	5,520,000
稲葉製作所	8,200	1,373.00	11,258,600

宮地エンジニアリンググループ	47,000	137.00	6,439,000	
トーカロ	10,700	1,783.00	19,078,100	
アルファ	5,300	922.00	4,886,600	
SUMCO	118,700	640.00	75,968,000	
川田テクノロジーズ	2,900	3,320.00	9,628,000	
シーアールイー	1,000	2,566.00	2,566,000	
住江織物	38,000	184.00	6,992,000	
日本フェルト	8,500	459.00	3,901,500	
イチカワ	10,000	257.00	2,570,000	
エコナックホールディングス	46,000	40.00	1,840,000	
日東製網	17,000	162.00	2,754,000	
芦森工業	33,000	160.00	5,280,000	
アツギ	119,000	107.00	12,733,000	
ダイニック	30,000	152.00	4,560,000	
共和レザー	10,000	778.00	7,780,000	
セーレン	37,800	967.00	36,552,600	
東海染工	22,000	115.00	2,530,000	
小松精練	23,400	680.00	15,912,000	
ワコールホールディングス	90,000	1,059.00	95,310,000	
ホギメディカル	9,600	7,200.00	69,120,000	
レナウン	41,300	106.00	4,377,800	
クラウドピア	3,600	503.00	1,810,800	
T S Iホールディングス	67,700	559.00	37,844,300	
T I S	47,400	2,312.00	109,588,800	
ネオス	4,200	581.00	2,440,200	
電算システム	5,000	1,440.00	7,200,000	
グリー	86,800	587.00	50,951,600	
コーエーテックモホールディングス	33,900	1,938.00	65,698,200	
三菱総合研究所	5,600	3,095.00	17,332,000	
ボルテージ	2,800	1,160.00	3,248,000	
電算	1,600	1,965.00	3,144,000	
A G S	2,600	980.00	2,548,000	
ファインデックス	9,400	1,293.00	12,154,200	
ヒト・コミュニケーションズ	3,200	1,877.00	6,006,400	
ブレインパッド	2,100	1,080.00	2,268,000	
K L a b	22,100	743.00	16,420,300	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	9,400	767.00	7,209,800	
イーブクイニシアティブジャパン	3,000	834.00	2,502,000	
ネクソン	137,400	1,523.00	209,260,200	
アイスタイル	21,700	747.00	16,209,900	
エムアップ	3,700	623.00	2,305,100	
エイチーム	7,900	1,930.00	15,247,000	
テクノスジャパン	4,100	2,058.00	8,437,800	
e n i s h	4,500	579.00	2,605,500	
コロプラ	39,800	2,070.00	82,386,000	
モバイルクリエイト	9,300	349.00	3,245,700	
オルトプラス	5,300	348.00	1,844,400	
ブロードリーフ	14,200	959.00	13,617,800	
ハーツユナイテッドグループ	4,300	3,360.00	14,448,000	

メディアドゥ	3,000	1,819.00	5,457,000
ブイキューブ	9,400	781.00	7,341,400
サイバーリンクス	2,200	1,003.00	2,206,600
ディー・エル・イー	3,800	929.00	3,530,200
VOYAGE GROUP	4,800	1,061.00	5,092,800
オブティム	1,200	4,760.00	5,712,000
特種東海製紙	88,000	368.00	32,384,000
ベリサーブ	1,600	3,535.00	5,656,000
ティーガイア	14,200	1,492.00	21,186,400
日本アジアグループ	16,100	410.00	6,601,000
豆蔵ホールディングス	11,300	938.00	10,599,400
テクマトリックス	6,100	2,433.00	14,841,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	333,000	290.00	96,570,000
GMOペイメントゲートウェイ	11,700	5,690.00	66,573,000
ザッパラス	8,400	371.00	3,116,400
インターネットイニシアティブ	23,100	2,105.00	48,625,500
さくらインターネット	9,300	831.00	7,728,300
GMOクラウド	3,200	1,074.00	3,436,800
SRAホールディングス	8,200	2,145.00	17,589,000
MINORIソリューションズ	2,900	853.00	2,473,700
システムインテグレータ	2,000	596.00	1,192,000
朝日ネット	13,400	419.00	5,614,600
コムチュア	2,400	3,600.00	8,640,000
サイバーコム	1,600	828.00	1,324,800
王子ホールディングス	593,000	402.00	238,386,000
日本製紙	78,500	1,852.00	145,382,000
三菱製紙	233,000	68.00	15,844,000
北越紀州製紙	94,100	755.00	71,045,500
中越パルプ工業	60,000	208.00	12,480,000
巴川製紙所	24,000	175.00	4,200,000
大王製紙	67,200	1,173.00	78,825,600
gumi	14,700	848.00	12,465,600
パイブドHD	1,800	976.00	1,756,800
レンゴー	134,000	709.00	95,006,000
トーモク	48,000	299.00	14,352,000
ザ・パック	10,700	2,757.00	29,499,900
昭和電工	101,100	949.00	95,943,900
住友化学	1,117,000	412.00	460,204,000
日本化成	30,000	104.00	3,120,000
住友精化	31,000	621.00	19,251,000
日産化学工業	90,700	3,175.00	287,972,500
ラサ工業	58,000	94.00	5,452,000
クレハ	115,000	366.00	42,090,000
多木化学	8,000	668.00	5,344,000
テイカ	26,000	467.00	12,142,000
石原産業	273,000	62.00	16,926,000
片倉コープアグリ	18,000	197.00	3,546,000
日東エフシー	9,000	837.00	7,533,000
日本曹達	98,000	412.00	40,376,000

東ソー	409,000	456.00	186,504,000
トクヤマ	252,000	299.00	75,348,000
セントラル硝子	164,000	440.00	72,160,000
東亜合成	95,000	990.00	94,050,000
大阪ソーダ	66,000	428.00	28,248,000
関東電化工業	36,000	1,043.00	37,548,000
デンカ	315,000	409.00	128,835,000
イビデン	88,700	1,132.00	100,408,400
信越化学工業	272,200	6,077.00	1,654,159,400
日本カーバイド工業	51,000	138.00	7,038,000
堺化学工業	62,000	271.00	16,802,000
エア・ウォーター	125,000	1,531.00	191,375,000
大陽日酸	116,900	910.00	106,379,000
日本化学工業	56,000	200.00	11,200,000
日本パーカライジング	77,600	1,152.00	89,395,200
高压ガス工業	20,000	656.00	13,120,000
チタン工業	18,000	163.00	2,934,000
四国化成工業	21,000	792.00	16,632,000
戸田工業	30,000	273.00	8,190,000
ステラ ケミファ	7,700	3,480.00	26,796,000
保土谷化学工業	45,000	267.00	12,015,000
日本触媒	22,000	5,950.00	130,900,000
大日精化工業	59,000	422.00	24,898,000
カネカ	205,000	675.00	138,375,000
協和発酵キリン	181,600	1,820.00	330,512,000
三菱瓦斯化学	261,000	513.00	133,893,000
三井化学	644,000	363.00	233,772,000
J S R	142,400	1,371.00	195,230,400
東京応化工業	30,400	2,556.00	77,702,400
大阪有機化学工業	11,000	554.00	6,094,000
三菱ケミカルホールディングス	1,016,600	475.60	483,494,960
日本合成化学工業	35,000	518.00	18,130,000
ダイセル	204,600	1,018.00	208,282,800
住友ベークライト	134,000	469.00	62,846,000
積水化学工業	344,500	1,340.00	461,630,000
日本ゼオン	128,000	650.00	83,200,000
アイカ工業	45,700	2,362.00	107,943,400
宇部興産	812,000	170.00	138,040,000
積水樹脂	23,500	1,520.00	35,720,000
タキロン	36,000	463.00	16,668,000
旭有機材	50,000	192.00	9,600,000
日立化成	75,000	1,879.00	140,925,000
ニチバン	15,000	805.00	12,075,000
リケンテクノス	32,800	424.00	13,907,200
大倉工業	37,000	281.00	10,397,000
積水化成品工業	39,000	305.00	11,895,000
群栄化学工業	41,000	288.00	11,808,000
タイガースポリマー	7,600	489.00	3,716,400
ミライアル	5,500	737.00	4,053,500
ダイキアクシス	2,900	826.00	2,395,400

ダイキョーニシカワ	19,500	1,136.00	22,152,000
日本化薬	99,000	944.00	93,456,000
カーリットホールディングス	14,400	464.00	6,681,600
E P Sホールディングス	18,800	1,284.00	24,139,200
レグス	3,000	698.00	2,094,000
プレステージ・インターナショナル	12,800	1,596.00	20,428,800
フェイス	3,700	1,032.00	3,818,400
アミューズ	8,400	1,819.00	15,279,600
野村総合研究所	100,200	3,595.00	360,219,000
ドリームインキュベータ	5,100	1,948.00	9,934,800
サイバネットシステム	11,600	684.00	7,934,400
クイック	7,800	792.00	6,177,600
T A C	8,200	190.00	1,558,000
C Eホールディングス	1,800	917.00	1,650,600
ケネディクス	203,000	396.00	80,388,000
電通	168,700	4,670.00	787,829,000
インテージホールディングス	7,500	1,640.00	12,300,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,100	391.00	2,776,100
東邦システムサイエンス	4,300	606.00	2,605,800
ぴあ	4,600	2,164.00	9,954,400
イオンファンタジー	5,300	2,838.00	15,041,400
ソースネクスト	7,100	496.00	3,521,600
シーティーエス	4,700	764.00	3,590,800
ネクシィーズグループ	5,400	1,307.00	7,057,800
メディカルシステムネットワーク	16,100	479.00	7,711,900
ティー・ワイ・オー	28,400	188.00	5,339,200
日本精化	12,700	791.00	10,045,700
扶桑化学工業	9,600	1,570.00	15,072,000
A D E K A	74,600	1,201.00	89,594,600
日油	114,000	822.00	93,708,000
ミヨシ油脂	57,000	119.00	6,783,000
新日本理化	24,100	138.00	3,325,800
ハリマ化成グループ	13,100	496.00	6,497,600
花王	408,200	5,898.00	2,407,563,600
第一工業製薬	34,000	325.00	11,050,000
三洋化成工業	48,000	785.00	37,680,000
武田薬品工業	604,500	4,383.00	2,649,523,500
アステラス製薬	1,699,500	1,628.00	2,766,786,000
大日本住友製薬	107,500	1,923.00	206,722,500
塩野義製薬	221,200	5,750.00	1,271,900,000
田辺三菱製薬	176,900	1,847.00	326,734,300
わかもと製薬	7,000	226.00	1,582,000
あすか製薬	19,300	1,830.00	35,319,000
日本新薬	34,800	5,440.00	189,312,000
バイオフェルミン製薬	2,500	2,743.00	6,857,500
中外製薬	151,100	3,800.00	574,180,000
科研製薬	26,200	7,140.00	187,068,000
エーザイ	186,800	5,728.00	1,069,990,400
理研ビタミン	4,800	5,030.00	24,144,000
ロート製薬	74,300	1,540.00	114,422,000

小野薬品工業	344,600	3,977.00	1,370,474,200
久光製薬	47,100	6,230.00	293,433,000
有機合成薬品工業	10,800	224.00	2,419,200
持田製薬	10,400	8,830.00	91,832,000
参天製薬	279,600	1,681.00	470,007,600
扶桑薬品工業	52,000	277.00	14,404,000
日本ケミファ	18,000	445.00	8,010,000
ツムラ	47,800	2,884.00	137,855,200
日医工	35,500	2,092.00	74,266,000
テルモ	222,100	4,630.00	1,028,323,000
みらかホールディングス	38,700	4,615.00	178,600,500
キッセイ薬品工業	26,900	2,087.00	56,140,300
生化学工業	28,200	1,687.00	47,573,400
栄研化学	12,800	2,354.00	30,131,200
日水製薬	6,300	1,129.00	7,112,700
鳥居薬品	10,400	2,428.00	25,251,200
JCRファーマ	11,700	3,115.00	36,445,500
東和薬品	7,000	5,130.00	35,910,000
富士製薬工業	5,000	2,400.00	12,000,000
沢井製薬	25,800	8,030.00	207,174,000
ゼリア新薬工業	31,100	1,608.00	50,008,800
第一三共	510,500	2,638.00	1,346,699,000
キョーリン製薬ホールディングス	40,500	2,105.00	85,252,500
大幸薬品	7,500	1,626.00	12,195,000
ダイト	8,500	2,980.00	25,330,000
大塚ホールディングス	326,300	4,983.00	1,625,952,900
大正製薬ホールディングス	36,500	10,920.00	398,580,000
ペプチドリーム	25,400	5,780.00	146,812,000
大日本塗料	87,000	188.00	16,356,000
日本ペイントホールディングス	117,100	2,437.00	285,372,700
関西ペイント	171,700	2,015.00	345,975,500
神東塗料	11,000	163.00	1,793,000
中国塗料	43,000	633.00	27,219,000
日本特殊塗料	10,700	1,056.00	11,299,200
藤倉化成	20,800	573.00	11,918,400
太陽ホールディングス	11,100	3,110.00	34,521,000
DIC	59,900	2,173.00	130,162,700
サカタインクス	31,000	1,201.00	37,231,000
東洋インキSCホールディングス	150,000	431.00	64,650,000
T&K TOKA	11,000	838.00	9,218,000
アルプス技研	5,600	1,940.00	10,864,000
サニックス	24,400	149.00	3,635,600
ダイオーズ	2,700	956.00	2,581,200
日本空調サービス	14,400	536.00	7,718,400
オリエンタルランド	163,600	6,510.00	1,065,036,000
フォーカスシステムズ	5,600	451.00	2,525,600
ダスキン	38,800	1,736.00	67,356,800
パーク24	72,200	3,445.00	248,729,000
明光ネットワークジャパン	18,800	1,135.00	21,338,000
ファルコホールディングス	6,700	1,343.00	8,998,100

クレスコ	3,200	2,538.00	8,121,600
フジ・メディア・ホールディングス	148,900	1,133.00	168,703,700
秀英予備校	2,900	370.00	1,073,000
田谷	3,000	679.00	2,037,000
ラウンドワン	47,200	825.00	38,940,000
リゾートトラスト	63,500	2,177.00	138,239,500
オービック	49,300	5,700.00	281,010,000
ジャストシステム	26,100	872.00	22,759,200
TDCソフトウェアエンジニアリング	6,400	599.00	3,833,600
ヤフー	1,025,000	459.00	470,475,000
ビー・エム・エル	8,900	4,900.00	43,610,000
ワタベウェディング	4,300	422.00	1,814,600
トレンドマイクロ	69,400	3,625.00	251,575,000
りらいあコミュニケーションズ	25,000	1,048.00	26,200,000
インフォメーション・ディベロブメント	2,900	957.00	2,775,300
リソー教育	28,100	413.00	11,605,300
日本オラクル	22,900	5,660.00	129,614,000
早稲田アカデミー	2,100	848.00	1,780,800
アルファシステムズ	4,700	1,724.00	8,102,800
フューチャー	17,200	781.00	13,433,200
CAC Holdings	10,800	790.00	8,532,000
ソフトバンク・テクノロジー	3,800	1,904.00	7,235,200
トーセ	3,800	629.00	2,390,200
ユー・エス・エス	183,200	1,658.00	303,745,600
オービックビジネスコンサルタント	7,300	4,785.00	34,930,500
伊藤忠テクノソリューションズ	32,400	2,286.00	74,066,400
アイティフォー	18,600	514.00	9,560,400
東京個別指導学院	7,400	649.00	4,802,600
東計電算	2,600	1,789.00	4,651,400
サイバーエージェント	39,800	6,420.00	255,516,000
楽天	708,500	1,105.00	782,892,500
エクスネット	1,500	1,509.00	2,263,500
テー・オー・ダブリュー	12,200	597.00	7,283,400
大塚商会	38,500	4,835.00	186,147,500
総合メディカル	6,900	3,865.00	26,668,500
サイボウズ	19,300	377.00	7,276,100
ソフトブレイン	21,000	495.00	10,395,000
セントラルスポーツ	5,200	2,330.00	12,116,000
パラカ	4,800	1,507.00	7,233,600
電通国際情報サービス	8,800	1,738.00	15,294,400
デジタルガレージ	22,300	2,094.00	46,696,200
イーエムシステムズ	4,900	1,258.00	6,164,200
ウェザーニューズ	4,800	3,205.00	15,384,000
C I J	13,300	458.00	6,091,400
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,375.00	2,062,500
日本エンタープライズ	14,300	290.00	4,147,000
WOWOW	6,800	2,368.00	16,102,400
フュージョンパートナー	8,900	535.00	4,761,500
フルキャストホールディングス	13,900	838.00	11,648,200

富士フイルムホールディングス	347,300	3,888.00	1,350,302,400	
コニカミノルタ	361,800	747.00	270,264,600	
資生堂	288,000	2,934.00	844,992,000	
ライオン	175,000	1,705.00	298,375,000	
高砂香料工業	10,000	2,753.00	27,530,000	
マンダム	14,100	4,845.00	68,314,500	
ミルボン	9,000	4,830.00	43,470,000	
ファンケル	35,300	1,463.00	51,643,900	
コーセー	24,500	8,860.00	217,070,000	
コタ	5,300	1,127.00	5,973,100	
シーズ・ホールディングス	19,100	2,353.00	44,942,300	
シーボン	1,600	2,062.00	3,299,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	15,500	9,750.00	151,125,000	
ノエビアホールディングス	9,600	3,235.00	31,056,000	
アジュバンコスメジャパン	3,100	900.00	2,790,000	
エステー	10,500	1,143.00	12,001,500	
アグロ カネショウ	6,000	1,046.00	6,276,000	
コニシ	23,800	1,313.00	31,249,400	
長谷川香料	19,200	1,825.00	35,040,000	
星光PMC	8,300	1,016.00	8,432,800	
小林製薬	45,900	4,465.00	204,943,500	
荒川化学工業	13,000	939.00	12,207,000	
メック	11,700	864.00	10,108,800	
日本高純度化学	4,400	2,046.00	9,002,400	
タカラバイオ	32,500	1,367.00	44,427,500	
JCU	4,500	3,130.00	14,085,000	
新田ゼラチン	10,300	768.00	7,910,400	
OATアグリオ	1,800	1,253.00	2,255,400	
デクセリアルズ	45,300	719.00	32,570,700	
アース製薬	10,900	5,080.00	55,372,000	
イハラケミカル工業	23,300	988.00	23,020,400	
北興化学工業	16,000	287.00	4,592,000	
大成ラミック	4,300	2,833.00	12,181,900	
クミアイ化学工業	31,200	592.00	18,470,400	
日本農薬	34,700	485.00	16,829,500	
昭和シェル石油	152,600	948.00	144,664,800	
富士興産	5,500	411.00	2,260,500	
ニチレキ	18,800	675.00	12,690,000	
東燃ゼネラル石油	229,000	946.00	216,634,000	
ユシロ化学工業	8,200	1,391.00	11,406,200	
ビービー・カストロール	6,400	1,185.00	7,584,000	
富士石油	35,300	323.00	11,401,900	
MORESCO	4,800	1,123.00	5,390,400	
出光興産	79,200	2,023.00	160,221,600	
JXホールディングス	1,796,700	392.20	704,665,740	
コスモエネルギーホールディングス	45,800	1,205.00	55,189,000	
横浜ゴム	91,500	1,293.00	118,309,500	
東洋ゴム工業	68,600	1,094.00	75,048,400	
ブリヂストン	512,200	3,253.00	1,666,186,600	
住友ゴム工業	142,000	1,360.00	193,120,000	

藤倉ゴム工業	12,800	487.00	6,233,600
オカモト	46,000	1,132.00	52,072,000
アキレス	125,000	133.00	16,625,000
フコク	5,700	736.00	4,195,200
ニッタ	16,300	2,352.00	38,337,600
クリエートメディック	4,900	804.00	3,939,600
住友理工	32,800	804.00	26,371,200
三ツ星ベルト	37,000	813.00	30,081,000
パンドー化学	55,000	494.00	27,170,000
鬼怒川ゴム工業	33,000	776.00	25,608,000
旭硝子	801,000	518.00	414,918,000
日本板硝子	731,000	64.00	46,784,000
石塚硝子	21,000	153.00	3,213,000
有沢製作所	22,400	518.00	11,603,200
日本山村硝子	62,000	156.00	9,672,000
日本電気硝子	313,000	437.00	136,781,000
オハラ	6,200	504.00	3,124,800
住友大阪セメント	301,000	471.00	141,771,000
太平洋セメント	947,000	262.00	248,114,000
デイ・シイ	14,100	360.00	5,076,000
リゾートソリューション	14,000	299.00	4,186,000
日本ヒューム	14,800	546.00	8,080,800
日本コンクリート工業	31,400	293.00	9,200,200
三谷セキサン	7,600	2,088.00	15,868,800
アジアパイルホールディングス	18,900	389.00	7,352,100
東海カーボン	132,000	272.00	35,904,000
日本カーボン	74,000	194.00	14,356,000
東洋炭素	8,500	1,422.00	12,087,000
ノリタケカンパニーリミテド	86,000	238.00	20,468,000
TOTO	111,500	4,115.00	458,822,500
日本碍子	191,600	2,012.00	385,499,200
日本特殊陶業	130,700	1,466.00	191,606,200
ダントーホールディングス	17,000	185.00	3,145,000
MARUWA	5,600	3,095.00	17,332,000
品川リフラクトリーズ	39,000	178.00	6,942,000
黒崎播磨	33,000	241.00	7,953,000
ヨータイ	8,000	275.00	2,200,000
イソライト工業	7,100	189.00	1,341,900
東京窯業	17,000	151.00	2,567,000
ニッカトー	5,500	368.00	2,024,000
フジインコーポレーテッド	13,400	1,531.00	20,515,400
エーアンドエーマテリアル	32,000	79.00	2,528,000
ニチアス	78,000	819.00	63,882,000
新日鐵住金	684,100	1,980.50	1,354,860,050
神戸製鋼所	2,786,000	86.00	239,596,000
中山製鋼所	171,000	50.00	8,550,000
合同製鐵	85,000	157.00	13,345,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	414,600	1,334.50	553,283,700
日新製鋼	69,200	1,289.00	89,198,800

東京製鐵	83,700	600.00	50,220,000
共英製鋼	16,200	1,643.00	26,616,600
大和工業	33,500	2,296.00	76,916,000
東京鐵鋼	32,000	360.00	11,520,000
大阪製鐵	9,600	1,684.00	16,166,400
淀川製鋼所	22,600	2,503.00	56,567,800
東洋鋼鈹	36,200	241.00	8,724,200
丸一鋼管	50,800	3,640.00	184,912,000
モリ工業	21,000	281.00	5,901,000
大同特殊鋼	254,000	370.00	93,980,000
日本高周波鋼業	61,000	66.00	4,026,000
日本冶金工業	111,300	118.00	13,133,400
山陽特殊製鋼	90,000	511.00	45,990,000
愛知製鋼	90,000	465.00	41,850,000
日立金属	173,600	1,001.00	173,773,600
日本金属	41,000	92.00	3,772,000
大平洋金属	106,000	288.00	30,528,000
新日本電工	86,300	156.00	13,462,800
栗本鐵工所	73,000	158.00	11,534,000
虹 技	22,000	148.00	3,256,000
日本鑄鉄管	17,000	136.00	2,312,000
日本製鋼所	251,000	454.00	113,954,000
三菱製鋼	106,000	155.00	16,430,000
日亜鋼業	18,800	218.00	4,098,400
日本精線	10,000	394.00	3,940,000
大紀アルミニウム工業所	24,000	292.00	7,008,000
日本軽金属ホールディングス	343,200	224.00	76,876,800
三井金属鉱業	387,000	186.00	71,982,000
東邦亜鉛	79,000	354.00	27,966,000
三菱マテリアル	946,000	255.00	241,230,000
住友金属鉱山	419,000	1,080.50	452,729,500
DOWAホールディングス	195,000	553.00	107,835,000
古河機械金属	237,000	138.00	32,706,000
エス・サイエンス	65,100	31.00	2,018,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,900	1,274.00	18,982,600
東邦チタニウム	25,700	669.00	17,193,300
UACJ	212,000	261.00	55,332,000
古河電気工業	477,000	251.00	119,727,000
住友電気工業	607,300	1,298.00	788,275,400
フジクラ	211,000	458.00	96,638,000
昭和電線ホールディングス	184,000	57.00	10,488,000
東京特殊電線	2,300	731.00	1,681,300
タツタ電線	31,900	291.00	9,282,900
沖電線	18,000	177.00	3,186,000
カナレ電気	2,400	1,832.00	4,396,800
平河ヒューテック	7,200	844.00	6,076,800
リョービ	92,000	416.00	38,272,000
アールスティ	17,600	702.00	12,355,200
アサヒホールディングス	22,900	1,606.00	36,777,400
東洋製罐グループホールディングス	107,800	2,007.00	216,354,600

ホッカホールディングス	40,000	300.00	12,000,000
コロナ	8,100	1,040.00	8,424,000
横河ブリッジホールディングス	28,800	1,051.00	30,268,800
OSJBホールディングス	33,400	195.00	6,513,000
駒井ハルテック	28,000	195.00	5,460,000
高田機工	12,000	177.00	2,124,000
三和ホールディングス	150,600	956.00	143,973,600
文化シャッター	42,400	805.00	34,132,000
三協立山	20,000	1,519.00	30,380,000
アルインコ	11,500	969.00	11,143,500
東洋シャッター	3,600	507.00	1,825,200
LIXILグループ	211,300	1,694.00	357,942,200
日本フィルコン	10,700	425.00	4,547,500
ノーリツ	29,800	1,846.00	55,010,800
長府製作所	16,200	2,581.00	41,812,200
リンナイ	28,200	9,280.00	261,696,000
ユニプレス	30,000	1,528.00	45,840,000
ダイニチ工業	7,700	604.00	4,650,800
日東精工	20,000	274.00	5,480,000
三洋工業	19,000	167.00	3,173,000
岡部	31,600	739.00	23,352,400
ジーテクト	15,800	1,317.00	20,808,600
中国工業	2,500	672.00	1,680,000
東プレ	29,200	2,201.00	64,269,200
高周波熱錬	28,300	728.00	20,602,400
東京製綱	103,000	155.00	15,965,000
サンコール	8,300	446.00	3,701,800
モリテックスチール	7,500	242.00	1,815,000
パイオラックス	7,700	4,530.00	34,881,000
日本発条	142,700	810.00	115,587,000
中央発條	17,000	278.00	4,726,000
アドバネクス	2,800	1,141.00	3,194,800
三浦工業	67,600	2,310.00	156,156,000
タクマ	56,000	825.00	46,200,000
テクノプロ・ホールディングス	24,500	3,355.00	82,197,500
インターワークス	2,600	1,238.00	3,218,800
Keeper 技研	1,700	1,534.00	2,607,800
ファーストロジック	800	1,760.00	1,408,000
リブセンス	9,900	428.00	4,237,200
ジャパンマテリアル	6,300	4,050.00	25,515,000
ベクトル	4,700	3,070.00	14,429,000
ウチヤマホールディングス	7,700	417.00	3,210,900
サクセスホールディングス	1,500	1,235.00	1,852,500
キャリアリンク	4,000	953.00	3,812,000
IBJ	11,800	626.00	7,386,800
アサンテ	5,600	1,500.00	8,400,000
N・フィールド	7,100	1,750.00	12,425,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	2,196.00	4,172,400
ライドオン・エクスプレス	3,300	1,430.00	4,719,000
ERIホールディングス	4,000	768.00	3,072,000

アビスト	2,300	2,072.00	4,765,600
ウィルグループ	3,300	964.00	3,181,200
日本ビューホテル	2,200	1,270.00	2,794,000
リクルートホールディングス	305,200	3,855.00	1,176,546,000
エラン	1,700	1,352.00	2,298,400
ツガミ	44,000	423.00	18,612,000
オークマ	99,000	677.00	67,023,000
東芝機械	82,000	309.00	25,338,000
アマダホールディングス	221,100	1,010.00	223,311,000
アイダエンジニアリング	39,700	850.00	33,745,000
滝澤鉄工所	48,000	123.00	5,904,000
富士機械製造	49,500	947.00	46,876,500
牧野フライス製作所	75,000	525.00	39,375,000
オーエスジー	69,000	1,583.00	109,227,000
ダイジェット工業	17,000	128.00	2,176,000
旭ダイヤモンド工業	40,800	755.00	30,804,000
D M G 森精機	83,600	984.00	82,262,400
ソディック	38,400	783.00	30,067,200
ディスコ	19,300	9,180.00	177,174,000
日東工器	8,900	2,189.00	19,482,100
パンチ工業	6,000	736.00	4,416,000
日本郵政	445,000	1,229.00	546,905,000
ベルシステム24ホールディングス	29,600	793.00	23,472,800
豊田自動織機	131,900	3,880.00	511,772,000
豊和工業	8,700	527.00	4,584,900
O K K	59,000	95.00	5,605,000
石川製作所	37,000	72.00	2,664,000
東洋機械金属	11,300	352.00	3,977,600
津田駒工業	37,000	116.00	4,292,000
エンシュウ	38,000	57.00	2,166,000
島精機製作所	21,400	1,871.00	40,039,400
N C ホールディングス	4,800	912.00	4,377,600
フリー	3,000	2,650.00	7,950,000
ヤマシンフィルタ	3,100	443.00	1,373,300
日阪製作所	19,200	861.00	16,531,200
やまびこ	27,800	744.00	20,683,200
ベガサスミシン製造	15,700	457.00	7,174,900
ナプテスコ	78,800	2,552.00	201,097,600
三井海洋開発	17,800	1,510.00	26,878,000
レオン自動機	12,800	559.00	7,155,200
S M C	45,500	24,260.00	1,103,830,000
新川	13,600	506.00	6,881,600
ホソカワミクロン	25,000	533.00	13,325,000
ユニオンツール	6,600	2,817.00	18,592,200
オイレス工業	19,600	1,688.00	33,084,800
日精エー・エス・ピー機械	5,300	1,711.00	9,068,300
サトーホールディングス	20,400	2,023.00	41,269,200
日本エアーテック	5,400	627.00	3,385,800
日精樹脂工業	11,000	602.00	6,622,000
オカダアイヨン	3,000	746.00	2,238,000

ワイエイシイ	6,100	1,413.00	8,619,300
小松製作所	743,400	1,860.50	1,383,095,700
住友重機械工業	442,000	441.00	194,922,000
日立建機	67,800	1,460.00	98,988,000
日工	22,000	299.00	6,578,000
巴工業	6,200	1,503.00	9,318,600
井関農機	155,000	224.00	34,720,000
TOWA	14,600	1,069.00	15,607,400
丸山製作所	31,000	160.00	4,960,000
北川鉄工所	70,000	170.00	11,900,000
シンニッタン	13,700	535.00	7,329,500
タカキタ	3,600	514.00	1,850,400
クボタ	728,100	1,328.00	966,916,800
荏原実業	4,700	1,192.00	5,602,400
東洋エンジニアリング	87,000	332.00	28,884,000
三菱化工機	50,000	190.00	9,500,000
月島機械	28,800	989.00	28,483,200
帝国電機製作所	11,100	786.00	8,724,600
東京機械製作所	57,000	36.00	2,052,000
新東工業	34,400	759.00	26,109,600
澁谷工業	12,700	1,775.00	22,542,500
アイチコーポレーション	21,500	713.00	15,329,500
小森コーポレーション	36,900	1,189.00	43,874,100
鶴見製作所	11,300	1,259.00	14,226,700
住友精密工業	24,000	298.00	7,152,000
酒井重工業	30,000	168.00	5,040,000
荏原製作所	335,000	571.00	191,285,000
石井鐵工所	22,000	149.00	3,278,000
西島製作所	16,200	1,082.00	17,528,400
北越工業	16,400	576.00	9,446,400
千代田化工建設	117,000	687.00	80,379,000
ダイキン工業	211,000	8,507.00	1,794,977,000
オルガノ	26,000	387.00	10,062,000
トーヨーカネツ	78,000	203.00	15,834,000
栗田工業	91,100	2,235.00	203,608,500
椿本チエイン	86,000	626.00	53,836,000
大同工業	27,000	193.00	5,211,000
日機装	52,100	672.00	35,011,200
木村化工機	13,100	296.00	3,877,600
新興プランテック	33,300	743.00	24,741,900
アネスト岩田	24,400	919.00	22,423,600
ダイフク	77,900	1,870.00	145,673,000
サムコ	3,700	833.00	3,082,100
加藤製作所	34,000	399.00	13,566,000
油研工業	29,000	170.00	4,930,000
タダノ	69,900	828.00	57,877,200
フジテック	42,200	925.00	39,035,000
CKD	40,300	813.00	32,763,900
キトー	18,300	802.00	14,676,600
平和	44,900	2,071.00	92,987,900

理想科学工業	16,000	1,329.00	21,264,000
SANKYO	40,300	3,885.00	156,565,500
日本金銭機械	13,400	769.00	10,304,600
マースエンジニアリング	8,200	2,127.00	17,441,400
福島工業	9,000	3,265.00	29,385,000
オーイズミ	6,100	363.00	2,214,300
ダイコク電機	6,000	1,488.00	8,928,000
竹内製作所	28,600	1,121.00	32,060,600
アマノ	44,800	1,745.00	78,176,000
JUKI	21,500	816.00	17,544,000
サンデンホールディングス	88,000	273.00	24,024,000
蛇の目ミシン工業	14,100	538.00	7,585,800
ブラザー工業	187,300	1,057.00	197,976,100
マックス	22,000	1,181.00	25,982,000
モリタホールディングス	25,400	1,367.00	34,721,800
グローリー	49,400	2,810.00	138,814,000
新晃工業	10,100	1,111.00	11,221,100
大和冷機工業	23,300	907.00	21,133,100
セガサミーホールディングス	155,700	1,152.00	179,366,400
日本ピストンリング	6,100	1,361.00	8,302,100
リケン	67,000	317.00	21,239,000
T P R	17,800	1,897.00	33,766,600
ツバキ・ナカシマ	17,900	1,102.00	19,725,800
ホシザキ	31,800	9,380.00	298,284,000
大豊工業	11,700	1,061.00	12,413,700
日本精工	297,500	744.00	221,340,000
NTN	359,000	259.00	92,981,000
ジェイテクト	154,400	1,114.00	172,001,600
不二越	134,000	278.00	37,252,000
ミネベア	233,400	652.00	152,176,800
日本トムソン	49,500	304.00	15,048,000
THK	96,300	1,780.00	171,414,000
ユーシン精機	5,600	1,690.00	9,464,000
前澤給装工業	6,200	1,343.00	8,326,600
イーグル工業	17,900	1,159.00	20,746,100
前澤工業	10,700	268.00	2,867,600
日本ピラー工業	14,700	1,008.00	14,817,600
キッツ	64,600	508.00	32,816,800
日立製作所	3,697,000	419.90	1,552,370,300
東芝	3,050,000	285.00	869,250,000
三菱電機	1,546,000	1,170.50	1,809,593,000
富士電機	437,000	426.00	186,162,000
東洋電機製造	29,000	252.00	7,308,000
安川電機	180,000	1,256.00	226,080,000
シンフォニアテクノロジー	94,000	164.00	15,416,000
明電舎	133,000	328.00	43,624,000
オリジン電気	21,000	257.00	5,397,000
山洋電気	38,000	448.00	17,024,000
デンヨー	13,400	1,019.00	13,654,600
日立工機	38,700	593.00	22,949,100

三櫻工業	18,600	532.00	9,895,200
マキタ	94,500	6,450.00	609,525,000
東芝テック	104,000	357.00	37,128,000
芝浦メカトロニクス	24,000	205.00	4,920,000
マブチモーター	40,900	4,065.00	166,258,500
日本電産	174,400	7,438.00	1,297,187,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,700	2,679.00	4,554,300
東光高岳	8,100	1,605.00	13,000,500
ダブル・スコープ	12,500	1,825.00	22,812,500
宮越ホールディングス	4,900	538.00	2,636,200
ダイヘン	85,000	457.00	38,845,000
田淵電機	16,300	351.00	5,721,300
ヤーマン	1,900	2,024.00	3,845,600
JVCケンウッド	106,300	211.00	22,429,300
ミマキエンジニアリング	13,000	434.00	5,642,000
第一精工	6,000	980.00	5,880,000
日新電機	33,900	1,505.00	51,019,500
大崎電気工業	27,000	810.00	21,870,000
オムロン	163,600	3,195.00	522,702,000
日東工業	23,200	1,253.00	29,069,600
I D E C	19,000	920.00	17,480,000
不二電機工業	1,400	1,400.00	1,960,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	279,000	401.00	111,879,000
サクサホールディングス	36,000	185.00	6,660,000
メルコホールディングス	8,000	2,228.00	17,824,000
テクノメディカ	3,200	1,438.00	4,601,600
日本電気	1,992,000	254.00	505,968,000
富士通	1,397,000	361.30	504,736,100
沖電気工業	628,000	131.00	82,268,000
岩崎通信機	69,000	63.00	4,347,000
電気興業	38,000	456.00	17,328,000
サンケン電気	79,000	316.00	24,964,000
ナカヨ	13,000	309.00	4,017,000
アイホン	8,300	1,738.00	14,425,400
ルネサスエレクトロニクス	75,000	549.00	41,175,000
セイコーエプソン	215,700	1,639.00	353,532,300
ワコム	112,400	399.00	44,847,600
アルバック	26,600	2,953.00	78,549,800
アクセル	6,500	685.00	4,452,500
E I Z O	14,300	2,751.00	39,339,300
ジャパンディスプレイ	270,400	186.00	50,294,400
日本信号	39,900	865.00	34,513,500
京三製作所	34,000	356.00	12,104,000
能美防災	16,400	1,427.00	23,402,800
ホーチキ	10,500	1,193.00	12,526,500
エレコム	12,500	2,263.00	28,287,500
日本無線	42,000	267.00	11,214,000
パナソニック	1,655,500	931.10	1,541,436,050
シャープ	1,224,000	106.00	129,744,000
アンリツ	87,000	581.00	50,547,000

富士通ゼネラル	44,000	2,248.00	98,912,000
日立国際電気	33,100	1,618.00	53,555,800
ソニー	1,022,500	3,133.00	3,203,492,500
T D K	87,500	5,540.00	484,750,000
帝国通信工業	35,000	144.00	5,040,000
ミツミ電機	55,100	410.00	22,591,000
タムラ製作所	56,000	291.00	16,296,000
アルプス電気	124,800	1,738.00	216,902,400
池上通信機	46,000	120.00	5,520,000
パイオニア	234,300	172.00	40,299,600
日本電波工業	13,100	862.00	11,292,200
鈴木	5,700	504.00	2,872,800
日本トリム	3,900	7,980.00	31,122,000
ローランド ディー・ジー	7,100	1,859.00	13,198,900
日本コロムビア	5,100	455.00	2,320,500
フォスター電機	18,200	1,666.00	30,321,200
クラリオン	76,000	234.00	17,784,000
S M K	43,000	338.00	14,534,000
ヨコオ	10,500	528.00	5,544,000
ティアック	101,000	34.00	3,434,000
ホシデン	43,900	607.00	26,647,300
ヒロセ電機	23,400	12,390.00	289,926,000
日本航空電子工業	41,000	1,364.00	55,924,000
T O A	17,100	950.00	16,245,000
日立マクセル	24,000	1,366.00	32,784,000
古野電気	17,300	538.00	9,307,400
ユニデンホールディングス	46,000	116.00	5,336,000
アルパイン	34,500	987.00	34,051,500
スミダコーポレーション	11,900	682.00	8,115,800
アイコム	8,100	1,918.00	15,535,800
リオン	5,600	1,392.00	7,795,200
本多通信工業	3,700	726.00	2,686,200
船井電機	14,700	867.00	12,744,900
横河電機	145,000	1,203.00	174,435,000
新電元工業	51,000	328.00	16,728,000
アズビル	47,300	3,055.00	144,501,500
東亜ディーケーケー	8,200	454.00	3,722,800
日本光電工業	60,500	2,976.00	180,048,000
チノー	5,200	1,055.00	5,486,000
共和電業	17,900	319.00	5,710,100
日本電子材料	5,800	402.00	2,331,600
堀場製作所	26,800	4,450.00	119,260,000
アドバンテスト	98,800	1,074.00	106,111,200
小野測器	7,100	857.00	6,084,700
エスベック	15,000	1,237.00	18,555,000
パナソニック デバイスSUNX	12,800	608.00	7,782,400
キーエンス	32,800	72,710.00	2,384,888,000
日置電機	7,600	1,869.00	14,204,400
シスメックス	112,500	7,100.00	798,750,000
日本マイクロニクス	27,000	898.00	24,246,000

メガチップス	14,600	1,124.00	16,410,400
OBARA GROUP	8,500	3,955.00	33,617,500
イマジカ・ロボットホールディングス	12,000	479.00	5,748,000
澤藤電機	8,000	169.00	1,352,000
デンソー	358,000	3,536.00	1,265,888,000
コーセル	20,100	996.00	20,019,600
新日本無線	10,400	354.00	3,681,600
オブテックス	10,700	2,646.00	28,312,200
千代田インテグレ	7,600	1,850.00	14,060,000
アイ・オー・データ機器	4,600	626.00	2,879,600
レーザーテック	17,000	1,330.00	22,610,000
スタンレー電気	103,600	2,201.00	228,023,600
岩崎電気	50,000	131.00	6,550,000
ウシオ電機	87,900	1,193.00	104,864,700
岡谷電機産業	8,000	353.00	2,824,000
ヘリオス テクノホールディング	12,500	341.00	4,262,500
日本セラミック	8,300	1,990.00	16,517,000
遠藤照明	7,400	936.00	6,926,400
日本デジタル研究所	12,300	1,423.00	17,502,900
古河電池	10,000	605.00	6,050,000
双信電機	6,900	263.00	1,814,700
山一電機	12,500	635.00	7,937,500
図研	10,500	877.00	9,208,500
日本電子	57,000	374.00	21,318,000
カシオ計算機	145,200	1,500.00	217,800,000
ファナック	148,300	16,160.00	2,396,528,000
日本シイエムケイ	31,200	406.00	12,667,200
エンプラス	7,400	2,640.00	19,536,000
大真空	27,000	257.00	6,939,000
ローム	70,000	3,875.00	271,250,000
浜松ホトニクス	113,100	2,913.00	329,460,300
三井ハイテック	21,000	627.00	13,167,000
新光電気工業	54,600	490.00	26,754,000
京セラ	237,900	4,824.00	1,147,629,600
協栄産業	20,000	124.00	2,480,000
太陽誘電	70,400	829.00	58,361,600
村田製作所	152,800	10,970.00	1,676,216,000
ユーシン	19,300	634.00	12,236,200
双葉電子工業	23,700	1,917.00	45,432,900
日東電工	117,300	6,565.00	770,074,500
北陸電気工業	59,000	107.00	6,313,000
東海理化電機製作所	42,400	1,437.00	60,928,800
ニチコン	45,600	656.00	29,913,600
日本ケミコン	117,000	126.00	14,742,000
KOA	20,100	725.00	14,572,500
三井造船	561,000	141.00	79,101,000
日立造船	114,900	483.00	55,496,700
三菱重工業	2,580,000	431.00	1,111,980,000
川崎重工業	1,127,000	268.00	302,036,000

I H I	1,113,000	289.00	321,657,000	
名村造船所	43,500	513.00	22,315,500	
サノヤスホールディングス	17,900	168.00	3,007,200	
日本車輛製造	60,000	282.00	16,920,000	
ニチユ三菱フォークリフト	16,800	617.00	10,365,600	
近畿車輛	22,000	259.00	5,698,000	
F P G	51,000	1,045.00	53,295,000	
島根銀行	3,300	1,155.00	3,811,500	
じもとホールディングス	102,700	144.00	14,788,800	
全国保証	37,200	4,010.00	149,172,000	
足利ホールディングス	105,000	321.00	33,705,000	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	19,700	2,154.00	42,433,800	
九州フィナンシャルグループ	218,800	519.00	113,557,200	
かんぽ生命保険	58,200	1,980.00	115,236,000	
ゆうちょ銀行	366,500	1,131.00	414,511,500	
富山第一銀行	36,500	472.00	17,228,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	995,900	404.20	402,542,780	
日産自動車	2,022,200	967.00	1,955,467,400	
いすゞ自動車	419,900	1,292.50	542,720,750	
トヨタ自動車	1,802,200	5,301.00	9,553,462,200	*
日野自動車	206,800	967.00	199,975,600	
三菱自動車工業	575,200	463.00	266,317,600	
エフテック	7,700	904.00	6,960,800	
レシップホールディングス	4,700	802.00	3,769,400	
G M B	2,500	923.00	2,307,500	
ファルテック	2,700	1,155.00	3,118,500	
武蔵精密工業	15,500	1,910.00	29,605,000	
日産車体	70,700	998.00	70,558,600	
新明和工業	63,000	616.00	38,808,000	
極東開発工業	28,900	944.00	27,281,600	
日信工業	32,400	1,300.00	42,120,000	
トピー工業	120,000	209.00	25,080,000	
ティラド	57,000	182.00	10,374,000	
曙ブレーキ工業	73,600	195.00	14,352,000	
タチエス	23,000	1,504.00	34,592,000	
N O K	70,100	1,651.00	115,735,100	
フタバ産業	44,300	453.00	20,067,900	
K Y B	162,000	328.00	53,136,000	
市光工業	35,000	256.00	8,960,000	
大同メタル工業	20,200	1,020.00	20,604,000	
プレス工業	76,900	331.00	25,453,900	
ミクニ	18,600	299.00	5,561,400	
カルソニックカンセイ	111,000	762.00	84,582,000	
太平洋工業	32,200	942.00	30,332,400	
ケーヒン	33,300	1,501.00	49,983,300	
河西工業	17,800	901.00	16,037,800	
アイシン精機	148,500	3,960.00	588,060,000	
富士機工	16,800	293.00	4,922,400	
マツダ	458,800	1,293.00	593,228,400	

ダイハツ工業	172,900	1,377.00	238,083,300
今仙電機製作所	13,300	850.00	11,305,000
本田技研工業	1,304,000	2,576.50	3,359,756,000
スズキ	265,100	2,828.00	749,702,800
富士重工業	457,900	3,489.00	1,597,613,100
安永	4,300	470.00	2,021,000
ヤマハ発動機	204,600	1,488.00	304,444,800
ショーワ	37,500	569.00	21,337,500
小糸製作所	86,800	4,535.00	393,638,000
T B K	17,600	356.00	6,265,600
エクセディ	19,700	2,129.00	41,941,300
ミツバ	24,600	1,029.00	25,313,400
豊田合成	52,600	1,791.00	94,206,600
愛三工業	25,300	647.00	16,369,100
盟和産業	1,800	999.00	1,798,200
ヨロズ	13,500	1,451.00	19,588,500
エフ・シー・シー	23,700	1,687.00	39,981,900
新家工業	30,000	129.00	3,870,000
シマノ	58,400	14,420.00	842,128,000
タカタ	26,200	355.00	9,301,000
テイ・エス テック	33,600	2,433.00	81,748,800
ジャムコ	8,500	1,956.00	16,626,000
小野建	12,500	1,214.00	15,175,000
はるやま商事	6,100	751.00	4,581,100
佐鳥電機	11,400	675.00	7,695,000
カップ・クリエイト	20,100	1,310.00	26,331,000
エコートレーディング	3,800	581.00	2,207,800
伯東	10,900	863.00	9,406,700
コンドーテック	11,500	729.00	8,383,500
中山福	9,200	775.00	7,130,000
ライトオン	10,700	1,352.00	14,466,400
ナガイレーベン	20,600	2,522.00	51,953,200
ジーンズメイト	4,600	167.00	768,200
三菱食品	15,800	2,772.00	43,797,600
良品計画	16,400	22,730.00	372,772,000
三城ホールディングス	18,100	418.00	7,565,800
松田産業	10,500	1,271.00	13,345,500
第一興商	25,300	4,270.00	108,031,000
メディカルホールディングス	143,100	1,602.00	229,246,200
アドヴァン	14,600	867.00	12,658,200
S P K	3,400	1,998.00	6,793,200
萩原電気	4,900	1,888.00	9,251,200
アルビス	3,800	2,138.00	8,124,400
アズワン	11,200	4,265.00	47,768,000
スズデン	4,700	909.00	4,272,300
尾家産業	4,800	898.00	4,310,400
シモジマ	10,000	1,094.00	10,940,000
ドウシシャ	16,800	2,016.00	33,868,800
小津産業	3,200	2,021.00	6,467,200
コナカ	18,300	498.00	9,113,400

高速	8,700	858.00	7,464,600
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,408.00	2,956,800
G - 7ホールディングス	4,200	1,213.00	5,094,600
たけびし	5,200	1,004.00	5,220,800
イオン北海道	10,000	516.00	5,160,000
コジマ	21,400	244.00	5,221,600
ヒマラヤ	4,500	915.00	4,117,500
コーナン商事	20,300	1,995.00	40,498,500
黒田電気	26,600	1,825.00	48,545,000
ネットワンシステムズ	61,900	631.00	39,058,900
エコス	5,500	1,231.00	6,770,500
ワタミ	17,000	1,077.00	18,309,000
マルシェ	3,700	823.00	3,045,100
リックス	3,200	1,660.00	5,312,000
ドンキホーテホールディングス	92,500	3,715.00	343,637,500
丸文	12,700	587.00	7,454,900
西松屋チェーン	28,200	1,583.00	44,640,600
ゼンショーホールディングス	73,600	1,554.00	114,374,400
ハビネット	13,000	838.00	10,894,000
幸楽苑ホールディングス	9,200	1,539.00	14,158,800
ハークスレイ	4,100	968.00	3,968,800
橋本総業ホールディングス	2,600	1,484.00	3,858,400
日本ライフライン	6,900	3,875.00	26,737,500
サイゼリヤ	23,500	1,875.00	44,062,500
エクセル	7,000	1,319.00	9,233,000
V Tホールディングス	48,400	475.00	22,990,000
マルカキカイ	4,600	1,025.00	4,715,000
アルゴグラフィックス	6,600	1,558.00	10,282,800
魚力	4,500	1,394.00	6,273,000
ガリバーインターナショナル	38,400	804.00	30,873,600
日本エム・ディ・エム	11,900	691.00	8,222,900
ポブラ	3,500	488.00	1,708,000
ユナイテッドアローズ	20,400	3,120.00	63,648,000
進和	8,500	1,404.00	11,934,000
エスケイジャパン	3,200	252.00	806,400
ダイトエレクトロン	6,600	569.00	3,755,400
ハイデイ日高	13,000	2,561.00	33,293,000
シークス	9,100	3,395.00	30,894,500
京都きもの友禅	10,000	813.00	8,130,000
コロワイド	47,500	1,900.00	90,250,000
ピーシーデポコーポレーション	15,800	1,442.00	22,783,600
田中商事	4,800	637.00	3,057,600
オーハシテクニカ	8,100	1,148.00	9,298,800
壱番屋	12,900	3,590.00	46,311,000
白銅	4,200	1,087.00	4,565,400
トップカルチャー	5,400	455.00	2,457,000
P L A N T	3,400	1,166.00	3,964,400
スギホールディングス	25,700	5,030.00	129,271,000
島津製作所	186,000	1,397.00	259,842,000
J M S	24,000	279.00	6,696,000

クボテック	3,000	449.00	1,347,000
長野計器	9,000	567.00	5,103,000
ブイ・テクノロジー	3,500	12,070.00	42,245,000
スター精密	27,500	1,085.00	29,837,500
東京計器	46,000	158.00	7,268,000
愛知時計電機	18,000	304.00	5,472,000
オーバル	14,700	230.00	3,381,000
東京精密	28,000	2,283.00	63,924,000
マニー	19,300	1,986.00	38,329,800
ニコン	270,600	1,398.00	378,298,800
トプコン	48,600	970.00	47,142,000
オリンパス	215,800	3,580.00	772,564,000
理研計器	11,700	1,092.00	12,776,400
S C R E E Nホールディングス	149,000	1,101.00	164,049,000
キヤノン電子	13,300	1,412.00	18,779,600
タムロン	11,700	1,337.00	15,642,900
H O Y A	327,700	3,636.00	1,191,517,200
ノーリツ鋼機	13,000	700.00	9,100,000
エー・アンド・デイ	13,200	367.00	4,844,400
キヤノン	780,100	2,882.00	2,248,248,200
リコー	469,200	845.00	396,474,000
シチズンホールディングス	178,300	511.00	91,111,300
リズム時計工業	64,000	181.00	11,584,000
大研医器	11,500	819.00	9,418,500
メニコン	9,700	3,190.00	30,943,000
スノーピーク	1,600	4,385.00	7,016,000
パラマウントベッドホールディングス	15,300	5,040.00	77,112,000
トランザクション	2,900	1,176.00	3,410,400
S H O B I	5,000	401.00	2,005,000
ニホンフラッシュ	5,700	1,192.00	6,794,400
前田工織	14,600	1,045.00	15,257,000
永大産業	19,000	386.00	7,334,000
アートネイチャー	15,500	810.00	12,555,000
ダンロップスポーツ	9,200	940.00	8,648,000
パンダイナムコホールディングス	149,800	2,746.00	411,350,800
アイフィスジャパン	2,400	364.00	873,600
共立印刷	24,500	297.00	7,276,500
S H O E I	6,700	1,535.00	10,284,500
フランスベッドホールディングス	20,300	922.00	18,716,600
マーベラス	24,100	835.00	20,123,500
パイロットコーポレーション	25,300	4,425.00	111,952,500
萩原工業	4,000	2,611.00	10,444,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	26,300	1,155.00	30,376,500
トッパン・フォームズ	25,900	1,080.00	27,972,000
フジシールインターナショナル	17,600	3,770.00	66,352,000
タカラトミー	47,700	931.00	44,408,700
廣済堂	13,700	304.00	4,164,800
アーク	61,200	70.00	4,284,000
レック	4,700	1,878.00	8,826,600

タカノ	6,600	610.00	4,026,000
プロネクサス	13,600	1,018.00	13,844,800
ホクシン	11,900	110.00	1,309,000
ウッドワン	23,000	230.00	5,290,000
大建工業	57,000	335.00	19,095,000
きもと	25,100	151.00	3,790,100
凸版印刷	409,000	879.00	359,511,000
大日本印刷	418,000	1,192.00	498,256,000
図書印刷	27,000	462.00	12,474,000
共同印刷	47,000	324.00	15,228,000
日本写真印刷	24,300	1,809.00	43,958,700
光村印刷	3,000	182.00	546,000
藤森工業	13,000	2,010.00	26,130,000
宝印刷	7,100	1,376.00	9,769,600
前澤化成工業	10,900	1,015.00	11,063,500
アシックス	134,900	1,694.00	228,520,600
ツツミ	7,300	2,014.00	14,702,200
J S P	9,900	1,953.00	19,334,700
ニチハ	20,200	1,596.00	32,239,200
エフピコ	13,500	5,110.00	68,985,000
小松ウオール工業	5,000	1,568.00	7,840,000
ヤマハ	106,500	2,706.00	288,189,000
河合楽器製作所	5,500	1,900.00	10,450,000
クリナップ	17,100	772.00	13,201,200
ピジョン	82,100	2,919.00	239,649,900
天馬	11,300	1,605.00	18,136,500
兼松日産農林	14,000	139.00	1,946,000
キングジム	12,200	843.00	10,284,600
リンテック	34,400	2,023.00	69,591,200
T A S A K I	2,700	1,137.00	3,069,900
信越ポリマー	29,800	607.00	18,088,600
東リ	36,000	296.00	10,656,000
イトーキ	30,500	559.00	17,049,500
任天堂	89,200	20,260.00	1,807,192,000
三菱鉛筆	10,900	4,700.00	51,230,000
松風	7,100	1,373.00	9,748,300
タカラスタンダード	60,000	974.00	58,440,000
コクヨ	75,300	1,398.00	105,269,400
ナカバヤシ	29,000	238.00	6,902,000
ニフコ	29,000	5,320.00	154,280,000
立川ブラインド工業	6,600	696.00	4,593,600
グローブライト	7,100	1,694.00	12,027,400
岡村製作所	50,600	1,001.00	50,650,600
日本バルカー工業	59,000	261.00	15,399,000
M U T O Hホールディングス	17,000	225.00	3,825,000
伊藤忠商事	1,122,200	1,272.50	1,427,999,500
丸紅	1,407,200	478.30	673,063,760
スクロール	21,600	367.00	7,927,200
高島	28,000	157.00	4,396,000
ヨンドシーホールディングス	10,900	1,976.00	21,538,400

三陽商会	85,000	197.00	16,745,000
長瀬産業	86,000	1,125.00	96,750,000
ナイガイ	55,000	41.00	2,255,000
蝶理	9,200	1,343.00	12,355,600
豊田通商	159,300	2,288.00	364,478,400
オンワードホールディングス	98,000	653.00	63,994,000
三共生興	21,900	334.00	7,314,600
兼松	304,000	165.00	50,160,000
美津濃	78,000	481.00	37,518,000
ツカモトコーポレーション	27,000	101.00	2,727,000
ファミリーマート	44,000	6,270.00	275,880,000
ルック	28,000	130.00	3,640,000
三井物産	1,293,200	1,224.00	1,582,876,800
日本紙パルプ商事	75,000	342.00	25,650,000
東京エレクトロン	118,900	8,770.00	1,042,753,000
日立ハイテクノロジーズ	49,600	2,818.00	139,772,800
カメイ	18,600	791.00	14,712,600
東都水産	24,000	156.00	3,744,000
OUGホールディングス	20,000	237.00	4,740,000
スターゼン	5,200	3,980.00	20,696,000
セイコーホールディングス	93,000	305.00	28,365,000
山善	54,900	826.00	45,347,400
椿本興業	15,000	262.00	3,930,000
住友商事	900,200	1,048.50	943,859,700
日本ユニシス	39,500	1,292.00	51,034,000
内田洋行	35,000	470.00	16,450,000
三菱商事	1,073,100	1,846.50	1,981,479,150
第一実業	32,000	459.00	14,688,000
キヤノンマーケティングジャパン	40,800	1,949.00	79,519,200
西華産業	46,000	242.00	11,132,000
佐藤商事	13,100	612.00	8,017,200
菱洋エレクトロ	16,200	1,325.00	21,465,000
東京産業	14,400	345.00	4,968,000
ユアサ商事	13,500	2,231.00	30,118,500
神鋼商事	32,000	166.00	5,312,000
小林産業	9,800	250.00	2,450,000
阪和興業	143,000	560.00	80,080,000
カナデン	13,800	913.00	12,599,400
菱電商事	23,000	624.00	14,352,000
ニプロ	108,000	1,279.00	138,132,000
フルサト工業	7,900	1,272.00	10,048,800
岩谷産業	170,000	588.00	99,960,000
すてきナイスグループ	61,000	135.00	8,235,000
昭光通商	53,000	71.00	3,763,000
ニチモウ	23,000	165.00	3,795,000
極東貿易	21,000	179.00	3,759,000
イワキ	21,000	184.00	3,864,000
兼松エレクトロニクス	9,100	1,848.00	16,816,800
三愛石油	35,000	638.00	22,330,000
稲畑産業	34,300	954.00	32,722,200

G S Iクレオス	38,000	95.00	3,610,000
明和産業	13,300	306.00	4,069,800
キムラタン	588,000	6.00	3,528,000
ゴールドウイン	6,400	4,720.00	30,208,000
ユニ・チャーム	307,300	2,132.50	655,317,250
デサント	34,600	1,112.00	38,475,200
キング	6,900	354.00	2,442,600
ワキタ	30,500	612.00	18,666,000
ヤマトインターナショナル	10,100	388.00	3,918,800
東邦ホールディングス	45,800	2,397.00	109,782,600
サンゲツ	49,800	1,989.00	99,052,200
ミツウロコグループホールディングス	23,300	507.00	11,813,100
シナネンホールディングス	28,000	406.00	11,368,000
伊藤忠エネクス	36,900	975.00	35,977,500
サンリオ	44,100	1,801.00	79,424,100
サンワテクノス	9,200	750.00	6,900,000
リョーサン	22,700	2,463.00	55,910,100
新光商事	16,800	990.00	16,632,000
トーヨー	6,600	2,490.00	16,434,000
三信電気	19,800	861.00	17,047,800
東陽テクニカ	19,500	986.00	19,227,000
モスフードサービス	18,700	2,972.00	55,576,400
加賀電子	12,900	1,217.00	15,699,300
三益半導体工業	11,200	917.00	10,270,400
ソーダニッカ	15,200	457.00	6,946,400
立花エレテック	10,600	1,086.00	11,511,600
木曽路	17,600	2,283.00	40,180,800
サトレストランシステムズ	17,000	815.00	13,855,000
千趣会	28,300	682.00	19,300,600
タカキュー	11,600	177.00	2,053,200
ケーヨー	24,500	528.00	12,936,000
アデランス	25,200	496.00	12,499,200
上新電機	34,000	870.00	29,580,000
日本瓦斯	21,800	2,365.00	51,557,000
ベスト電器	46,900	103.00	4,830,700
ロイヤルホールディングス	23,700	1,872.00	44,366,400
東天紅	10,000	130.00	1,300,000
いなげや	16,000	1,421.00	22,736,000
島忠	37,000	2,139.00	79,143,000
チヨダ	16,800	2,137.00	35,901,600
ライフコーポレーション	9,000	2,664.00	23,976,000
リンガーハット	12,900	2,314.00	29,850,600
さが美	12,000	76.00	912,000
MR MAX	12,400	275.00	3,410,000
テンアライド	13,800	367.00	5,064,600
A O K Iホールディングス	32,600	1,056.00	34,425,600
オークワ	20,000	1,028.00	20,560,000
コメリ	22,000	2,599.00	57,178,000
青山商事	27,400	3,790.00	103,846,000
しまむら	16,600	15,230.00	252,818,000

はせがわ	4,800	419.00	2,011,200
高島屋	208,000	735.00	152,880,000
松屋	28,700	679.00	19,487,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	73,200	1,342.00	98,234,400
近鉄百貨店	55,000	332.00	18,260,000
丸栄	31,000	81.00	2,511,000
ニッセンホールディングス	20,600	92.00	1,895,200
パルコ	13,800	853.00	11,771,400
丸井グループ	175,500	1,507.00	264,478,500
クレディセゾン	108,500	1,670.00	181,195,000
アクシアル リテイリング	11,100	3,545.00	39,349,500
井筒屋	79,000	45.00	3,555,000
イオン	588,500	1,487.50	875,393,750
ユニーグループ・ホールディングス	137,000	865.00	118,505,000
イズミ	28,400	3,905.00	110,902,000
東武ストア	17,000	293.00	4,981,000
フォーバル	7,500	755.00	5,662,500
平和堂	29,000	1,959.00	56,811,000
フジ	15,900	2,368.00	37,651,200
ヤオコー	16,200	4,555.00	73,791,000
ゼビオホールディングス	19,400	1,410.00	27,354,000
ケーズホールディングス	60,400	2,047.00	123,638,800
PALTAC	22,900	2,193.00	50,219,700
三谷産業	15,400	323.00	4,974,200
Olympicグループ	8,600	531.00	4,566,600
日産東京販売ホールディングス	24,200	209.00	5,057,800
新生銀行	1,238,000	144.00	178,272,000
あおぞら銀行	905,000	345.00	312,225,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,474,600	446.50	5,123,408,900
りそなホールディングス	1,673,300	366.50	613,264,450
三井住友トラスト・ホールディングス	2,986,000	306.80	916,104,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,145,100	2,851.00	3,264,680,100
第四銀行	181,000	327.00	59,187,000
北越銀行	155,000	177.00	27,435,000
西日本シティ銀行	465,000	176.00	81,840,000
千葉銀行	551,000	469.00	258,419,000
常陽銀行	517,000	377.00	194,909,000
群馬銀行	317,000	366.00	116,022,000
武蔵野銀行	22,800	2,294.00	52,303,200
千葉興業銀行	39,200	366.00	14,347,200
筑波銀行	59,400	279.00	16,572,600
七十七銀行	224,000	339.00	75,936,000
青森銀行	104,000	285.00	29,640,000
秋田銀行	93,000	316.00	29,388,000
山形銀行	80,000	400.00	32,000,000
岩手銀行	10,000	4,100.00	41,000,000
東邦銀行	128,000	335.00	42,880,000
東北銀行	74,000	145.00	10,730,000
みちのく銀行	72,000	183.00	13,176,000
ふくおかフィナンシャルグループ	618,000	335.00	207,030,000

静岡銀行	419,000	690.00	289,110,000
十六銀行	179,000	267.00	47,793,000
スルガ銀行	135,700	2,226.00	302,068,200
八十二銀行	258,500	444.00	114,774,000
山梨中央銀行	89,000	380.00	33,820,000
大垣共立銀行	191,000	290.00	55,390,000
福井銀行	122,000	227.00	27,694,000
北國銀行	152,000	286.00	43,472,000
清水銀行	4,900	2,255.00	11,049,500
富山銀行	2,700	3,440.00	9,288,000
滋賀銀行	134,000	446.00	59,764,000
南都銀行	138,000	332.00	45,816,000
百五銀行	129,000	353.00	45,537,000
京都銀行	273,000	648.00	176,904,000
紀陽銀行	56,100	1,327.00	74,444,700
三重銀行	64,000	178.00	11,392,000
ほくほくフィナンシャルグループ	972,000	119.00	115,668,000
広島銀行	422,000	337.00	142,214,000
山陰合同銀行	86,000	661.00	56,846,000
中国銀行	101,300	1,037.00	105,048,100
鳥取銀行	46,000	165.00	7,590,000
伊予銀行	152,800	610.00	93,208,000
百十四銀行	157,000	310.00	48,670,000
四国銀行	111,000	201.00	22,311,000
阿波銀行	114,000	538.00	61,332,000
大分銀行	82,000	304.00	24,928,000
宮崎銀行	95,000	246.00	23,370,000
佐賀銀行	87,000	227.00	19,749,000
十八銀行	88,000	244.00	21,472,000
沖縄銀行	13,100	2,990.00	39,169,000
琉球銀行	29,500	1,018.00	30,031,000
セブン銀行	535,500	316.00	169,218,000
みずほフィナンシャルグループ	20,282,100	146.30	2,967,271,230
高知銀行	57,000	102.00	5,814,000
山口フィナンシャルグループ	134,000	943.00	126,362,000
アクリーティブ	11,500	349.00	4,013,500
芙蓉総合リース	16,400	4,295.00	70,438,000
興銀リース	26,900	1,765.00	47,478,500
東京センチュリーリース	33,600	3,315.00	111,384,000
SBIホールディングス	171,700	1,004.00	172,386,800
日本証券金融	63,000	374.00	23,562,000
アイフル	239,400	311.00	74,453,400
日本アジア投資	9,900	308.00	3,049,200
ポケットカード	14,500	485.00	7,032,500
長野銀行	48,000	198.00	9,504,000
名古屋銀行	120,000	316.00	37,920,000
北洋銀行	215,200	272.00	58,534,400
愛知銀行	4,800	4,230.00	20,304,000
第三銀行	82,000	158.00	12,956,000
中京銀行	59,000	233.00	13,747,000

大光銀行	51,000	185.00	9,435,000
愛媛銀行	85,000	225.00	19,125,000
トマト銀行	57,000	140.00	7,980,000
みなと銀行	129,000	153.00	19,737,000
京葉銀行	117,000	388.00	45,396,000
関西アーバン銀行	19,900	911.00	18,128,900
栃木銀行	74,000	347.00	25,678,000
北日本銀行	4,500	2,519.00	11,335,500
東和銀行	268,000	80.00	21,440,000
福島銀行	177,000	89.00	15,753,000
大東銀行	87,000	181.00	15,747,000
リコーリース	11,300	2,572.00	29,063,600
イオンフィナンシャルサービス	93,800	2,211.00	207,391,800
アコム	287,200	481.00	138,143,200
ジャックス	79,000	488.00	38,552,000
オリエントコーポレーション	618,300	185.00	114,385,500
日立キャピタル	33,700	1,785.00	60,154,500
アプラスフィナンシャル	69,000	94.00	6,486,000
オリックス	1,012,700	1,309.50	1,326,130,650
三菱UFJリース	362,700	367.00	133,110,900
ジャフコ	23,900	2,474.00	59,128,600
トモニホールディングス	109,600	332.00	36,387,200
大和証券グループ本社	1,338,000	541.90	725,062,200
野村ホールディングス	2,751,400	373.70	1,028,198,180
岡三証券グループ	122,000	470.00	57,340,000
丸三証券	42,500	858.00	36,465,000
東洋証券	55,000	185.00	10,175,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	163,800	442.00	72,399,600
光世証券	35,000	111.00	3,885,000
水戸証券	44,400	223.00	9,901,200
いちよし証券	32,000	738.00	23,616,000
松井証券	70,100	872.00	61,127,200
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	317,700	2,700.50	857,948,850
だいこう証券ビジネス	7,000	561.00	3,927,000
日本取引所グループ	419,900	1,223.00	513,537,700
マネックスグループ	166,200	233.00	38,724,600
カブドットコム証券	122,200	317.00	38,737,400
極東証券	19,200	1,099.00	21,100,800
岩井コスモホールディングス	13,500	845.00	11,407,500
藍澤證券	26,800	512.00	13,721,600
フィデアホールディングス	116,400	134.00	15,597,600
池田泉州ホールディングス	151,700	384.00	58,252,800
アニコムホールディングス	9,700	2,756.00	26,733,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	427,400	2,554.50	1,091,793,300
マネースクウェアHD	4,900	832.00	4,076,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	137,000	1,073.00	147,001,000

マネーパートナーズグループ	13,300	512.00	6,809,600
小林洋行	4,700	283.00	1,330,100
第一生命保険	916,200	1,061.00	972,088,200
東京海上ホールディングス	579,400	3,450.00	1,998,930,000
イー・ギャランティ	4,700	3,265.00	15,345,500
アサックス	2,500	1,363.00	3,407,500
NECキャピタルソリューション	5,900	1,427.00	8,419,300
T&Dホールディングス	521,200	869.80	453,339,760
三井不動産	758,000	2,161.00	1,638,038,000
三菱地所	1,063,000	1,786.00	1,898,518,000
平和不動産	27,000	1,264.00	34,128,000
東京建物	156,100	1,203.00	187,788,300
ダイビル	36,800	838.00	30,838,400
京阪神ビルディング	23,800	504.00	11,995,200
住友不動産	343,000	2,577.00	883,911,000
太平洋興発	63,000	68.00	4,284,000
大京	265,000	148.00	39,220,000
テオーシー	55,400	828.00	45,871,200
東京楽天地	24,000	473.00	11,352,000
レオパレス21	168,400	721.00	121,416,400
スターツコーポレーション	16,400	1,964.00	32,209,600
フジ住宅	18,400	653.00	12,015,200
空港施設	17,300	480.00	8,304,000
明和地所	7,800	559.00	4,360,200
住友不動産販売	10,300	2,108.00	21,712,400
ゴールドクレスト	11,200	1,508.00	16,889,600
リログループ	5,700	17,020.00	97,014,000
日本エスリード	5,700	1,000.00	5,700,000
日神不動産	19,300	345.00	6,658,500
タカラレーベン	62,300	802.00	49,964,600
サンヨーハウジング名古屋	7,800	906.00	7,066,800
イオンモール	92,200	1,248.00	115,065,600
ファースト住建	5,400	1,194.00	6,447,600
ランド	64,400	20.00	1,288,000
東祥	4,500	4,800.00	21,600,000
トーセイ	21,700	781.00	16,947,700
穴吹興産	16,000	249.00	3,984,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	88,800	1,047.00	92,973,600
サンフロンティア不動産	17,300	996.00	17,230,800
エフ・ジェー・ネクスト	12,600	496.00	6,249,600
ランドビジネス	9,400	241.00	2,265,400
グランディハウス	12,600	324.00	4,082,400
東武鉄道	775,000	576.00	446,400,000
相鉄ホールディングス	248,000	564.00	139,872,000
東京急行電鉄	844,000	878.00	741,032,000
京浜急行電鉄	397,000	1,044.00	414,468,000
小田急電鉄	464,000	1,235.00	573,040,000
京王電鉄	405,000	983.00	398,115,000
京成電鉄	217,000	1,341.00	290,997,000
富士急行	40,000	1,490.00	59,600,000

新京成電鉄	18,000	380.00	6,840,000
東日本旅客鉄道	264,900	9,559.00	2,532,179,100
西日本旅客鉄道	139,500	6,586.00	918,747,000
東海旅客鉄道	129,800	18,810.00	2,441,538,000
西武ホールディングス	153,900	1,602.00	246,547,800
鴻池運輸	20,500	1,076.00	22,058,000
西日本鉄道	188,000	522.00	98,136,000
ハマキョウレックス	11,200	2,000.00	22,400,000
サカイ引越センター	5,700	3,005.00	17,128,500
近鉄グループホールディングス	1,459,000	442.00	644,878,000
阪急阪神ホールディングス	973,000	775.00	754,075,000
南海電気鉄道	326,000	592.00	192,992,000
京阪ホールディングス	325,000	730.00	237,250,000
神戸電鉄	33,000	363.00	11,979,000
名古屋鉄道	528,000	596.00	314,688,000
山陽電気鉄道	52,000	492.00	25,584,000
トランコム	4,200	6,880.00	28,896,000
日本通運	561,000	487.00	273,207,000
ヤマトホールディングス	259,100	2,615.00	677,546,500
山九	191,000	548.00	104,668,000
日新	59,000	300.00	17,700,000
丸運	9,500	241.00	2,289,500
丸全昭和運輸	45,000	376.00	16,920,000
センコー	65,300	627.00	40,943,100
トナミホールディングス	30,000	271.00	8,130,000
ニッコンホールディングス	46,100	1,880.00	86,668,000
日本石油輸送	17,000	222.00	3,774,000
福山通運	88,000	574.00	50,512,000
セイノーホールディングス	102,800	989.00	101,669,200
神奈川中央交通	16,000	606.00	9,696,000
日立物流	30,200	1,697.00	51,249,400
丸和運輸機関	4,300	3,095.00	13,308,500
C & F ロジホールディングス	13,900	1,082.00	15,039,800
日本郵船	1,301,000	177.00	230,277,000
商船三井	705,000	214.00	150,870,000
川崎汽船	634,000	250.00	158,500,000
N S ユナイテッド海運	65,000	123.00	7,995,000
明治海運	13,000	307.00	3,991,000
飯野海運	75,100	374.00	28,087,400
共栄タンカー	12,000	153.00	1,836,000
日本航空	277,400	3,101.00	860,217,400
A N A ホールディングス	2,690,000	284.30	764,767,000
パスコ	13,000	312.00	4,056,000
三菱倉庫	103,000	1,426.00	146,878,000
三井倉庫ホールディングス	84,000	258.00	21,672,000
住友倉庫	106,000	501.00	53,106,000
澁澤倉庫	38,000	277.00	10,526,000
ヤマタネ	68,000	138.00	9,384,000
東陽倉庫	24,000	219.00	5,256,000
乾汽船	11,500	904.00	10,396,000

日本トランスシティ	31,000	356.00	11,036,000
ケイヒン	28,000	131.00	3,668,000
中央倉庫	7,900	906.00	7,157,400
安田倉庫	11,400	598.00	6,817,200
東洋埠頭	43,000	141.00	6,063,000
宇徳	11,400	294.00	3,351,600
上組	173,000	924.00	159,852,000
サンリツ	1,700	494.00	839,800
キムラユニティー	3,900	1,021.00	3,981,900
キューソー流通システム	4,000	2,578.00	10,312,000
郵船ロジスティクス	13,400	989.00	13,252,600
近鉄エクスプレス	25,900	1,276.00	33,048,400
東海運	8,300	257.00	2,133,100
エーアイティー	9,100	860.00	7,826,000
内外トランスライン	5,000	921.00	4,605,000
東京放送ホールディングス	85,700	1,372.00	117,580,400
日本テレビホールディングス	130,500	1,714.00	223,677,000
朝日放送	14,300	617.00	8,823,100
テレビ朝日ホールディングス	39,100	1,645.00	64,319,500
スカパーJ S A Tホールディングス	108,500	442.00	47,957,000
テレビ東京ホールディングス	12,900	1,971.00	25,425,900
日本BS放送	3,300	1,006.00	3,319,800
U - N E X T	4,500	758.00	3,411,000
ワイヤレスゲート	4,200	1,605.00	6,741,000
コネクシオ	12,700	1,409.00	17,894,300
日本通信	101,300	212.00	21,475,600
クロップス	1,400	518.00	725,200
日本電信電話	1,105,500	4,914.00	5,432,427,000
K D D I	1,414,900	3,165.00	4,478,158,500
光通信	17,200	8,720.00	149,984,000
N T T ドコモ	1,068,700	2,841.00	3,036,176,700
エムティーアイ	21,800	661.00	14,409,800
G M O インターネット	52,100	1,084.00	56,476,400
カドカワ	44,700	1,444.00	64,546,800
学研ホールディングス	48,000	257.00	12,336,000
ゼンリン	18,900	1,995.00	37,705,500
昭文社	8,100	538.00	4,357,800
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	1,229,000	411.00	505,119,000
中部電力	443,400	1,457.50	646,255,500
関西電力	591,300	972.10	574,802,730
中国電力	200,300	1,306.00	261,591,800
北陸電力	141,900	1,259.00	178,652,100
東北電力	362,000	1,291.00	467,342,000
四国電力	130,500	1,125.00	146,812,500
九州電力	320,000	919.00	294,080,000
北海道電力	135,600	786.00	106,581,600
沖縄電力	23,100	2,164.00	49,988,400
電源開発	123,500	2,470.00	305,045,000
ファーストエスコ	5,900	717.00	4,230,300

イーレックス	4,400	2,431.00	10,696,400
東京瓦斯	1,617,000	430.50	696,118,500
大阪瓦斯	1,500,000	401.20	601,800,000
東邦瓦斯	365,000	896.00	327,040,000
北海道瓦斯	37,000	279.00	10,323,000
広島ガス	25,600	312.00	7,987,200
西部瓦斯	164,000	242.00	39,688,000
静岡ガス	41,300	743.00	30,685,900
メタウォーター	9,300	2,945.00	27,388,500
アイネット	8,100	1,117.00	9,047,700
松竹	94,000	1,095.00	102,930,000
東宝	102,000	2,770.00	282,540,000
エイチ・アイ・エス	24,700	3,195.00	78,916,500
東映	53,000	939.00	49,767,000
AOI Pro.	7,200	1,098.00	7,905,600
ラックランド	2,200	1,546.00	3,401,200
エヌ・ティ・ティ・データ	88,400	4,910.00	434,044,000
共立メンテナンス	11,400	6,690.00	76,266,000
イチネンホールディングス	15,900	932.00	14,818,800
建設技術研究所	9,000	805.00	7,245,000
スペース	8,300	1,126.00	9,345,800
アインホールディングス	17,200	7,090.00	121,948,000
燦ホールディングス	2,900	1,355.00	3,929,500
ピー・シー・エー	2,000	1,174.00	2,348,000
スバル興業	3,000	387.00	1,161,000
東京テアトル	60,000	115.00	6,900,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	915.00	1,555,500
ナガワ	2,800	3,525.00	9,870,000
よみうりランド	30,000	440.00	13,200,000
東京都競馬	104,000	208.00	21,632,000
常盤興産	57,000	150.00	8,550,000
カナモト	21,100	1,968.00	41,524,800
東京ドーム	121,000	472.00	57,112,000
D T S	15,900	1,940.00	30,846,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,500	3,380.00	204,490,000
シーイーシー	9,300	1,332.00	12,387,600
カブコン	36,600	2,225.00	81,435,000
西尾レントオール	12,200	2,175.00	26,535,000
アイ・エス・ビー	2,300	827.00	1,902,100
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	77,000	34.00	2,618,000
日本空港ビルデング	45,600	3,770.00	171,912,000
トランス・コスモス	17,600	2,974.00	52,342,400
乃村工藝社	32,400	1,654.00	53,589,600
ジャステック	9,200	999.00	9,190,800
S C S K	34,000	3,765.00	128,010,000
藤田観光	55,000	360.00	19,800,000
K N T - C Tホールディングス	73,000	137.00	10,001,000
日本管財	13,000	1,694.00	22,022,000

トーカイ	6,700	3,150.00	21,105,000
白洋舎	500	2,396.00	1,198,000
セコム	157,400	7,662.00	1,205,998,800
日本システムウエア	5,400	1,069.00	5,772,600
セントラル警備保障	6,700	2,098.00	14,056,600
アイネス	20,300	1,030.00	20,909,000
丹青社	28,300	753.00	21,309,900
メイテック	18,300	3,610.00	66,063,000
T K C	13,200	2,762.00	36,458,400
アサツー ディ・ケイ	26,500	2,298.00	60,897,000
富士ソフト	21,200	2,347.00	49,756,400
応用地質	14,300	1,086.00	15,529,800
船井総研ホールディングス	21,100	1,343.00	28,337,300
N S D	30,400	1,660.00	50,464,000
進学会	7,400	491.00	3,633,400
丸紅建材リース	12,000	173.00	2,076,000
オオバ	11,000	394.00	4,334,000
コナミホールディングス	64,600	4,270.00	275,842,000
学究社	2,300	1,150.00	2,645,000
ベネッセホールディングス	50,700	2,447.00	124,062,900
イオンディライト	14,600	2,985.00	43,581,000
ナック	9,300	827.00	7,691,100
福井コンピュータホールディングス	4,100	2,094.00	8,585,400
ニチイ学館	26,400	685.00	18,084,000
ダイセキ	28,400	1,867.00	53,022,800
ステップ	5,200	1,074.00	5,584,800
日鉄住金物産	125,000	342.00	42,750,000
元気寿司	4,000	2,081.00	8,324,000
トラスコ中山	16,300	5,340.00	87,042,000
ヤマダ電機	434,800	555.00	241,314,000
オートバックスセブン	52,900	1,409.00	74,536,100
アークランドサカモト	24,200	1,150.00	27,830,000
ニトリホールディングス	61,800	13,340.00	824,412,000
グルメ杵屋	9,000	971.00	8,739,000
愛眼	10,800	202.00	2,181,600
ケーユーホールディングス	7,600	726.00	5,517,600
吉野家ホールディングス	52,800	1,437.00	75,873,600
加藤産業	22,400	2,416.00	54,118,400
イノテック	13,200	434.00	5,728,800
イエローハット	13,500	2,339.00	31,576,500
松屋フーズ	6,900	2,808.00	19,375,200
J B C Cホールディングス	12,200	659.00	8,039,800
J Kホールディングス	14,800	469.00	6,941,200
サガミチェーン	19,200	1,222.00	23,462,400
日伝	5,900	3,105.00	18,319,500
関西スーパーマーケット	11,700	1,025.00	11,992,500
ミロク情報サービス	10,600	1,461.00	15,486,600
北沢産業	11,000	155.00	1,705,000
杉本商事	8,300	1,161.00	9,636,300
因幡電機産業	20,100	3,490.00	70,149,000

王将フードサービス	10,500	3,855.00	40,477,500	
プレナス	16,000	1,645.00	26,320,000	
ミニストップ	10,600	1,690.00	17,914,000	
アークス	26,800	2,660.00	71,288,000	
パローホールディングス	30,800	2,779.00	85,593,200	
バイテックホールディングス	5,900	1,054.00	6,218,600	
ミスミグループ本社	160,600	1,725.00	277,035,000	
アルテック	12,900	132.00	1,702,800	
ベルク	7,100	4,505.00	31,985,500	
大 庄	7,700	1,549.00	11,927,300	
タキヒヨー	22,000	429.00	9,438,000	
ファーストリテイリング	23,900	26,845.00	641,595,500	
ソフトバンクグループ	810,300	5,678.00	4,600,883,400	
蔵王産業	2,400	1,287.00	3,088,800	
スズケン	65,100	3,165.00	206,041,500	
サンドラッグ	30,200	9,230.00	278,746,000	
サクスパー ホールディングス	13,400	964.00	12,917,600	
ジェコス	9,900	946.00	9,365,400	
ヤマザワ	3,000	1,683.00	5,049,000	
やまや	2,900	1,669.00	4,840,100	
ルネサスイーストン	12,100	400.00	4,840,000	
ペルーナ	35,700	596.00	21,277,200	
合計	239,741,700		269,406,635,500	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,378,512,489	2,669,800,351
国債証券		339,001,056,200	322,571,545,900
地方債証券		27,726,101,297	24,847,419,058
特殊債券		23,820,724,355	21,383,050,814
社債券		21,974,406,920	18,810,793,240
未収利息		1,017,983,517	871,382,620
前払費用		20,720,985	7,312,311
流動資産合計		416,939,505,763	391,161,304,294
資産合計		416,939,505,763	391,161,304,294
負債の部			
流動負債			
未払金		851,602,400	2,553,334,000
未払解約金		227,765,000	203,965,000
流動負債合計		1,079,367,400	2,757,299,000
負債合計		1,079,367,400	2,757,299,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	332,334,674,604	292,253,585,690
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		83,525,463,759	96,150,419,604
元本等合計		415,860,138,363	388,404,005,294
純資産合計		415,860,138,363	388,404,005,294
負債純資産合計		416,939,505,763	391,161,304,294

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28年1月12日現在	平成28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	341,625,978,311円 51,561,686,310円 60,852,990,017円	332,334,674,604円 28,402,466,785円 68,483,555,699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	10,422,340,439円	9,941,134,725円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	179,996,085円	172,180,702円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	134,619,110円	123,653,996円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	58,341,657円	36,694,771円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	441,457,931円	358,912,607円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	110,920,540円	109,095,285円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	19,733,972円	14,849,516円
たわらノーロード 国内債券	145,101,455円	843,892,595円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	- 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>	11,440,979,213円	12,136,230,303円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,607,514,076円	4,455,584,454円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	6,981,550,379円	6,480,666,778円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,859,964,156円	2,577,558,464円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,702,593,088円	1,635,560,673円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,868,821,247円	1,752,431,130円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	277,399,912円	244,957,185円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	116,791,587円	107,376,967円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,431,182,324円	2,232,067,996円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,416,069円	8,622,472円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	238,570,350円	241,882,463円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,177,768円	180,929,656円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	45,802,577円	42,599,566円
投資のソムリエ	7,838,572,612円	8,397,162,509円
クルーズコントロール	909,261,368円	603,930,416円
投資のソムリエ<DC年金>	140,353,064円	193,382,273円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	696,372,772円	830,691,516円
DIAM DC バランス・F(成長型)	48,959,007円	60,028,288円
クルーズコントロール<DC年金>	144,945円	162,357円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,304,061円	1,845,659円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,498,216円	3,267,039円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,924,563円	42,386,066円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	1,164,445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)	31,119,371,814円	31,069,835,454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)	775,948,701円	1,017,679,760円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	627,350,416円	565,187,887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)	1,243,748,653円	487,442,086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)	333,618,744円	263,811,800円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	168,338,894円	120,775,930円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	442,409,232円	308,201,994円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	177,024,127円	134,933,432円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	141,749,531円	100,766,131円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,319,323,771円	8,142,086,582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)	5,433,174,282円	2,882,754,786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)	9,230,597,150円	7,291,850,962円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	4,137,017,580円	3,347,753,977円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	7,238,748,293円	5,855,728,654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)	844,399,916円	726,773,720円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	3,663,128,444円	3,065,894,724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)	5,142,793,879円	4,268,643,026円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	7,021,084,542円	5,825,783,266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)	884,082,241円	839,267,900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)	7,038,621,101円	6,155,191,528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)	7,564,188,784円	6,389,387,464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)	95,566,153,088円	83,661,791,662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)	1,372,854,302円	1,148,667,373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)	8,115,982,356円	7,204,561,225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)	30,286,852,009円	26,346,101,006円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	495,530円	93,379,444円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	41,401,133円	12,695,134円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	27,629,632円	1,771,365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)	33,976,620,681円	29,694,944,222円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	630,558,152円	532,331,561円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	167,965,929円	149,060,577円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	418,821,258円	686,289,506円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	243,744,056円	414,302円

	D I A Mバランス60VA(適格機関 投資家限定)	351,001円	308,265円
計		332,334,674,604円	292,253,585,690円
2.	受益権の総数	332,334,674,604口	292,253,585,690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27年7月14日 至 平成28年1月12日	自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年1月12日現在	平成28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28年1月12日現在	平成28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	7,438,289,000	17,818,346,000
地方債証券	44,591,254	17,098,491
特殊債証券	59,337,796	22,523,087
社債証券	87,441,060	76,252,550
合計	7,336,101,398	17,889,173,954

(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27年2月17日から平成28年1月12日まで及び平成28年2月16日から平成28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28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2513円	1.3290円
(1万口当たり純資産額)	(12,513円)	(13,290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28年7月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 5 5 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,015,090,000	
	3 5 6 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,010,840,000	
	3 5 8 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,509,300,000	
	3 6 1 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,007,370,000	
	3 6 3 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,008,040,000	
	3 6 4 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,512,615,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,529,790,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,326,697,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,240,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,022,020,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,521,780,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,025,140,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,550,155,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,257,330,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,060,160,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,557,645,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,526,850,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,029,340,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,571,235,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,559,430,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,582,665,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,078,240,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,266,368,000	
	1 2 7 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,065,760,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	1,001,964,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,184,820,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,370,056,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,328,296,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,149,939,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,267,144,000	
	8 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,484,170,000	
	9 回 利付国庫債券(40年)	200,000,000	221,632,000	
	2 8 8 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,536,795,000	
	2 8 9 回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,286,048,000	
	2 9 0 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,029,480,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,291,784,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,081,160,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,398,693,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	940,122,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,059,645,000	

303回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,373,359,000
305回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,643,075,000
306回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,598,580,000
308回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	852,688,000
309回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,058,090,000
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,961,308,000
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,354,264,000
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,235,770,000
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,616,790,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,077,200,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,822,247,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,621,920,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,075,730,000
321回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,159,100,000
324回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,606,530,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,686,100,000
326回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,820,564,000
328回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,133,700,000
329回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,842,256,000
330回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,630,215,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,148,380,000
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,151,740,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,479,377,000
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,143,320,000
336回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	536,720,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,372,865,000
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,131,480,000
339回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,200,190,000
340回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,270,640,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,174,840,000
342回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,194,300,000
343回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	519,420,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	140,069,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	135,706,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,696,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	288,864,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	270,164,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	278,194,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	415,302,000
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	393,177,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	519,568,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	411,117,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	406,758,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	714,745,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	290,466,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	582,420,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	288,238,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,169,115,000
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	286,026,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	441,375,000

21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	717,955,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	695,139,400	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	891,060,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	446,460,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	871,362,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	1,034,663,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,359,468,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,215,248,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,659,999,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,496,290,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,335,906,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,821,348,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,894,542,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,818,012,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,918,657,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	2,076,508,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	2,053,590,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,449,380,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,183,928,000	
40回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	1,020,383,000	
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,147,960,000	
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,438,770,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,154,144,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,157,272,000	
45回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,115,872,000	
46回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,398,180,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,713,444,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,511,994,000	
49回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,377,660,000	
50回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,687,378,000	
51回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	211,934,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	624,750,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	419,964,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	761,918,400	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	864,080,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	949,981,800	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	992,205,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	550,965,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,052,828,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	564,280,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	863,483,400	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	670,536,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	621,252,500	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	799,400,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	921,261,600	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,286,098,200	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	686,268,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,105,929,000	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	875,424,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,408,784,000	

64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	700,326,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,289,508,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,236,718,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,529,375,000	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,506,275,000	
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,430,665,600	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,701,896,000	
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,743,741,000	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,703,464,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,724,688,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,730,834,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,513,356,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,506,600,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,625,689,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	871,465,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	1,004,728,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,540,608,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,789,676,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,525,764,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,675,297,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,845,130,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,672,502,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,808,422,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,033,328,000	
111回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,104,384,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,960,695,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,230,706,000	
116回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,396,016,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,306,970,000	
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,151,451,000	
121回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,075,520,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,128,144,000	
125回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,427,858,000	
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	915,061,000	
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,162,818,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,201,568,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,051,584,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,170,612,000	
135回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	1,027,824,000	
137回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,190,246,000	
140回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,067,104,000	
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,459,246,000	
143回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,687,517,000	
145回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,078,272,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,081,840,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,185,758,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,906,335,000	
149回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,674,602,000	
150回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,134,826,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,198,268,000	

	152回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,588,509,000	
	153回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,356,570,000	
	154回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,201,796,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,898,096,000	
	156回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,603,890,000	
	157回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	308,883,000	
国債証券 合計		276,720,000,000	322,571,545,900	
地方債証券	659回 東京都公募公債	203,500,000	209,918,390	
	667回 東京都公募公債	300,000,000	312,717,000	
	680回 東京都公募公債	200,000,000	210,288,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	522,355,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	207,916,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	527,520,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	735,840,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	526,355,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	317,658,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	420,956,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	118,082,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	247,912,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	209,988,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	211,696,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	313,083,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,667,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	312,387,000	
	310回 大阪府公募公債	240,000,000	246,045,600	
	319回 大阪府公募公債	200,000,000	207,768,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	210,778,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	316,785,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	211,462,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	314,046,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	319,098,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	363,118,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	207,312,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	325,365,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	205,727,100	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	208,772,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	211,248,000	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	103,542,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	209,584,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	531,035,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	317,094,000	
	22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	210,660,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	459,654,800	
	23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	211,640,000	
	26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	418,668,000	
	21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	209,726,000	
	25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	210,112,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	209,080,000		
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	313,695,000		
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	211,534,000		

65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,443,000		
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	736,484,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	528,280,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	740,740,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,152,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	530,470,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	736,967,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	525,450,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,350,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	838,453,668		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,650,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,908,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,710,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,245,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,390,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	415,280,000		
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	418,480,000		
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,535,000		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	470,898,000		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	209,826,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	211,222,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	475,231,500		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	424,092,000		
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	307,530,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	210,728,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,454,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	209,424,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	213,138,000		
地方債証券 合計		23,624,400,000	24,847,419,058		
特殊債券	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	205,682,000	
	48回	高速道路機構債	700,000,000	732,018,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	732,256,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	104,668,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,123,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	334,440,000	
	47回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	204,536,000	
	54回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	512,280,000	
	56回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,134,000	
	60回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	732,678,240	
	66回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	167,551,740	
	67回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	416,229,980	

7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	621,330,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	728,385,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,586,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,017,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	422,224,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,048,420,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,975,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	531,430,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	350,997,900	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	519,125,000	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	511,905,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	679,884,870	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,841,940	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	522,745,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,253,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,725,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,484,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,806,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,292,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,419,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	422,180,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	531,630,000	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,065,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	206,864,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	204,784,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,266,000	
6 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,675,000	65,527,179	
8 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	42,768,000	46,196,282	
9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	63,165,000	68,261,783	
2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	67,842,000	73,936,246	
1 3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,429,000	31,011,397	
1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	150,505,000	157,500,472	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,359,000	41,627,483	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,043,000	27,203,710	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	95,312,000	103,580,316	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,726,000	78,753,530	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,505,000	134,659,334	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	224,810,000	244,278,546	

	36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	428,376,000	460,671,266	
	755号 利付商工債	260,000,000	261,328,600	
	い第769号 利付商工債	200,000,000	201,390,000	
	い第779号 利付商工債	200,000,000	201,478,000	
	753号 利附農林債	300,000,000	301,158,000	
	760号 利附農林債	300,000,000	302,556,000	
	764号 利附農林債	500,000,000	504,260,000	
	275回 利附信金中金債	400,000,000	401,500,000	
	282回 利附信金中金債	300,000,000	301,599,000	
	293回 利附信金中金債	400,000,000	402,624,000	
	302回 利附信金中金債	300,000,000	301,854,000	
	186号 利附商工債(3年)	200,000,000	200,592,000	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	309,744,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	208,118,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	526,410,000	
特殊債券 合計		20,538,515,000	21,383,050,814	
社債券	1回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,580,000	
	337回 東京交通債	200,000,000	220,954,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,186,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	312,693,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,492,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	201,740,000	
	3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	103,922,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	105,376,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	104,349,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	201,626,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	105,653,000	
	1回 日本電産社債	100,000,000	100,524,000	
	11回 パナソニック社債	100,000,000	101,823,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	202,806,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	101,981,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	212,880,000	
	16回 トヨタ自動車社債	100,000,000	104,799,000	
	49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	104,543,000	
	66回 伊藤忠商事社債	200,000,000	201,042,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	106,074,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	105,402,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	104,932,000	
	69回 三菱商事社債	300,000,000	311,448,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	105,612,000	
	32回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,806,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	106,899,000	
	140回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,050,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	214,158,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,548,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,260,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	322,362,000	

4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,773,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,047,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,590,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,456,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,329,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	207,530,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	104,827,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,124,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,092,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,196,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	426,728,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,995,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	212,998,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,583,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	214,890,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	211,162,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	102,178,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,394,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,554,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,203,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,280,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	211,042,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	118,136,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	103,051,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	210,166,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,679,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	103,076,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	103,470,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	332,913,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,366,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	355,089,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,820,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	312,729,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,196,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	344,538,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,307,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,465,000	
11回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,544,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	116,962,000	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	212,014,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,902,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	206,204,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	317,511,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	207,962,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	208,506,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	512,450,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	104,249,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	524,020,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	313,755,000	
492回	関西電力社債	200,000,000	202,978,000	

493回	関西電力社債	200,000,000	203,030,000	
377回	中国電力社債	200,000,000	215,224,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	108,915,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	207,234,000	
471回	東北電力社債	200,000,000	215,736,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	307,680,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	104,914,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	213,220,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	205,856,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	215,562,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	426,912,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	205,198,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	170,956,240	
38回	電源開発社債	300,000,000	319,290,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	105,073,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	104,557,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	109,609,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	106,278,000	
社債券 合計		17,861,000,000	18,810,793,240	
合計		338,743,915,000	387,612,809,012	

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。

「DIAMマネーマザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		124,852,663
地方債証券		188,085,083
特殊債券		729,656,920
未収利息		4,607,972
前払費用		91,556
流動資産合計		1,047,294,194
資産合計		1,047,294,194
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,036,129,534
剰余金		
剰余金又は欠損金()		11,164,660
元本等合計		1,047,294,194
純資産合計		1,047,294,194
負債純資産合計		1,047,294,194

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	地方債証券及び特殊債券 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28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	8,435,036,740円
同期中追加設定元本額	991,287,102円
同期中一部解約元本額	8,390,194,308円
元本の内訳	
ファンド名	
クルーズコントロール	990,000,991円
ダイナミック・ナビゲーション	1,286,111円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10,530,000円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<円コース>	1,281,836円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<豪ドルコース>	246,797円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<ブラジルリアルコース>	1,689,581円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<中国元コース>	654,944円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円
D I A M人民元債券ファンド	14,454,114円
ネット証券専用ファンドシリーズ 新興市場日本株 レアル型	103,986円
D I A M グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・通貨選択シリーズ 資源国通貨バスケットコース	4,486,988円
D I A M グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・通貨選択シリーズ ブラジルリアルコース	4,586,699円
D I A M グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・通貨選択シリーズ 円コース	997,109円
D I A M新興国ソブリンファンド（為替ヘッジあり）	99,592円

D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円
D I A M 米国リート・インカムプラス	994,728円
U Sストラテジック・インカム・ファンドAコース(為替ヘッジあり)	993,740円
U Sストラテジック・インカム・ファンドBコース(為替ヘッジなし)	1,987,479円
D I A M - ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<D C年金>	9,935円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)円コース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)米ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)豪ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)メキシコペソコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)トルコリラコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)ブラジルリアルコース	9,925円
U Sストラテジック・インカム・ファンド(年1回決算型)為替ヘッジあり	9,924円
U Sストラテジック・インカム・ファンド(年1回決算型)為替ヘッジなし	9,924円
米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジあり>	9,909円
米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジなし>	9,909円
計	1,036,129,534円
2 . 受益権の総数	1,036,129,534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1月13日 至 平成28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。
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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年7月11日現在
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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
地方債証券	111,026
特殊債券	3,011,500
合計	3,122,526

（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6日から平成28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28年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.0108円
（1万口当たり純資産額）	（10,108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28年7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
地方債証券	639回 東京都公募公債	10,000,000	10,035,600	
	640回 東京都公募公債	10,200,000	10,281,294	
	18回 東京再生都債	3,000,000	3,001,980	
	19年度2回 北海道公募公債	30,000,000	30,488,400	
	24年度4回 京都府公募公債	3,000,000	3,008,910	
	23年度 京都府京都みらい債	5,900,000	5,899,823	
	24年度 京都府京都みらい債	12,000,000	12,013,560	
	25年度 京都府京都みらい債	6,000,000	6,025,020	
	26年度 京都府京都みらい債	9,200,000	9,218,676	
	25年度6回 静岡県公募公債	13,250,000	13,347,255	
	26年度4回 静岡県公募公債	14,810,000	14,903,451	
	23年度2回 あいち県民債	9,900,000	9,916,929	
	23年度7回 福岡県公募公債	7,000,000	7,009,660	
	24年度8回 福岡県公募公債	7,300,000	7,317,885	
	26年度7回 福岡県公募公債	6,500,000	6,522,165	
	25年度1回 ぐんま県民債	4,000,000	4,014,240	
	23年度2回 大阪市みおつくし債	6,500,000	6,510,010	
	24年度1回 大阪市みおつくし債	3,800,000	3,807,486	
	9回 なごやか市民債	5,200,000	5,204,628	
	11回 京都市京都浪漫債	7,040,000	7,048,236	
23年度1回 北九州市公募公債 5年	12,500,000	12,509,875		
地方債証券 合計		187,100,000	188,085,083	
特殊債券	20回政保日本高速道路保有・債務返済機構	30,000,000	30,170,100	
	23回政保日本高速道路保有・債務返済機構	140,000,000	141,139,600	
	34回政保日本高速道路保有・債務返済機構	128,000,000	129,958,400	
	865回 政保公営企業債券	31,000,000	31,015,500	
	866回 政保公営企業債券	45,000,000	45,095,850	
	868回 政保公営企業債券	22,000,000	22,113,520	
	873回 政保公営企業債券	11,000,000	11,131,340	
	877回 政保公営企業債券	19,000,000	19,377,530	
	2回 政保首都高速道路会社債券	15,000,000	15,058,350	
	188回 政保中小企業債券	29,000,000	29,098,310	
	19回 政保国民生活債券	39,000,000	39,300,300	
	6回 政保東日本高速道路債券	21,000,000	21,144,480	
	10回 政保東日本高速道路債券	66,000,000	67,480,380	
	13回 政保中日本高速道路債券	33,000,000	33,493,680	
14回 政保中日本高速道路債券	20,000,000	20,363,400		
2回 政保西日本高速道路債券	29,000,000	29,155,440		

	6回 政保西日本高速道路債券	30,000,000	30,351,300	
	8回 政保西日本高速道路債券	14,000,000	14,209,440	
特殊債券	合計	722,000,000	729,656,920	
	合計	909,100,000	917,742,003	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,843,175,851	2,149,484,159
コール・ローン		99,622,215	555,810,350
株式		239,368,397,850	234,745,691,060
投資信託受益証券		710,818,356	849,632,766
投資証券		5,843,780,192	6,182,483,947
派生商品評価勘定		214,385	157,290,864
未収入金		1,939,313	12,533,139
未収配当金		344,637,908	327,009,097
差入委託証拠金		1,662,902,378	1,743,893,635
流動資産合計		251,875,488,448	246,723,829,017
資産合計		251,875,488,448	246,723,829,017
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		344,558,300	2,775,706
未払金		-	136,523,753
未払解約金		100,968,000	138,690,000
流動負債合計		445,526,300	277,989,459
負債合計		445,526,300	277,989,459
純資産の部			
元本等			
元本	1	97,735,137,391	102,470,324,899
剰余金			
剰余金又は欠損金()		153,694,824,757	143,975,514,659
元本等合計		251,429,962,148	246,445,839,558
純資産合計		251,429,962,148	246,445,839,558
負債純資産合計		251,875,488,448	246,723,829,017

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28年1月12日現在	平成28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	101,093,625,635円	97,735,137,391円
同期中追加設定元本額	10,633,225,942円	15,253,856,269円
同期中一部解約元本額	13,991,714,186円	10,518,668,761円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,152,620,379円	1,860,301,307円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,948,687円	7,070,818円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,286,868円	16,314,685円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	25,891,522円	37,700,196円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	12,127,549円	14,738,824円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	8,505,193円	14,433,689円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	8,744,923円	15,258,200円
たわらノーロード 先進国株式	271,389,618円	1,621,487,264円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	- 円	426,031円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	34,267,965,537円	35,148,925,218円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	156,636,797円	175,410,587円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	836,424,717円	919,847,850円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,060,659,656円	1,122,290,696円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	140,986,314円	145,919,659円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	406,671,520円	406,699,674円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	338,651,848円	343,433,795円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	42,663,525円	45,778,536円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	872,208,370円	951,244,965円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	231,794,603円	231,426,141円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	18,857,253円	23,489,567円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	36,754,707円	49,505,505円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	80,148,275円	95,169,676円

投資のソムリエ	339,757,071円	401,696,368円
クルーズコントロール	159,910,174円	126,776,777円
投資のソムリエ<DC年金>	6,043,950円	9,319,256円
DIAM 8資産バランスファン ドN<DC年金>	53,767,391円	83,698,246円
DIAM DC バランス・F (成長型)	18,740,201円	28,675,864円
クルーズコントロール<DC年 金>	25,159円	34,150円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,464,834円	943,122円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	1,957,062円	1,679,841円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	73,969円	2,039,677円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	575,059円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	251,105,219円	208,719,047円
DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,401,821,371円	3,250,698,975円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	174,358,190円	145,609,101円
DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	- 円	392,381円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	35,597,952円	40,539,307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)	451,682,842円	223,630,974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)	363,764,256円	363,341,022円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	31,437,072円	28,499,478円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	192,853,625円	169,736,421円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	15,423,325円	14,847,320円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	30,887,628円	27,732,262円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	4,160,443,133円	2,989,076,156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)	2,368,277,596円	1,587,774,045円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,005,184,802円	1,003,393,476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)	1,051,917,126円	1,075,482,053円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	3,155,528,740円	3,225,603,207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)	1,233,229,496円	1,334,768,278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)	1,925,332,257円	2,026,788,286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)	1,492,762,853円	1,567,593,129円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	1,018,540,451円	1,067,314,685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)	11,130,233円	12,333,699円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	4,623,912,268円	5,086,524,668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)	1,693,059,024円	1,739,502,696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)	10,410,355,488円	11,521,229,462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)	598,466,354円	632,413,399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)	1,768,131,803円	1,984,726,533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)	6,600,216,428円	7,261,622,463円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	133,759円	32,096,738円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	28,727,295円	11,009,666円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	43,970,103円	3,528,117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)	8,884,320,454円	9,817,602,164円

	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	54,572,307円	113,400,844円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	91,043,052円	187,990円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	273,217円	295,614円
	計	97,735,137,391円	102,470,324,899円
2.	受益権の総数	97,735,137,391口	102,470,324,899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27年7月14日 至 平成28年1月12日	自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年1月12日現在	平成28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28年1月12日現在	平成28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	25,905,428,686	24,559,598,481
投資信託受益証券	62,123,082	98,471,569
投資証券	342,241,526	1,013,874,167
合計	26,309,793,294	25,671,944,217

(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27年2月17日から平成28年1月12日まで及び平成28年2月16日から平成28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28年1月12日 現在				平成28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	122,124,485	-	121,910,100	214,385	-	-	-	-
アメリカ・ドル	67,145,430	-	67,140,300	5,130	-	-	-	-
イギリス・bond	15,445,830	-	15,427,800	18,030	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	2,473,620	-	2,473,200	420	-	-	-	-
カナダ・ドル	7,493,510	-	7,461,000	32,510	-	-	-	-
ユーロ	29,566,095	-	29,407,800	158,295	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,051,156,245	-	1,050,283,100	873,145
アメリカ・ドル	-	-	-	-	733,254,870	-	732,816,000	438,870
イギリス・bond	-	-	-	-	78,270,828	-	78,228,000	42,828
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	26,649,000	-	26,645,500	3,500
カナダ・ドル	-	-	-	-	42,537,180	-	42,427,000	110,180
ユーロ	-	-	-	-	170,444,367	-	170,166,600	277,767
合計	122,124,485	-	121,910,100	214,385	1,051,156,245	-	1,050,283,100	873,145

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

株式関連

種類	平成28年1月12日 現在				平成28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	5,666,776,185	-	5,322,217,885	344,558,300	5,077,497,639	-	5,232,885,942	155,388,303
合計	5,666,776,185	-	5,322,217,885	344,558,300	5,077,497,639	-	5,232,885,942	155,388,303

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
1口当たり純資産額	2,5726円	2,4050円
(1万口当たり純資産額)	(25,726円)	(24,050円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28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	32,610	745.810	24,320,864.100	
	ABBOTT LABORATORIES	120,265	41.890	5,037,900.850	
	AES CORP	56,133	12.320	691,558.560	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,310	154.460	11,477,922.600	
	ADOBE SYSTEMS INC	40,633	96.790	3,932,868.070	
	CHUBB LTD	37,498	130.240	4,883,739.520	
	AGCO CORP	5,610	47.700	267,597.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,700	144.350	2,410,645.000	
	ALLEGHANY CORP	1,288	547.560	705,257.280	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	71,019	63.690	4,523,200.110	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	93.250	438,554.750	
	ALLSTATE CORP	31,687	69.660	2,207,316.420	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,479	118.840	7,068,484.360	
	ALCOA INC	102,779	9.820	1,009,289.780	
	AMGEN INC	61,335	161.100	9,881,068.500	
	HESS CORP	22,862	56.810	1,298,790.220	
	AMERICAN EXPRESS CO	66,973	61.490	4,118,169.770	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,743	70.710	2,810,227.530	
	AFLAC INC	34,563	72.490	2,505,471.870	
	AMERICAN INTL GROUP	93,598	53.010	4,961,629.980	
	AMERCO	551	385.730	212,537.230	
	ANALOG DEVICES	24,925	57.740	1,439,169.500	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	55.910	2,292,477.730	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,216	124.420	2,266,434.720	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	34,678	42.770	1,483,178.060	
	TIME WARNER	64,493	77.960	5,027,874.280	
	JONES LANG LASALLE INC	3,815	99.700	380,355.500	
	VALERO ENERGY CORP	37,999	47.730	1,813,692.270	
	APACHE CORP	30,532	55.170	1,684,450.440	
	ANSYS INC	7,266	91.420	664,257.720	
	APPLE INC	451,881	96.680	43,687,855.080	
	APPLIED MATERIALS INC	92,239	24.930	2,299,518.270	
	ALBEMARLE CORP	9,134	83.580	763,419.720	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,497	43.480	2,108,649.560		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	81.170	759,751.200		
AMEREN CORP	19,716	53.150	1,047,905.400		

ARROW ELECTRONICS INC	7,403	63.280	468,461.840	
ASHLAND INC	5,128	117.910	604,642.480	
AUTOLIV INC	7,327	107.300	786,187.100	
AUTODESK INC	16,207	55.140	893,653.980	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,290	94.470	3,522,786.300	
AUTOZONE INC	2,471	815.020	2,013,914.420	
AVERY DENNISON CORP	7,368	73.300	540,074.400	
AVNET INC	10,288	41.250	424,380.000	
BAKER HUGHES INC	33,914	43.690	1,481,702.660	
BALL CORP	13,539	71.620	969,663.180	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	97,101	143.650	13,948,558.650	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	88,010	38.490	3,387,504.900	
CR BARD INC	5,892	239.000	1,408,188.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	40,198	46.650	1,875,236.700	
BED BATH & BEYOND INC	13,962	44.460	620,750.520	
BECTON DICKINSON & CO	17,278	175.640	3,034,707.920	
AMETEK INC	19,168	45.840	878,661.120	
BE AEROSPACE INC	8,229	45.620	375,406.980	
VERIZON COMM INC	331,408	55.900	18,525,707.200	
WR BERKLEY CORP	8,134	59.180	481,370.120	
BEST BUY CO INC	23,778	30.950	735,929.100	
YUM! BRANDS INC	32,791	85.760	2,812,156.160	
FIRSTENERGY CORP	34,261	36.020	1,234,081.220	
H&R BLOCK INC	20,906	23.590	493,172.540	
BOEING CO	51,296	130.090	6,673,096.640	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	38.660	419,306.360	
BORGWARNER INC	17,824	30.570	544,879.680	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,273	23.900	2,587,724.700	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	74.430	862,792.560	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	373.030	821,785.090	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	136,079	75.280	10,244,027.120	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,537	138.850	629,962.450	
INGREDION INC	6,148	132.400	813,995.200	
ONEOK INC	16,401	47.360	776,751.360	
UNITED RENTALS INC	7,795	67.440	525,694.800	
SEMPRA ENERGY	19,256	114.110	2,197,302.160	
FEDEX CORP	21,336	156.220	3,333,109.920	
VERISIGN INC	8,114	85.600	694,558.400	
AMPHENOL CORP	25,425	57.360	1,458,378.000	
BROWN-FORMAN CORP	9,485	98.270	932,090.950	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,735	52.730	1,304,276.550	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	179,873	4.120	741,076.760	

CSX CORP	77,703	26.530	2,061,460.590	
CABOT OIL & GAS CORP	38,049	25.440	967,966.560	
CAMPBELL SOUP CO	16,224	67.100	1,088,630.400	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	24.010	557,968.390	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,266	165.990	2,368,013.340	
CARDINAL HEALTH INC	26,820	80.380	2,155,791.600	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	33,738	44.520	1,502,015.760	
CATERPILLAR INC	47,406	77.370	3,667,802.220	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	11,333	83.150	942,338.950	
CELGENE CORP	63,803	105.030	6,701,229.090	
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	121.060	437,268.720	
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	83.540	1,043,414.600	
CENTURYLINK INC	44,114	30.220	1,333,125.080	
CERNER CORP	25,633	60.620	1,553,872.460	
JPMORGAN CHASE & CO	298,701	61.830	18,468,682.830	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,603	101.300	1,074,083.900	
CIGNA CORP	20,878	129.600	2,705,788.800	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,667	75.700	958,891.900	
CINTAS CORP	7,454	99.630	742,642.020	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	96,233	4.970	478,278.010	
CISCO SYSTEMS INC	410,147	29.260	12,000,901.220	
CLOROX COMPANY	10,463	138.370	1,447,765.310	
COCA-COLA CO/THE	334,562	45.380	15,182,423.560	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,859	74.250	5,112,780.750	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	16,501	69.850	1,152,594.850	
COMERICA INC	13,912	41.500	577,348.000	
NRG ENERGY, INC.	23,703	15.070	357,204.210	
COMCAST CORP-CL A	198,378	67.110	13,313,147.580	
CA INC	26,267	33.770	887,036.590	
CONAGRA FOODS INC	34,323	48.300	1,657,800.900	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,660	80.380	1,901,790.800	
CMS ENERGY CORP	22,372	45.510	1,018,149.720	
COOPER COS INC	3,794	181.830	689,863.020	
MOLSON COORS BREWING CO	15,273	102.560	1,566,398.880	
CORNING INC	91,502	20.910	1,913,306.820	
WR GRACE & CO	5,923	74.220	439,605.060	
SEALED AIR CORP	16,041	47.030	754,408.230	
CUMMINS INC	13,365	114.700	1,532,965.500	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	149.720	990,996.680	
DR HORTON INC	28,738	33.820	971,919.160	
DANAHER CORP	50,365	80.860	4,072,513.900	
MOODY'S CORP	14,180	96.730	1,371,631.400	

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	49,733	57.930	2,881,032.690	
TARGET CORP	46,606	71.310	3,323,473.860	
DEERE & CO	21,801	80.970	1,765,226.970	
MORGAN STANLEY	120,099	26.370	3,167,010.630	
REPUBLIC SERVICES INC	19,564	52.560	1,028,283.840	
THE WALT DISNEY CO	126,416	99.620	12,593,561.920	
DOLLAR TREE INC	19,144	95.080	1,820,211.520	
DOVER CORP	12,592	70.340	885,721.280	
DOW CHEMICAL	90,943	49.400	4,492,584.200	
OMNICOM GROUP	19,736	83.120	1,640,456.320	
DTE ENERGY CO	14,532	99.140	1,440,702.480	
XL GROUP PLC	24,408	33.010	805,708.080	
DUKE ENERGY CORP	55,845	86.010	4,803,228.450	
FLOWSERVE CORP	10,787	45.790	493,936.730	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	62.030	585,315.080	
EBAY INC	91,609	24.610	2,254,497.490	
EMC CORP/MASS	158,979	27.510	4,373,512.290	
BANK OF AMERICA CORP	840,771	13.170	11,072,954.070	
CITIGROUP INC	239,976	41.980	10,074,192.480	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,077	68.520	827,516.040	
E*TRADE FINANCIAL CORP	22,307	23.590	526,222.130	
EATON CORP PLC	36,973	61.920	2,289,368.160	
EATON VANCE CORP	9,184	35.320	324,378.880	
CADENCE DESIGN SYS INC	25,316	25.050	634,165.800	
DISH NETWORK CORP	18,138	51.850	940,455.300	
ECOLAB INC	21,802	119.200	2,598,798.400	
ELECTRONIC ARTS INC	25,227	78.260	1,974,265.020	
SALESFORCE.COM INC	51,470	80.890	4,163,408.300	
EMERSON ELECTRIC CO	52,422	53.440	2,801,431.680	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	80.000	657,680.000	
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	5.360	377,558.400	
ENERGY CORP	13,984	80.880	1,131,025.920	
EOG RESOURCES INC	44,568	82.540	3,678,642.720	
EQUIFAX INC	9,656	132.240	1,276,909.440	
EQT CORP	13,874	77.680	1,077,732.320	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,994	93.010	1,673,621.940	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	49.920	712,807.680	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	54,542	77.920	4,249,912.640	
EXXON MOBIL CORP	338,336	93.540	31,647,949.440	
FMC CORP	10,694	46.480	497,057.120	
NEXTERA ENERGY INC	37,378	129.930	4,856,523.540	
ASSURANT INC	4,960	86.430	428,692.800	
FASTENAL CO	24,929	45.230	1,127,538.670	
FIFTH THIRD BANCORP	63,684	17.250	1,098,549.000	
M&T BANK CORP	11,736	115.940	1,360,671.840	
FISERV INC	18,159	109.690	1,991,860.710	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	31.800	369,611.400	

MACY'S INC	24,512	34.360	842,232.320	
FORD MOTOR CO	302,025	13.090	3,953,507.250	
FRANKLIN RESOURCES INC	31,936	33.980	1,085,185.280	
FREEPORT-MCMORAN INC	96,812	11.200	1,084,294.400	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	12.530	555,868.390	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,684	48.700	715,110.800	
TEGNA INC	16,963	23.640	401,005.320	
GAP INC/THE	18,295	22.700	415,296.500	
DENTSPLY SIRONA INC	19,774	63.390	1,253,473.860	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,588	140.480	3,032,682.240	
GENERAL MILLS INC	47,773	72.460	3,461,631.580	
GENUINE PARTS CO	12,418	104.970	1,303,517.460	
GILEAD SCIENCES INC	111,467	86.550	9,647,468.850	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	13,585	76.700	1,041,969.500	
GARTNER INC	6,829	98.330	671,495.570	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22,038	26.530	584,668.140	
MCKESSON CORP	18,670	192.790	3,599,389.300	
NVIDIA CORP	43,025	50.850	2,187,821.250	
GENERAL ELECTRIC CO	759,940	32.200	24,470,068.000	
WW GRAINGER INC	5,060	230.470	1,166,178.200	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	15.850	352,440.600	
HALLIBURTON CO	69,769	45.030	3,141,698.070	
MONSTER BEVERAGE CORP	10,850	161.500	1,752,275.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	31,041	150.380	4,667,945.580	
HARLEY-DAVIDSON INC	14,799	48.730	721,155.270	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,679	73.750	418,826.250	
HARRIS CORP	10,390	84.200	874,838.000	
HASBRO INC	8,909	84.710	754,681.390	
HENRY SCHEIN INC	6,731	180.720	1,216,426.320	
HELMERICH & PAYNE INC	8,757	66.450	581,902.650	
HERSHEY FOODS CORP	12,284	110.700	1,359,838.800	
HP INC	140,131	13.080	1,832,913.480	
F5 NETWORKS INC	5,809	117.130	680,408.170	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,481	51.680	593,338.080	
REYNOLDS AMERICAN INC	69,489	53.130	3,691,950.570	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	114.410	1,186,317.290	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	111.160	383,168.520	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	22.660	628,588.400	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	22.720	315,535.360	
HOLOGIC INC	21,078	35.930	757,332.540	
UNUM GROUP	19,263	31.200	601,005.600	
HOME DEPOT INC	103,213	134.340	13,865,634.420	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	91.490	1,179,031.630	
HORMEL FOODS CORP	23,322	36.610	853,818.420	

CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	23.900	763,652.800	
HUMANA INC	12,124	158.150	1,917,410.600	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,455	85.000	633,675.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	65,555	8.720	571,639.600	
RED HAT INC	15,033	72.690	1,092,748.770	
BIOGEN INC	17,854	251.300	4,486,710.200	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,648	108.360	2,887,577.280	
INTUIT INC	19,960	115.480	2,304,980.800	
IDEXX LABORATORIES INC	7,050	94.960	669,468.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	9,222	25.360	233,869.920	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	65.740	1,384,681.620	
INTEL CORP	385,003	34.000	13,090,102.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,594	129.530	854,120.820	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,350	42.750	1,340,212.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,502	23.730	795,002.460	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,014	51.250	513,217.500	
INCYTE CORP	13,436	85.700	1,151,465.200	
JOHNSON & JOHNSON	224,831	122.850	27,620,488.350	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	32,350	43.580	1,409,813.000	
JOHNSON CONTROLS INC	53,180	43.840	2,331,411.200	
KLA-TENCOR CORP	14,558	73.750	1,073,652.500	
DEVON ENERGY CORP	37,258	37.580	1,400,155.640	
WESTAR ENERGY INC	13,569	56.420	765,562.980	
KELLOGG CO	20,813	82.640	1,719,986.320	
KEYCORP	67,971	11.090	753,798.390	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,291	135.960	3,982,404.360	
BLACKROCK INC/NEW YORK	10,074	345.200	3,477,544.800	
KOHL'S CORP	14,862	39.290	583,927.980	
KROGER CO	75,423	37.860	2,855,514.780	
LAM RESEARCH CORP	12,756	84.880	1,082,729.280	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,455	70.140	522,893.700	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	56.380	810,011.460	
LEGGETT & PLATT INC	12,274	52.030	638,616.220	
LENNAR CORP	14,850	49.160	730,026.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	27,535	17.460	480,761.100	
ELI LILLY & CO	81,196	79.660	6,468,073.360	
L BRANDS INC	20,102	69.180	1,390,656.360	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,990	38.880	738,331.200	
LINEAR TECH CORP	19,803	47.310	936,879.930	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	56,159	109.520	6,150,533.680	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,930	45.480	1,224,776.400	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,285	251.900	5,613,591.500	
LOEWS CORP	23,670	40.780	965,262.600	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	44.130	604,448.610	
LOWE'S COS INC	74,150	82.340	6,105,511.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	48,462	78.190	3,789,243.780	
SCANA CORP	10,902	75.080	818,522.160	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,882	22.960	846,810.720	
MCCORMICK & CO INC	9,163	106.960	980,074.480	
MCDONALD'S CORPORATION	73,194	121.310	8,879,164.140	
S&P GLOBAL INC	21,416	108.870	2,331,559.920	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	181.720	594,587.840	
MANPOWERGROUP INC	5,703	62.850	358,433.550	
MARKEL CORPORATION	1,153	947.530	1,092,502.090	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,461	104.720	1,828,515.920	
MARSH & MCLENNAN COS	42,209	67.170	2,835,178.530	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,542	87.480	484,814.160	
MASCO CORP	27,299	32.220	879,573.780	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,004	196.700	984,286.800	
MATTEL INC	27,746	32.620	905,074.520	
METLIFE INC	75,917	39.200	2,975,946.400	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,577	36.880	869,519.760	
MEDTRONIC PLC	114,490	88.360	10,116,336.400	
ACTIVISION BLIZZARD INC	46,881	41.290	1,935,716.490	
CVS HEALTH CORP	89,460	96.740	8,654,360.400	
MERCK & CO. INC.	226,173	59.350	13,423,367.550	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,362	135.300	1,131,378.600	
MICROSOFT CORP	612,102	52.300	32,012,934.600	
MICRON TECH INC	83,952	12.620	1,059,474.240	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,192	51.870	891,749.040	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,922	10.000	349,220.000	
3M CO	49,264	177.120	8,725,639.680	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,366	194.200	1,042,077.200	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,882	66.380	855,107.160	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,789	90.200	792,767.800	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	30.660	381,502.380	
ENDO INTERNATIONAL PLC	16,587	17.420	288,945.540	
MYLAN NV	33,285	44.540	1,482,513.900	
ILLUMINA INC	12,052	141.250	1,702,345.000	
XCEL ENERGY INC	40,991	44.590	1,827,788.690	

NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,520	32.590	994,646.800	
NETAPP INC	24,525	24.540	601,843.500	
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,400	43.820	718,648.000	
NEWELL BRANDS INC	36,046	48.860	1,761,207.560	
DUN & BRADSTREET CORP	3,012	123.820	372,945.840	
NEWMONT MINING CORP	46,504	41.140	1,913,174.560	
NIKE INC-CL B	110,012	56.720	6,239,880.640	
NOBLE ENERGY INC	34,645	35.980	1,246,527.100	
NORDSTROM INC	11,509	40.320	464,042.880	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,311	86.420	2,100,956.620	
EVERSOURCE ENERGY	25,660	59.570	1,528,566.200	
NISOURCE INC	28,245	26.130	738,041.850	
COACH INC	22,645	41.560	941,126.200	
NORTHERN TRUST CORP	17,585	64.530	1,134,760.050	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,964	221.970	3,099,589.080	
WELLS FARGO & CO	392,807	47.790	18,772,246.530	
NUCOR CORP	26,212	53.190	1,394,216.280	
MONSANTO CO	35,889	102.680	3,685,082.520	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	37.660	599,810.820	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,426	64.710	2,745,386.460	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,134	76.130	4,730,261.420	
OGE ENERGY CORP	16,028	32.260	517,063.280	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,954	280.610	2,231,971.940	
ORACLE CORP	256,550	40.870	10,485,198.500	
PACCAR INC	28,571	52.120	1,489,120.520	
EXELON CORP	74,581	36.110	2,693,119.910	
PARKER HANNIFIN CORP	10,973	111.330	1,221,624.090	
PATTERSON COS INC	7,169	49.830	357,231.270	
PAYCHEX INC	25,896	61.330	1,588,201.680	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	53.980	459,855.620	
MEDNAX INC	7,824	75.980	594,467.520	
PPL CORPORATION	54,358	37.460	2,036,250.680	
PEPSICO INC	117,564	108.270	12,728,654.280	
PENTAIR PLC	13,787	61.430	846,935.410	
PFIZER INC	503,036	36.120	18,169,660.320	
CONOCOPHILLIPS	100,343	42.300	4,244,508.900	
PVH CORP	6,682	97.320	650,292.240	
PG&E CORP	39,914	64.830	2,587,624.620	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,440	153.720	2,065,996.800	
ALTRIA GROUP INC	159,109	69.830	11,110,581.470	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,768	80.620	3,286,716.160	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	85.230	427,002.300	
GARMIN LTD	9,959	43.370	431,921.830	

AETNA INC	28,172	117.000	3,296,124.000	
FLUOR CORP (NEW)	11,793	51.570	608,165.010	
PPG INDUSTRIES INC	21,973	106.320	2,336,169.360	
PRAXAIR INC	23,235	114.740	2,665,983.900	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,817	165.440	5,925,564.480	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,251	73.240	1,483,183.240	
QUEST DIAGNOSTICS	11,714	82.230	963,242.220	
PROCTER & GAMBLE CO	220,116	85.770	18,879,349.320	
PROGRESSIVE CORP	47,700	33.690	1,607,013.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	40,943	46.140	1,889,110.020	
PULTE GROUP INC	25,477	20.480	521,768.960	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	39,870	14.730	587,285.100	
GLOBAL PAYMENTS INC	12,589	73.540	925,795.060	
QUALCOMM INC	121,972	54.190	6,609,662.680	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	50.040	509,757.480	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	115.980	409,989.300	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,328	378.350	2,394,198.800	
AUTONATION INC	5,772	50.770	293,044.440	
RESMED INC	11,376	64.510	733,865.760	
US BANCORP	141,384	40.090	5,668,084.560	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,261	70.770	726,170.970	
RITE AID CORP	85,598	7.100	607,745.800	
ROSS STORES INC	33,046	58.190	1,922,946.740	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,573	170.040	1,457,752.920	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,729	115.700	1,241,345.300	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,567	68.380	927,711.460	
RAYTHEON COMPANY	24,384	138.490	3,376,940.160	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,873	200.960	979,278.080	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	26.360	493,960.040	
ACCENTURE PLC-CL A	51,078	115.110	5,879,588.580	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	127,692	46.100	5,886,601.200	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,840	125.060	1,355,650.400	
ROCKWELL COLLINS INC	10,829	84.100	910,718.900	
ST JUDE MEDICAL INC	23,176	80.580	1,867,522.080	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	24,007	118.080	2,834,746.560	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	25,122	76.030	1,910,025.660	
PRICELINE GROUP INC	4,045	1,329.460	5,377,665.700	
SCHLUMBERGER LTD	113,221	78.740	8,915,021.540	
SCHWAB (CHARLES) CORP	97,381	25.730	2,505,613.130	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,310	124.890	2,036,955.900	
BUNGE LTD	11,367	60.000	682,020.000	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	49.150	545,909.050	
ANTHEM INC	21,326	132.150	2,818,230.900	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,019	81.920	1,312,276.480	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	41.590	971,168.090	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,396	306.520	1,960,501.920	
CENTENE CORP	13,899	70.930	985,856.070	
SMITH (A.O.) CORP	6,261	89.240	558,731.640	
ACUITY BRANDS INC	3,573	264.620	945,487.260	
SNAP-ON INC	4,811	160.160	770,529.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,772	70.990	2,539,454.280	
ADVANCE AUTO PARTS	6,029	164.850	993,880.650	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,997	12.870	501,891.390	
EDISON INTERNATIONAL	26,295	78.170	2,055,480.150	
SOUTHERN CO	73,354	54.140	3,971,385.560	
BB&T CORP	66,174	35.220	2,330,648.280	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	40.540	557,262.840	
AT&T INC	500,479	42.610	21,325,410.190	
CHEVRON CORP	153,421	104.770	16,073,918.170	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,676	114.970	1,457,359.720	
STAPLES INC	52,662	8.850	466,058.700	
STATE STREET CORP	32,891	53.230	1,750,787.930	
STARBUCKS CORP	120,300	56.510	6,798,153.000	
STRYKER CORP	27,397	122.290	3,350,379.130	
NETFLIX INC	34,895	97.060	3,386,908.700	
STERICYCLE INC	6,853	104.700	717,509.100	
SUNTRUST BANKS INC	41,008	41.440	1,699,371.520	
SYMANTEC CORP	53,442	20.700	1,106,249.400	
SYNOPSIS INC	12,600	54.250	683,550.000	
SYSCO CORP	43,896	51.590	2,264,594.640	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,047	678.840	2,068,425.480	
TESORO CORP	9,395	72.720	683,204.400	
TEXAS INSTRUMENTS INC	81,971	63.270	5,186,305.170	
TEXTRON INC	21,883	36.990	809,452.170	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,330	152.690	4,936,467.700	
TIFFANY & CO	10,305	61.350	632,211.750	
TOLL BROTHERS INC	13,356	28.240	377,173.440	
TORCHMARK CORP	10,414	61.320	638,586.480	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	54.010	736,534.370	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	78.070	1,088,764.220	
TRACTOR SUPPLY CO	10,977	93.690	1,028,435.130	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	20,073	24.040	482,554.920	

TYSON FOODS INC	24,179	68.920	1,666,416.680	
UGI CORP	16,721	44.740	748,097.540	
MARATHON OIL CORP	66,702	14.920	995,193.840	
UNION PACIFIC CORP	68,970	90.690	6,254,889.300	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,733	103.660	6,710,222.780	
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,405	141.270	10,935,004.350	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	137.160	1,020,607.560	
VALSPAR CORP	6,122	108.390	663,563.580	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	84.990	705,077.040	
VF CORP	27,914	64.050	1,787,891.700	
CBS CORP	33,859	57.080	1,932,671.720	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,184	88.960	1,795,568.640	
VULCAN MATERIALS CO	10,906	123.610	1,348,090.660	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	74,712	81.800	6,111,441.600	
WAL-MART STORES INC	130,305	73.840	9,621,721.200	
WASTE MANAGEMENT INC	36,145	67.610	2,443,763.450	
WATERS CORP	6,779	146.530	993,326.870	
ALLERGAN PLC	32,186	240.590	7,743,629.740	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,725	154.080	1,498,428.000	
WESTERN DIGITAL CORP	22,106	49.350	1,090,931.100	
WABTEC CORP	7,363	70.600	519,827.800	
WHIRLPOOL CORP	6,288	171.380	1,077,637.440	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,061	62.910	947,487.510	
WYNN RESORTS LTD	6,279	89.750	563,540.250	
WHOLE FOODS MARKET INC	26,602	33.580	893,295.160	
NASDAQ INC	9,132	65.880	601,616.160	
CME GROUP INC	27,754	98.900	2,744,870.600	
WILLIAMS COS INC	58,139	20.990	1,220,337.610	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	48.500	363,216.500	
LKQ CORP	25,910	33.090	857,361.900	
ALLIANT ENERGY CORP	22,424	40.550	909,293.200	
WEC ENERGY GROUP INC	25,516	65.030	1,659,305.480	
FOOT LOCKER INC	11,034	57.410	633,461.940	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,474	27.890	598,909.860	
CARMAX INC	15,331	52.670	807,483.770	
XEROX CORP	69,821	9.540	666,092.340	
XILINX INC	21,006	46.970	986,651.820	
YAHOO! INC	73,446	37.740	2,771,852.040	
CIMAREX ENERGY CO	8,044	118.430	952,650.920	
TJX COMPANIES INC	54,592	78.960	4,310,584.320	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	6.100	577,670.000	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,000	57.440	1,148,800.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,068	62.180	377,308.240	
SIGNATURE BANK	4,171	126.040	525,712.840	
CBRE GROUP INC	25,519	26.200	668,597.800	
LIBERTY GLOBAL PLC	23,519	29.270	688,401.130	
REGIONS FINANCIAL CORP	104,065	8.440	878,308.600	
DOMINO'S PIZZA INC	3,935	135.110	531,657.850	
T-MOBILE US INC	23,522	43.580	1,025,088.760	
LAS VEGAS SANDS CORP	35,605	44.130	1,571,248.650	
MEDIVATION INC	13,481	62.100	837,170.100	
MOSAIC CO/THE	26,525	25.480	675,857.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	28.000	1,010,156.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	91,443	27.700	2,532,971.100	
CELANESE CORP	12,107	67.140	812,863.980	
IHS INC-CLASS A	5,758	113.970	656,239.260	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	25.620	267,037.260	
EXPEDIA INC	9,786	109.430	1,070,881.980	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	24.860	459,288.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,029	90.840	1,274,394.360	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	50,537	28.700	1,450,411.900	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,758	256.890	2,506,732.620	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	40.430	594,159.280	
VIACOM INC-CLASS B	27,527	45.200	1,244,220.400	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,433	399.710	972,494.430	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	7,814	41.480	324,124.720	
TRANSDIGM GROUP INC	4,387	269.810	1,183,656.470	
MASTERCARD INC	79,900	88.560	7,075,944.000	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	35,957	26.070	937,398.990	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	9,200	72.350	665,620.000	
HANESBRANDS INC	32,964	26.270	865,964.280	
WESTERN UNION CO	41,207	19.570	806,420.990	
AERCAP HOLDINGS NV	14,032	34.500	484,104.000	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,099	11.950	216,283.050	
SPECTRA ENERGY CORP	54,583	36.360	1,984,637.880	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,152	66.620	676,326.240	

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,098	14.830	431,523.340	
DELTA AIR LINES INC	17,228	37.370	643,810.360	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,680	43.700	379,316.000	
DISCOVER FINANCIAL	33,582	54.980	1,846,338.360	
TE CONNECTIVITY LTD	30,476	57.530	1,753,284.280	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,740	118.390	1,271,508.600	
WABCO HOLDING INC	4,379	89.500	391,920.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,052	76.720	694,469.440	
VMWARE INC	6,987	59.180	413,490.660	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	250.820	1,230,773.740	
INVESCO LTD	34,162	25.630	875,572.060	
MSCI INC	7,958	79.450	632,263.100	
NETSUITE INC	3,026	74.720	226,102.720	
CALPINE CORP NPR	27,876	14.510	404,480.760	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,945	103.090	12,983,670.050	
VISA INC	156,281	76.420	11,942,994.020	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,201	97.130	1,573,603.130	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,301	83.360	1,192,131.360	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	64.410	424,139.850	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	84.230	513,381.850	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,874	24.440	510,160.560	
MARATHON PETROLEUM CORP	42,347	36.400	1,541,430.800	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	14,093	60.210	848,539.530	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	154,779	18.540	2,869,602.660	
XYLEM INC	14,720	46.410	683,155.200	
ALKERMES PLC	12,053	48.950	589,994.350	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,950	76.740	2,298,363.000	
LINKEDIN CORP	9,511	190.440	1,811,274.840	
SPLUNK INC	10,674	56.630	604,468.620	
HCA HOLDINGS INC	25,820	78.210	2,019,382.200	
VERISK ANALYTICS INC	13,563	83.400	1,131,154.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,846	139.880	677,858.480	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,373	143.790	1,060,163.670	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,177	89.360	1,356,216.720	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11,990	69.280	830,667.200	

CIT GROUP INC	16,266	32.540	529,295.640	
NXP SEMICONDUCTOR NV	24,098	79.150	1,907,356.700	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	562,500	0.450	253,125.000	
LEAR CORP	6,051	106.410	643,886.910	
DOLLAR GENERAL CORP	23,585	94.320	2,224,537.200	
FORTINET INC	11,399	33.460	381,410.540	
AON PLC	21,841	109.570	2,393,118.370	
REALOGY HOLDINGS CORP	12,857	29.240	375,938.680	
TESLA MOTORS INC	8,094	216.780	1,754,617.320	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	14,212	36.920	524,707.040	
GENERAL MOTORS CO	113,435	29.660	3,364,482.100	
VANTIV INC	12,141	58.980	716,076.180	
TRIPADVISOR INC	9,263	67.130	621,825.190	
ALLY FINANCIAL INC	35,251	16.630	586,224.130	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	14,486	50.230	727,631.780	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	24.130	401,378.420	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,217	64.850	1,440,772.450	
PHILLIPS 66	38,340	74.850	2,869,749.000	
FACEBOOK INC	187,037	117.240	21,928,217.880	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	7,204	71.410	514,437.640	
SERVICENOW INC	12,640	69.120	873,676.800	
WHITEWAVE FOODS CO	14,444	56.640	818,108.160	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	125.940	887,625.120	
WORKDAY INC	8,710	75.710	659,434.100	
ABBVIE INC	131,390	64.160	8,429,982.400	
ZOETIS INC	39,109	48.500	1,896,786.500	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	42.060	514,141.440	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	11.670	353,169.210	
MALLINCKRODT PLC	9,419	62.290	586,709.510	
CDW CORP	12,562	40.430	507,881.660	
SPRINT CORP	63,882	4.680	298,967.760	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	14,164	25.700	364,014.800	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	13,112	30.040	393,884.480	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	32.440	162,394.640	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	18,330	32.030	587,109.900	
BROADCOM LTD	31,792	155.140	4,932,210.880	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	36.780	566,779.800	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	25.700	338,289.100	
TWITTER INC	43,692	18.080	789,951.360	
PLAINS GP HOLDINGS LP	20,871	9.680	202,031.280	
PERRIGO CO PLC	11,759	93.730	1,102,171.070	

	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	44,389	23.330	1,035,595.370	
	ARAMARK	20,586	34.530	710,834.580	
	IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,407	27.680	343,425.760	
	SABRE CORP	17,624	27.800	489,947.200	
	NAVIENT CORP	28,699	12.690	364,190.310	
	FNF GROUP	20,571	36.870	758,452.770	
	SYNCHRONY FINANCIAL	67,120	27.310	1,833,047.200	
	MOBILEYE NV	14,001	45.830	641,665.830	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,810	19.850	849,778.500	
	CDK GLOBAL INC	10,850	55.250	599,462.500	
	QORVO INC	12,235	56.020	685,404.700	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	27.170	399,670.700	
	LIBERTY LILAC GROUP-C	6,305	35.700	225,088.500	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	29,438	52.870	1,556,387.060	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	35.730	574,895.700	
	WESTROCK CO	19,981	38.550	770,267.550	
	KRAFT HEINZ CO	49,423	89.850	4,440,656.550	
	FORTIVE CORP	23,758	50.200	1,192,651.600	
	WASTE CONNECTIONS INC	11,793	73.260	863,955.180	
	ALPHABET INC-CL A	23,841	717.780	17,112,592.980	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	139,382	19.040	2,653,833.280	
	PAYPAL HOLDINGS INC	89,723	37.360	3,352,051.280	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	36.160	294,125.440	
	ALPHABET INC-CL C	25,346	705.630	17,884,897.980	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	17,552	237.170	4,162,807.840	
	アメリカ・ドル 小計	26,091,419		1,534,600,962.930 (154,703,123,072)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.806	200,182.840	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	4.567	118,308.130	
	ASHTED GROUP	41,347	10.860	449,028.420	
	SEVERN TRENT PLC	19,770	24.630	486,935.100	
	BHP BILLITON PLC	171,489	9.614	1,648,695.240	
	BARCLAYS PLC	1,371,038	1.392	1,908,484.890	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,682	3.732	308,569.220	
	BT GROUP PLC	681,176	3.969	2,703,587.540	
	SKY PLC	86,067	8.645	744,049.210	
	AGGREKO PLC	19,416	12.070	234,351.120	
	BUNZL PLC	26,929	23.390	629,869.310	
	EASYJET PLC	13,628	10.700	145,819.600	
	CAPITA PLC	54,894	9.245	507,495.030	
	AVIVA PLC	330,507	3.630	1,199,740.410	
	CRODA INTERNATIONAL	10,965	32.390	355,156.350	
	DIAGEO PLC	204,692	21.435	4,387,573.020	

SCHRODERS PLC	11,918	23.930	285,197.740	
DCC PLC	7,281	66.150	481,638.150	
NATIONAL GRID PLC	303,709	11.100	3,371,169.900	
GKN PLC	134,180	2.720	364,969.600	
KINGFISHER PLC	196,101	3.097	607,324.790	
BAE SYSTEMS PLC	257,892	5.375	1,386,169.500	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	24.930	298,835.910	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	151,490	48.980	7,419,980.200	
COBHAM PLC	142,739	1.580	225,527.620	
NEXT PLC	11,843	49.430	585,399.490	
REXAM PLC	54,770	6.450	353,266.500	
IMPERIAL BRANDS PLC	77,589	40.355	3,131,104.090	
IMI PLC	21,218	9.750	206,875.500	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,938	29.760	474,314.880	
SABMILLER PLC	79,054	43.990	3,477,585.460	
ANGLO AMERICAN PLC	114,150	7.450	850,417.500	
COMPASS GROUP PLC	133,391	14.410	1,922,164.310	
HSBC HOLDINGS PLC	1,602,754	4.708	7,545,765.830	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	475,238	1.770	841,171.260	
ARM HOLDINGS PLC	115,799	11.670	1,351,374.330	
CENTRICA PLC	441,116	2.253	993,834.340	
UNILEVER PLC	104,293	36.515	3,808,258.890	
MEGGITT PLC	62,181	4.040	251,211.240	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	211,968	1.784	378,150.910	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	10.260	570,445.740	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	4.861	393,079.900	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29,159	28.260	824,033.340	
PEARSON PLC	65,009	9.445	614,010.000	
PERSIMMON PLC	23,150	14.200	328,730.000	
PRUDENTIAL PLC	209,832	12.200	2,559,950.400	
RIO TINTO PLC	100,701	23.680	2,384,599.680	
VODAFONE GROUP PLC	2,161,011	2.280	4,927,105.080	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	51,651	76.360	3,944,070.360	
RELX PLC	91,193	14.120	1,287,645.160	
OLD MUTUAL PLC	389,986	1.959	763,982.570	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	146,260	7.350	1,075,011.000	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	1.688	471,698.090	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	7.715	315,420.060	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	13.580	276,448.060	
SSE PLC	81,467	15.600	1,270,885.200	
BP PLC	1,505,691	4.570	6,881,007.870	

SHIRE PLC	73,209	48.410	3,544,047.690	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.400	545,734.400	
SMITHS GROUP PLC	31,720	11.470	363,828.400	
STANDARD CHARTERED PLC	267,656	5.868	1,570,605.400	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,226,266	0.526	2,749,015.910	
TATE & LYLE PLC	39,915	6.990	279,005.850	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.315	332,723.930	
TESCO PLC	665,246	1.632	1,085,681.470	
3I GROUP PLC	78,491	5.560	436,409.960	
SMITH & NEPHEW PLC	74,628	13.100	977,626.800	
GLAXOSMITHKLINE PLC	396,879	16.525	6,558,425.470	
WEIR GROUP	18,336	14.060	257,804.160	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,907	25.710	640,358.970	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	9.210	196,191.420	
WPP PLC	106,283	16.560	1,760,046.480	
WOLSELEY PLC	20,579	39.540	813,693.660	
ASTRAZENECA PLC	103,075	45.740	4,714,650.500	
WHITBREAD PLC	14,978	36.080	540,406.240	
CARNIVAL PLC	15,378	34.720	533,924.160	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	147,471	3.173	467,925.480	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	35.360	475,450.560	
WILLIAM HILL PLC	72,474	2.600	188,432.400	
BURBERRY GROUP PLC	35,774	11.620	415,693.880	
INVESTEC PLC	50,655	4.434	224,604.270	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,187	28.350	430,551.450	
ICAP PLC	44,767	4.256	190,528.350	
ITV PLC	301,271	1.808	544,697.960	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.239	244,968.990	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	92.650	803,553.450	
G4S PLC	122,250	1.736	212,226.000	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.820	314,999.260	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	24.910	267,184.660	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	342,067	21.020	7,190,248.340	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	305,666	21.270	6,501,515.820	
INMARSAT PLC	34,127	7.955	271,480.280	
PETROFAC LTD	21,809	7.555	164,766.990	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	26.000	297,882.000	
TUI AG-DI	19,394	9.545	185,115.730	
STANDARD LIFE PLC	155,609	2.700	420,144.300	
EXPERIAN PLC	78,135	14.490	1,132,176.150	
MONDI PLC	30,200	13.710	414,042.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	11.940	254,202.600	

	FRESNILLO PLC NPR	15,639	18.700	292,449.300	
	GLENCORE PLC	994,899	1.673	1,664,466.020	
	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	3.153	266,866.760	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.392	382,258.040	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	11.090	339,531.440	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	15.360	205,916.160	
	ROYAL MAIL PLC	79,209	4.863	385,193.360	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	71,339	4.595	327,802.700	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.336	254,696.920	
	WORLDPAY GROUP PLC	112,202	2.680	300,701.360	
イギリス・ボンド	小計	24,358,584		139,460,129.730 (18,184,206,315)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,152	19.180	1,959,275.360	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	13.130	1,631,665.100	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	7.830	1,473,840.900	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	14.900	736,223.900	
	NICE LTD	5,638	250.700	1,413,446.600	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	75,895	196.900	14,943,725.500	
イスラエル・シュケル	小計	545,596		22,158,177.360 (574,783,121)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	71.490	794,611.350	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	237,876	23.120	5,499,693.120	
	AMCOR LTD	93,885	15.100	1,417,663.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	271,811	28.270	7,684,096.970	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.030	306,607.070	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	3.860	575,935.160	
	TELSTRA CORP LTD	349,459	5.590	1,953,475.810	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	9.510	371,023.140	
	AMP LTD	240,738	5.240	1,261,467.120	
	ASX LTD	16,354	47.220	772,235.880	
	BHP BILLITON LTD	261,457	19.050	4,980,755.850	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	31.950	669,224.700	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	9.000	342,360.000	
	CSL LIMITED	37,912	110.490	4,188,896.880	
	REA GROUP LTD	4,119	62.330	256,737.270	
	TRANSURBAN GROUP	166,791	12.000	2,001,492.000	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.800	427,688.800	
	COCHLEAR LTD	5,226	121.300	633,913.800	

ORIGIN ENERGY LTD	143,330	5.640	808,381.200	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	139,157	72.410	10,076,358.370	
BORAL LIMITED	60,188	6.350	382,193.800	
RIO TINTO LIMITED	36,036	48.300	1,740,538.800	
APA GROUP	94,292	9.440	890,116.480	
ARISTOCRAT LEISU	44,406	13.510	599,925.060	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	200,111	5.490	1,098,609.390	
TPG TELECOM LTD	28,719	11.850	340,320.150	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,706	30.710	144,521.260	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	20.800	744,432.000	
ORICA LTD	34,301	12.300	421,902.300	
CIMIC GROUP LTD	8,709	31.500	274,333.500	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.110	605,274.300	
MACQUARIE GROUP LTD	24,601	67.200	1,653,187.200	
SUNCORP GROUP LTD	104,995	12.210	1,281,988.950	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	215,043	24.430	5,253,500.490	
NEWCREST MINING LTD	61,110	26.120	1,596,193.200	
OIL SEARCH LTD	116,483	6.950	809,556.850	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	2.920	398,363.920	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	109,432	10.360	1,133,715.520	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	8.610	393,537.270	
SANTOS LTD	133,862	4.760	637,183.120	
SONIC HEALTHCARE	33,734	21.350	720,220.900	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.300	304,336.800	
WESFARMERS LTD	92,057	40.430	3,721,864.510	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.320	243,689.160	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	26.610	1,541,331.030	
WOOLWORTHS LTD	101,809	20.610	2,098,283.490	
DUET GROUP	207,776	2.420	502,817.920	
SEEK LTD	25,899	15.230	394,441.770	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	67.120	307,476.720	
TATTS GROUP LTD	109,937	3.890	427,654.930	
AUSNET SERVICES	165,066	1.620	267,406.920	
AGL ENERGY LTD	55,792	19.900	1,110,260.800	
BRAMBLES LTD	129,410	12.750	1,649,977.500	
ASCIANO LTD	47,166	8.820	416,004.120	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.190	400,575.590	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	38,678	8.360	323,348.080	
AURIZON HOLDINGS LTD	171,522	4.900	840,457.800	
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	9.400	600,866.800	

	VOCUS COMMUNICATIONS LTD-RTS	4,345	0.800	3,476.000	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.750	409,879.250	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.930	688,107.570	
	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	1.730	747,406.710	
オーストラリア・ドル 小計		6,299,443		83,141,895.920 (6,331,255,374)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	72.840	1,175,710.440	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	34,037	54.190	1,844,465.030	
	BARRICK GOLD CORP	93,528	29.080	2,719,794.240	
	ATCO LTD	7,193	46.670	335,697.310	
	BANK OF MONTREAL	52,218	82.950	4,331,483.100	
	BANK OF NOVA SCOTIA	97,870	63.300	6,195,171.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,571	43.980	1,212,572.580	
	BCE INC	11,568	61.260	708,655.680	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	74,198	44.100	3,272,131.800	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	30.310	782,573.890	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	1.990	301,713.850	
	SAPUTO INC	20,680	38.800	802,384.000	
	BLACKBERRY LTD	39,652	8.660	343,386.320	
	CGI GROUP INC	18,082	55.860	1,010,060.520	
	CCL INDUSTRIES INC	2,268	217.930	494,265.240	
	CAE INC	23,000	16.080	369,840.000	
	CAMECO CORP	32,627	13.780	449,600.060	
	ROGERS COMM-CL B	29,459	53.190	1,566,924.210	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,271	97.110	3,133,836.810	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	88,596	40.300	3,570,418.800	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,911	141.520	836,524.720	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	39.140	356,917.660	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,204	78.110	5,014,974.440	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	22.380	255,512.460	
	AGRIUM INC	10,775	116.340	1,253,563.500	
	YAMANA GOLD INC	67,520	7.700	519,904.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	39.100	733,437.800	
	OPEN TEXT CORP	9,878	76.750	758,136.500	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	6.570	307,410.300	
	EMPIRE CO LTD	15,093	20.050	302,614.650	
	KINROSS GOLD CORP	125,461	7.230	907,083.030	
	FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	21.500	368,940.000	
FORTIS INC	22,804	43.810	999,043.240		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	9.290	513,699.840		
TELUS CORP	18,945	42.820	811,224.900		

GREAT WEST LIFECO INC	24,837	33.530	832,784.610	
IMPERIAL OIL LTD	24,952	40.790	1,017,792.080	
ENBRIDGE INC	74,606	53.860	4,018,279.160	
IGM FINANCIAL INC	8,426	35.210	296,679.460	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	4.570	402,137.150	
MANULIFE FINANCIAL CORP	160,807	16.970	2,728,894.790	
LINAMAR CORP	3,827	45.610	174,549.470	
LOBLAW CO LTD	17,936	69.300	1,242,964.800	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	40.230	387,414.900	
MAGNA INTERNATIONAL INC	33,042	45.630	1,507,706.460	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,032	41.050	2,053,813.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,805	690.000	1,245,450.000	
METRO INC	19,350	45.940	888,939.000	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.230	437,847.270	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	19.980	799,040.160	
METHANEX CORP	7,381	35.890	264,904.090	
ONEX CORP	6,646	79.480	528,224.080	
GOLDCORP INC	67,652	25.990	1,758,275.480	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	68,403	20.590	1,408,417.770	
POWER CORP OF CANADA	31,258	27.420	857,094.360	
POWER FINANCIAL CORP	22,140	29.410	651,137.400	
ROYAL BANK OF CANADA	120,819	77.350	9,345,349.650	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,459	54.580	680,012.220	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,856	173.900	2,061,758.400	
SHAW COMM INC-B	34,029	24.380	829,627.020	
SUNCOR ENERGY INC	135,594	36.280	4,919,350.320	
ENCANA CORP	69,257	9.960	689,799.720	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,857	17.660	809,834.620	
THOMSON REUTERS CORP	28,406	53.270	1,513,187.620	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	150,877	55.110	8,314,831.470	
TRANSCANADA CORP	57,653	60.300	3,476,475.900	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	37.200	211,891.200	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	111.860	530,551.980	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	91.600	981,768.800	
SILVER WHEATON CORP	33,943	33.640	1,141,842.520	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	498.750	745,132.500	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	13,919	103.390	1,439,085.410	
WASTE CONNECTIONS INC	2,429	95.480	231,920.920	
CI FINANCIAL CORP	20,695	26.640	551,314.800	

	VERESEN INC	24,982	11.120	277,799.840	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	33.570	529,701.030	
	KEYERA CORP	13,728	37.880	520,016.640	
	ALTAGAS LTD	12,538	30.910	387,549.580	
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,719	39.460	1,212,171.740	
	DOLLARAMA INC	9,286	90.960	844,654.560	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	67,060	18.030	1,209,091.800	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	40.820	338,438.620	
	ARC RESOURCES LTD	30,676	21.850	670,270.600	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	36.610	530,588.730	
	ELEMENT FINANCIAL CORP	30,631	14.160	433,734.960	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	27.340	812,462.780	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	24.730	369,985.530	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	27.000	465,237.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,390	53.950	938,190.500	
	HYDRO ONE LTD	16,612	26.590	441,713.080	
カナダ・ドル 小計		3,281,528		120,517,360.070 (9,297,914,330)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.180	397,500.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	2.820	229,548.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.980	492,326.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.345	238,788.300	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	146,600	15.700	2,301,620.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	47,300	8.010	378,873.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	35.600	364,686.400	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.580	522,262.000	
	CAPITALAND LTD	251,315	2.990	751,431.850	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.755	441,222.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	5.480	653,764.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.780	494,562.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	714,200	0.169	120,699.800	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	249,053	8.740	2,176,723.220	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	642,722	4.140	2,660,869.080	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.740	510,150.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	104,900	18.150	1,903,935.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	151,000	3.270	493,770.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	145,700	0.880	128,216.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	256,000	1.830	468,480.000	

	NOBLE GROUP LTD-RTS	338,900	0.055	18,639.500	
シンガポール・ドル 小計		5,078,174		15,748,066.150 (1,178,585,271)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	153,118	10.230	1,566,397.140	
	SYNGENTA AG	7,570	369.500	2,797,115.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	259,635	77.300	20,069,785.500	
	CIE FINANC RICHEMONT	42,276	55.450	2,344,204.200	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	57,289	254.500	14,580,050.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	177.100	628,350.800	
	SIKA INHABER	176	4,148.000	730,048.000	
	SGS SA-REG	465	2,240.000	1,041,600.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	185,580	80.800	14,994,864.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	104.900	432,922.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	232	1,232.000	285,824.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,105	474.700	999,243.500	
	ABB LTD	159,997	19.300	3,087,942.100	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,319	49.130	654,362.470	
	GEBERIT AG	3,062	364.600	1,116,405.200	
	LONZA GROUP AG-REG	4,373	161.600	706,676.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,815.000	436,125.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	70,410.000	633,690.000	
	GIVAUDAN-REG	757	2,034.000	1,539,738.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,176	228.900	2,787,086.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD	23,324	40.800	951,619.200	
	ACTELION	8,330	167.700	1,396,941.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	129.800	586,566.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	134.900	600,709.700	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,454	279.000	684,666.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	54.200	248,886.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	177.600	295,348.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,618	211.500	553,707.000	
	GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,318.000	401,990.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	808	504.000	407,232.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	87.350	523,226.500		
DUFREY GROUP	3,566	114.000	406,524.000		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,474	421.250	620,922.500		
ARYZTA AG	7,191	36.130	259,810.830		
JULIUS BAER GROUP LTD	18,205	37.940	690,697.700		
SWISS RE LTD	27,071	81.600	2,208,993.600		
UBS GROUP AG	298,643	12.010	3,586,702.430		
スイス・フラン 小計		1,325,095		85,856,974.770 (8,802,915,623)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,983	220.500	11,682,751.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,729	200.900	6,776,156.100	

ERICSSON LM-B SHS	248,663	64.900	16,138,228.700	
GETINGE AB-B SHS	19,578	174.100	3,408,529.800	
SKF AB-B SHS	32,306	133.300	4,306,389.800	
SANDVIK AB	86,729	84.150	7,298,245.350	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	121,939	71.050	8,663,765.950	
SKANSKA AB-B SHS	27,150	178.900	4,857,135.000	
SWEDBANK AB	72,788	170.600	12,417,632.800	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	50,376	271.400	13,672,046.400	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	95.600	11,367,700.400	
VOLVO AB-B SHS	125,161	84.150	10,532,298.150	
SWEDISH MATCH AB	15,807	302.000	4,773,714.000	
TELE2 AB-B SHS	26,976	75.600	2,039,385.600	
NORDEA AB	244,219	70.200	17,144,173.800	
INDUSTRIVARDEN C	14,804	135.800	2,010,383.200	
ELECTROLUX AB-SER B	19,191	230.400	4,421,606.400	
SECURITAS AB-B SHS	24,098	129.900	3,130,330.200	
INVESTOR AB-B SHS	37,451	276.000	10,336,476.000	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,506	252.900	19,601,267.400	
ASSA ABLOY AB-B	81,437	170.900	13,917,583.300	
TELIA CO AB	217,869	39.960	8,706,045.240	
LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	152.800	2,565,512.000	
BOLIDEN AB	21,855	169.700	3,708,793.500	
ALFA LAVAL AB	24,553	131.500	3,228,719.500	
KINNEVIK AB-B	18,310	203.000	3,716,930.000	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	496.000	2,644,672.000	
ICA GRUPPEN AB	5,920	280.900	1,662,928.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	63.800	2,149,549.600	
HEXAGON AB	21,137	310.700	6,567,265.900	
スウェーデン・クローナ 小計	1,897,258		223,446,215.590 (2,621,024,109)	
デンマーク・ク ローネ				
CARLSBERG AS-B	8,601	635.500	5,465,935.500	
A P MOLLER A/S	481	8,655.000	4,163,055.000	
AP MOLLER MAERSK A	351	8,320.000	2,920,320.000	
DANSKE BANK A/S	58,792	171.000	10,053,432.000	
GENMAB A/S	4,633	1,202.000	5,568,866.000	
NOVOZYMES-B SHS	19,126	324.200	6,200,649.200	
NOVO NORDISK A/S-B	151,165	367.200	55,507,788.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,097	442.500	8,007,922.500	
TDC A/S	68,939	35.530	2,449,402.670	
COLOPLAST-B	9,961	511.000	5,090,071.000	
DSV A/S	15,601	275.000	4,290,275.000	
WILLIAM DEMANT	12,975	130.400	1,691,940.000	
TRYG A/S	11,107	121.200	1,346,168.400	
PANDORA A/S	9,446	852.500	8,052,715.000	

	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	420.000	3,237,360.000	
	ISS A/S	14,618	245.800	3,593,104.400	
デンマーク・クローネ 小計		411,601		127,639,004.670 (1,908,203,119)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.960	682,024.320	
	CONTACT ENERGY L	64,605	5.290	341,760.450	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	8.580	645,910.980	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	166,326	3.760	625,385.760	
ニュージーランド・ドル 小計		404,204		2,295,081.510 (168,527,835)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	31,839	141.500	4,505,218.500	
	DNB ASA	78,026	99.350	7,751,883.100	
	NORSK HYDRO ASA	119,498	30.890	3,691,293.220	
	TELENOR ASA	61,888	142.500	8,819,040.000	
	SCHIBSTED ASA	11,275	249.000	2,807,475.000	
	ORKLA ASA	61,421	74.050	4,548,225.050	
	STATOIL ASA	88,513	146.100	12,931,749.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,576	263.300	3,837,860.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	141.800	2,365,649.400	
ノルウェー・クローネ 小計		483,719		51,258,394.370 (605,361,638)	
ユーロ	CRH PLC	67,295	25.320	1,703,909.400	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	96.300	601,489.800	
	KERRY GROUP PLC-A	13,414	79.000	1,059,706.000	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.174	382,562.830	
	UMICORE	7,660	47.470	363,620.200	
	AIR LIQUIDE	27,762	89.870	2,494,970.940	
	AIRBUS GROUP SE	48,107	49.030	2,358,686.210	
	AXA	157,901	17.075	2,696,159.570	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,774	19.100	740,583.400	
	ADIDAS AG	15,210	126.900	1,930,149.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	96,611	10.600	1,024,076.600	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	53,488	13.630	729,041.440	
	DANONE	47,989	64.040	3,073,215.560	
	SAFRAN SA	25,619	59.860	1,533,553.340	
	INTESA SANPAOLO	1,009,721	1.760	1,777,108.960	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	1.654	186,017.110	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,271	68.440	1,866,427.240	
	ACCOR SA	14,860	35.945	534,142.700	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	30.550	231,049.650	
	BOUYGUES	17,362	25.810	448,113.220	
BNP PARIBAS	86,250	39.815	3,434,043.750		
RELX NV	80,368	15.620	1,255,348.160		

THALES SA	8,128	75.600	614,476.800	
CAP GEMINI SA	13,109	75.390	988,287.510	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	49.960	213,029.440	
CHRISTIAN DIOR SE	4,641	144.950	672,712.950	
INGENICO GROUP	4,334	106.450	461,354.300	
UNICREDIT SPA	417,621	1.906	795,985.620	
NATIXIS	70,166	3.309	232,179.290	
KONINKLIJKE DSM NV	14,459	53.090	767,628.310	
DELHAIZE GROUP	8,529	99.550	849,061.950	
COMMERZBANK AG	87,317	5.711	498,667.380	
EIFFAGE	4,777	63.390	302,814.030	
FRESENIUS SE & CO KGAA	33,358	66.410	2,215,304.780	
UNITED INTERNET	9,882	37.960	375,120.720	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	35.530	197,049.380	
PUBLICIS GROUPE	15,068	60.240	907,696.320	
MAN SE	3,396	91.890	312,058.440	
IBERDROLA SA	440,361	5.858	2,579,634.730	
ENI SPA	207,364	14.500	3,006,778.000	
IMERYS SA	2,764	56.530	156,248.920	
JERONIMO MARTINS	19,517	14.200	277,141.400	
KBC GROUPE	20,385	41.885	853,825.720	
HANNOVER RUECK SE	5,050	90.810	458,590.500	
WARTSILA OYJ	11,645	37.610	437,968.450	
L'OREAL	20,609	172.800	3,561,235.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,770	134.400	3,060,288.000	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	20.760	199,296.000	
GEA GROUP AG	14,635	44.270	647,891.450	
BOLLORE	71,347	3.011	214,825.810	
MEDIOBANCA SPA	42,404	5.290	224,317.160	
MICHELIN(CGDE)-B	14,633	85.400	1,249,658.200	
CONTINENTAL AG	9,039	172.800	1,561,939.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	77,665	24.770	1,923,762.050	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	32.400	304,527.600	
AXEL SPRINGER SE	3,067	47.280	145,007.760	
OMV AG	13,397	24.965	334,456.100	
PERNOD-RICARD	17,390	99.170	1,724,566.300	
PEUGEOT SA	40,058	11.020	441,439.160	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,066	42.710	515,338.860	
RENAULT SA	15,758	69.570	1,096,284.060	
REPSOL SA	86,648	11.650	1,009,449.200	
REMY COINTREAU	1,860	78.290	145,619.400	
MERCK KGAA	10,600	92.720	982,832.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	65,313	116.000	7,576,308.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	38,991	34.080	1,328,813.280	
SAIPEM	465,751	0.376	175,122.370	

RWE AG	39,183	14.885	583,238.950	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,915	43.250	601,823.750	
SOCIETE GENERALE-A	62,440	28.000	1,748,320.000	
VINCI S.A.	40,691	63.600	2,587,947.600	
SODEXO	7,368	98.950	729,063.600	
SOLVAY SA	5,991	80.860	484,432.260	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,546	52.100	2,372,946.600	
VIVENDI SA	96,285	16.785	1,616,143.720	
SAP SE	80,018	69.370	5,550,848.660	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	8,870	48.590	430,993.300	
TELEFONICA S.A	365,090	8.490	3,099,614.100	
TOTAL SA	179,673	42.650	7,663,053.450	
VALEO	19,670	40.000	786,800.000	
E.ON SE	160,581	9.185	1,474,936.480	
VOEST-ALPINE AG	9,875	30.195	298,175.620	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	20.765	317,330.730	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	95.000	818,330.000	
METRO AG	15,629	27.675	432,532.570	
SIEMENS AG-REG	62,261	89.240	5,556,171.640	
UPM-KYMMENE OYJ	41,826	16.770	701,422.020	
ING GROEP NV-CVA	315,173	9.121	2,874,692.930	
BAYER AG	67,445	90.920	6,132,099.400	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	7.480	316,426.440	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,356	109.150	1,566,957.400	
DAIMLER AG	78,548	54.150	4,253,374.200	
BASF SE	74,820	67.010	5,013,688.200	
BEIERSDORF AG	8,300	84.490	701,267.000	
HOCHTIEF AG	1,707	114.150	194,854.050	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	68.540	754,556.860	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,988	79.080	1,422,491.040	
ORANGE	161,525	14.155	2,286,386.370	
SAMPO OYJ-A SHS	36,399	36.670	1,334,751.330	
RANDSTAD HOLDINGS	9,998	34.985	349,780.030	
ALLIANZ SE	37,136	122.450	4,547,303.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.761	527,610.530	
KONINKLIJKE AHOLD NV	68,190	21.040	1,434,717.600	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	37.980	668,523.960	
HERMES INTL	2,185	337.450	737,328.250	
ENDESA S.A.	27,930	18.260	510,001.800	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	10.845	214,167.060	
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	19.570	456,450.680	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,558	145.100	1,967,265.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	148,840	4.469	665,165.960	
SOCIETE BIC SA	2,478	124.550	308,634.900	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,673	67.880	724,483.240	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,490	25.410	393,600.900	
HEINEKEN NV	19,424	82.790	1,608,112.960	
AKZO NOBEL	20,390	55.450	1,130,625.500	
ASML HOLDING NV	30,191	87.300	2,635,674.300	
AEGON NV	144,321	3.302	476,547.940	
BANKINTER S.A.	57,960	5.753	333,443.880	
VOLKSWAGEN AG	2,794	121.700	340,029.800	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,987	110.100	1,650,068.700	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	532,194	5.005	2,663,630.970	
KERING	6,178	147.100	908,783.800	
CNP ASSURANCES	13,987	12.850	179,732.950	
FORTUM OYJ	37,132	14.580	541,384.560	
AGEAS	16,658	29.770	495,908.660	
UCB SA	10,367	67.740	702,260.580	
THYSSENKRUPP AG	29,215	18.095	528,645.420	
UNILEVER NV-CVA	132,599	41.860	5,550,594.140	
CARREFOUR SA	43,732	22.000	962,104.000	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	17.810	516,668.100	
ATOS SE	7,050	73.010	514,720.500	
NOKIA OYJ	471,518	4.940	2,329,298.920	
TUI AG	19,196	11.185	214,707.260	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	76,580	22.300	1,707,734.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	36.205	893,213.550	
SANOFI	95,864	74.190	7,112,150.160	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	5.162	304,609.620	
ELISA OYJ	13,644	34.290	467,852.760	
BANCO SANTANDER SA	1,176,851	3.523	4,146,046.070	
METSO OYJ	8,585	21.300	182,860.500	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	8,649	80.000	691,920.000	
QIAGEN N.V.	19,737	20.010	394,937.370	
LINDE AG	15,184	122.550	1,860,799.200	
DEUTSCHE BANK AG-REG	112,859	11.755	1,326,657.540	
BMW VORZUG	4,116	58.230	239,674.680	
K & S	14,982	17.825	267,054.150	
ENEL SPA	621,624	3.930	2,442,982.320	
COLRUYT NV	4,673	50.560	236,266.880	
VOPAK (KON.)	5,364	43.135	231,376.140	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	262,222	14.815	3,884,818.930	
BANCO POPULAR ESPANOL	277,768	1.174	326,099.630	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	34,431	9.270	319,175.370	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	89,582	12.785	1,145,305.870	
KONINKLIJKE KPN NV	276,563	3.112	860,664.050	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.383	127,224.930	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,463	71.960	1,112,717.480	
EURAZEO	4,063	54.120	219,889.560	

BANCO SABADELL	428,014	1.145	490,076.030	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,276	72.580	600,672.080	
FRAPORT AG	3,149	47.695	150,191.550	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	72.420	580,373.880	
INDITEX	89,467	29.795	2,665,669.260	
JC DECAUX SA	6,058	29.315	177,590.270	
ANDRITZ AG	6,265	43.130	270,209.450	
MAPFRE SA	84,474	1.990	168,103.260	
ESSILOR INTL	16,883	118.600	2,002,323.800	
SNAM SPA	217,172	5.240	1,137,981.280	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	7.541	645,396.480	
ENAGAS	18,095	27.015	488,836.420	
WENDEL	2,220	91.500	203,130.000	
TENARIS SA	38,237	12.710	485,992.270	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	2.512	188,284.440	
TELECOM ITALIA SPA	804,591	0.648	521,374.960	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.528	262,730.680	
ATLANTIA SPA	33,870	22.170	750,897.900	
ILIAD SA	2,102	171.900	361,333.800	
PROXIMUS	13,498	27.590	372,409.820	
SES FDR	30,439	18.985	577,884.410	
TERNA SPA	117,108	4.918	575,937.140	
GRIFOLS SA	25,309	20.150	509,976.350	
FERROVIAL SA	40,995	17.595	721,307.020	
LANXESS AG	6,856	38.550	264,298.800	
EXOR SPA	9,441	32.460	306,454.860	
NESTE OYJ	10,692	31.370	335,408.040	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	10.595	102,146.390	
KONE OYJ	27,018	41.210	1,113,411.780	
ENGIE	120,700	14.540	1,754,978.000	
ALSTOM	12,046	20.605	248,207.830	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	40.950	205,773.750	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	18,706	17.005	318,095.530	
ELECTRICITE DE FRANCE	20,751	10.875	225,667.120	
DEUTSCHE WOHNEN AG	26,714	30.800	822,791.200	
ARKEMA SA	5,658	68.450	387,290.100	
LEGRAND SA	21,957	46.760	1,026,709.320	
ADP	2,313	98.520	227,876.760	
ORION OYJ	8,051	36.540	294,183.540	
RTL GROUP SA	3,446	70.700	243,632.200	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	12.305	466,617.900	
SYMRISE AG	10,237	60.840	622,819.080	
SCOR SE	13,875	26.020	361,027.500	
REXEL SA	23,245	10.975	255,113.870	
PRYSMIAN SPA	14,925	19.690	293,873.250	

CAIXABANK		226,091	2.022	457,156.000	
BUREAU VERITAS SA		21,480	18.800	403,824.000	
GROUPE EUROTUNNEL SE		37,646	9.043	340,432.770	
SUEZ SA		25,406	14.035	356,573.210	
ENGIE		3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA		36,223	38.370	1,389,876.510	
TNT EXPRESS NV W/I		44,157	8.447	372,994.170	
BRENTAG AG		12,331	43.560	537,138.360	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA		68,448	4.385	300,144.480	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA		48,305	5.417	261,668.180	
EVONIK INDUSTRIES AG		11,575	26.485	306,563.870	
EDENRED		18,682	19.475	363,831.950	
BANKIA SA		370,638	0.620	229,795.560	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		61,541	3.629	223,332.280	
HUGO BOSS AG -ORD		5,218	48.075	250,855.350	
OSRAM LICHT AG		7,017	46.015	322,887.250	
GEMALTO		6,103	54.560	332,979.680	
VONOVIA SE		39,169	32.600	1,276,909.400	
REPSOL SA-RTS		86,619	0.296	25,639.220	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS-RTS		15,466	0.680	10,516.880	
IBERDROLA SA-RTS		440,361	0.130	57,246.930	
OCI NV		8,363	12.660	105,875.580	
FERRARI NV		10,363	37.550	389,130.650	
CNH INDUSTRIAL NV		78,645	5.835	458,893.570	
SFR GROUP SA		8,774	20.345	178,507.030	
NN GROUP NV		25,750	22.950	590,962.500	
ZALANDO SE		6,674	24.665	164,614.210	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		70,110	5.535	388,058.850	
AENA SA		5,256	123.400	648,590.400	
ABN AMRO GROUP NV		19,363	15.120	292,768.560	
ALTICE NV-A		38,525	12.745	491,001.120	
COVESTRO AG		5,966	38.950	232,375.700	
POSTE ITALIANE SPA		40,015	5.935	237,489.020	
SCHAEFFLER AG		12,644	12.355	156,216.620	
LAFARGEHOLCIM LTD		14,105	37.645	530,982.720	
ユーロ 小計		19,277,197		247,487,140.320 (27,525,519,747)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	15.500	3,890,500.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	29.150	3,254,889.000	
	CLP HOLDINGS LTD	150,500	78.900	11,874,450.000	
	PCCW LTD	331,000	5.440	1,800,640.000	

LI & FUNG LTD	532,400	3.670	1,953,908.000	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	63.950	3,133,550.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,640	183.600	17,375,904.000	
MTR CORP	118,500	39.500	4,680,750.000	
HANG SENG BANK LTD	62,600	131.700	8,244,420.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	94,222	43.050	4,056,257.100	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	112,500	70.450	7,925,625.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	46.700	5,592,325.000	
HONG KONG & CHINA GAS	616,588	13.900	8,570,573.200	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	246,000	22.600	5,559,600.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	344,500	23.100	7,957,950.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	7.830	3,455,112.780	
SINO LAND CO	255,400	12.820	3,274,228.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	97.700	12,896,400.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	86.650	3,682,625.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	32.750	3,717,125.000	
WHEELOCK & CO LTD	76,000	36.800	2,796,800.000	
WYNN MACAU LTD	240,000	11.040	2,649,600.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	113,200	9.970	1,128,604.000	
AIA GROUP LTD	982,027	45.850	45,025,937.950	
HKT TRUST / HKT LTD	214,000	11.440	2,448,160.000	
SANDS CHINA LTD	245,600	25.050	6,152,280.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	21.000	2,188,200.000	
WH GROUP LTD	530,500	6.070	3,220,135.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	221,332	81.900	18,127,090.800	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	246,832	49.250	12,156,476.000	
香港・ドル 小計	7,193,217		218,790,115.830 (2,844,271,506)	
合計	96,647,035		234,745,691,060 (234,745,691,060)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28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 PROPERTY GROUP	87,929.000	813,343.250	
		GOODMAN GROUP	143,627.000	1,025,496.780	
		GPT GROUP	144,955.000	785,656.100	
		LENLEASE GROUP	51,144.000	607,590.720	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	606,355.150	
		SCENTRE GROUP	428,482.000	2,189,543.020	
		STOCKLAND	193,279.000	931,604.780	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	924,915.060	

		WESTFIELD CORP	159,515.000	1,714,786.250	
	オーストラリア・ドル	小計	1,775,157.000	9,599,291.110 (730,986,018)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	491,974.700	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	319,665.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	429,840.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	343,859.000	
	シンガポール・ドル	小計	802,906.000	1,585,338.700 (118,646,748)	
投資信託受益証券	合計		2,578,063	849,632,766 (849,632,766)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,215.000	741,629.850	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,741.000	495,256.840	
		AMERICAN TOWER CORP	34,415.000	3,911,608.900	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	836,527.120	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,002.000	2,034,709.880	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,365.000	1,648,501.800	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	16,708.000	451,116.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	566,655.600	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,844.000	2,743,456.800	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,787.000	1,299,398.880	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	771,757.360	
		EQUINIX INC	5,560.000	2,165,342.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,299.000	2,065,579.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,283.000	1,222,116.390	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,980.000	930,635.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	963,397.210	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	48,619.000	1,506,216.620	
		HCP INC	37,800.000	1,358,532.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	974,526.960	
		IRON MOUNTAIN INC	22,149.000	882,637.650	
		KIMCO REALTY	32,980.000	1,040,189.200	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	464,795.100	
		MID AMERICA	6,099.000	658,752.990	
		PROLOGIS INC	41,891.000	2,075,699.050	
		PUBLIC STORAGE	11,882.000	3,057,713.880	
		REALTY INCOME CORP	20,047.000	1,401,485.770	
REGENCY CENTERS CORP	9,409.000	789,979.640			

	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,048.000	5,499,538.880	
	SL GREEN	8,752.000	927,536.960	
	THE MACERICH COMPANY	10,631.000	930,106.190	
	UDR INC	21,797.000	808,450.730	
	VENTAS INC	27,031.000	1,963,261.530	
	VEREIT INC	65,404.000	673,661.200	
	VORNADO REALTY TRUST	13,819.000	1,388,256.740	
	WELLTOWER INC	28,765.000	2,175,209.300	
	WEYERHAEUSER CO	63,671.000	1,952,789.570	
アメリカ・ドル 小計		880,096.000	53,377,029.090 (5,380,938,303)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	86,344.000	506,839.280	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	303,337.800	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	202,394.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	638,000.790	
	SEGRO PLC	82,229.000	325,215.690	
イギリス・ポンド 小計		365,132.000	1,975,788.360 (257,623,045)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	248,171.320	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	468,663.720	
カナダ・ドル 小計		26,512.000	716,835.040 (55,303,823)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,868.000	314,275.000	
	GECINA SA	3,212.000	408,405.800	
	KLEPIERRE	20,051.000	771,963.500	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,773.000	1,762,527.750	
ユーロ 小計		34,904.000	3,257,172.050 (362,262,676)	
香港・ドル	LINK REIT	181,000.000	9,719,700.000	
香港・ドル 小計		181,000.000	9,719,700.000 (126,356,100)	
投資証券 合計		1,487,644	6,182,483,947 (6,182,483,947)	
合計			7,032,116,713 (7,032,116,713)	

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 593銘柄	62.77%	-%	-%	66.21%
	投資証券 36銘柄	-%	-%	2.18%	
イギリス・ポンド	株式 109銘柄	7.38%	-%	-%	7.63%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.10%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.23%	-%	-%	0.24%
オーストラリア・ドル	株式 62銘柄	2.57%	-%	-%	2.92%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.30%	-%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	3.77%	-%	-%	3.87%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.48%	-%	-%	0.54%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	3.57%	-%	-%	3.64%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.06%	-%	-%	1.08%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.77%	-%	-%	0.79%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.07%	-%	-%	0.07%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.25%	-%	-%	0.25%
ユーロ	株式 237銘柄	11.17%	-%	-%	11.53%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.15%	
香港・ドル	株式 30銘柄	1.15%	-%	-%	1.23%
	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。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,698,070,125	4,327,859,938
コール・ローン		291,474,629	257,557,361
国債証券		278,281,011,942	246,435,012,067
派生商品評価勘定		503,338	383,796
未収利息		2,758,190,278	2,099,442,256
前払費用		79,304,720	116,757,577
流動資産合計		287,108,555,032	253,237,012,995
資産合計		287,108,555,032	253,237,012,995
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		68,304	69,393
未払金		2,595,316,426	-
未払解約金		164,480,000	128,380,000
流動負債合計		2,759,864,730	128,449,393
負債合計		2,759,864,730	128,449,393
純資産の部			
元本等			
元本	1	157,146,877,456	153,756,172,524
剰余金			
剰余金又は欠損金()		127,201,812,846	99,352,391,078
元本等合計		284,348,690,302	253,108,563,602
純資産合計		284,348,690,302	253,108,563,602
負債純資産合計		287,108,555,032	253,237,012,995

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年1月12日現在	平成28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	170,818,512,952円	157,146,877,456円
同期中追加設定元本額	12,207,972,753円	19,538,780,375円
同期中一部解約元本額	25,879,608,249円	22,929,485,307円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・	4,632,609,121円	4,657,576,294円
ファンド		
M I T O ラップ型ファンド	16,724,661円	18,453,626円
（安定型）		
M I T O ラップ型ファンド	49,393,546円	49,958,425円
（中立型）		
M I T O ラップ型ファンド	89,340,619円	76,117,034円
（積極型）		
グローバル8資産ラップファン	40,990,271円	38,466,174円
ド（安定型）		
グローバル8資産ラップファン	40,835,253円	44,194,140円
ド（中立型）		
グローバル8資産ラップファン	30,173,710円	30,803,761円
ド（積極型）		
たわらノーロード 先進国債券	62,320,567円	335,095,097円
たわらノーロード 先進国債券	- 円	606,412円
<ラップ向け>		
D I A M外国債券インデックス	4,607,021,121円	4,669,154,605円
ファンド< D C年金>		
D I A Mバランス・ファンド<	381,621,256円	409,560,484円
D C年金> 1 安定型		

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,288,327,853円	1,342,108,909円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,366,997,870円	1,396,294,182円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	325,115,189円	329,414,218円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	702,091,373円	702,091,373円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	519,717,784円	508,486,226円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27,522,794円	27,854,849円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	566,824,244円	575,214,392円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	23,731,784円	22,038,818円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	8,579,678円	10,139,432円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	14,982,115円	18,447,725円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	30,501,024円	34,021,297円
クルーズコントロールDIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	592,777,382円	454,750,989円
DIAM DC バランス・F(成長型)	24,577,735円	34,924,753円
DIAM DC バランス・F(成長型)	23,881,626円	34,167,706円
クルーズコントロール<DC年金>	94,958円	122,277円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	4,320,630円	2,788,106円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	5,894,605円	4,869,065円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	1,169,942円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,825,343,934円	1,681,199,585円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,964,866,690円	7,844,833,698円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,693,991,211円	4,309,315,918円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,391,636,066円	4,584,579,483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)	329,808,770円	246,920,518円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	128,365,986円	135,908,048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)	3,354,131,198円	1,541,804,314円

D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資家 限定)	899,947,592円	834,638,389円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	113,441,262円	95,495,469円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	198,730,313円	162,405,252円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	47,708,392円	42,645,519円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	23,864,059円	19,888,235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)	9,650,231,702円	6,436,925,429円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	2,440,640,362円	1,519,112,343円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,443,074,652円	5,044,396,602円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	3,018,044,259円	2,867,773,547円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,878,613,601円	4,629,882,412円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	946,789,436円	957,544,555円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	3,449,631,113円	3,393,963,726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)	4,623,134,564円	4,498,153,103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)	17,389,138,689円	16,927,285,923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)	54,973,620円	56,954,254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)	2,366,232,785円	2,432,893,808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)	11,247,854,827円	11,168,532,699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)	16,086,647,926円	16,537,657,599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)	20,408,738,102円	20,838,484,079円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	124,405円	27,666,037円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	27,840,409円	10,037,825円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	18,575,269円	1,401,032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)	18,317,153,960円	18,787,964,059円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	128,954,949円	127,936,598円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	84,456,122円	162,702,241円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	117,081,015円	234,554円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	141,447円	145,360円
計	157,146,877,456円	153,756,172,524円
2 . 受益権の総数	157,146,877,456口	153,756,172,524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27年7月14日 至 平成28年1月12日	自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年1月12日現在	平成28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28年1月12日現在	平成28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	5,119,597,918	6,911,518,000
合計	5,119,597,918	6,911,518,000

（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27年2月24日から平成28年1月12日まで及び平成28年2月23日から平成28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28年1月12日 現在				平成28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	85,913,818	-	85,410,480	503,338	93,808,596	-	93,424,800	383,796
ユーロ	85,913,818	-	85,410,480	503,338	93,808,596	-	93,424,800	383,796
買 建	1,250,924,084	-	1,250,855,780	68,304	1,674,302,693	-	1,674,233,300	69,393
アメリカ・ドル	562,946,128	-	562,918,410	27,718	670,247,125	-	670,219,200	27,925
イギリス・ポンド	187,711,251	-	187,704,900	6,351	83,706,014	-	83,703,960	2,054
カナダ・ドル	-	-	-	-	167,252,528	-	167,239,520	13,008
ポーランド・ズロチ	25,000,678	-	24,976,850	23,828	-	-	-	-
ユーロ	475,266,027	-	475,255,620	10,407	753,097,026	-	753,070,620	26,406
合計	1,336,837,902	-	1,336,266,260	435,034	1,768,111,289	-	1,767,658,100	314,403

（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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.8094円	1.6462円
(1万口当たり純資産額)	(18,094円)	(16,462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28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 0.5 07/31/17	18,000,000.000	17,990,820.000	
		US T N/B 0.625 04/30/18	10,500,000.000	10,504,830.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	13,500,000.000	13,531,050.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	19,000,000.000	19,040,660.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	2,700,000.000	2,711,259.000	
		US T N/B 0.875 07/15/18	10,000,000.000	10,051,100.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	7,032,200.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	10,000,000.000	10,071,000.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	3,500,000.000	3,529,785.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	5,039,450.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,547,710.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	11,135,300.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,971,180.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	7,112,630.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	2,000,000.000	2,040,540.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	13,237,640.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,427,953.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	12,245,520.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	13,500,000.000	13,774,185.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	20,500,000.000	20,826,565.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	12,700,000.000	12,935,077.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,349,180.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	7,500,000.000	7,673,400.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	8,000,000.000	8,202,480.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	15,000,000.000	15,462,750.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,721,475.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	5,184,350.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	3,000,000.000	3,113,190.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	15,000,000.000	15,567,150.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	15,000,000.000	15,570,600.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	5,186,300.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,215,580.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,328,320.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,440,770.000	
		US T N/B 1.875 08/31/17	14,000,000.000	14,209,440.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	7,000,000.000	7,311,150.000	
US T N/B 1.875 09/30/17	18,000,000.000	18,281,880.000			
US T N/B 2.0 02/15/22	7,500,000.000	7,888,425.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	10,010,625.000			
US T N/B 2.0 02/15/25	13,500,000.000	14,261,400.000			

US T N/B 2.0 02/28/21	11,000,000.000	11,532,730.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,600,000.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	12,000,000.000	12,679,680.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,278,880.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,941,112.000	
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,994,550.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,427,440.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	11,203,815.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	10,059,550.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,630,740.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,152,340.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,575,000.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,700,000.000	13,444,093.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,482,480.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	12,198,970.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,500,000.000	11,298,945.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	13,000,000.000	14,022,710.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	10,000,000.000	10,229,200.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	15,000,000.000	15,520,800.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,664,065.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,831,034.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,000,000.000	7,579,110.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	7,000,000.000	7,597,170.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,850,770.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,500,000.000	2,717,375.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	8,000,000.000	8,151,840.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,719,360.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,666,550.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,441,300.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	9,000,000.000	9,485,100.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	7,000,000.000	7,781,480.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,890,000.000	4,442,769.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	11,097,600.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,877,836.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,391,000.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	6,070,000.000	7,081,019.200	
US T N/B 2.875 08/15/45	8,000,000.000	9,340,000.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,715,124.300	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,500,000.000	7,764,900.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,800,000.000	8,113,216.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	4,500,000.000	5,382,045.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,000,000.000	1,222,650.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	5,600,000.000	6,846,000.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,893,230.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,824,320.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,100,000.000	7,445,294.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,000,000.000	3,666,540.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,690,000.000	8,542,795.500	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,345,280.000	

US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	14,640,360.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,000,000.000	2,600,620.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	15,406,440.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	19,814,040.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	6,169,020.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	6,500,000.000	8,679,515.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,443,750.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	6,942,364.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,480,000.000	4,690,100.400	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	7,782,267.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,487,760.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,570,000.000	3,517,276.300	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	12,861,000.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,345,032.100	
US T N/B 4.25 11/15/17	9,000,000.000	9,445,410.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,887,180.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,450,000.000	2,125,381.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	4,086,903.600	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,450,000.000	3,608,752.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,860,000.000	4,186,525.200	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,800,000.000	4,134,592.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	2,133,145.300	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,200,000.000	3,274,898.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	5,600,283.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	4,641,540.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.000	15,683,700.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	2,256,711.600	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	2,139,600.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,979,634.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,605,500.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,546,496.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	2,089,500.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	2,233,644.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,347,260.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	8,188,080.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,906,560.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,850,440.000	
アメリカ・ドル 小計	989,910,000.000 (99,792,827,100)	1,072,816,007.500 (108,150,581,716)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	2,400,000.000	2,423,040.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	5,500,000.000	5,625,400.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,400,000.000	2,525,496.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,200,000.000	1,273,560.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,700,000.000	4,917,375.000	

UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,559,380.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,500,000.000	1,603,245.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,800,000.000	4,220,584.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,200,000.000	3,582,112.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,200,000.000	1,668,036.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,800,000.000	3,265,556.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,600,000.000	4,925,160.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,000,000.000	5,748,400.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,650,000.000	4,692,090.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,600,000.000	4,260,100.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,451,020.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	4,400,000.000	5,045,040.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,200,000.000	3,757,984.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,400,000.000	4,435,440.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,770,350.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,350,000.000	4,946,610.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,950,000.000	4,201,685.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,050,000.000	3,123,585.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,160,000.000	2,935,008.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,500,000.000	3,867,500.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,700,000.000	4,445,550.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,561,642.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,490,000.000	4,621,689.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,400,000.000	2,681,040.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,500,000.000	5,238,450.000	

	UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,750,000.000	4,498,450.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.000	7,582,900.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,900,000.000	4,267,060.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,500,000.000	4,028,750.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	1,800,000.000	1,947,780.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,880,000.000	3,930,912.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,750,000.000	2,780,925.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	2,000,000.000	2,752,000.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	800,000.000	878,320.000	
	イギリス・ポンド 小計	109,400,000.000 (14,264,666,000)	145,039,224.000 (18,911,664,417)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,876,080.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,500,000.000	4,936,545.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,413,397.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	1,800,000.000	1,813,824.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	4,164,732.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	949,986.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,558,320.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,200,000.000	2,368,740.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,000,000.000	4,448,600.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	2,149,584.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	500,000.000	563,640.000	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	1,500,000.000	1,555,935.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	2,006,614.500	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	4,100,000.000	4,963,706.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,800,000.000	1,847,916.000	

	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,371,392.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,900,000.000	4,966,182.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	5,200,000.000	5,506,124.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,718,470.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.000	3,696,810.000	
オーストラリア・ドル 小計		55,250,000.000 (4,207,287,500)	62,876,597.500 (4,788,052,900)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	600,000.000	1,028,118.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,424,792.000	
	CANADA 1.25 02/01/18	1,500,000.000	1,518,180.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,600,000.000	1,620,752.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,450,000.000	2,491,797.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,899,810.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,786,955.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	4,900,000.000	4,956,938.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,000,000.000	1,034,110.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	2,016,648.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,500,000.000	2,834,350.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,400,000.000	2,696,688.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	800,000.000	1,043,744.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	900,000.000	1,279,377.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,200,000.000	2,489,146.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,300,000.000	4,797,381.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,550,000.000	3,721,725.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	5,700,000.000	6,236,883.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,500,000.000	3,749,675.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	5,500,000.000	5,891,490.000	
CANADA 5.0 06/01/37	2,060,000.000	3,329,413.200		
CANADA 5.75 06/01/29	1,800,000.000	2,762,820.000		
CANADA 5.75 06/01/33	2,000,000.000	3,288,300.000		
カナダ・ドル 小計		54,960,000.000 (4,240,164,000)	64,899,092.200 (5,006,964,963)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	1,430,000.000	1,420,218.800	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	200,000.000	226,198.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	710,000.000	801,235.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	444,600.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	510,876.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	710,000.000	783,840.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,756,800.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,449,746.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	571,718.400	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,167,500.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,550,000.000	1,650,130.000	

シンガポール・ドル 小計		9,880,000.000 (739,419,200)	10,782,862.200 (806,989,407)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	3,000,000.000	3,262,890.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,914,440.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,800,000.000	14,465,148.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,900,000.000	10,327,161.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	15,370,000.000	18,836,396.100	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	7,780,000.000	8,160,597.600	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	13,300,000.000	15,055,334.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	14,181,717.200	
スウェーデン・クローナ 小計		79,260,000.000 (929,719,800)	95,203,683.900 (1,116,739,212)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	2,000,000.000	2,039,160.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,500,000.000	9,576,950.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	11,470,000.000	13,326,190.100	
	DENMARK 3.0 11/15/21	12,000,000.000	14,213,640.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	9,780,000.000	10,395,162.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	13,900,000.000	16,030,592.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	18,000,000.000	34,253,460.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	3,700,000.000	5,948,490.000	
デンマーク・クローネ 小計		79,350,000.000 (1,186,282,500)	105,783,644.100 (1,581,465,479)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	1,000,000.000	1,057,850.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	4,099,098.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	8,279,592.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	10,400,000.000	12,157,080.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	9,100,000.000	10,498,670.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	7,560,000.000	8,432,424.000	
ノルウェー・クローネ 小計		39,460,000.000 (466,022,600)	44,524,714.000 (525,836,872)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,950,230.000	
	POLAND 10/25/18	2,000,000.000	1,924,700.000	
	POLAND 2.5 07/25/18	1,500,000.000	1,526,250.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,500,000.000	3,391,150.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,199,707.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,494,298.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	7,000,000.000	7,264,600.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,397,755.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	4,000,000.000	4,182,760.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	3,890,000.000	4,384,030.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,994,239.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,357,040.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,773,640.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,322,160.000	
ポーランド・ズロチ 小計		48,570,000.000 (1,224,449,700)	52,162,559.500 (1,315,018,125)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	2,000,000.000	1,978,500.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,209,666.600	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,213,618.000	

	MALAYSIA 3.502 05/31/27	3,270,000.000	3,155,582.700	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	3,700,000.000	3,760,717.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,153,783.400	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	797,560.000	
	MALAYSIA 4.012 09/15/17	3,500,000.000	3,554,320.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	2,450,000.000	2,419,032.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,738,370.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,468,467.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	4,300,000.000	4,398,728.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,818,257.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,229,087.400	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,000,000.000	1,043,690.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	800,000.000	834,216.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,772,752.000	
マレーシア・リングgit 小計		41,730,000.000 (1,049,509,500)	42,546,347.700 (1,070,040,645)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	17,000,000.000	24,215,140.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	41,000,000.000	52,413,170.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	41,500,000.000	41,231,910.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,956,950.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	10,000,000.000	10,409,800.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	26,000,000.000	27,036,100.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	11,164,900.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,493,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	23,635,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	3,000,000.000	3,481,770.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	33,000,000.000	34,409,760.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	32,685,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,884,260.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	37,539,760.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	19,000,000.000	23,937,150.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	15,000,000.000	16,117,050.000	
	メキシコ・ペソ 小計		325,500,000.000 (1,773,975,000)	370,612,020.000 (2,019,835,509)

ユーロ	AUSTRIA 0.75 10/20/26	800,000.000	853,824.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,700,000.000	1,899,699.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,442,075.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,617,420.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,506,456.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	800,000.000	1,062,856.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	970,000.000	1,567,665.500	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,868,670.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,600,000.000	3,140,800.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,600,000.000	1,981,600.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	570,000.000	1,150,037.700	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,500,000.000	2,950,875.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,800,000.000	3,064,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	1,200,000.000	1,268,856.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	2,300,000.000	2,606,820.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,700,000.000	1,835,150.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,500,000.000	2,215,200.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,931,597.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,700,000.000	2,889,648.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,000,000.000	1,083,930.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,000,000.000	1,077,050.000	
	BELGIUM 1.25 06/22/18	2,000,000.000	2,074,100.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	1,050,120.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	700,000.000	866,635.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	2,000,000.000	2,359,380.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,171,948.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,207,552.500	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	2,100,000.000	2,345,784.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,500,000.000	2,613,075.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	3,000,000.000	3,554,490.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	2,100,000.000	2,267,832.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	1,950,000.000	2,197,767.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	2,300,000.000	2,894,895.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	1,400,000.000	2,158,464.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	2,500,000.000	4,478,750.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,691,155.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/22	2,600,000.000	3,363,646.000	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,297,072.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	3,000,000.000	5,378,340.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	3,050,000.000	4,922,273.000	
	BUNDESABL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,039,860.000	
	BUNDESABL 0.5 02/23/18	2,600,000.000	2,650,544.000	
	BUNDESABL 0.5 04/12/19	4,300,000.000	4,445,125.000	
	BUNDESABL 0.5 10/13/17	4,100,000.000	4,160,680.000	
BUNDESABL 04/09/21	3,200,000.000	3,296,000.000		
BUNDESABL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,870,218.000		
BUNDESSCHAT 12/15/17	2,000,000.000	2,019,840.000		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,900,000.000	4,175,613.000		

DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,200,000.000	4,479,300.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,893,644.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,568,064.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,000,000.000	1,135,500.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,334,204.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	3,800,000.000	4,380,298.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,838,532.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,754,340.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,500,000.000	3,994,130.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.000	2,862,475.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,100,000.000	3,658,775.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	2,700,000.000	3,035,745.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,500,000.000	2,875,875.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,700,000.000	3,088,935.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,800,000.000	4,424,980.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,580,000.000	4,153,980.600	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	4,500,000.000	5,167,800.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	7,700,000.000	8,774,150.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,800,000.000	4,546,320.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,350,000.000	4,080,305.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	5,900,000.000	6,647,530.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	4,900,000.000	5,448,310.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,900,000.000	4,174,638.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,500,000.000	6,194,685.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	4,000,000.000	4,194,120.000	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	5,200,000.000	5,713,240.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,200,000.000	4,173,290.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,600,000.000	2,551,440.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,100,000.000	5,674,705.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,500,000.000	5,108,000.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,700,000.000	4,858,380.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,360,000.000	3,954,652.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,400,000.000	2,118,830.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,300,000.000	2,424,305.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,550,000.000	2,708,780.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	519,485.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	500,000.000	520,500.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	479,025.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	323,850.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	900,000.000	934,911.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	770,000.000	864,402.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	450,300.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	800,000.000	936,280.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	710,000.000	1,076,573.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	780,000.000	1,023,828.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,130,000.000	1,299,839.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,000,000.000	1,193,000.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	700,000.000	737,562.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,010,000.000	1,382,740.500	
FINLAND 4.375 07/04/19	810,000.000	932,229.000	
FR TREASURY 1.0 07/25/17	3,000,000.000	3,049,980.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	2,200,000.000	3,530,670.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,300,000.000	4,502,229.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,284,920.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	4,300,000.000	4,431,107.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,777,690.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	1,200,000.000	1,245,684.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	4,031,150.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,000,000.000	1,104,800.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	2,200,000.000	2,545,774.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	5,020,224.000	

FRANCE OAT 1.75 11/25/24	6,460,000.000	7,459,685.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,100,000.000	4,889,414.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	5,469,108.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,800,000.000	6,215,280.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,200,000.000	10,395,540.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,440,000.000	7,001,062.400	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,348,340.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,250,000.000	5,238,740.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,300,000.000	7,535,745.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,582,765.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,940,000.000	9,264,206.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	7,200,000.000	8,673,912.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,544,658.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	6,200,000.000	6,716,026.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,600,000.000	5,063,500.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	3,688,372.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,010,000.000	6,762,343.700	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	7,600,000.000	8,637,096.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	5,000,000.000	5,314,650.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,672,455.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,600,000.000	8,795,622.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,300,000.000	7,957,150.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,800,000.000	6,665,884.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,800,000.000	8,005,152.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,600,000.000	8,488,564.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,604,313.100	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	5,464,200.000	
IRISH 0.8 03/15/22	800,000.000	842,672.000	
IRISH 1.0 05/15/26	500,000.000	527,505.000	
IRISH 2.0 02/18/45	790,000.000	949,635.300	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,346,026.000	
IRISH 3.4 03/18/24	1,230,000.000	1,529,541.900	
IRISH 3.9 03/20/23	800,000.000	1,006,720.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,130,000.000	1,289,612.500	
IRISH 4.5 04/18/20	1,750,000.000	2,069,830.000	
IRISH 4.5 10/18/18	1,540,000.000	1,711,864.000	

IRISH 5.0 10/18/20	1,400,000.000	1,710,800.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,600,000.000	2,285,440.000	
IRISH 5.5 10/18/17	300,000.000	322,626.000	
IRISH 5.9 10/18/19	750,000.000	902,100.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,500,000.000	3,572,800.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	3,000,000.000	3,055,800.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,068,840.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	500,000.000	524,755.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,602,400.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,558,050.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,100,000.000	3,130,628.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,913,381.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,000,000.000	1,094,200.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	500,000.000	533,450.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,495,880.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	400,000.000	445,640.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,300,000.000	4,102,659.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,700,000.000	3,372,678.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,100,000.000	2,278,101.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,835,425.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,680,190.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	4,500,000.000	5,278,950.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,316,233.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,750,000.000	6,448,600.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	5,104,000.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,327,440.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,200,000.000	5,991,440.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	7,246,720.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	11,500,000.000	12,320,525.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,211,900.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,848,000.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,696,854.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,703,760.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,100,000.000	3,888,764.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	6,200,000.000	6,780,320.000	

ITALY BTPS 4.75 08/01/23	3,000,000.000	3,839,100.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,780,230.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,230,000.000	4,440,442.500	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,726,912.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	6,200,000.000	7,767,360.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,430,000.000	5,889,773.600	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,800,000.000	5,696,960.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	4,663,500.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	5,380,275.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	3,000,000.000	3,170,610.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,700,000.000	6,836,620.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	5,000,000.000	6,496,050.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,258,200.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,470,000.000	3,921,372.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,400,000.000	6,963,440.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,700,000.000	5,694,300.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,700,000.000	2,690,930.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	2,400,000.000	3,798,720.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	1,150,000.000	1,186,616.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,500,000.000	2,582,700.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	800,000.000	837,680.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	3,500,000.000	3,600,905.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	2,060,000.000	2,157,850.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,400,000.000	2,764,008.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,500,000.000	2,954,825.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,808,168.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,387,610.600	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,750,000.000	2,882,670.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	3,380,000.000	4,028,960.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,270,000.000	2,649,203.500	

NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,500,000.000	3,182,500.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,270,000.000	4,142,523.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,150,000.000	3,741,860.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	2,906,582.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,501,335.000	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	2,290,000.000	2,408,896.800	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,300,000.000	3,751,990.000	
SPAIN 0.25 01/31/19	1,400,000.000	1,410,878.000	
SPAIN 0.25 04/30/18	800,000.000	805,344.000	
SPAIN 0.5 10/31/17	2,000,000.000	2,017,100.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	700,000.000	718,522.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	1,200,000.000	1,253,172.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,800,000.000	1,895,130.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	3,200,000.000	3,443,072.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,200,000.000	2,330,174.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,850,042.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,155,080.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	3,900,000.000	4,470,336.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,503,138.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	200,000.000	239,750.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	2,700,000.000	2,939,760.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	3,400,000.000	4,152,182.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,597,800.000	
SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,671,950.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,636,230.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	5,600,000.000	6,393,240.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,665,890.000	
SPAIN 4.5 01/31/18	5,700,000.000	6,112,680.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	4,700,000.000	5,359,645.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	3,600,000.000	4,726,800.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	2,300,000.000	3,509,915.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	3,200,000.000	4,147,200.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,490,295.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,200,000.000	3,411,540.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	3,118,500.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	2,000,000.000	3,293,200.000	
SPAIN 5.4 01/31/23	3,200,000.000	4,209,280.000	
SPAIN 5.5 04/30/21	4,200,000.000	5,272,260.000	
SPAIN 5.5 07/30/17	1,300,000.000	1,377,675.000	
SPAIN 5.75 07/30/32	3,000,000.000	4,775,010.000	
SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,830,646.000	
SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,617,750.000	

	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,357,135.000	
ユーロ 小計		717,330,000.000 (79,781,442,600)	900,383,436.200 (100,140,645,774)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	28,042,750.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,715,124.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,523,883.200	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	19,660,000.000	18,522,472.400	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,599,000.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	10,110,000.000	9,269,555.700	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	14,000,000.000	14,024,780.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	8,000,000.000	7,375,840.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	3,270,000.000	3,294,198.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	10,065,020.500	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	9,000,000.000	8,404,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	15,000,000.000	13,960,350.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	3,000,000.000	2,881,590.000	
	南アフリカ・ランド 小計		156,010,000.000 (1,079,589,200)	144,678,763.800 (1,001,177,045)
国債証券 合計		210,735,354,700 (210,735,354,700)	246,435,012,067 (246,435,012,067)	
合計		210,735,354,700 (210,735,354,700)	246,435,012,067 (246,435,012,067)	

(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 126銘柄	42.73%	43.89%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	7.47%	7.67%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	1.89%	1.94%
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	1.98%	2.03%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.32%	0.33%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.44%	0.45%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.62%	0.64%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.21%	0.21%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.52%	0.53%
マレーシア・リングギット	国債証券 17銘柄	0.42%	0.43%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.80%	0.82%
ユーロ	国債証券 253銘柄	39.56%	40.64%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.40%	0.41%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		504,593,573	551,295,658
コール・ローン		39,386,400	771,456,421
株式		30,903,849,398	33,016,616,407
投資信託受益証券		213,344,522	228,200,023
投資証券		99,523,361	108,141,051
派生商品評価勘定		-	56,533,988
未収入金		-	762,225
未収配当金		15,714,978	203,278,452
差入委託証拠金		296,519,211	358,743,475
流動資産合計		32,072,931,443	35,295,027,700
資産合計		32,072,931,443	35,295,027,700
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		50,458,335	1,676,969
未払金		126,028,250	722,729,675
未払解約金		16,871,000	17,307,000
流動負債合計		193,357,585	741,713,644
負債合計		193,357,585	741,713,644
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,843,963,916	43,354,457,363
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	7,964,390,058	8,801,143,307
元本等合計		31,879,573,858	34,553,314,056
純資産合計		31,879,573,858	34,553,314,056
負債純資産合計		32,072,931,443	35,295,027,700

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28年1月12日現在	平成28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	34,877,056,190円	39,843,963,916円
同期中追加設定元本額	13,181,307,136円	13,462,610,283円
同期中一部解約元本額	8,214,399,410円	9,952,116,836円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデック スファンド< D C 年金 >	870,537,540円	1,287,494,886円
D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	19,979,163円	109,971,037円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	8,599,925円	9,493,872円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,440,862円	25,710,953円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	81,231,193円	39,215,095円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	21,077,324円	19,789,538円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	21,035,717円	22,745,716円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	27,436,748円	15,870,387円
たわらノーロード 新興国株式	- 円	426,894,579円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	- 円	10,783,741円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	510,196,135円	534,755,049円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	29,658,485円	35,045,169円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	76,889,791円	98,599,627円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	188,143,542円	212,453,833円
投資のソムリエ	1,077,540,227円	1,812,394,970円
クルーズコントロール	462,865,911円	379,160,098円
投資のソムリエ< D C 年金 >	19,208,691円	41,920,471円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C 年金 >	84,150,830円	124,852,987円
クルーズコントロール< D C 年 金 >	72,955円	102,607円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	8,415,198円	5,763,126円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	11,161,515円	10,101,934円
投資のソムリエ< D C 年金 >リ スク抑制型	234,481円	6,129,158円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	495,412円

	エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用)	7,098,394,804円	7,655,896,389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)	191,028,343円	190,433,666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)	2,145,904,763円	2,193,601,345円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	16,439,453,886円	17,217,537,348円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	10,425,305,887円	10,867,244,370円
	計	39,843,963,916円	43,354,457,363円
2 .	受益権の総数	39,843,963,916口	43,354,457,363口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,964,390,058円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,801,143,307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27年7月14日 至 平成28年1月12日	自 平成28年1月13日 至 平成28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	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年1月12日現在	平成28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	(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28年1月12日現在	平成28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	7,723,490,794	509,266,622
投資信託受益証券	38,814,652	1,113,663
投資証券	6,865,722	2,164,879
合計	7,769,171,168	512,545,164

(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27年4月21日から平成28年1月12日まで及び平成28年4月19日から平成28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28年1月12日 現在				平成28年7月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	116,409,498	-	116,397,951	11,547
アメリカ・ドル	-	-	-	-	116,409,498	-	116,397,951	11,547
買 建	153,134,540	-	153,127,000	7,540	1,556,984,988	-	1,556,504,420	480,568
アメリカ・ドル	153,134,540	-	153,127,000	7,540	928,462,800	-	927,360,000	1,102,800
インド・ルピー	-	-	-	-	81,900,500	-	83,050,000	1,149,500
タイ・バーツ	-	-	-	-	23,548,743	-	23,480,600	68,143
チェコ・コルナ	-	-	-	-	1,346,847	-	1,343,970	2,877
トルコ・リラ	-	-	-	-	9,325,864	-	9,326,400	536
ハンガリー・ フォリント	-	-	-	-	926,640	-	920,140	6,500
フィリピン・ペ ソ	-	-	-	-	8,025,375	-	8,025,000	375
ポーランド・ズ ロチ	-	-	-	-	9,165,604	-	9,147,600	18,004
マレーシア・リ ンギット	-	-	-	-	28,225,705	-	28,218,300	7,405
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	38,895,150	-	38,841,600	53,550
韓国・ウォン	-	-	-	-	135,493,985	-	135,540,350	46,365
香港・ドル	-	-	-	-	157,234,660	-	157,179,000	55,660
台湾・ドル	-	-	-	-	116,409,498	-	116,064,000	345,498
南アフリカ・ラ ンド	-	-	-	-	18,023,617	-	18,007,460	16,157
合計	153,134,540	-	153,127,000	7,540	1,673,394,486	-	1,672,902,371	469,021

(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28年1月12日 現在				平成28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	854,188,415	-	803,737,620	50,450,795	1,824,551,117	-	1,879,877,157	55,326,040
合計	854,188,415	-	803,737,620	50,450,795	1,824,551,117	-	1,879,877,157	55,326,040

(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28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.8001円	0.7970円
(1万口当たり純資産額)	(8,001円)	(7,970円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28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	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	30,200	40.610	1,226,422.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,273	12.960	236,818.080	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	65,400	6.211	406,199.400	
	CREDICORP LTD	5,949	156.330	930,007.170	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	47,625	8.500	404,812.500	
	NETEASE INC-ADR	7,000	185.130	1,295,910.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,480	25.770	192,759.600	
	LUKOIL SPON ADR	39,101	43.250	1,691,118.250	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	48,121	1.810	87,099.010	
	GAZPROM PAO ADR	539,379	4.320	2,330,117.280	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	96,568	3.850	371,786.800	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	68,580	1.537	105,407.460	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	69,241	4.920	340,665.720	
	SISTEMA JSFC GDR	15,837	7.720	122,261.640	
	NOVATEK OAO GDR	8,543	101.600	867,968.800	
	BAIDU INC -SPON ADR	24,200	159.800	3,867,160.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,034	13.590	720,732.060	
	ROSTELECOM SPON ADR	19,141	8.200	156,956.200	
	ROSNEFT OIL CO GDR	110,287	5.050	556,949.350	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,000	41.700	500,400.000	
	SEVERSTAL GDR	21,971	10.150	223,005.650	
	TATNEFT ADR	22,267	29.100	647,969.700	
	VTB BANK OJSC GDR	255,010	2.086	531,950.860	
	DP WORLD LTD	14,393	16.800	241,802.400	
	MAGNIT PJSC GDR	26,409	34.000	897,906.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	34,300	12.250	420,175.000	
	SOUFUN HOLDINGS LTD ADR	23,400	5.220	122,148.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	154,666	0.883	136,570.070	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	3,800	61.960	235,448.000	
	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO LTD ADR	8,100	72.340	585,954.000	
	SBERBANK ADR	246,884	8.810	2,175,048.040	
	PHOSAGRO OAO GDR	11,514	13.950	160,620.300	
YY INC-ADR	2,400	33.620	80,688.000		
MEGAFON PJSC GDR	11,719	10.200	119,533.800		

	58.COM INC ADR	6,600	46.740	308,484.000	
	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	3,200	29.490	94,368.000	
	JD.COM INC ADR	61,400	20.720	1,272,208.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	88,400	78.990	6,982,716.000	
アメリカ・ドル 小計		2,282,392		31,648,147.140 (3,190,449,714)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	82,067	12.800	1,050,457.600	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	88,156	5.330	469,871.480	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	154,715	18.950	2,931,849.250	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	175,877	6.200	1,090,437.400	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	55,579	10.350	575,242.650	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	298,755	6.350	1,897,094.250	
	ARABTEC HOLDING CO	190,922	1.510	288,292.220	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	265,978	2.680	712,821.040	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	174,604	1.300	226,985.200	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	178,166	2.860	509,554.760	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC-RTS	22,039	1.740	38,347.860	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,686,858		9,790,953.710 (268,467,951)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	112,346	978.400	109,919,326.400	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,259	1,114.700	8,091,607.300	
	ASIAN PAINTS LTD	23,671	1,010.700	23,924,279.700	
	EICHER MOTORS LTD	1,038	19,451.600	20,190,760.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	33,094	1,453.450	48,100,474.300	
	SHREE CEMENT LTD	777	15,648.500	12,158,884.500	
	ICICI BANK LTD	94,024	241.950	22,749,106.800	
	STATE BANK OF INDIA LTD	136,898	218.300	29,884,833.400	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,923	1,465.900	4,284,825.700	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	23,672	511.150	12,099,942.800	
	TATA STEEL LTD	25,639	318.350	8,162,175.650	
	TATA MOTORS LTD	133,641	466.300	62,316,798.300	
	JSW STEEL LTD	7,479	1,476.950	11,046,109.050	
	TATA POWER CO LTD	83,703	73.200	6,127,059.600	
	NESTLE INDIA LTD	2,134	6,412.150	13,683,528.100	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	137.900	6,770,752.100	
	GAIL INDIA LTD	26,335	375.500	9,888,792.500	
	VEDANTA LTD	81,588	143.100	11,675,242.800	
AXIS BANK LTD	52,720	546.450	28,808,844.000		
TITAN COMPANY LTD	25,302	401.450	10,157,487.900		

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	78,975	223.300	17,635,117.500	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	881	6,122.000	5,393,482.000	
LUPIN LTD	19,710	1,639.150	32,307,646.500	
ACC LTD	3,300	1,597.650	5,272,245.000	
BAJAJ FINANCE LTD	1,390	8,207.800	11,408,842.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	129,665	1,286.900	166,865,888.500	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	48,150	453.100	21,816,765.000	
INFOSYS LTD	159,109	1,158.200	184,280,043.800	
WIPRO LTD	52,275	561.650	29,360,253.750	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	55,994	920.700	51,553,675.800	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,999	1,370.200	9,590,029.800	
HCL TECHNOLOGIES LTD	50,030	721.850	36,114,155.500	
DABUR INDIA LTD	44,319	312.800	13,862,983.200	
HERO MOTOCORP LTD	4,116	3,167.800	13,038,664.800	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,965	3,561.250	35,487,856.250	
BHARTI AIRTEL LTD	85,376	355.050	30,312,748.800	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	2,624.650	14,288,594.600	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	85,247	777.500	66,279,542.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	6,922	1,121.800	7,765,099.600	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,953	4,161.800	37,260,595.400	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,754	836.000	10,662,344.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,762	778.950	16,951,509.900	
HAVELLS INDIA LTD	20,340	357.400	7,269,516.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	27,798	279.450	7,768,151.100	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,711	1,210.800	16,601,278.800	
CIPLA LTD/INDIA	30,629	520.300	15,936,268.700	
LARSEN & TOUBRO LTD	27,151	1,532.650	41,612,980.150	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,015	3,400.050	10,251,150.750	
ASHOK LEYLAND LTD	103,421	93.800	9,700,889.800	
BOSCH LTD	705	22,789.150	16,066,350.750	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	40,871	2,426.600	99,177,568.600	
NTPC LTD	139,441	153.800	21,446,025.800	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,629	1,487.600	9,861,300.400	
YES BANK LTD	8,712	1,120.250	9,759,618.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	61,876	258.100	15,970,195.600	
BHARAT FORGE LTD	9,622	737.650	7,097,668.300	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	110,967	126.850	14,076,163.950	
ITC LTD	298,245	245.850	73,323,533.250	

	UNITED PHOSPHORUS LTD	23,573	551.650	13,004,045.450	
	SIEMENS INDIA LTD	6,447	1,276.000	8,226,372.000	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,946	1,646.500	18,022,589.000	
	TECH MAHINDRA LTD	21,631	502.950	10,879,311.450	
	CAIRN INDIA LTD	43,218	145.350	6,281,736.300	
	IDEA CELLULAR LTD	103,591	102.000	10,566,282.000	
	MARICO LTD	38,600	264.100	10,194,260.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	193.950	4,997,121.750	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	70,134	207.050	14,521,244.700	
	BAJAJ AUTO LTD	6,953	2,604.600	18,109,783.800	
	COAL INDIA LTD	65,944	311.700	20,554,744.800	
	TATA MOTORS LTD	35,104	296.200	10,397,804.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	354.400	8,404,596.000	
	BHARTI INFRATEL LTD	50,446	344.800	17,393,780.800	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,789	688.200	18,436,189.800	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	360.300	6,538,003.800	
インド・ルピー 小計		3,288,813		1,849,995,442.300 (2,793,493,118)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	184,100	6,425.000	1,182,842,500.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	144,301	14,800.000	2,135,654,800.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	389,600	7,025.000	2,736,940,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	128,100	43,800.000	5,610,780,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,784,500	7,400.000	13,205,300,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,434,600	3,970.000	17,605,362,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	704,700	3,730.000	2,628,531,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	43,500	68,250.000	2,968,875,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	825,000	3,690.000	3,044,250,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	113,500	16,425.000	1,864,237,500.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	1,000,800	1,810.000	1,811,448,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	3,590.000	1,042,593,440.000	
	BANK MANDIRI	793,100	9,400.000	7,455,140,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	196,000	19,750.000	3,871,000,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	978,100	10,750.000	10,514,575,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	953,400	2,340.000	2,230,956,000.000	
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	597,200	5,150.000	3,075,580,000.000		

	KALBE FARMA TBK PT	1,728,800	1,515.000	2,619,132,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	279,700	9,250.000	2,587,225,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,087,800	13,225.000	14,386,155,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	3,610.000	1,049,427,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,759,900	1,150.000	2,023,885,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	625,200	1,000.000	625,200,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,220.000	1,040,070,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	5,150.000	965,625,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	2,090.000	1,238,952,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	885.000	965,092,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	91,300	16,950.000	1,547,535,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	148,500	6,600.000	980,100,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	344,900	2,500.000	862,250,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	535,800	3,220.000	1,725,276,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	22,792,817		115,599,989,740.000 (890,119,921)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	10,674	72.400	772,797.600	
	QATAR NATIONAL BANK	17,378	141.700	2,462,462.600	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	13,439	37.050	497,914.950	
	OOREDOO QSC	6,737	89.300	601,614.100	
	DOHA BANK QSC	10,788	35.200	379,737.600	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,398	213.000	510,774.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,763	98.200	1,253,326.600	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,187	97.000	503,139.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	25,786	23.100	595,656.600	
	MASRAF AL RAYAN	32,030	34.100	1,092,223.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	33.350	263,998.600	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	73,441	18.250	1,340,298.250	
	VODAFONE QATAR	31,747	10.690	339,375.430	
カタール・リアル	小計	250,284		10,613,318.330 (294,307,317)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	35,125	8,800.000	309,100,000.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	8,908	37,600.000	334,940,800.000	
	ECOPETROL SA	413,049	1,350.000	557,616,150.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	9,067	36,920.000	334,753,640.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	362,757	1,170.000	424,425,690.000	

	CEMENTOS ARGOS SA	38,592	11,820.000	456,157,440.000	
	GRUPO ARGOS SA	26,973	18,580.000	501,158,340.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	39,277	25,320.000	994,493,640.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	20,613	37,660.000	776,285,580.000	
コロンビア・ペソ	小計	954,361		4,688,931,280.000 (161,299,236)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	163.500	3,220,950.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	24.000	2,068,800.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	310,900	16.500	5,129,850.000	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PCL-NVDR	39,400	64.500	2,541,300.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	141,400	145.000	20,503,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	834,855	7.700	6,428,383.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	58,100	175.000	10,167,500.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,307,700	2.280	2,981,556.000	
	IRPC PCL NVDR	937,000	4.880	4,572,560.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	165,200	15.800	2,610,160.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	10,100	188.000	1,898,800.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	229,000	26.500	6,068,500.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	94,200	161.000	15,166,200.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	361,920	9.650	3,492,528.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	45,500	68.750	3,128,125.000	
	PTT PCL	88,500	312.000	27,612,000.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	164,100	21.800	3,577,380.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,050	474.000	5,237,700.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	39,100	385.000	15,053,500.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	24,500	474.000	11,613,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	99,400	178.000	17,693,200.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	123,600	58.250	7,199,700.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	351,700	23.700	8,335,290.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	30,300	182.500	5,529,750.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	183,910	40.500	7,448,355.000	
	THAI OIL PCL NVDR	75,100	59.500	4,468,450.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	84.000	3,494,400.000	
	CP ALL PCL NVDR	445,700	53.000	23,622,100.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	9.650	4,972,645.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	114,545	82.000	9,392,690.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	75,722	29.250	2,214,868.500	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	29.250	1,606,790.250	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	189,608	58.750	11,139,470.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	129,100	21.100	2,724,010.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	578,400	6.750	3,904,200.000	
タイ・パーツ 小計		7,977,343		266,817,711.250 (765,766,831)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,700	885.600	5,933,520.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	213.000	1,209,201.000	
	CEZ	15,209	425.500	6,471,429.500	
チェコ・コルナ 小計		27,586		13,614,150.500 (56,090,301)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,829,922	32.000	186,557,504.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,315	28,661.000	95,011,215.000	
	BANCO DE CHILE	2,171,579	70.320	152,705,435.280	
	EMPRESAS CMPC SA	114,623	1,383.400	158,569,458.200	
	EMPRESAS COPEC SA	39,358	6,005.300	236,356,597.400	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	7,649.400	100,895,586.000	
	ENTEL CHILE SA	12,381	5,985.000	74,100,285.000	
	ENDESA CHILE	274,605	588.370	161,569,343.850	
	ENERSIS AMERICAS SA	1,664,838	113.580	189,092,300.040	
	COLBUN SA	616,527	159.560	98,373,048.120	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	385.160	86,320,518.560	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,602.700	55,645,726.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	25,767	4,428.800	114,116,889.600	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,243	16,857.000	138,952,251.000	
	SACI FALABELLA	44,391	5,024.200	223,029,262.200	
	ITAU CORPBANCA	16,810,453	5.569	93,617,412.750	
	CENCOSUD SA	117,239	1,892.000	221,816,188.000	
	AES GENER SA	209,506	314.450	65,879,161.700	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOMUNICACIONES SA-RTS	3,393	576.000	1,954,368.000	
	ENDESA AMERICAS SA	274,605	301.130	82,691,803.650	
ENERSIS CHILE SA	1,664,838	75.500	125,695,269.000		
チリ・ペソ 小計		30,144,269		2,662,949,623.350 (406,898,703)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	191,935	8.320	1,596,899.200	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	20,373	19.030	387,698.190	
	ARCEL IK	20,283	20.440	414,584.520	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	132,172	4.230	559,087.560	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	32.880	183,601.920	
	KOC HOLDING AS	54,486	13.550	738,285.300	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	47,602	3.900	185,647.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	56,870	3.410	193,926.700	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	13,047	24.420	318,607.740	
	TURK HAVA YOLLARI	51,118	5.620	287,283.160	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	81,365	10.300	838,059.500	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	202,941	7.820	1,586,998.620	
	TURKIYE IS BANKASI	139,877	4.610	644,832.970	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,419	61.100	697,700.900	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	14,893	21.300	317,220.900	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	78,404	3.980	312,047.920	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	89,021	9.370	834,126.770	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	35.560	229,397.560	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,655	57.200	1,067,066.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	4.630	294,505.040	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	15,347	12.240	187,847.280	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	58,286	8.500	495,431.000	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	39,975	6.200	247,845.000	
	トルコ・リラ 小計	1,413,712		12,618,701.550 (439,383,188)	
ハンガリー・フォ リント	RICHTER GEDEON NYRT	12,643	5,758.000	72,798,394.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,603	17,450.000	62,872,350.000	
	OTP BANK NYRT	21,675	6,480.000	140,454,000.000	
	ハンガリー・フォリント 小計	37,921		276,124,744.000 (97,748,159)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	658,700	38.200	25,162,340.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	176,670	78.000	13,780,260.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	59,486	99.000	5,889,114.000	
	AYALA CORP	22,883	844.000	19,313,252.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	169,800	15.260	2,591,148.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.500	4,398,125.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,960	2,356.000	6,973,760.000	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	62.000	2,522,160.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	257,790	84.250	21,718,807.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	37,710	244.800	9,231,408.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	47,451	90.900	4,313,295.900	
	BDO UNIBANK INC	149,778	112.800	16,894,958.400	
	MEGAWORLD CORP	1,126,000	4.650	5,235,900.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	8,715	2,094.000	18,249,210.000	
	ROBINSONS LAND CORP	175,600	30.100	5,285,560.000	
	SECURITY BANK CORP	18,000	191.000	3,438,000.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	743,775	27.500	20,453,812.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	78,780	200.000	15,756,000.000	
	SM INVESTMENTS CORP	14,032	987.000	13,849,584.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	876,500	5.500	4,820,750.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,180,800	6.820	8,053,056.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	44.000	5,407,600.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	7,425	1,470.000	10,914,750.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,328,285		244,252,851.300 (522,701,101)	
ブラジル・レアル	BRF SA	54,592	49.500	2,702,304.000	
	VALE SA	114,527	16.190	1,854,192.130	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	30.420	243,907.560	
	VALE SA-PREF A	167,496	13.020	2,180,797.920	
	RAIA DROGASIL SA	20,900	61.990	1,295,591.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	7.140	497,658.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	19.920	463,140.000	
	BANCO DO BRASIL SA	74,200	17.230	1,278,466.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	349,278	7.800	2,724,368.400	
	LOJAS AMERICANAS SA	56,874	17.500	995,295.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	14,670	11.830	173,546.100	
	GERDAU SA	82,730	6.160	509,616.800	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	13,706	48.060	658,710.360	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	266,310	12.300	3,275,613.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	351,012	9.840	3,453,958.080	
	KROTON EDUCACIONAL SA	128,268	14.120	1,811,144.160	
	CCR SA	81,820	16.600	1,358,212.000	
	WEG SA	50,340	13.700	689,658.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	249,015	26.510	6,601,387.650	
	BANCO BRADESCO SA	73,441	27.540	2,022,565.140	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	26.940	398,712.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	54,806	9.060	496,542.360	

SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	10.800	339,120.000	
CPFL ENERGIA SA	17,474	22.460	392,466.040	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	257,808	31.940	8,234,387.520	
PORTO SEGURO SA	9,400	26.400	248,160.000	
FIBRIA CELULOSE SA	21,490	21.230	456,232.700	
BRASKEM SA	14,130	18.410	260,133.300	
TRACTEBEL ENERGIA SA	13,970	39.330	549,440.100	
LOCALIZA RENT A CAR	14,605	34.700	506,793.500	
TELEFONICA BRASIL S.A.	40,228	46.100	1,854,510.800	
LOJAS RENNER SA	55,300	25.500	1,410,150.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	29,200	13.980	408,216.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	32,952	70.750	2,331,354.000	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,000	34.500	379,500.000	
TOTVS SA	11,500	31.060	357,190.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	18,400	49.600	912,640.000	
EMBRAER SA	61,560	17.840	1,098,230.400	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,000	12.580	213,860.000	
M DIAS BRANCO SA	3,300	104.180	343,794.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	8,200	19.950	163,590.000	
ODONTOPREV SA	22,300	13.420	299,266.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	49,400	12.900	637,260.000	
JBS SA	61,100	9.880	603,668.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	66,649	7.790	519,195.710	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	30,398	29.420	894,309.160	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,000	61.270	428,890.000	
DURATEX SA	27,734	9.100	252,379.400	
SUL AMERICA SA	15,448	15.400	237,899.200	
HYPERMARCAS SA	29,900	24.710	738,829.000	
BM&FBOVESPA SA	154,300	18.150	2,800,545.000	
QUALICORP SA	17,800	19.350	344,430.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,400	18.740	700,876.000	
CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,259	43.700	885,318.300	
CIELO SA	91,423	35.000	3,199,805.000	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	62,100	27.750	1,723,275.000	
AMBEV SA	420,995	19.400	8,167,303.000	

	KLABIN SA	49,200	15.100	742,920.000	
	RUMO LOGISTICA OPERADORA MULTIMODAL SA	68,700	5.540	380,598.000	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA-RCT	4,964	14.000	69,496.000	
	AES TIETE ENERGIA SA	14,300	15.430	220,649.000	
ブラジル・リアル 小計		4,240,040		79,992,065.790 (2,443,757,610)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	59,382	4.410	261,874.620	
	MBANK	1,260	306.000	385,560.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	63.030	163,625.880	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,128	68.010	824,825.280	
	BANK PEKAO SA	12,005	128.250	1,539,641.250	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.010	293,586.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	28,565	64.050	1,829,588.250	
	LPP SA	112	4,826.800	540,601.600	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,975	266.400	792,540.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,110	22.750	1,754,252.500	
	CCC SA	2,584	174.100	449,874.400	
	SYNTHOS SA	46,508	3.500	162,778.000	
	EUROCASH SA	7,580	45.950	348,301.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	29.630	236,358.510	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	167,670	5.370	900,387.900	
	CYFROWY POLSAT SA	16,740	21.960	367,610.400	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	68.510	263,969.030	
	ENEA SA	18,176	9.520	173,035.520	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,259	11.660	865,859.940	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	2.940	242,620.560	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	49,966	27.650	1,381,559.900		
ALIOR BANK SA	4,463	51.000	227,613.000		
ENERGA SA	16,930	8.950	151,523.500		
ポーランド・ズロチ 小計		753,963		14,157,587.040 (356,912,769)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	170,200	4.360	742,072.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.520	237,752.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	251,500	4.390	1,104,085.000	
	DIGI.COM BHD	308,200	4.750	1,463,950.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	6.000	414,720.000	
	RHB BANK BHD	85,180	5.110	435,269.800	

HAP SENG CONSOLIDATED BHD	45,000	7.700	346,500.000	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	69,235	3.120	216,013.200	
GAMUDA BHD	159,300	4.910	782,163.000	
GENTING BHD	199,000	7.970	1,586,030.000	
YTL CORP BHD	370,010	1.630	603,116.300	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	16,656	15.300	254,836.800	
HONG LEONG BANK BHD	59,308	13.180	781,679.440	
IJM CORP BHD	254,060	3.460	879,047.600	
IOI CORP BHD	189,613	4.280	811,543.640	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	39,500	23.200	916,400.000	
MALAYAN BANKING BHD	306,775	8.200	2,515,555.000	
LAFARGE MALAYSIA BHD	34,100	7.800	265,980.000	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	86,100	4.050	348,705.000	
MISC BHD	103,880	7.300	758,324.000	
PPB GROUP BHD	43,600	16.220	707,192.000	
PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	23.440	410,200.000	
PETRONAS GAS BHD	63,900	22.200	1,418,580.000	
GENTING MALAYSIA BHD	269,400	4.290	1,155,726.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	54.420	620,388.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.780	644,100.000	
TENAGA NASIONAL BHD	305,050	14.100	4,301,205.000	
UMW HOLDINGS BHD	47,900	5.380	257,702.000	
DIALOG GROUP BHD	310,844	1.530	475,591.320	
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	242,130	19.340	4,682,794.200	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.410	205,666.830	
AIRASIA BHD	83,400	2.590	216,006.000	
SIME DARBY BERHAD	229,800	7.410	1,702,818.000	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	63,700	4.400	280,280.000	
AXIATA GROUP BERHAD	222,000	5.500	1,221,000.000	
MAXIS BHD	164,100	5.930	973,113.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	214,700	6.560	1,408,432.000	
SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	319,200	1.390	443,688.000	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	125,500	2.850	357,675.000	
IHH HEALTHCARE BHD	263,100	6.630	1,744,353.000	
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	1.480	176,416.000	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	99,600	4.240	422,304.000	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	139,639	2.330	325,358.870	
マレーシア・リンギット 小計	6,435,863		39,614,332.000 (996,300,450)	

メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	240,400	30.300	7,284,120.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	44,600	147.980	6,599,908.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	17,800	181.360	3,228,208.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	164,300	34.400	5,651,920.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	215,300	95.410	20,541,773.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	147,300	56.790	8,365,167.000	
	GRUMA SAB DE CV	20,005	269.470	5,390,747.350	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	24,350	216.130	5,262,765.500	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	46,900	75.390	3,535,791.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	220,300	101.820	22,430,946.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	93,588	38.100	3,565,702.800	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,115	454.150	6,410,327.250	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	140,600	43.550	6,123,130.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	18,935	283.390	5,365,989.650	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	330,552	41.330	13,661,714.160	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,807,678	11.320	31,782,914.960	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,300	31.220	6,190,926.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	36,400	127.750	4,650,100.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	465,900	44.280	20,630,052.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	32,500	190.540	6,192,550.000	
OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	22.070	1,549,314.000		
GENTERA SAB DE CV	95,000	32.600	3,097,000.000		
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	29,000	42.730	1,239,170.000		
GRUPO LALA SAB DE CV	56,500	40.780	2,304,070.000		
メキシコ・ペソ 小計	5,530,523		201,054,306.670 (1,095,745,972)		
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	500,000	0.146	73,000.000	
	ALPHA BANK A.E.	100,000	1.620	162,000.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.187	747.620	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	17.500	61,565.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	8.130	81,332.520	
	FF GROUP	3,130	17.600	55,088.000	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	0.525	855.750	
	OPAP SA	8,501	6.450	54,831.450	
JUMBO SA	5,623	10.750	60,447.250		
ユーロ 小計	636,404		549,867.590		

韓国・ウォン					
CHEIL WORLDWIDE INC	7,090	16,350.000	115,921,500.000		
HANMI PHARM CO LTD	1,068	158,000.000	168,744,000.000		
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,205	94,500.000	302,872,500.000		
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,979	264,500.000	787,945,500.000		
DONGBU INSURANCE CO LTD	4,549	64,300.000	292,500,700.000		
COWAY CO LTD	4,877	93,000.000	453,561,000.000		
KT&G CORP	10,471	130,000.000	1,361,230,000.000		
S-1 CORPORATION	1,763	106,500.000	187,759,500.000		
KOREA GAS CORP	2,659	39,050.000	103,833,950.000		
CJ CORP	1,369	207,000.000	283,383,000.000		
KAKAO CORP	2,808	93,700.000	263,109,600.000		
SK TELECOM CO LTD	1,782	216,000.000	384,912,000.000		
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,400	76,900.000	184,560,000.000		
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	15,692	7,830.000	122,868,360.000		
NCSOFT CORPORATION	1,603	251,000.000	402,353,000.000		
LG UPLUS CORP	18,179	10,800.000	196,333,200.000		
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	21,600.000	87,480,000.000		
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,183	5,620.000	68,468,460.000		
POSCO DAEWOO CORP	4,351	23,150.000	100,725,650.000		
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	828	1,128,000.000	933,984,000.000		
LG CHEM LTD	4,072	247,500.000	1,007,820,000.000		
LG CHEM LTD	726	179,500.000	130,317,000.000		
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	202	671,000.000	135,542,000.000		
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	38,284	37,500.000	1,435,650,000.000		
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	4,997	37,950.000	189,636,150.000		
S-OIL CORP	4,176	75,200.000	314,035,200.000		
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	9,297	23,600.000	219,409,200.000		
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,874	34,800.000	169,615,200.000		
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,310	281,000.000	368,110,000.000		
HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	66,400.000	196,212,000.000		
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,546	100,500.000	356,373,000.000		
HYUNDAI MOBIS	6,090	249,500.000	1,519,455,000.000		
SK HYNIX INC	51,317	31,050.000	1,593,392,850.000		
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,675	31,900.000	212,932,500.000		
HYUNDAI MOTOR CO	2,107	92,200.000	194,265,400.000		
HYUNDAI MOTOR CO	12,836	130,500.000	1,675,098,000.000		

HYUNDAI STEEL CO	6,811	45,400.000	309,219,400.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,220	11,050.000	256,581,000.000	
KCC CORP	483	370,000.000	178,710,000.000	
KIA MOTORS CORP	23,045	40,900.000	942,540,500.000	
KOREA ZINC CO LTD	772	534,000.000	412,248,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	23,078	59,600.000	1,375,448,800.000	
HANWHA CORP	3,785	35,000.000	132,475,000.000	
KOREAN AIR CO LTD	3,845	25,350.000	97,470,750.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	98,900.000	148,350,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	630	219,000.000	137,970,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,423	63,600.000	90,502,800.000	
KT CORP	3,085	30,650.000	94,555,250.000	
LG ELECTRONICS INC	9,583	56,200.000	538,564,600.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	430	189,000.000	81,270,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	60	1,721,000.000	103,260,000.000	
HANSSEM CO LTD	869	165,500.000	143,819,500.000	
LG CORP	8,420	64,900.000	546,458,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	9,040.000	104,773,600.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	25,800.000	101,781,000.000	
NAVER CORP	2,510	750,000.000	1,882,500,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	15,700.000	51,354,700.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,243	127,500.000	158,482,500.000	
DONGSUH CO INC	3,429	32,350.000	110,928,150.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,287	42,400.000	139,368,800.000	
OTTOGI CORP	112	842,000.000	94,304,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,571	163,500.000	420,358,500.000	
KANGWON LAND INC	10,592	40,600.000	430,035,200.000	
POSCO	6,229	200,500.000	1,248,914,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,933	104,500.000	515,498,500.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	5,000	46,700.000	233,500,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	9,061	1,460,000.000	13,229,060,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	12,525	8,890.000	111,347,250.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,637	1,198,000.000	1,961,126,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	191,000.000	127,779,000.000	
HYOSUNG CORP	1,930	120,000.000	231,600,000.000	
ORION CORP	326	906,000.000	295,356,000.000	
YUHAN CORP	699	315,500.000	220,534,500.000	
HANON SYSTEMS	16,843	10,200.000	171,798,600.000	

	HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	28,900.000	165,019,000.000	
	GS HOLDINGS CORP	4,663	47,350.000	220,793,050.000	
	LG DISPLAY CO LTD	20,914	28,850.000	603,368,900.000	
	SK NETWORKS CO LTD	10,280	5,880.000	60,446,400.000	
	CELLTRION INC	6,829	99,900.000	682,217,100.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	26,693	22,450.000	599,257,850.000	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,731	167,000.000	289,077,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	6,755	23,000.000	155,365,000.000	
	LOTTE SHOPPING CO	1,045	197,500.000	206,387,500.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,297	94,800.000	596,955,600.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,819	421,500.000	1,188,208,500.000	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	853	244,000.000	208,132,000.000	
	SAMSUNG CARD CO	2,877	40,700.000	117,093,900.000	
	SK INNOVATION CO LTD	5,739	136,500.000	783,373,500.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	710	386,500.000	274,415,000.000	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,117	65,800.000	139,298,600.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,196	79,900.000	95,560,400.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	4,116	203,000.000	835,548,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	34,032	31,800.000	1,082,217,600.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,454	82,500.000	119,955,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,314	75,700.000	402,269,800.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	23,598	7,950.000	187,604,100.000	
	HANMI PHARM CO LTD	471	690,000.000	324,990,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	19,713	5,540.000	109,210,020.000	
	O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,833	70,100.000	128,493,300.000	
	E-MART CO LTD	1,770	167,000.000	295,590,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	8,450.000	114,404,550.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	52,900.000	131,297,800.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,577	51,200.000	336,742,400.000	
	BGF RETAIL CO LTD	797	204,500.000	162,986,500.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,961	140,500.000	416,020,500.000	
	WOORI BANK	27,802	9,450.000	262,728,900.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,688	126,000.000	842,688,000.000	
	韓国・ウォン 小計	731,186		56,087,969,590.000 (4,918,914,934)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	115,000	9.100	1,046,500.000	
	JIANGSU EXPRESS	110,000	10.460	1,150,600.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	4.430	717,660.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	548,000	87.450	47,922,600.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	112,000	18.680	2,092,160.000	
	BEIJING ENTERPRISES	44,500	44.400	1,975,800.000	

HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	4.460	1,596,680.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	5.650	1,559,400.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	176,000	5.020	883,520.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	64,500	65.750	4,240,875.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	128,000	3.480	445,440.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	78,320	11.150	873,268.000	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	244,000	7.750	1,891,000.000	
CNOOC LTD	1,586,000	9.490	15,051,140.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	282,000	8.560	2,413,920.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	378,000	6.900	2,608,200.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	353,120	24.900	8,792,688.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	244,888	18.060	4,422,677.280	
CITIC LTD	394,000	11.060	4,357,640.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	148,000	8.400	1,243,200.000	
LENOVO GROUP LTD	618,000	4.680	2,892,240.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,898,000	5.230	9,926,540.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	536,742	7.980	4,283,201.160	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	136,790	13.940	1,906,852.600	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,293,200	5.400	12,383,280.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	15.260	1,175,020.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	70,000	37.000	2,590,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	282,000	6.160	1,737,120.000	
COSCO PACIFIC LTD	130,000	7.570	984,100.000	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	116,000	20.650	2,395,400.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	362,000	2.640	955,680.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	84,000	14.460	1,214,640.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	152,000	11.700	1,778,400.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	465,000	4.410	2,050,650.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	78,000	23.000	1,794,000.000	
BYD CO LTD	59,500	47.100	2,802,450.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,246,000	3.500	4,361,000.000	

CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	5.900	944,000.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,020,000	1.780	1,815,600.000	
SINOTRANS LTD	147,000	3.320	488,040.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	233,000	8.240	1,919,920.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	405,192	11.700	4,740,746.400	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	188,000	5.560	1,045,280.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	179,200	10.780	1,931,776.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	273,000	6.550	1,788,150.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	665,000	16.320	10,852,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	535,000	2.910	1,556,850.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	4.460	713,600.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,443,000	0.620	1,514,660.000	
WEICHAI POWER CO LTD	84,720	7.710	653,191.200	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	3.660	1,087,020.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	17.320	796,720.000	
TINGYI HOLDING CORP	186,000	7.060	1,313,160.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	25.950	778,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	248,000	11.340	2,812,320.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	112,000	16.620	1,861,440.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	7.230	838,680.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	373,000	5.180	1,932,140.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.670	472,610.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	248,000	13.080	3,243,840.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	503,800	177.000	89,172,600.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	466,500	33.150	15,464,475.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	382,000	4.250	1,623,500.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,097,240	0.950	1,042,378.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	2.710	737,120.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	5.480	887,760.000	
ZTE CORP	58,488	9.680	566,163.840	

SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.220	805,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	293,000	13.840	4,055,120.000	
COSCO HOLDINGS	227,000	2.720	617,440.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	782,205	4.860	3,801,516.300	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	162,000	9.930	1,608,660.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	66,000	65.950	4,352,700.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,506,530	5.070	38,058,107.100	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	50,000	38.750	1,937,500.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	7.980	1,819,440.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	141,000	5.930	836,130.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	284,000	3.400	965,600.000	
BANK OF CHINA LTD	7,098,200	3.030	21,507,546.000	
SHUI ON LAND LTD	338,100	1.980	669,438.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	117,500	10.080	1,184,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	90,800	10.500	953,400.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	348,970	16.780	5,855,716.600	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,582,235	4.140	27,250,452.900	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	3.870	811,152.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	390,000	8.020	3,127,800.000	
CHINA COAL ENERGY CO	162,000	4.080	660,960.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	12.800	691,200.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	48,500	42.100	2,041,850.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	11.340	1,190,700.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	489,142	3.230	1,579,928.660	
CHINA CITIC BANK-H	803,800	4.620	3,713,556.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	569,000	4.330	2,463,770.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	93,000	14.880	1,383,840.000	
FOSUN INTERNATIONAL	235,028	9.780	2,298,573.840	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	396,000	2.220	879,120.000	

SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	287,000	3.240	929,880.000	
SOHO CHINA LTD	196,000	3.800	744,800.000	
KINGSOFT CORP LTD	71,000	13.040	925,840.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,239,000	1.140	1,412,460.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	372,000	5.650	2,101,800.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	172,000	9.410	1,618,520.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	487,000	5.100	2,483,700.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	232,600	25.300	5,884,780.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	373,000	4.800	1,790,400.000	
CRRC CORP LTD - H	354,450	6.920	2,452,794.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	110,000	12.300	1,353,000.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235,500	5.150	1,212,825.000	
SINOPHARM GROUP CO	108,000	37.300	4,028,400.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	195,805	9.300	1,820,986.500	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	250,000	3.850	962,500.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	277,000	6.260	1,734,020.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	56,800	17.540	996,272.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	2.650	906,300.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	178,000	4.960	882,880.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	126,500	9.860	1,247,290.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	67,100	27.100	1,818,410.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	531,380	7.360	3,910,956.800	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	306,000	3.290	1,006,740.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,201,000	2.770	6,096,770.000	
FAR EAST HORIZON LTD	194,000	6.100	1,183,400.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	187,500	16.600	3,112,500.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	280,000	12.560	3,516,800.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	638,000	2.870	1,831,060.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	18.500	619,750.000	

	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	114,000	7.030	801,420.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	272,000	6.850	1,863,200.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	3.110	1,004,530.000	
	QINQIN FOODSTUFFS GROUP CAYMAN CO LTD	12,900	3.140	40,506.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	819,000	2.420	1,981,980.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	113,000	14.960	1,690,480.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	112,561	16.080	1,809,980.880	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	120,000	4.510	541,200.000	
	CGN POWER CO LTD	965,000	2.110	2,036,150.000	
	DALIAN WANDA COMMERCIAL PROPERTIES CO LTD	50,200	47.100	2,364,420.000	
	GF SECURITIES CO LTD	118,200	17.120	2,023,584.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	131,200	16.160	2,120,192.000	
	3SBIO INC	90,000	7.950	715,500.000	
香港・ドル	小計	68,230,506		533,665,437.060 (6,937,650,682)	
台湾・ドル	ACER INC	274,532	15.150	4,159,159.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	60,554	267.000	16,167,918.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	47,616	102.000	4,856,832.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	536,729	35.200	18,892,860.800	
	ASIA CEMENT CORP	204,928	27.750	5,686,752.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	393,839	8.200	3,229,479.800	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	71,000	42.550	3,021,050.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	51.800	4,040,400.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,082	71.900	3,313,295.800	
	QUANTA COMPUTER INC	228,858	61.600	14,097,652.800	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	63,070	53.100	3,349,017.000	
	EVA AIRWAYS CORP	178,624	14.150	2,527,529.600	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	219.500	12,239,320.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	413,393	16.300	6,738,305.900	
	CHINA AIRLINES	232,156	9.250	2,147,443.000	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	157,169	65.400	10,278,852.600	
	CHINA STEEL CORP	1,018,058	20.650	21,022,897.700	

CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	286,695	24.350	6,981,023.250	
ADVANTECH CO LTD	30,264	243.500	7,369,284.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	377,304	20.350	7,678,136.400	
DELTA ELECTRONICS INC	166,663	159.000	26,499,417.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	57,000	38.300	2,183,100.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	335,327	118.000	39,568,586.000	
AU OPTRONICS CORP	731,194	10.900	7,970,014.600	
TAIWAN MOBILE CO LTD	147,800	112.500	16,627,500.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	11.900	1,908,664.800	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	265,824	23.650	6,286,737.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	26,630	133.500	3,555,105.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	17,022	295.000	5,021,490.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,285	122.000	6,500,770.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	350,633	78.100	27,384,437.300	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	70,000	30.400	2,128,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	284,594	77.800	22,141,413.200	
TRANSCEND INFORMATION INC	19,897	91.900	1,828,534.300	
GIANT MANUFACTURING	26,151	200.500	5,243,275.500	
MEDIATEK INC	130,507	238.000	31,060,666.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	582,936	36.050	21,014,842.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	573,189	16.600	9,514,937.400	
HOTAI MOTOR CO LTD	21,000	313.000	6,573,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	140,000	80.000	11,200,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	27,088	115.000	3,115,120.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	890,141	10.750	9,569,015.750	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	701,920	34.100	23,935,472.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,150,403	7.570	8,708,550.710	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	603,128	18.400	11,097,555.200	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,211,120	82.100	99,432,952.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	931,495	23.800	22,169,581.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	2,875.000	23,632,500.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	704,751	12.250	8,633,199.750	

SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	739,724	6.220	4,601,083.280	
INVENTEC CO LTD	231,005	23.350	5,393,966.750	
HTC CORPORATION	65,832	98.100	6,458,119.200	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	172,893	46.800	8,091,392.400	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	833,650	9.560	7,969,694.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,380,452	16.900	23,329,638.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	821,323	16.750	13,757,160.250	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	21,950	138.500	3,040,075.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	62,560	71.100	4,448,016.000	
NAN YA PLASTICS CORP	419,828	60.900	25,567,525.200	
WISTRON CORP	217,601	23.200	5,048,343.200	
POU CHEN CORP	182,990	41.700	7,630,683.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	427,297	63.600	27,176,089.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,392	251.500	11,667,588.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	101,480	86.500	8,778,020.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	10,658	284.000	3,026,872.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	36.550	2,761,242.850	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	45,715	49.650	2,269,749.750	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	79,791	73.400	5,856,659.400	
SILICONWARE PRECISION INDS	181,743	47.850	8,696,402.550	
STANDARD FOODS CORP	32,120	78.800	2,531,056.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	124,666	34.550	4,307,210.300	
TAIWAN CEMENT CORP	291,874	34.100	9,952,903.400	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	156,000	26.750	4,173,000.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,133,083	164.500	350,892,153.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,019,525	12.400	12,642,110.000	
YULON MOTOR CO	65,149	27.550	1,794,854.950	
INOTERA MEMORIES INC	202,000	23.900	4,827,800.000	
INNOLUX CORPORATION	794,345	10.900	8,658,360.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	137,526	37.850	5,205,359.100	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,879	144.000	2,430,576.000	
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	210.000	2,730,000.000	
HERMES MICROVISION INC	3,000	1,295.000	3,885,000.000	
PEGATRON CORP	176,554	68.300	12,058,638.200	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	90,076	52.400	4,719,982.400	

	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.500	1,974,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	57.800	1,987,453.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	601,424	14.200	8,540,220.800	
	OBI PHARMA INC	9,000	473.000	4,257,000.000	
	CASETEK HOLDINGS LTD	12,000	113.000	1,356,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	12,000	279.000	3,348,000.000	
台湾・ドル	小計	27,373,978		1,260,141,647.340 (3,931,641,940)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	BIDVEST GROUP LTD	28,147	134.470	3,784,927.090	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	40,339	81.000	3,267,459.000	
	DISCOVERY LTD	29,704	118.970	3,533,884.880	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	370,520	11.200	4,149,824.000	
	MASSMART HOLDINGS LTD	9,965	126.300	1,258,579.500	
	GOLD FIELDS LTD	73,055	81.000	5,917,455.000	
	REMGRO LTD	43,549	247.710	10,787,522.790	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	136.480	2,361,240.480	
	MMI HOLDINGS LTD	96,226	21.820	2,099,651.320	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	184,806	25.600	4,731,033.600	
	EXXARO RESOURCES LTD	12,410	71.340	885,329.400	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	576.000	1,833,984.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	10,532	121.210	1,276,583.720	
	MTN GROUP LTD	148,095	140.720	20,839,928.400	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,562	298.470	10,912,660.140	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	64.500	1,304,641.500	
	FIRSTRAND LTD	302,271	44.170	13,351,310.070	
	PSG GROUP LTD	8,154	179.990	1,467,638.460	
	NASPERS LTD	39,052	2,145.000	83,766,540.000	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	21,138	65.640	1,387,498.320	
	NEDBANK GROUP LTD	17,564	183.790	3,228,087.560	
	NETCARE LTD	84,426	30.850	2,604,542.100	
	PICK'N PAY STORES LTD	23,031	72.110	1,660,765.410	
	RMB HOLDINGS LTD	66,732	55.880	3,728,984.160	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	389.200	2,043,689.200	
	SAPPI LTD	47,759	67.400	3,218,956.600	
	SASOL LTD	49,669	384.630	19,104,187.470	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	38,220	163.650	6,254,703.000	
	MR PRICE GROUP LTD	21,087	210.000	4,428,270.000	
	BRAIT SE	28,931	120.990	3,500,361.690	

STANDARD BANK GROUP LTD	115,029	124.100	14,275,098.900	
SPAR GROUP LTD/THE	15,747	195.010	3,070,822.470	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	90,265	80.020	7,223,005.300	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	11,798	144.500	1,704,811.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,215	376.950	11,389,544.250	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	37,976	137.720	5,230,054.720	
TIGER BRANDS LTD	14,721	366.740	5,398,779.540	
SANLAM LTD	125,848	58.600	7,374,692.800	
INVESTEC LTD	23,104	84.400	1,949,977.600	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	66,179	50.900	3,368,511.100	
PIONEER FOODS LTD	12,824	171.010	2,193,032.240	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	17,113	156.350	2,675,617.550	
MONDI LTD	10,429	260.310	2,714,772.990	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	85,649	37.650	3,224,684.850	
RMI HOLDINGS	59,287	39.980	2,370,294.260	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	32,270	27.200	877,744.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	33,143	170.100	5,637,624.300	
SIBANYE GOLD LTD	64,504	56.340	3,634,155.360	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	15.900	1,255,257.300	
FORTRESS INCOME FUND LTD	69,755	34.200	2,385,621.000	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	259,114	82.500	21,376,905.000	
BID CORP LTD	27,891	251.090	7,003,151.190	
南アフリカ・ランド 小計	3,272,251		345,059,282.740 (2,387,810,237)	
合計	194,389,355		33,016,616,407 (33,016,616,407)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28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	1,260,811.000	14,549,758.940	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	164,500.000	27,321,805.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,425,311.000	41,871,563.940 (228,200,023)	
投資信託受益証券 合計			1,425,311	228,200,023 (228,200,023)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	473,555.940	
		トルコ・リラ 小計	162,734.000	473,555.940 (16,489,218)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	233,700.000	9,140,007.000	

メキシコ・ペソ 小計		233,700.000	9,140,007.000 (49,813,038)	
南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,966.000	2,704,614.000	
	RESILIENT REIT LTD	26,226.000	3,341,454.660	
南アフリカ・ランド 小計		47,192.000	6,046,068.660 (41,838,795)	
投資証券 合計		443,626	108,141,051 (108,141,051)	
合計			336,341,074 (336,341,074)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 38銘柄	9.23%	-%	-%	9.57%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 11銘柄	0.78%	-%	-%	0.80%
インド・ルピー	株式 74銘柄	8.08%	-%	-%	8.38%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.58%	-%	-%	2.67%
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.85%	-%	-%	0.88%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.47%	-%	-%	0.48%
タイ・バーツ	株式 35銘柄	2.22%	-%	-%	2.30%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.16%	-%	-%	0.17%
チリ・ペソ	株式 21銘柄	1.18%	-%	-%	1.22%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	1.27% -%	-% -%	-% 0.05%	1.37%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.28%	-%	-%	0.29%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.51%	-%	-%	1.57%
ブラジル・リアル	株式 61銘柄	7.07%	-%	-%	7.33%
ポーランド・ズロチ	株式 23銘柄	1.03%	-%	-%	1.07%
マレーシア・リンギット	株式 43銘柄	2.88%	-%	-%	2.99%
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	3.17% -% -%	-% 0.66% -%	-% -% 0.14%	4.12%
ユーロ	株式 9銘柄	0.18%	-%	-%	0.18%
韓国・ウォン	株式 107銘柄	14.24%	-%	-%	14.75%
香港・ドル	株式 139銘柄	20.08%	-%	-%	20.80%
台湾・ドル	株式 90銘柄	11.38%	-%	-%	11.79%
南アフリカ・ランド	株式 53銘柄 投資証券 2銘柄	6.91% -%	-% -%	-% 0.12%	7.28%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,681,575,183	1,340,658,664
コール・ローン		25,347,818	2,447,769,702
国債証券		45,261,801,641	50,188,470,405
派生商品評価勘定		290,000	-
未収入金		7,879,336,545	-
未収利息		689,019,990	675,837,437
前払費用		340,566,713	134,809,696
流動資産合計		55,877,937,890	54,787,545,904
資産合計		55,877,937,890	54,787,545,904
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,951,000	3,589,660
未払金		252,327,600	3,088,785,435
未払解約金		12,725,000	6,374,000
流動負債合計		268,003,600	3,098,749,095
負債合計		268,003,600	3,098,749,095
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,117,451,125	30,853,888,560
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		23,492,483,165	20,834,908,249
元本等合計		55,609,934,290	51,688,796,809
純資産合計		55,609,934,290	51,688,796,809
負債純資産合計		55,877,937,890	54,787,545,904

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	27,089,131,404円	32,117,451,125円
同期中追加設定元本額	29,628,419,874円	15,576,655,407円
同期中一部解約元本額	24,600,100,153円	16,840,217,972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）	13,743,994円	94,766,105円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	62,230,620円	66,007,340円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	15,001,959円	16,757,240円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	38,845,125円	46,563,531円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	95,788,554円	101,573,970円
投資のソムリエ	1,426,851,882円	2,864,387,945円
クルーズコントロール	249,216,579円	187,812,398円
投資のソムリエ<DC年金>	25,542,585円	66,121,012円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	42,875,511円	58,760,088円
クルーズコントロール<DC年金>	39,295円	50,590円
DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）	2,268,568円	1,431,372円

D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	3,061,585円	2,489,686円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	351,697円	12,547,457円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	352,463円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	5,714,487,906円	3,120,641,050円
為替フルヘッジ型エマージング 債券ファンド(適格機関投資家 限定)	436,148,271円	503,111,358円
エマージング債券パッシブファ ンドV A(適格機関投資家専 用)	3,685,046,795円	3,663,571,532円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A(適格機関投資 家限定)	8,357,358,025円	8,223,044,392円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A(適格機関投資 家限定)	5,300,140,113円	5,179,610,606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)	2,965,384,800円	3,037,431,770円
D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドI I(適格機関投資家限 定)	3,683,067,261円	3,606,856,655円
計	32,117,451,125円	30,853,888,560円
2 . 受益権の総数	32,117,451,125口	30,853,888,560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27年7月14日 至 平成28年1月12日	自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年1月12日現在	平成28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28年1月12日現在	平成28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	1,784,591,995	1,609,994,841
合計	1,784,591,995	1,609,994,841

（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27年4月21日から平成28年1月12日まで及び平成28年4月19日から平成28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28年1月12日 現在				平成28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	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000	-	-	-	-
アメリカ・ドル	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	3,098,149,660	-	3,094,560,000	3,589,660
アメリカ・ドル	-	-	-	-	3,098,149,660	-	3,094,560,000	3,589,660
合計	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000	3,098,149,660	-	3,094,560,000	3,589,660

（注）時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年1月12日現在	平成28年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7315円	1.6753円
(1万口当たり純資産額)	(17,315円)	(16,753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28年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 10.125 05/15/27	2,100,000.000	3,062,010.000	
		BRAZIL 2.625 01/05/23	2,600,000.000	2,389,400.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	9,100,000.000	9,029,475.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	5,600,000.000	5,936,000.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	6,400,000.000	5,936,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	4,500,000.000	4,488,750.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	5,100,000.000	5,610,000.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	3,900,000.000	4,514,250.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	3,000,000.000	3,723,000.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	1,200,000.000	1,551,000.000	
		BRAZIL 8.875 04/15/24	1,600,000.000	2,043,360.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	1,200,000.000	1,450,800.000	
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,184,895.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,700,000.000	1,663,450.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	3,900,000.000	4,130,100.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	3,600,000.000	3,902,400.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	4,600,000.000	4,922,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	5,200,000.000	5,941,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	4,400,000.000	5,247,000.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	5,300,000.000	6,073,800.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	3,400,000.000	4,539,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	1,900,000.000	2,483,870.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	3,000,000.000	3,208,800.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	2,800,000.000	3,085,936.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	1,900,000.000	2,081,070.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	2,800,000.000	3,078,880.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	2,800,000.000	3,064,040.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	800,000.000	834,352.000	
		HUNGARY 4.125 02/19/18	2,100,000.000	2,172,807.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	3,100,000.000	3,485,547.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	3,200,000.000	3,635,200.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	3,200,000.000	3,692,064.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	3,100,000.000	3,467,877.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	5,200,000.000	5,970,900.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	2,200,000.000	3,285,436.000	
		INDONESIA 11.625 03/04/19	4,200,000.000	5,202,330.000	
INDONESIA 3.375 04/15/23	3,300,000.000	3,359,730.000			
INDONESIA 3.75 04/25/22	4,400,000.000	4,596,284.000			

INDONESIA 4.125 01/15/25	3,200,000.000	3,370,624.000	
INDONESIA 4.625 04/15/43	2,800,000.000	2,920,820.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	2,500,000.000	2,732,975.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	3,200,000.000	3,510,560.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	3,100,000.000	3,396,918.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,700,000.000	1,934,736.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	2,400,000.000	2,792,760.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,100,000.000	2,348,955.000	
INDONESIA 6.625 02/17/37	2,500,000.000	3,169,000.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	2,700,000.000	3,521,988.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	2,600,000.000	2,797,600.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,900,000.000	4,037,815.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	1,900,000.000	2,778,465.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	2,200,000.000	2,359,500.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	2,800,000.000	3,120,600.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	3,600,000.000	4,893,480.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,600,000.000	2,122,400.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	2,000,000.000	2,992,500.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,700,000.000	2,652,000.000	
PERU 5.625 11/18/50	4,400,000.000	5,660,380.000	
PERU 6.55 03/14/37	2,200,000.000	3,016,640.000	
PERU 7.125 03/30/19	1,400,000.000	1,617,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	3,400,000.000	4,661,060.000	
PERU 8.75 11/21/33	3,700,000.000	5,904,460.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	2,200,000.000	3,642,892.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	3,000,000.000	3,564,240.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	2,000,000.000	2,208,200.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	2,600,000.000	2,999,334.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	2,200,000.000	2,926,792.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	2,000,000.000	2,554,380.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	1,400,000.000	2,012,514.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,600,000.000	5,362,524.000	

PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	936,400.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	3,300,000.000	5,205,387.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	2,300,000.000	2,758,643.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	3,400,000.000	5,923,208.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,700,000.000	2,053,532.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	2,400,000.000	2,606,088.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	1,800,000.000	2,022,750.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	1,800,000.000	2,316,420.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	4,500,000.000	5,383,125.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	3,800,000.000	4,117,490.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	18,023,500.000	22,075,363.030	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	4,800,000.000	5,660,160.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	3,500,000.000	6,205,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	5,200,000.000	5,367,596.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	5,400,000.000	5,798,250.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	4,600,000.000	5,039,070.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	4,400,000.000	5,049,660.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	2,400,000.000	2,843,976.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	2,800,000.000	2,973,208.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	1,600,000.000	1,756,000.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	3,600,000.000	3,935,232.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,200,000.000	1,360,320.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	2,800,000.000	3,194,968.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	1,000,000.000	1,207,500.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,700,000.000	3,032,775.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	2,300,000.000	4,031,210.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	2,500,000.000	2,456,375.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	2,400,000.000	2,466,408.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	4,300,000.000	4,312,341.000	

TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,612,545.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	4,700,000.000	5,175,358.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	3,900,000.000	4,395,534.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	4,500,000.000	5,161,320.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,800,000.000	3,193,596.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	4,900,000.000	6,108,536.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	5,000,000.000	5,402,500.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	3,500,000.000	4,377,520.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	4,200,000.000	5,253,780.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	1,700,000.000	1,889,873.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	3,300,000.000	3,776,421.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,400,000.000	1,836,814.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	5,100,000.000	6,344,400.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	1,800,000.000	2,065,716.000	
TURKEY 8.0 02/14/34	2,100,000.000	2,894,094.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	600,000.000	642,900.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	6,200,000.000	6,593,700.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	4,700,000.000	5,040,750.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	5,300,000.000	5,795,550.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	4,800,000.000	5,262,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	7,200,000.000	8,064,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	4,200,000.000	4,710,300.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	5,200,000.000	6,480,500.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	4,800,000.000	5,520,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	3,800,000.000	4,255,050.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,500,000.000	7,170,625.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	3,200,000.000	4,389,760.000	
UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	1,200,000.000	1,753,080.000	
UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	1,800,000.000	2,970,000.000	
アメリカ・ドル 小計	421,123,500.000 (42,453,460,035)	497,852,102.030 (50,188,470,405)	
国債証券 合計	42,453,460,035 (42,453,460,035)	50,188,470,405 (50,188,470,405)	
合計	42,453,460,035 (42,453,460,035)	50,188,470,405 (50,188,470,405)	

(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 128銘柄	97.10%	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28年7月29日現在

資産総額	31,091,718,083円
負債総額	40,887,871円
純資産総額(-)	31,050,830,212円
発行済数量	26,101,262,307口
1口当たり純資産額(/)	1.1896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28年7月29日現在

資産総額	283,753,919,033円
負債総額	744,207,668円
純資産総額(-)	283,009,711,365円
発行済数量	146,094,339,413口
1口当たり純資産額(/)	1.9372円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	398,735,456,342円
負債総額	10,246,604,000円
純資産総額(-)	388,488,852,342円
発行済数量	295,667,334,525口
1口当たり純資産額(/)	1.3139円

D I A Mマネーマザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	1,045,675,306円
負債総額	0円
純資産総額(-)	1,045,675,306円
発行済数量	1,034,991,821口
1口当たり純資産額(/)	1.0103円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	259,987,986,034円
負債総額	254,940,508円
純資産総額(-)	259,733,045,526円
発行済数量	101,479,245,363口
1口当たり純資産額(/)	2.5595円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	264,533,397,966円
負債総額	144,395,320円
純資産総額（ - ）	264,389,002,646円
発行済数量	155,159,431,634口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7040円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	38,268,118,676円
負債総額	328,429,636円
純資産総額（ - ）	37,939,689,040円
発行済数量	43,579,576,666口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8706円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	53,948,501,547円
負債総額	32,540,000円
純資産総額（ - ）	53,915,961,547円
発行済数量	31,404,166,557口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7168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) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(平成28年10月1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28年10月1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。

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、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。

平成28年7月29日現在、D I A Mアセットマネジメント株式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	0	0
追加型株式投資信託	389	5,918,600,293,964
単位型公社債投資信託	48	353,027,465,726
単位型株式投資信託	7	79,600,055,072
合計	444	6,351,227,814,762

（ご参考）

平成28年7月29日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式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）

・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	13	250,148,557,515
追加型株式投資信託	234	2,260,638,584,910
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,491,433,486
合計	250	2,512,278,575,911

・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	25	622,747,870,142
追加型株式投資信託	244	3,210,390,488,192
単位型公社債投資信託	6	40,614,819,596
単位型株式投資信託	75	269,539,047,169
合計	350	4,143,292,225,099

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)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31期事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

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、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新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表を参考として添付しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

「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

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（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。

会計上の見積りの変更

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期(平成27年3月31日現在)

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

第31期(平成28年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
 該当事項はありません。

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

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

7. 減損処理を行った有価証券
 該当事項はありません。

(金銭の信託関係)

1. 運用目的の金銭の信託

第30期(平成27年3月31日現在)

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

第31期(平成28年3月31日現在)

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
 該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
 該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
 該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
 該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第30期	第31期
	(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	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(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。
- 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、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。

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。

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

(4) 役員退職慰労引当金

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

(5) 時効後支払損引当金

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

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジの有効性評価の方法

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

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

1. 概要

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

2. 適用予定日

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

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

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

追加情報

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

(損益計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

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

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

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当するものはありません。

(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、記載しておりません。

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。

(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。

なお、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、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。

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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

(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

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金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、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)と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

(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28年3月末現在 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います。

(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
株式会社東邦銀行	23,519	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。
スルガ銀行株式会社	30,043	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	36,166	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社紀陽銀行	80,096	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社阿波銀行	23,452	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社伊予銀行	20,948	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八銀行	24,404	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社肥後銀行	18,128	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社鹿児島銀行	18,130	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社きらやか銀行	22,700	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。
株式会社東和銀行	38,653	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。
信金中央金庫	(1) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余剰資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社	(2) 60,000	日本において保険業務を営んでおります。
ぐんぎん証券株式会社	(3) 3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
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。
池田泉州T T証券株式会社	1,250	「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。
いよぎん証券株式会社	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。
株式会社SBI証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

岡三オンライン証券株式会社	1,000	「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。
日本アジア証券株式会社	4,400	「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。
みずほ証券株式会社	125,167	「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。
東海東京証券株式会社	6,000	「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。
とうほう証券株式会社	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。
内藤証券株式会社	3,002	「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	7,657	「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。
ワイエム証券株式会社	1,270	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28年3月末現在

(1) 出資の総額

(2) 平成28年10月1日現在

(3) 平成28年10月3日現在

(3) 投資顧問会社

a. 名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末現在 200百万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

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。
（ファンドの略称：クルーズコン）

独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているDIAMアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

(注2) 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28年8月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているクルーズコントロールの平成28年1月13日から平成28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、クルーズコントロールの平成28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

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。