

【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27年10月13日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託受 益証券に係るファンドの名称】	投資のソムリエ＜DC年金＞
【届出の対象とした募集内国投資信託受 益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいますが、）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。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当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。

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.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（５）【申込手数料】

ありません。

（ 6 ）【申込単位】

1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

（ 7 ）【申込期間】

継続申込期間：平成27年10月14日から平成28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】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

コールセンター：0120-506-860（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、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。

（ 1 0 ）【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、

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

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（ 1 1 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は以下の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ）【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。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積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は、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、

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は行いません。

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この信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に 安定的なリターンをめざします。

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

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

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

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

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

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

運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

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

■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

基本配分戦略

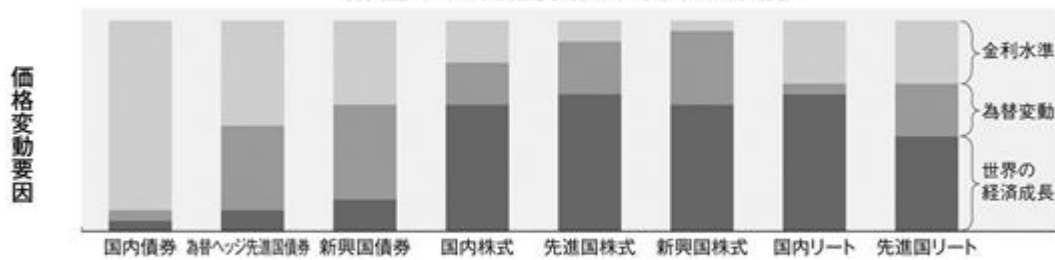
(月次戦略)

資産価格は様々な要因により変動し、またその要因も刻々と変化していきます。

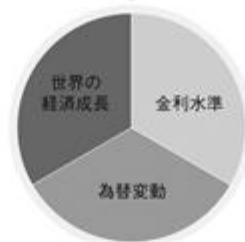
当ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、これを分散させることで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率を決定します。

基本配分比率決定のイメージ

各資産における価格変動要因と要因の比率(例)

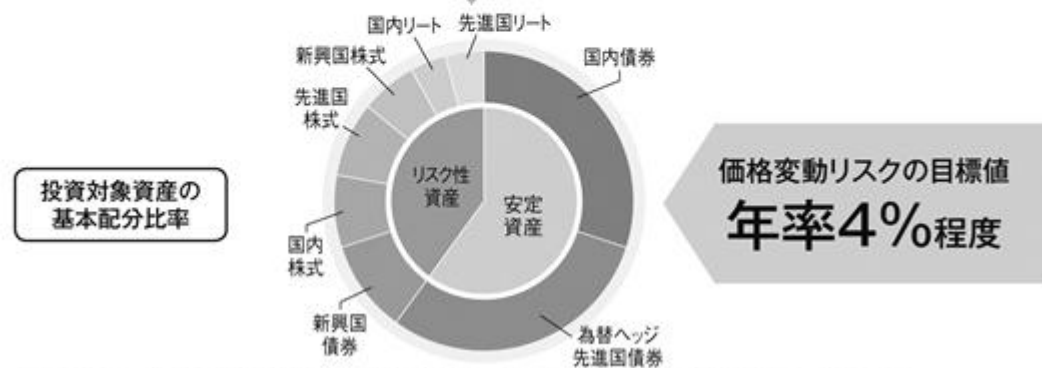


価格変動要因の比率を均等に配分



着目する価格変動要因は
各時点において適宜変更します。

価格変動要因の分散から最適な資産配分の比率を決定



※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、価格変動要因の全てを網羅したものではありません。

機動的配分戦略

(日次戦略)

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

*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等です。

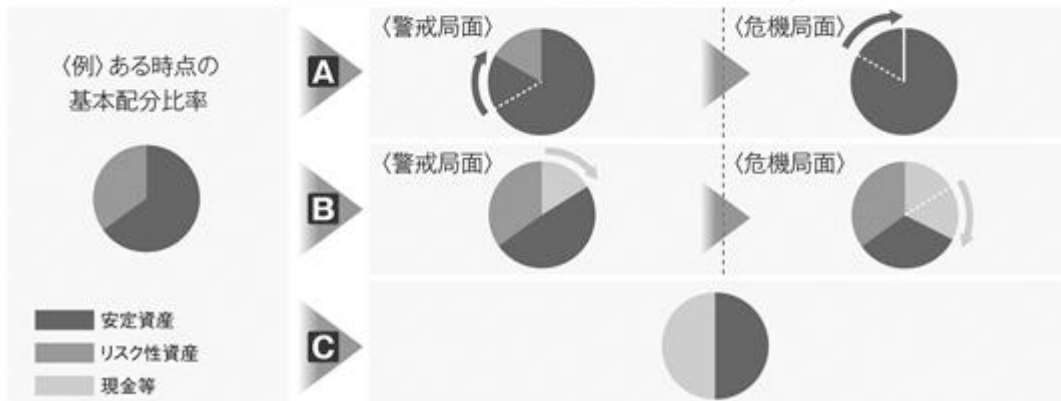
投資行動

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

※2015年6月末時点

※各投資行動は基本配分比率に対するものです。

(ご参考) 配分比率変更のイメージ



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

投資対象資産

	安定資産			
	国内	先進国	新興国	
債券	国内債券	為替ヘッジ先進国債券	新興国債券	
株式	国内株式	先進国株式	新興国株式	
リート	国内リート	先進国リート		

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

リスク性資産

分配方針

年2回の決算時(毎年1月11日および7月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 (一部ヘッジ)
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(債 券、株式、不動 産投信)資産配 分変更型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

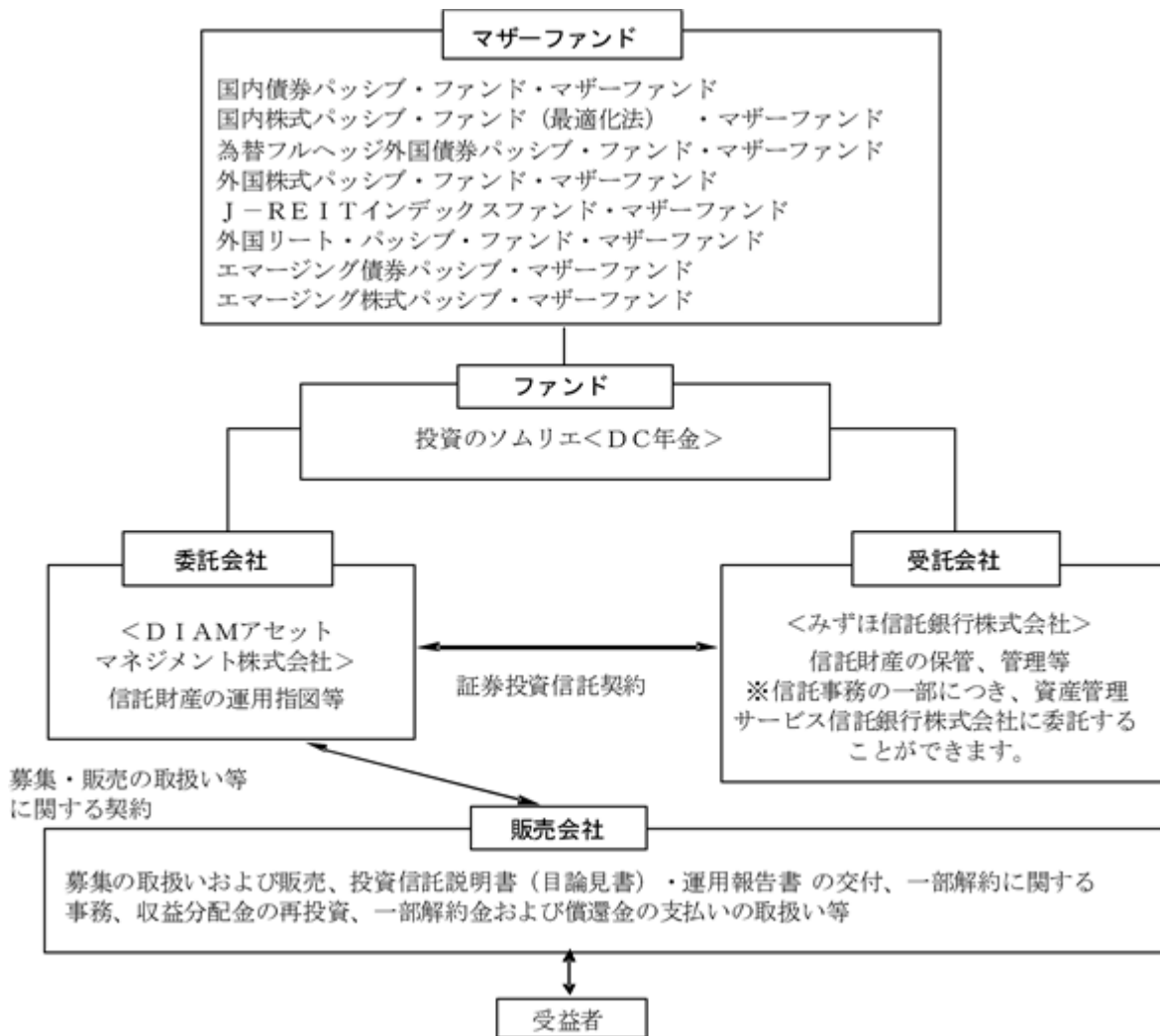
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成25年10月31日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

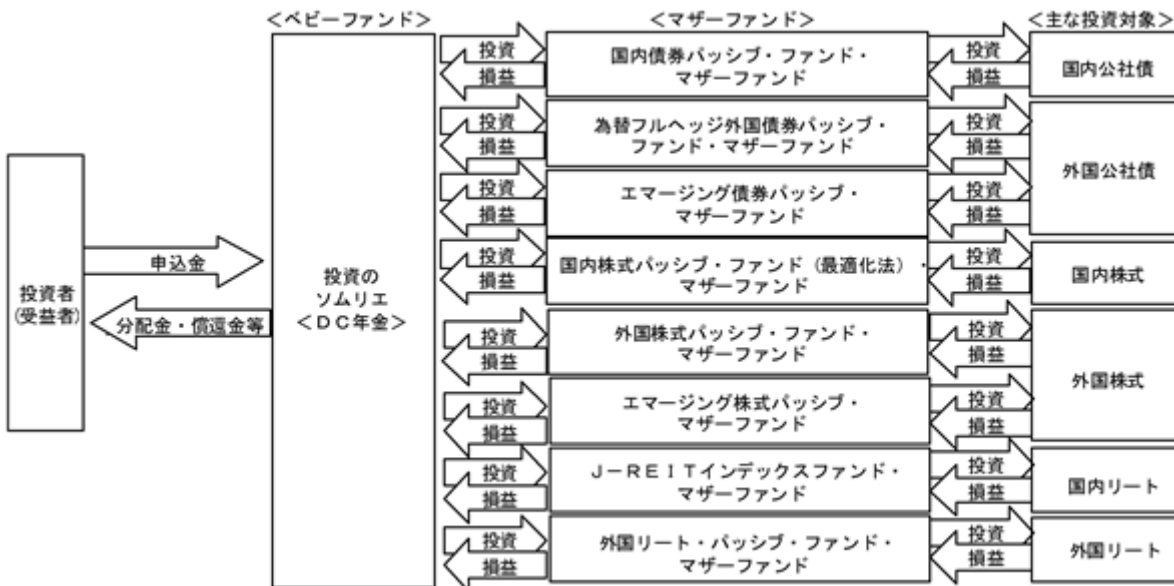
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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

委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成27年7月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日

会社設立

平成10年3月31日

「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

平成10年12月1日

証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月1日

第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年1月1日

「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成27年7月31日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

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

<投資態度>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

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

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

（それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

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

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

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

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

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

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

基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

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

・基本配分戦略は月次で行います。

機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

・機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-

REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

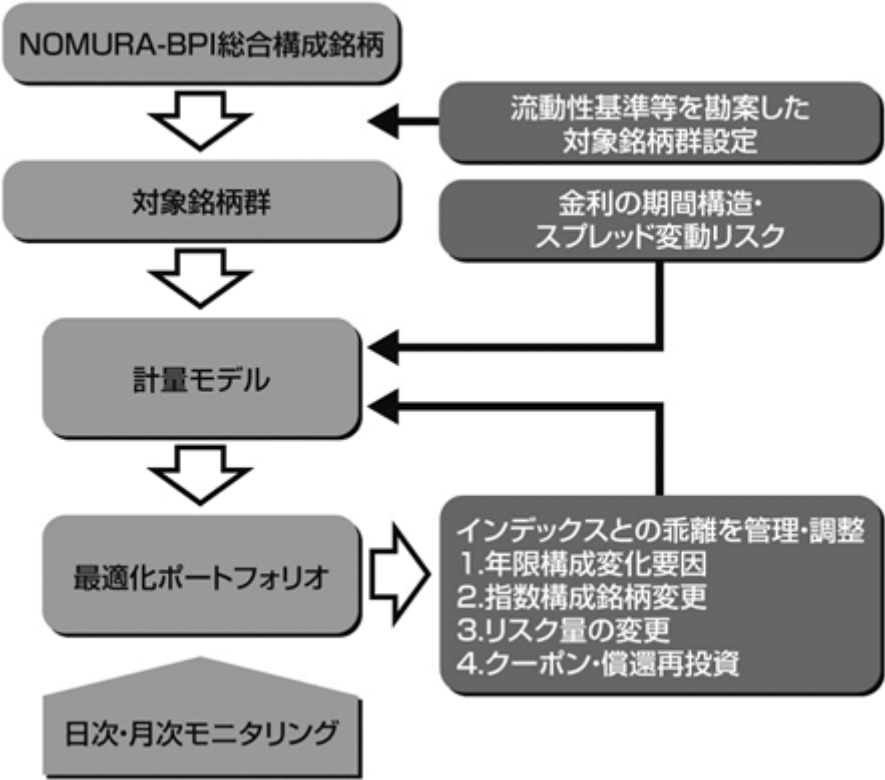
運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

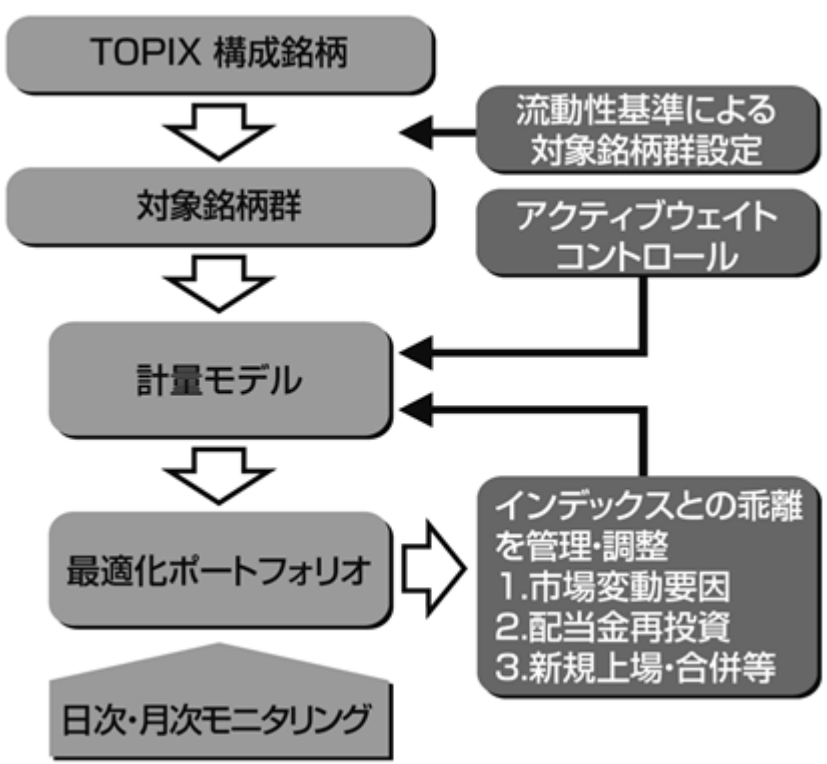
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場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

運用プロセス	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p>  <pre> graph TD A[NOMURA-BPI総合構成銘柄] --> 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[金利の期間構造・スプレッド変動リスク] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限構成変化要因 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] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
--------	---

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します。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。
--------	---

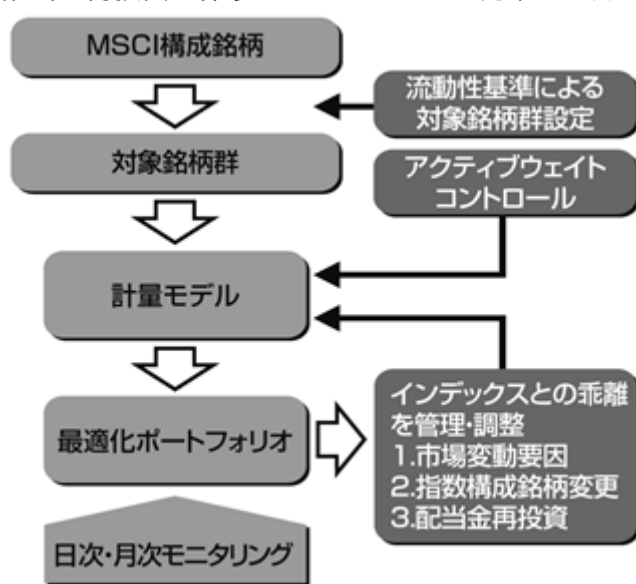
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）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株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
------	--

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	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <p>シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。</p>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> C subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>
主な投資制限	<p>1.株式への投資は、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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4.同一銘柄の転換社債等への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5.外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><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 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
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.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。</p> <p>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。</p> <p>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

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

投資態度

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

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

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

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

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

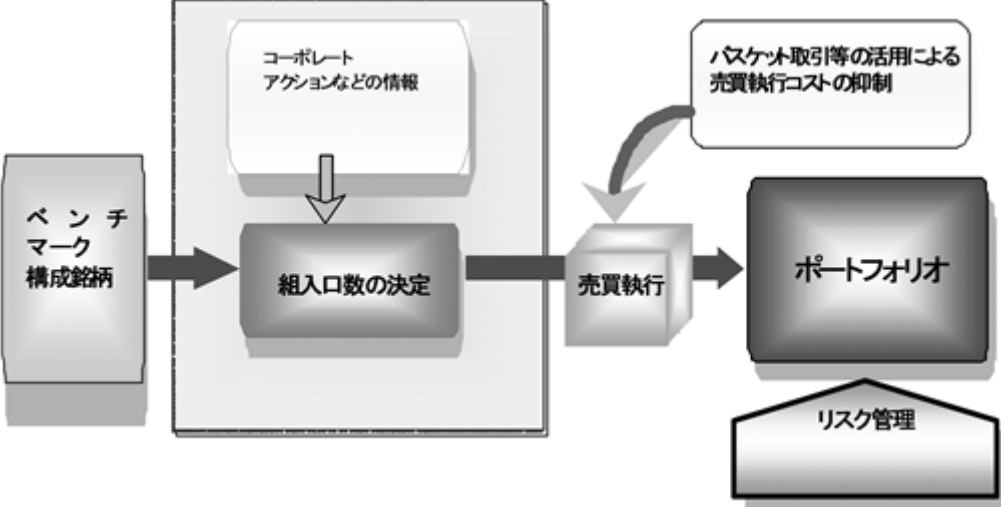
当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>

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

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

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

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

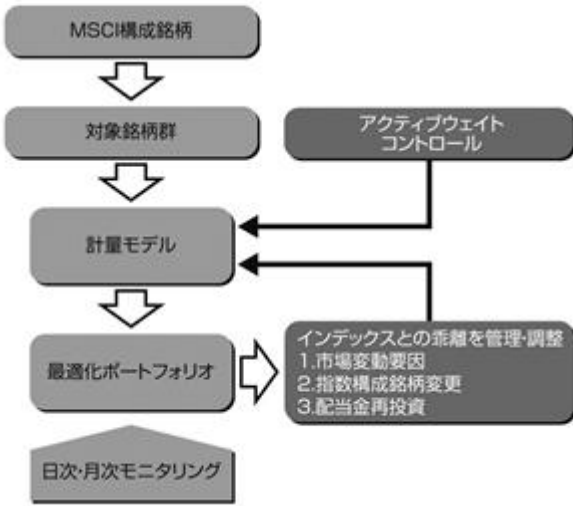
S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくはDIAMアセットマネジメント株式会社を得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、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

	<p>のれんを含む)について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとDIAMアセットマネジメント株式会社間での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] --> B C --> E </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

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。

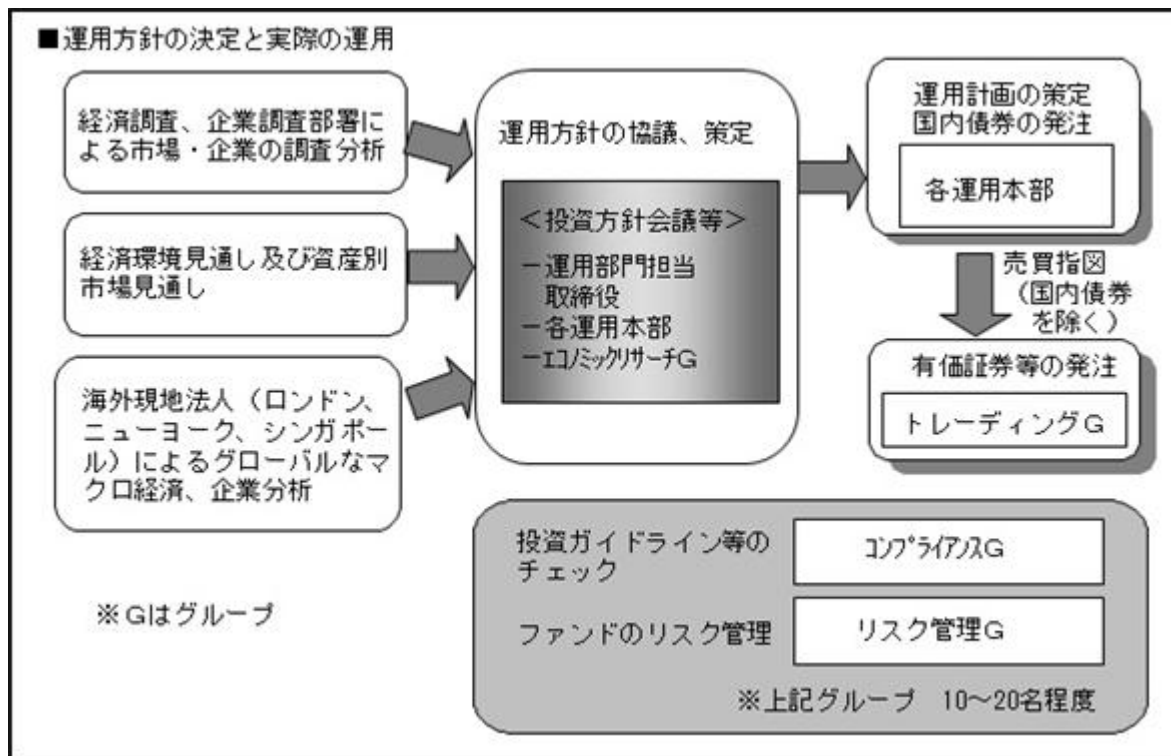
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはM o o d y ' sの外貨建て長期格付がB B - 格もしくはB a 3 格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、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>J P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[インデックスとの乖離を管理・調整] G --> H[日次・月次モニタリング] </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。

<p>投資態度</p>	<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>
<p>運用プロセス</p>	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[アクティブウェイトコントロール] --> C F --> D G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> D </pre>
<p>主な投資制限</p>	<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>

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】



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

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

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

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

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【配分方針】

収益配分方針

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配分方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

2)売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2)上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末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ます。）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けを行います。当該売付け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）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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）

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。）、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。）、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。）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ます。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ます。
- 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ます。

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ます。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ます。
- 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ます。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

- 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ます。
 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ます。
- 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ます。
- 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ます。

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、および為替変動リスクを回避するため、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ます。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および運用の安定性に資するため、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。

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

株価変動リスク

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

金利リスク

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

リートの価格変動リスク

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

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

為替リスク

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

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

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

信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、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、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

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

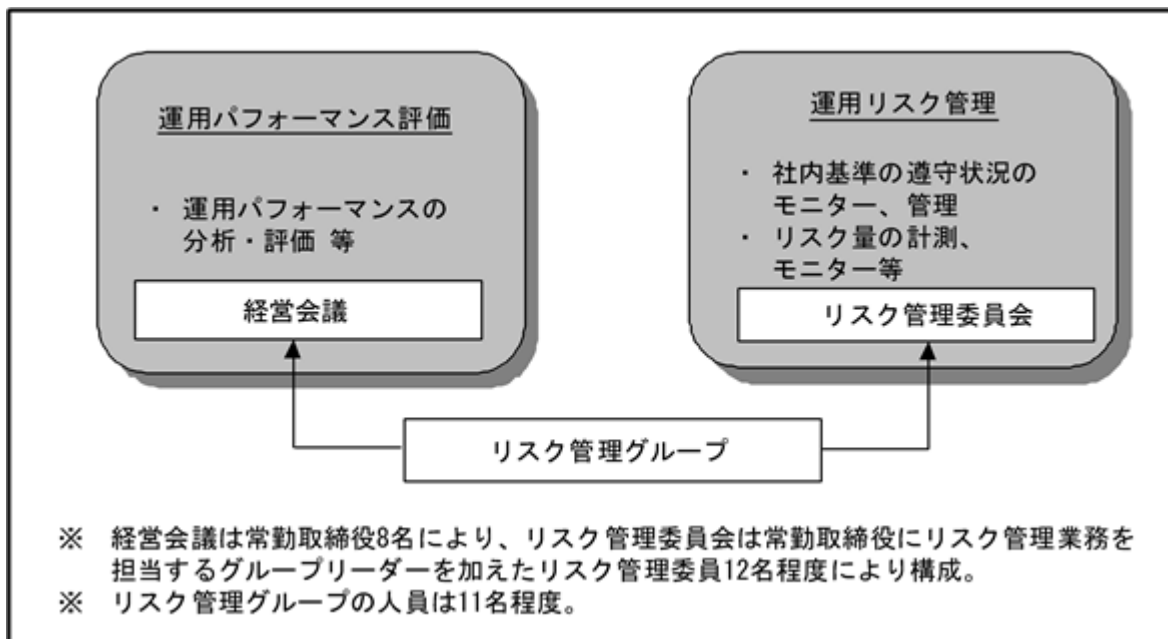
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注意事項

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

< 運用評価・運用リスク管理体制 >



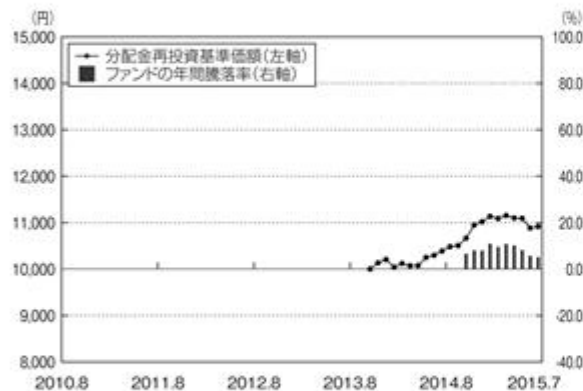
運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理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、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

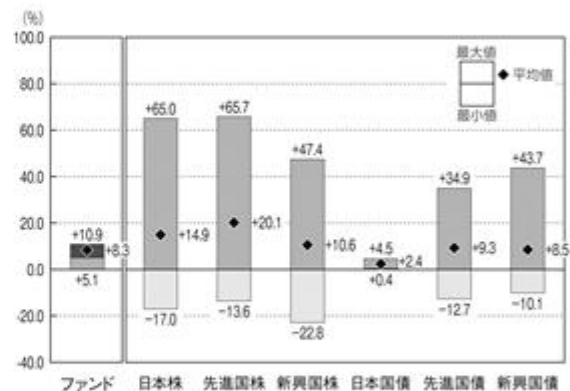
上記体制は平成27年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンド:2014年10月~2015年7月

代表的な資産クラス:2010年8月~2015年7月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日本株…… 東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(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グローバルレティバースファイド(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(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、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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なく、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グローバルレティバースファイド」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】

ありません。

(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1.188%（税抜1.10%）

信託報酬の配分（税抜）		主な役務
委託会社	年率0.525%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.525%	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0.050%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

・ 信託財産留保額

ありません。

・ その他の費用

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

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、信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、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が追加される予定です。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、平成27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、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27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	409,881,962	87.06
内 日本	409,881,962	87.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	60,931,990	12.94
純資産総額	470,813,952	100.00

その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	17,084,370	3.63
-	17,084,370	3.63
為替予約取引（売建）	107,127,390	22.75
-	107,127,390	22.75

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	325,191,145,230	97.67
内 日本	325,191,145,230	97.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,765,934,323	2.33
純資産総額	332,957,079,553	100.00

その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,536,400,000	2.26
内 日本	7,536,400,000	2.26

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	339,337,444,800	81.13
内 日本	339,337,444,800	81.13
地方債証券	27,840,163,973	6.66
内 日本	27,840,163,973	6.66
特殊債券	26,407,772,104	6.31
内 日本	26,407,772,104	6.31
社債券	22,471,081,840	5.37
内 日本	22,163,903,840	5.30
内 アメリカ	307,178,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,185,919,973	0.52
純資産総額	418,242,382,690	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	23,189,034,900	98.90
内 日本	23,189,034,900	98.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	258,976,726	1.10
純資産総額	23,448,011,626	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	292,544,050,669	95.21
内 アメリカ	175,062,748,814	56.98
内 イギリス	24,341,706,515	7.92
内 スイス	12,843,681,326	4.18
内 フランス	11,351,262,503	3.69
内 ドイツ	11,291,071,818	3.67
内 カナダ	11,065,312,555	3.60
内 オーストラリア	7,726,959,622	2.51
内 アイルランド	5,269,626,239	1.72
内 オランダ	5,166,798,379	1.68
内 スペイン	4,498,997,341	1.46
内 スウェーデン	3,623,264,074	1.18
内 香港	2,931,650,283	0.95
内 イタリア	2,822,036,852	0.92
内 デンマーク	2,198,863,407	0.72
内 シンガポール	1,949,406,827	0.63
内 ジャージー	1,792,608,238	0.58
内 ベルギー	1,670,595,462	0.54
内 フィンランド	1,066,584,507	0.35
内 バミューダ	1,064,542,487	0.35
内 オランダ領キュラソー	1,021,923,803	0.33
内 イスラエル	834,893,731	0.27
内 ケイマン諸島	774,138,348	0.25
内 ノルウェー	695,423,815	0.23
内 ルクセンブルグ	438,190,326	0.14
内 オーストリア	213,949,945	0.07
内 パナマ	208,963,658	0.07
内 ポルトガル	207,379,135	0.07
内 ニュージーランド	141,104,469	0.05
内 リベリア	136,806,717	0.04
内 イギリス領バージン諸島	86,571,038	0.03
内 マン島	46,987,279	0.02
内 モーリシャス	1,156	0.00
投資信託受益証券	868,383,138	0.28
内 オーストラリア	758,660,917	0.25
内 シンガポール	109,722,221	0.04
投資証券	6,319,598,666	2.06
内 アメリカ	5,245,540,208	1.71
内 イギリス	467,796,561	0.15
内 フランス	425,704,032	0.14
内 香港	141,322,800	0.05
内 カナダ	39,235,065	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,519,143,244	2.45
純資産総額	307,251,175,717	100.00

その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	935,822,600	0.30
-	935,822,600	0.30
株価指数先物取引（買建）	6,676,411,222	2.17
内 アメリカ	4,305,558,642	1.40
内 ドイツ	1,272,569,370	0.41
内 イギリス	576,518,904	0.19
内 オーストラリア	279,776,497	0.09
内 カナダ	241,987,809	0.08

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,212,760,475	10.96
内 オーストラリア	2,305,299,792	7.87
内 シンガポール	907,460,683	3.10
投資証券	25,912,603,151	88.41
内 アメリカ	20,455,690,502	69.79
内 イギリス	2,125,921,638	7.25
内 フランス	1,439,500,501	4.91
内 カナダ	575,232,304	1.96
内 香港	496,288,141	1.69
内 オランダ	164,850,189	0.56
内 ベルギー	151,792,621	0.52
内 スペイン	143,121,028	0.49
内 ニューゼーランド	129,445,341	0.44
内 アイルランド	72,488,779	0.25
内 ドイツ	48,602,020	0.17
内 シンガポール	43,264,000	0.15
内 イタリア	30,748,189	0.10
内 マン島	23,311,454	0.08
内 イスラエル	12,346,444	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	184,679,835	0.63
純資産総額	29,310,043,461	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	173,937,279,157	98.40
内 アメリカ	74,458,521,316	42.12
内 イタリア	17,031,922,159	9.64
内 フランス	16,771,128,849	9.49
内 イギリス	15,117,625,099	8.55
内 ドイツ	13,139,566,145	7.43
内 スペイン	9,251,710,743	5.23
内 オランダ	4,473,566,270	2.53
内 ベルギー	4,462,471,521	2.52
内 カナダ	3,768,979,149	2.13
内 オーストラリア	2,816,811,092	1.59
内 オーストリア	2,738,079,896	1.55
内 メキシコ	1,726,509,973	0.98
内 アイルランド	1,309,670,613	0.74
内 デンマーク	1,239,660,391	0.70
内 ポーランド	1,007,696,285	0.57
内 フィンランド	951,642,736	0.54
内 南アフリカ	881,274,072	0.50
内 スウェーデン	845,641,072	0.48
内 マレーシア	835,630,719	0.47
内 シンガポール	630,131,208	0.36
内 ノルウェー	479,039,849	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,825,737,413	1.60
純資産総額	176,763,016,570	100.00

その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	173,942,210,948	98.40
-	173,942,210,948	98.40

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	35,260,565,659	96.45
内 韓国	5,099,178,487	13.95
内 中国	4,613,226,036	12.62
内 台湾	4,409,882,307	12.06
内 インド	2,992,117,210	8.18
内 南アフリカ	2,773,658,836	7.59
内 ブラジル	2,539,434,986	6.95
内 ケイマン諸島	1,831,494,153	5.01
内 香港	1,811,925,083	4.96
内 ロシア	1,340,273,833	3.67
内 メキシコ	1,335,574,302	3.65
内 マレーシア	1,204,028,798	3.29
内 インドネシア	850,405,207	2.33
内 タイ	797,995,554	2.18
内 ポーランド	532,483,052	1.46
内 フィリピン	519,870,449	1.42
内 トルコ	493,568,765	1.35
内 バミューダ	453,971,807	1.24
内 チリ	433,480,044	1.19
内 カタール	355,657,675	0.97
内 アラブ首長国連邦	289,624,996	0.79
内 コロンビア	202,635,007	0.55
内 ハンガリー	86,414,036	0.24
内 チェコ	69,690,330	0.19
内 エジプト	66,618,725	0.18
内 ギリシャ	59,273,939	0.16
内 アメリカ	46,154,291	0.13
内 マルタ	36,045,793	0.10
内 ペルー	15,881,958	0.04
投資信託受益証券	270,549,187	0.74
内 メキシコ	270,549,187	0.74
投資証券	93,999,746	0.26
内 メキシコ	50,824,366	0.14
内 南アフリカ	23,577,904	0.06
内 トルコ	19,597,476	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	935,004,549	2.56
純資産総額	36,560,119,141	100.00

その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	52,092,600	0.14
-	52,092,600	0.14
為替予約取引（売建）	1,004,643,000	2.75
-	1,004,643,000	2.75
株価指数先物取引（買建）	964,984,685	2.64
内 アメリカ	964,984,685	2.64

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	56,589,644,081	96.86
内 トルコ	8,480,382,715	14.52
内 メキシコ	7,974,758,964	13.65
内 ロシア	7,400,547,548	12.67
内 ブラジル	5,932,235,946	10.15
内 インドネシア	5,430,372,273	9.29
内 コロンビア	4,499,838,772	7.70
内 フィリピン	4,464,798,464	7.64
内 ハンガリー	3,066,575,797	5.25
内 ベルギー	2,382,805,918	4.08
内 南アフリカ	2,077,151,884	3.56
内 クロアチア	1,832,571,921	3.14
内 パナマ	1,810,851,276	3.10
内 ルーマニア	1,236,752,603	2.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,833,720,283	3.14
純資産総額	58,423,364,364	100.00

その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	260,463,000	0.45
-	260,463,000	0.45

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	129,727,776	1.2248 158,891,663	1.2283 159,344,627	- -	33.84%
2	為替フルヘッジ外国債券パッ シブ・ファンド・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	50,191,095	1.2920 64,847,883	1.3068 65,589,722	- -	13.93%
3	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	32,941,366	1.8573 61,185,221	1.8656 61,455,412	- -	13.05%
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	23,940,581	2.3486 56,227,634	2.3799 56,976,188	- -	12.10%
5	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	7,805,816	3.0121 23,512,276	3.0453 23,771,051	- -	5.05%
6	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	14,014,756	1.0605 14,863,723	1.0310 14,449,213	- -	3.07%
7	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	12,101,020	1.1585 14,019,491	1.1698 14,155,773	- -	3.01%
8	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	8,505,249	1.6279 13,846,161	1.6625 14,139,976	- -	3.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	87.06%
合計	87.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,843,200	7,700.00 14,192,640,000	8,253.00 15,211,929,600	- -	4.57%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	10,579,500	679.90 7,193,002,050	900.00 9,521,550,000	- -	2.86%
3	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	997,100	4,177.00 4,164,886,700	5,544.00 5,527,922,400	- -	1.66%
4	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	18,491,400	200.43 3,706,354,332	267.90 4,953,846,060	- -	1.49%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,031,800	3,606.00 3,720,670,800	4,763.50 4,914,979,300	- -	1.48%
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	697,400	7,136.00 4,976,646,400	6,881.00 4,798,809,400	- -	1.44%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,202,000	3,820.50 4,592,241,000	3,979.50 4,783,359,000	- -	1.44%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	884,700	3,525.80 3,119,279,100	4,813.50 4,258,503,450	- -	1.28%
9	K D D I 日本	株式 情報・通信業	1,339,600	2,595.33 3,476,708,802	3,150.50 4,220,409,800	- -	1.27%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	938,800	3,102.36 2,912,503,057	3,533.00 3,316,780,400	- -	1.00%
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	524,200	5,922.00 3,104,312,400	6,240.00 3,271,008,000	- -	0.98%
12	セブン&アイ・ホールディン グス 日本	株式 小売業	551,500	4,386.00 2,418,879,000	5,724.00 3,156,786,000	- -	0.95%
13	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	244,800	9,140.00 2,237,472,000	12,250.00 2,998,800,000	- -	0.90%
14	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,567,200	1,830.00 2,867,976,000	1,867.00 2,925,962,400	- -	0.88%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	139,100	20,035.00 2,786,868,500	20,680.00 2,876,588,000	- -	0.86%
16	キャノン 日本	株式 電気機器	719,100	3,732.50 2,684,040,750	3,972.00 2,856,265,200	- -	0.86%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	534,200	4,076.50 2,177,666,300	5,165.00 2,759,143,000	- -	0.83%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,010,300	2,223.00 2,245,896,900	2,679.50 2,707,098,850	- -	0.81%
19	三菱地所 日本	株式 不動産業	980,000	2,514.00 2,463,720,000	2,755.00 2,699,900,000	- -	0.81%
20	N T T ドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,016,700	1,996.50 2,029,841,550	2,614.50 2,658,162,150	- -	0.80%

21	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	119,600	19,475.00 2,329,210,000	21,720.00 2,597,712,000	- -	0.78%
22	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,207,000	798.70 2,561,430,900	804.40 2,579,710,800	- -	0.77%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	140,200	12,780.00 1,791,756,000	18,400.00 2,579,680,000	- -	0.77%
24	三井不動産 日本	株式 不動産業	699,000	3,126.00 2,185,074,000	3,528.50 2,466,421,500	- -	0.74%
25	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	2,694,600	643.40 1,733,705,640	881.40 2,375,020,440	- -	0.71%
26	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,628,000	1,318.50 2,146,518,000	1,457.00 2,371,996,000	- -	0.71%
27	花王 日本	株式 化学	376,300	5,014.00 1,886,768,200	6,291.00 2,367,303,300	- -	0.71%
28	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,875,200	1,064.00 1,995,212,800	1,198.50 2,247,427,200	- -	0.67%
29	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	472,100	4,565.54 2,155,395,100	4,678.00 2,208,483,800	- -	0.66%
30	第一生命保険 日本	株式 保険業	844,900	1,720.00 1,453,228,000	2,522.00 2,130,837,800	- -	0.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
株式	97.67%
合計	97.67%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.55%
輸送用機器		10.76%
銀行業		9.51%
情報・通信業		6.86%
化学		5.76%
医薬品		4.85%
小売業		4.77%
機械		4.46%
食料品		4.40%
陸運業		4.10%
卸売業		3.96%
サービス業		3.14%
不動産業		2.79%
保険業		2.71%
建設業		2.56%
電気・ガス業		2.27%
その他製品		1.56%
精密機器		1.40%
証券、商品先物取引業		1.39%
その他金融業		1.31%
鉄鋼		1.26%
ガラス・土石製品		0.92%
ゴム製品		0.90%
非鉄金属		0.89%
繊維製品		0.72%
空運業		0.67%
金属製品		0.57%
石油・石炭製品		0.47%
鉱業		0.37%
海運業		0.26%
パルプ・紙	0.23%	
倉庫・運輸関連業	0.21%	
水産・農林業	0.07%	
合計		97.67%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 2 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	99.98 4,999,120,000	100.13 5,006,500,000	0.100000 2019/12/20	1.20%
2	1 2 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.05 5,002,610,000	100.09 5,004,600,000	0.100000 2020/3/20	1.20%
3	1 1 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.80 4,536,370,000	100.87 4,539,375,000	0.300000 2018/9/20	1.09%
4	1 1 8 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.34 4,515,420,000	100.58 4,526,100,000	0.200000 2019/6/20	1.08%
5	1 1 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.38 4,517,310,000	100.57 4,526,055,000	0.200000 2019/3/20	1.08%
6	1 1 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.42 4,518,900,000	100.57 4,525,785,000	0.200000 2018/12/20	1.08%
7	1 0 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,523,850,000	100.48 4,521,915,000	0.300000 2017/3/20	1.08%
8	1 0 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.37 4,516,830,000	100.41 4,518,675,000	0.200000 2017/9/20	1.08%
9	1 0 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.33 4,515,210,000	100.37 4,516,875,000	0.200000 2017/6/20	1.08%
10	1 0 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.39 4,317,028,000	100.46 4,319,909,000	0.200000 2017/12/20	1.03%
11	3 3 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.73 4,029,445,000	101.37 4,054,840,000	0.500000 2024/9/20	0.97%
12	3 3 8 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.07 4,002,970,000	100.13 4,005,560,000	0.400000 2025/3/20	0.96%
13	3 0 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	105.57 3,694,982,000	105.36 3,687,880,000	1.300000 2019/12/20	0.88%
14	3 0 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	105.97 3,603,082,000	105.61 3,590,740,000	1.500000 2019/6/20	0.86%
15	3 3 2 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.96 3,568,845,000	102.53 3,588,725,000	0.600000 2023/12/20	0.86%

16	113回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.76 3,526,775,000	100.81 3,528,665,000	0.300000 2018/6/20	0.84%
17	102回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.48 3,517,010,000	100.41 3,514,455,000	0.300000 2016/12/20	0.84%
18	282回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,400,000,000	102.64 3,489,998,000	101.91 3,465,212,000	1.700000 2016/9/20	0.83%
19	297回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,300,000,000	104.98 3,464,571,000	104.62 3,452,559,000	1.400000 2018/12/20	0.83%
20	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,300,000,000	101.75 3,357,810,000	102.32 3,376,824,000	0.600000 2024/6/20	0.81%
21	330回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	103.89 3,324,627,000	104.21 3,334,880,000	0.800000 2023/9/20	0.80%
22	289回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	104.09 3,330,912,000	103.54 3,313,344,000	1.500000 2017/12/20	0.79%
23	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	102.03 3,265,025,000	102.43 3,277,952,000	0.600000 2024/3/20	0.78%
24	313回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	107.04 3,211,320,000	106.65 3,199,560,000	1.300000 2021/3/20	0.77%
25	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.40 3,162,060,000	105.57 3,167,250,000	1.000000 2022/3/20	0.76%
26	296回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.05 3,151,770,000	104.61 3,138,330,000	1.500000 2018/9/20	0.75%
27	328回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	102.28 3,068,580,000	102.77 3,083,160,000	0.600000 2023/3/20	0.74%
28	120回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.31 3,009,570,000	100.57 3,017,280,000	0.200000 2019/9/20	0.72%
29	99回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.58 3,017,580,000	100.45 3,013,530,000	0.400000 2016/9/20	0.72%
30	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	104.76 2,933,448,000	104.59 2,928,576,000	1.000000 2020/9/20	0.70%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	81.13%
地方債証券	6.66%
特殊債券	6.31%
社債券	5.37%
合計	99.48%

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,136	572,296.60 1,794,722,145	554,000.00 1,737,344,000	- -	7.41%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,908	561,501.45 1,632,846,220	556,000.00 1,616,848,000	- -	6.90%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	5,398	245,156.29 1,323,353,663	243,000.00 1,311,714,000	- -	5.59%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	5,874	183,625.55 1,078,616,493	180,000.00 1,057,320,000	- -	4.51%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	3,844	234,116.22 899,942,783	244,500.00 939,858,000	- -	4.01%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	4,966	173,164.75 859,936,172	168,800.00 838,260,800	- -	3.57%
7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,888	291,279.65 841,215,646	270,500.00 781,204,000	- -	3.33%
8	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,939	403,182.28 781,770,450	401,500.00 778,508,500	- -	3.32%
9	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,932	226,470.78 664,012,344	230,300.00 675,239,600	- -	2.88%
10	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,075	597,809.56 642,645,285	612,000.00 657,900,000	- -	2.81%
11	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	616	1,039,365.73 640,249,292	1,042,000.00 641,872,000	- -	2.74%
12	G L P投資法人 日本	投資証券	5,310	119,767.23 635,963,994	119,300.00 633,483,000	- -	2.70%

13	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,102	572,421.43 630,808,423	540,000.00 595,080,000	- -	2.54%
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	6,984	80,867.12 564,775,980	80,200.00 560,116,800	- -	2.39%
15	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	3,699	156,444.83 578,689,456	148,900.00 550,781,100	- -	2.35%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	899	625,590.44 562,405,808	574,000.00 516,026,000	- -	2.20%
17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,487	160,920.10 561,128,399	145,300.00 506,661,100	- -	2.16%
18	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,076	460,781.14 495,800,509	440,500.00 473,978,000	- -	2.02%
19	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	7,038	61,253.25 431,100,418	66,000.00 464,508,000	- -	1.98%
20	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	828	559,090.35 462,926,814	530,000.00 438,840,000	- -	1.87%
21	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,661	264,196.34 438,830,133	261,500.00 434,351,500	- -	1.85%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	783	559,132.45 437,800,711	552,000.00 432,216,000	- -	1.84%
23	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,844	250,066.79 461,123,161	233,500.00 430,574,000	- -	1.84%
24	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	779	520,223.36 405,254,004	489,000.00 380,931,000	- -	1.62%
25	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,798	151,153.17 422,926,577	135,800.00 379,968,400	- -	1.62%
26	プレミア投資法人 日本	投資証券	585	644,203.70 376,859,166	649,000.00 379,665,000	- -	1.62%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,422	159,845.66 387,146,193	149,000.00 360,878,000	- -	1.54%
28	福岡リート投資法人 日本	投資証券	1,659	210,920.95 349,917,867	208,500.00 345,901,500	- -	1.48%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,171	153,656.90 333,589,141	143,200.00 310,887,200	- -	1.33%
30	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	3,643	82,630.27 301,022,094	82,100.00 299,090,300	- -	1.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.90%
合計	98.90%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	451,246	15,763.00 7,112,992,141	15,178.77 6,849,361,413	- -	2.23%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	603,178	5,441.63 3,282,274,395	5,814.99 3,507,477,174	- -	1.14%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	324,220	11,581.61 3,754,991,150	10,296.56 3,338,350,812	- -	1.09%
4	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	378,626	6,863.13 2,598,560,670	7,212.92 2,731,001,319	- -	0.89%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	215,091	12,356.86 2,657,850,406	12,384.15 2,663,719,981	- -	0.87%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	778,640	3,119.60 2,429,050,015	3,239.92 2,522,735,046	- -	0.82%
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	288,234	7,401.46 2,133,354,381	8,563.72 2,468,355,731	- -	0.80%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	249,232	9,013.16 2,246,368,640	9,346.50 2,329,449,131	- -	0.76%
9	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	178,005	12,141.48 2,161,245,393	12,821.00 2,282,202,105	- -	0.74%
10	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	473,777	4,296.74 2,035,699,240	4,431.94 2,099,755,596	- -	0.68%
11	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	473,039	4,233.47 2,002,596,990	4,316.59 2,041,916,363	- -	0.66%
12	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	30,569	47,362.19 1,447,814,883	66,579.71 2,035,275,167	- -	0.66%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	208,318	10,655.03 2,219,635,789	9,599.45 1,999,739,391	- -	0.65%
14	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	54,396	31,231.95 1,698,893,478	35,732.12 1,943,684,780	- -	0.63%

15	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	23,917	67,899.23 1,623,945,978	78,466.46 1,876,682,409	- -	0.61%
16	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	320,919	6,116.41 1,962,872,950	5,788.94 1,857,783,018	- -	0.60%
17	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	124,653	12,921.24 1,610,672,177	14,888.52 1,855,898,833	- -	0.60%
18	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	155,654	9,394.78 1,462,336,580	11,809.84 1,838,250,142	- -	0.60%
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	812,749	2,060.30 1,674,510,340	2,248.84 1,827,746,687	- -	0.59%
20	GOOGLE 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	22,071	68,365.88 1,508,903,478	82,432.02 1,819,357,166	- -	0.59%
21	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	234,611	6,350.84 1,489,978,800	7,303.47 1,713,475,620	- -	0.56%
22	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	115,302	12,639.67 1,457,379,922	14,624.31 1,686,212,883	- -	0.55%
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	144,792	13,989.23 2,025,528,763	11,539.44 1,670,818,770	- -	0.54%
24	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,485,361	1,157.15 1,718,797,486	1,116.34 1,658,171,225	- -	0.54%
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	319,580	5,208.29 1,664,465,565	5,031.06 1,607,826,921	- -	0.52%
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	219,478	7,294.79 1,601,046,446	7,258.82 1,593,151,471	- -	0.52%
27	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	88,977	18,400.09 1,637,185,128	17,719.11 1,576,593,606	- -	0.51%
28	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	101,644	13,878.83 1,410,700,365	14,445.69 1,468,318,568	- -	0.48%
29	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サー ビス	72,318	19,896.01 1,438,840,085	19,965.47 1,443,863,466	- -	0.47%
30	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	151,156	8,361.23 1,263,850,095	9,474.17 1,432,078,426	- -	0.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.21%
投資信託受益証券	0.28%
投資証券	2.06%
合計	97.55%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.39%
医薬品		7.63%
石油・ガス・消耗燃料		6.40%
保険		4.24%
メディア		3.13%
ソフトウェア		2.83%
コンピュータ・周辺機器		2.77%
各種電気通信サービス		2.65%
化学		2.63%
情報技術サービス		2.44%
バイオテクノロジー		2.38%
資本市場		2.26%
インターネットソフトウェア・サービス		2.25%
食品		2.18%
飲料		2.18%
食品・生活必需品小売り		2.14%
航空宇宙・防衛		2.01%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.89%
コングロマリット		1.87%
専門小売り		1.87%
ホテル・レストラン・レジャー		1.71%
半導体・半導体製造装置		1.62%
ヘルスケア機器・用品		1.59%
電力		1.56%
家庭用品		1.39%
タバコ		1.38%
機械		1.36%
各種金融サービス		1.31%
繊維・アパレル・贅沢品		1.27%
金属・鉱業		1.22%
通信機器		1.17%
総合公益事業		1.15%
インターネット販売・カタログ販売		1.11%
自動車		1.11%
陸運・鉄道		0.88%
エネルギー設備・サービス		0.85%
電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.67%

不動産管理・開発	0.64%
複合小売り	0.59%
自動車部品	0.56%
航空貨物・物流サービス	0.56%
消費者金融	0.50%
専門サービス	0.50%
無線通信サービス	0.47%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.45%
家庭用耐久財	0.44%
商業サービス・用品	0.39%
電子装置・機器・部品	0.33%
建設資材	0.31%
商社・流通業	0.30%
建設・土木	0.28%
容器・包装	0.24%
建設関連製品	0.23%
運送インフラ	0.20%
旅客航空輸送業	0.16%
ガス	0.14%
紙製品・林産品	0.14%
水道	0.09%
海運業	0.08%
販売	0.08%
レジャー用品	0.08%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.05%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	73,460	22,260.70 1,635,271,209	23,088.80 1,696,103,659	- -	5.79%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	34,240	23,738.93 812,821,149	25,182.60 862,252,251	- -	2.94%
3	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	85,800	9,184.91 788,065,589	9,214.93 790,641,131	- -	2.70%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	23,130	30,701.06 710,115,551	33,197.66 767,861,933	- -	2.62%
5	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	82,740	8,510.48 704,157,338	8,535.19 706,201,819	- -	2.41%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	31,150	20,584.96 641,221,788	21,239.36 661,606,350	- -	2.26%
7	VENTAS INC アメリカ	投資証券	77,980	8,072.58 629,500,292	8,231.29 641,876,337	- -	2.19%
8	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	123,500	4,869.97 601,442,442	4,986.40 615,821,388	- -	2.10%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	36,140	15,688.89 566,996,827	15,299.09 552,909,242	- -	1.89%
10	HCP INC アメリカ	投資証券	108,800	4,675.88 508,736,264	4,744.53 516,204,864	- -	1.76%
11	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	148,200	3,355.51 497,287,428	3,336.67 494,495,383	- -	1.69%
12	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	41,240	12,385.85 510,792,462	11,961.17 493,278,947	- -	1.68%
13	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	189,000	2,394.63 452,585,875	2,481.83 469,066,852	- -	1.60%
14	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,260,000	352.28 443,877,865	358.81 452,107,656	- -	1.54%
15	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	178,400	2,536.24 452,466,797	2,424.98 432,616,788	- -	1.48%
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	15,390	27,260.57 419,540,271	27,757.67 427,190,559	- -	1.46%
17	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	452,500	829.17 375,203,352	905.19 409,600,239	- -	1.40%
18	LINK REIT/THE 香港	投資証券	542,523	767.64 416,465,111	719.19 390,182,541	- -	1.33%
19	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	241,400	1,575.91 380,425,593	1,604.58 387,346,770	- -	1.32%
20	SL GREEN アメリカ	投資証券	23,430	14,292.23 334,867,135	14,166.60 331,923,634	- -	1.13%
21	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	54,710	5,716.39 312,744,122	5,905.54 323,092,334	- -	1.10%
22	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	33,140	9,548.88 316,450,039	9,685.04 320,962,331	- -	1.10%

23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	97,100	2,949.30 286,377,387	3,032.77 294,482,743	- -	1.00%
24	KLEPIERRE フランス	投資証券	50,440	5,199.65 262,270,498	5,675.70 286,282,686	- -	0.98%
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	16,150	16,589.60 267,922,139	16,938.90 273,563,273	- -	0.93%
26	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	31,940	8,418.82 268,897,115	8,017.94 256,093,182	- -	0.87%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	60,900	4,125.17 251,223,107	4,145.41 252,455,883	- -	0.86%
28	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	26,120	8,542.94 223,141,611	9,033.83 235,963,723	- -	0.81%
29	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	185,000	1,222.60 226,181,702	1,267.03 234,400,920	- -	0.80%
30	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	212,700	1,052.16 223,795,510	1,066.74 226,896,448	- -	0.77%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.96%
投資証券	88.41%
合計	99.37%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.625 08/31/17 アメリカ	国債証券	2,356,760,000	99.77 2,351,410,154	99.69 2,349,477,611	0.625000 2017/8/31	1.33%
2	US T N/B 3.625 08/15/19 アメリカ	国債証券	2,108,680,000	109.04 2,299,431,192	108.75 2,293,189,500	3.625000 2019/8/15	1.30%
3	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	1,959,832,000	104.17 2,041,654,986	103.80 2,034,462,402	3.250000 2016/12/31	1.15%
4	US T N/B 0.875 04/30/17 アメリカ	国債証券	1,786,176,000	100.51 1,795,303,359	100.37 1,792,927,745	0.875000 2017/4/30	1.01%
5	US T N/B 8.125 08/15/19 アメリカ	国債証券	1,364,440,000	127.32 1,737,205,008	126.51 1,726,221,266	8.125000 2019/8/15	0.98%
6	US T N/B 0.875 01/31/18 アメリカ	国債証券	1,724,156,000	100.03 1,724,768,802	99.93 1,723,000,815	0.875000 2018/1/31	0.97%
7	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,724,156,000	97.66 1,683,972,125	97.75 1,685,362,490	2.000000 2025/2/15	0.95%
8	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,474,835,600	109.43 1,614,015,835	109.12 1,609,414,348	3.625000 2020/2/15	0.91%
9	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	1,525,692,000	100.01 1,525,859,826	99.86 1,523,601,801	0.625000 2017/5/31	0.86%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,459,950,800	98.47 1,437,701,149	98.43 1,437,073,370	1.750000 2022/5/15	0.81%
11	US T N/B 0.75 03/31/18 アメリカ	国債証券	1,438,864,000	99.53 1,432,115,727	99.44 1,430,820,750	0.750000 2018/3/31	0.81%
12	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,347,074,400	100.92 1,359,480,955	100.93 1,359,696,487	2.000000 2021/5/31	0.77%
13	US T N/B 3.125 10/31/16 アメリカ	国債証券	1,302,420,000	103.65 1,349,984,378	103.28 1,345,204,497	3.125000 2016/10/31	0.76%
14	US T N/B 2.375 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,302,420,000	103.53 1,348,408,450	103.23 1,344,592,359	2.375000 2017/7/31	0.76%
15	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,240,400,000	100.46 1,246,205,072	100.31 1,244,270,048	1.375000 2019/2/28	0.70%
16	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,240,400,000	97.96 1,215,145,456	97.92 1,214,612,084	1.000000 2019/11/30	0.69%
17	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,117,600,400	101.15 1,130,519,860	101.12 1,130,173,404	2.375000 2024/8/15	0.64%
18	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,116,360,000	99.79 1,114,037,971	99.69 1,112,999,756	0.750000 2017/12/31	0.63%
19	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 イタリア	国債証券	992,332,500	105.86 1,050,522,877	105.86 1,050,582,417	4.000000 2017/2/1	0.59%
20	US T N/B 1.5 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,041,936,000	100.83 1,050,636,165	100.70 1,049,333,745	1.500000 2019/3/31	0.59%
21	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	992,320,000	105.19 1,043,871,024	104.62 1,038,175,107	4.875000 2016/8/15	0.59%
22	US T N/B 2.0 08/31/21 アメリカ	国債証券	955,108,000	100.66 961,449,917	100.62 961,106,078	2.000000 2021/8/31	0.54%
23	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	956,348,400	100.33 959,552,167	100.34 959,628,675	2.000000 2022/2/15	0.54%

24	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	857,116,400	109.01 934,419,728	108.72 931,874,092	3.500000 2020/5/15	0.53%
25	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	864,727,500	107.19 926,970,585	106.84 923,874,861	3.750000 2017/4/25	0.52%
26	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	880,684,000	104.59 921,133,816	104.56 920,860,804	2.750000 2023/11/15	0.52%
27	ITALY BTPS 4.5 03/01/19 イタリア	国債証券	800,925,000	113.06 905,525,805	114.24 915,056,812	4.500000 2019/3/1	0.52%
28	US T N/B 4.625 11/15/16 アメリカ	国債証券	868,280,000	105.83 918,978,869	105.29 914,264,108	4.625000 2016/11/15	0.52%
29	US T N/B 3.25 03/31/17 アメリカ	国債証券	868,280,000	104.70 909,149,939	104.33 905,954,669	3.250000 2017/3/31	0.51%
30	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	868,280,000	104.14 904,261,523	103.78 901,109,666	3.000000 2017/2/28	0.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	98.40%
合計	98.40%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	8,630	153,291.50 1,322,905,702	129,154.50 1,114,603,335	- -	3.05%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,926,083	559.63 1,077,900,158	544.30 1,048,376,607	- -	2.87%
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	403,200	2,538.34 1,023,462,384	2,284.80 921,231,360	- -	2.52%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	480,000	1,717.09 824,206,398	1,598.40 767,232,000	- -	2.10%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	6,577,530	121.86 801,539,740	100.63 661,962,619	- -	1.81%
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	31,026	17,979.97 557,846,768	17,301.79 536,805,584	- -	1.47%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	5,772,235	108.20 624,601,913	85.75 495,026,873	- -	1.35%
8	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,221,200	85.80 533,806,426	67.52 420,055,424	- -	1.15%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,044,781	364.92 381,262,140	357.23 373,234,430	- -	1.02%
10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	117,374	2,544.27 298,631,215	2,604.80 305,736,968	- -	0.84%
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	144,500	2,115.02 305,620,931	2,086.50 301,499,250	- -	0.82%
12	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,562,278	128.64 329,621,590	116.58 298,726,767	- -	0.82%
13	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	408,000	869.43 354,729,999	716.00 292,128,000	- -	0.80%
14	OAQ GAZPROM ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	470,714	706.94 332,768,425	577.53 271,851,568	- -	0.74%
15	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	583,000	613.93 357,926,776	462.40 269,579,200	- -	0.74%
16	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サービス	129,742	2,234.24 289,875,317	2,015.65 261,515,500	- -	0.72%

17	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	368,695	697.09 257,015,238	695.50 256,430,985	- -	0.70%
18	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	237,608	1,217.30 289,240,563	1,076.18 255,709,642	- -	0.70%
19	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,403,000	211.24 296,382,546	155.52 218,194,560	- -	0.60%
20	PETRO CHINA CO LTD 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,658,000	168.02 278,578,068	124.64 206,653,120	- -	0.57%
21	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	40,874	6,123.60 250,296,283	5,050.90 206,450,846	- -	0.56%
22	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	102,149	1,813.80 185,278,028	1,950.29 199,220,428	- -	0.54%
23	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	197,378	1,127.43 222,531,187	994.89 196,371,174	- -	0.54%
24	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	12,070	17,821.57 215,106,389	15,945.00 192,456,150	- -	0.53%
25	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,007,200	111.70 224,218,352	94.24 189,158,528	- -	0.52%
26	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	43,212	4,557.23 196,927,432	4,238.94 183,173,308	- -	0.50%
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	37,015	4,839.06 179,117,898	4,837.26 179,051,456	- -	0.49%
28	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	45,831	4,722.33 216,429,298	3,667.34 168,078,317	- -	0.46%
29	GRUPO TELEVIS A SAB メキシコ	株式 メディア	193,300	811.66 156,894,090	851.17 164,531,624	- -	0.45%
30	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV メキシコ	投資信託受益 証券 -	145,300	1,095.48 159,174,111	1,128.73 164,004,992	- -	0.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
株式	96.45%
投資信託受益証券	0.74%
投資証券	0.26%
合計	97.44%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	17.27%
石油・ガス・消耗燃料		7.76%
無線通信サービス		5.63%
コンピュータ・周辺機器		4.74%
半導体・半導体製造装置		4.74%
保険		4.33%
インターネットソフトウェア・サービス		2.93%
金属・鉱業		2.80%
情報技術サービス		2.40%
食品		2.37%
不動産管理・開発		2.36%
電子装置・機器・部品		2.30%
自動車		2.29%
メディア		2.29%
コングロマリット		2.04%
化学		2.02%
食品・生活必需品小売り		1.97%
各種金融サービス		1.84%
医薬品		1.80%
各種電気通信サービス		1.67%
電力		1.28%
資本市場		1.27%
飲料		1.17%
建設・土木		1.17%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		1.05%
運送インフラ		1.03%
建設資材		0.93%
パーソナル用品		0.93%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.89%
家庭用耐久財		0.78%
複合小売り		0.74%
タバコ		0.73%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.72%
自動車部品		0.71%
機械		0.70%
家庭用品		0.70%
繊維・アパレル・贅沢品		0.62%
専門小売り		0.56%

ガス	0.52%
ホテル・レストラン・レジャー	0.49%
紙製品・林産品	0.39%
電気設備	0.30%
旅客航空輸送業	0.29%
水道	0.28%
不動産投資信託	0.28%
航空宇宙・防衛	0.26%
商社・流通業	0.26%
商業サービス・用品	0.20%
海運業	0.18%
ソフトウェア	0.17%
消費者金融	0.15%
エネルギー設備・サービス	0.15%
陸運・鉄道	0.15%
各種消費者サービス	0.14%
容器・包装	0.13%
航空貨物・物流サービス	0.11%
総合公益事業	0.11%
レジャー用品	0.09%
建設関連製品	0.07%
販売	0.07%
通信機器	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.03%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03%
インターネット販売・カタログ販売	0.02%
合計	96.45%

(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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	2,488,552,500	117.93 2,934,986,569	116.72 2,904,762,901	7.500000 2030/3/31	4.97%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,203,188,000	98.19 1,181,422,081	94.67 1,139,118,239	4.250000 2025/1/7	1.95%
3	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	818,664,000	122.61 1,003,845,796	119.92 981,823,735	11.000000 2018/7/24	1.68%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	855,876,000	104.62 895,460,265	103.15 882,836,094	4.000000 2023/10/2	1.51%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	880,684,000	103.20 908,918,605	97.50 858,666,900	4.750000 2044/3/8	1.47%
6	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	707,028,000	122.58 866,698,490	118.20 835,707,096	7.375000 2025/2/5	1.43%
7	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	682,220,000	121.99 832,264,986	116.00 791,375,200	6.050000 2040/1/11	1.35%
8	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	769,048,000	103.96 799,566,801	102.30 786,774,556	5.000000 2020/4/29	1.35%
9	TURKEY 6.25 09/26/22 トルコ	国債証券	669,816,000	113.19 758,169,692	110.67 741,292,065	6.250000 2022/9/26	1.27%
10	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	632,604,000	118.04 746,776,618	116.20 735,085,848	7.375000 2019/3/18	1.26%
11	TURKEY 6.75 04/03/18 トルコ	国債証券	645,008,000	110.57 713,190,307	109.81 708,315,535	6.750000 2018/4/3	1.21%
12	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	682,220,000	102.69 700,633,738	101.60 693,135,520	3.625000 2022/3/15	1.19%
13	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	669,816,000	106.23 711,574,066	103.45 692,924,652	4.875000 2021/1/22	1.19%
14	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	458,948,000	156.97 720,419,358	149.20 684,750,416	8.750000 2033/11/21	1.17%
15	INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア	国債証券	520,968,000	132.38 689,662,400	130.94 682,181,547	11.625000 2019/3/4	1.17%
16	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	496,160,000	138.27 686,077,644	134.13 665,499,408	6.375000 2034/10/23	1.14%
17	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	632,604,000	109.94 695,531,972	104.39 660,406,945	6.000000 2041/1/14	1.13%
18	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	570,584,000	116.42 664,299,941	114.55 653,609,677	6.375000 2021/3/29	1.12%
19	TURKEY 6.875 03/17/36 トルコ	国債証券	570,584,000	119.99 684,689,636	114.33 652,405,745	6.875000 2036/3/17	1.12%

20	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	595,392,000	116.60 694,270,486	108.50 646,000,320	6.125000 2041/1/18	1.11%
21	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	595,392,000	112.36 669,022,144	108.12 643,767,600	5.550000 2045/1/21	1.10%
22	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	434,140,000	148.62 645,259,181	145.75 632,780,757	7.750000 2031/1/14	1.08%
23	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17 メキシコ	国債証券	595,392,000	107.01 637,150,066	105.95 630,817,824	5.625000 2017/1/15	1.08%
24	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 メキシコ	国債証券	620,200,000	102.33 634,700,276	99.37 616,323,750	3.600000 2025/1/30	1.05%
25	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	545,776,000	118.88 648,825,951	112.07 611,678,452	5.625000 2050/11/18	1.05%
26	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	719,432,000	93.38 671,862,660	84.75 609,718,620	5.000000 2045/1/27	1.04%
27	COLOMBIA 4.375 07/12/21 コロンビア	国債証券	570,584,000	106.23 606,133,864	104.40 595,689,696	4.375000 2021/7/12	1.02%
28	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	384,524,000	158.56 609,739,706	154.35 593,551,246	12.750000 2028/6/24	1.02%
29	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	570,584,000	110.19 628,733,952	102.00 581,995,680	5.625000 2044/2/26	1.00%
30	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	570,584,000	107.08 611,021,040	100.50 573,436,920	5.750000 2110/10/12	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27年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.86%
合計	96.86%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	イギリス・ポンド買/ 円売2015年10月	買建	31,000	5,992,300	5,986,410	1.27%
		アメリカ・ドル買/ 円売2015年10月	買建	30,000	3,718,560	3,717,000	0.79%
		カナダ・ドル買/ 円売2015年10月	買建	32,000	3,060,288	3,049,600	0.65%
		オーストラリア・ドル 買/ 円売2015年1 0月	買建	33,000	2,975,115	2,973,960	0.63%
		ユーロ買/ 円売201 5年10月	買建	10,000	1,361,085	1,357,400	0.29%
		イギリス・ポンド売/ 円買2015年10月	売建	193,000	36,929,992	37,270,230	7.92%
		アメリカ・ドル売/ 円買2015年10月	売建	188,000	23,143,780	23,293,200	4.95%
		カナダ・ドル売/ 円買2015年10月	売建	196,000	18,751,672	18,678,800	3.97%
		オーストラリア・ドル 売/ 円買2015年1 0月	売建	207,000	18,721,843	18,654,840	3.96%
		ユーロ売/ 円買201 5年10月	売建	68,000	9,238,183	9,230,320	1.96%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2709月	買建	454	7,456,312,096	7,536,400,000	2.26%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2015年08月	売建	5,650,000	700,862,570	700,769,500	0.23%
		ユーロ売/円買201 5年08月	売建	850,000	115,388,180	115,387,500	0.04%
		イギリス・ポンド売/ 円買2015年08月	売建	340,000	65,765,078	65,762,800	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2015年0 8月	売建	300,000	27,175,500	27,174,000	0.01%
		カナダ・ドル売/円買 2015年08月	売建	280,000	26,728,912	26,728,800	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 5 0 0 F U T U R E S e p 1 5	買建	66	4,234,592,257	4,305,558,642	1.40%
	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 5	買建	262	1,252,291,035	1,272,569,370	0.41%
	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 5	買建	45	566,554,809	576,518,904	0.19%
	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 5	買建	22	276,063,752	279,776,497	0.09%
	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 5	買建	15	237,888,327	241,987,809	0.08%

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2015年08月	売建	602,505,600	73,701,143,732	74,728,769,568	42.28%
		ユーロ売/円買2015年08月	売建	513,895,000	70,064,958,195	69,761,246,250	39.47%
		イギリス・ポンド売/円買2015年08月	売建	78,383,000	15,074,226,645	15,160,056,030	8.58%
		カナダ・ドル売/円買2015年08月	売建	39,299,700	3,848,580,321	3,751,156,365	2.12%
		オーストラリア・ドル売/円買2015年08月	売建	31,259,900	2,933,147,677	2,831,209,143	1.60%
		メキシコ・ペソ売/円買2015年08月	売建	227,532,000	1,769,163,689	1,736,069,160	0.98%
		デンマーク・クローネ売/円買2015年08月	売建	68,128,100	1,245,722,308	1,239,250,139	0.70%
		ポーランド・ズロチ売/円買2015年08月	売建	31,251,900	1,015,484,187	1,023,499,725	0.58%
		南アフリカ・ランド売/円買2015年08月	売建	93,509,200	936,538,049	912,649,792	0.52%
		スウェーデン・クローナ売/円買2015年08月	売建	59,769,100	881,594,225	860,675,040	0.49%
		マレーシア・リングギット売/円買2015年08月	売建	25,370,000	828,333,037	824,271,300	0.47%
		シンガポール・ドル売/円買2015年08月	売建	7,044,500	639,522,843	636,188,795	0.36%
ノルウェー・クローネ売/円買2015年08月	売建	31,372,100	487,334,554	477,169,641	0.27%		

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2015年08月	買建	420,000	52,095,036	52,092,600	0.14%
		アメリカ・ドル売/円 買2015年08月	売建	8,100,000	1,005,015,600	1,004,643,000	2.75%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 15	買建	175	1,006,350,784	964,984,685	2.64%

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2015年08月	売建	2,100,000	260,559,600	260,463,000	0.45%

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成27年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成26年1月14日)	10	10	1.0126	1.0126
第2計算期間末 (平成26年7月11日)	39	39	1.0284	1.0284
第3計算期間末 (平成27年1月13日)	167	167	1.1049	1.1049
第4計算期間末 (平成27年7月13日)	395	395	1.0878	1.0878
平成26年7月末日	92	-	1.0387	-
8月末日	102	-	1.0481	-
9月末日	113	-	1.0506	-
10月末日	118	-	1.0664	-
11月末日	142	-	1.0946	-
12月末日	153	-	1.1018	-
平成27年1月末日	188	-	1.1134	-
2月末日	219	-	1.1088	-
3月末日	286	-	1.1153	-
4月末日	319	-	1.1098	-
5月末日	327	-	1.1091	-
6月末日	387	-	1.0882	-
7月末日	470	-	1.0915	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.3
第2計算期間	1.6
第3計算期間	7.4
第4計算期間	1.5

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の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計算期間については、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計算期間	10,000,000	0
第2計算期間	29,620,308	1,469,785
第3計算期間	157,808,160	44,749,582
第4計算期間	295,136,653	82,702,800

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2015年7月31日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2013年10月31日)~2015年7月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2013年10月31日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第1期 (2014.01.14)	0円
第2期 (2014.07.11)	0円
第3期 (2015.01.13)	0円
第4期 (2015.07.13)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	33.84%
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.93%
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	13.05%
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	12.10%
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.05%
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3.07%
7	外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド	3.01%
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	3.00%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	3.63
為替予約取引(売建)	△22.75

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	81.13
内 日本	81.13
地方債証券	6.66
内 日本	6.66
特殊債券	6.31
内 日本	6.31
社債券	5.37
内 日本	5.30
内 アメリカ	0.07
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.52
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.20%
2	123回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/3/20	1.20%
3	114回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2018/9/20	1.09%
4	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.08%
5	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.08%

■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	97.67
内 日本	97.67
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.33
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.57%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.86%
3	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.66%
4	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.49%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.48%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.55%
2	輸送用機器	10.76%
3	銀行業	9.51%
4	情報・通信業	6.86%
5	化学	5.76%

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)	2.26

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2015年7月31日

■為替フルヘッジ外国債券バッシブ・ファンド・マザーファンド

(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	98.40
内 アメリカ	42.12
内 イタリア	9.64
内 フランス	9.49
内 イギリス	8.55
内 ドイツ	7.43
内 その他	21.17
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.60
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 0.625 08/31/17	国債証券	アメリカ	0.625000	2017/8/31	1.33%
2	US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	アメリカ	3.625000	2019/8/15	1.30%
3	US T N/B 3.25 12/31/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/12/31	1.15%
4	US T N/B 0.875 04/30/17	国債証券	アメリカ	0.875000	2017/4/30	1.01%
5	US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	アメリカ	8.125000	2019/8/15	0.98%

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)	△98.40

■外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.21
内 アメリカ	56.98
内 イギリス	7.92
内 スイス	4.18
内 フランス	3.69
内 ドイツ	3.67
内 その他	18.77
投資信託受益証券	0.28
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.06
内 アメリカ	1.71
内 イギリス	0.15
内 フランス	0.14
内 香港	0.05
内 カナダ	0.01
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.45
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	2.23%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.14%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.09%
4	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.89%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.87%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	9.39%
2	医薬品	7.63%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.40%
4	保険	4.24%
5	メディア	3.13%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.30
株価指数先物取引(買建)	2.17

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	98.90
内 日本	98.90
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.10
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	7.41%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	6.90%
3	日本リートリアルエステイト投資法人	日本	5.59%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.51%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.01%

■外国リート・バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.96
内 オーストラリア	7.87
内 シンガポール	3.10
投資証券	88.41
内 アメリカ	69.79
内 イギリス	7.25
内 フランス	4.91
内 カナダ	1.96
内 香港	1.69
内 その他	2.81
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.63
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	5.79%
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.94%
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.70%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.62%
5	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	2.41%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2015年7月31日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	96.86
内 トルコ	14.52
内 メキシコ	13.65
内 ロシア	12.67
内 ブラジル	10.15
内 インドネシア	9.29
内 その他	36.58
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.14
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	4.97%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.95%
3	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	国債証券	ロシア	11.000000	2018/7/24	1.68%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	メキシコ	4.000000	2023/10/2	1.51%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.47%

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)	△0.45

■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	96.45
内 韓国	13.95
内 中国	12.62
内 台湾	12.06
内 インド	8.18
内 南アフリカ	7.59
内 その他	42.05
投資信託受益証券	0.74
内 メキシコ	0.74
投資証券	0.26
内 メキシコ	0.14
内 南アフリカ	0.06
内 トルコ	0.05
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.56
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.05%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	2.87%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン/中国	インターネット/ソフトウェアサービス	2.52%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	2.10%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	商業銀行	1.81%

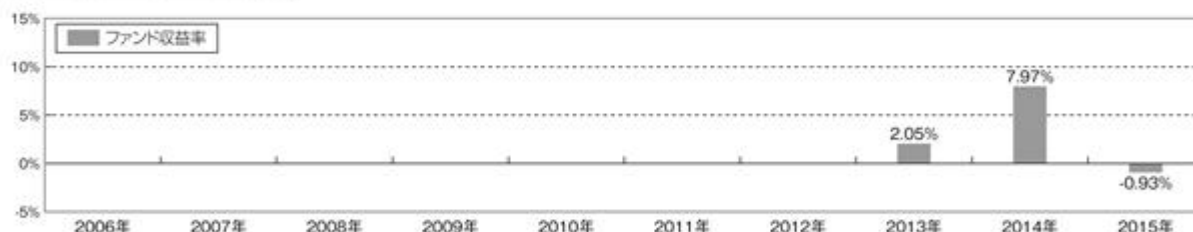
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	17.27%
2	石油・ガス・消耗燃料	7.76%
3	無線通信サービス	5.63%
4	コンピュータ・周辺機器	4.74%
5	半導体・半導体製造装置	4.74%

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)	0.14
為替予約取引(売建)	△2.75
株価指数先物取引(買建)	2.64

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、2013年は設定日から年末までの収益率、および2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はい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。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積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は、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。

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この信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当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.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・お申込単位

1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

・お申込手数料

ありません。

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の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.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・解約単位

1口単位とします。

- ・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。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（「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。）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。

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.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（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25年10月31日（設定日）から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ

り次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知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.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。
- 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。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

二. 公告

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

（URL <http://www.diam.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.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1) 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、原則として自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金受領権

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、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翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3) 一部解約請求権

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

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。

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（平成27年1月14日から平成27年7月13日まで）の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

投資のソムリエ＜DC年金＞

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 平成27年1月13日現在	第4期 平成27年7月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,320,535	70,275,707
親投資信託受益証券	134,663,433	339,648,929
派生商品評価勘定	1,238,547	20,768
未収入金	-	2,421,842
流動資産合計	170,222,515	412,367,246
資産合計		
	170,222,515	412,367,246
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,448,850	312,062
未払金	-	5,754,634
未払解約金	-	9,035,104
未払受託者報酬	31,541	76,247
未払委託者報酬	663,464	1,602,089
その他未払費用	2,908	7,166
流動負債合計	3,146,763	16,787,302
負債合計		
	3,146,763	16,787,302
純資産の部		
元本等		
元本	1 151,209,101	1 363,642,954
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,866,651	31,936,990
（分配準備積立金）	7,615,891	7,300,831
元本等合計	167,075,752	395,579,944
純資産合計		
	167,075,752	395,579,944
負債純資産合計		
	170,222,515	412,367,246

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第3期		第4期	
	自	平成26年7月12日 平成27年1月13日	自	平成27年1月14日 平成27年7月13日
営業収益				
受取利息		1,537		8,338
有価証券売買等損益		11,062,506		1,374,504
為替差損益		2,053,634		2,721,765
営業収益合計		9,010,409		4,087,931
営業費用				
受託者報酬		31,541		76,247
委託者報酬		663,464		1,602,089
その他費用		24,508		7,166
営業費用合計		719,513		1,685,502
営業利益又は営業損失（ ）		8,290,896		5,773,433
経常利益又は経常損失（ ）		8,290,896		5,773,433
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,290,896		5,773,433
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,149,222		460,350
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,081,620		15,866,651
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,508,213		30,111,631
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,508,213		30,111,631
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,864,856		8,728,209
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,864,856		8,728,209
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		15,866,651		31,936,990

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成27年1月13日、当計算期間末日を平成27年7月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 平成27年1月13日現在	第4期 平成27年7月13日現在
1 . 1 期首元本額	38,150,523円	151,209,101円
期中追加設定元本額	157,808,160円	295,136,653円
期中一部解約元本額	44,749,582円	82,702,800円
2 . 受益権の総数	151,209,101口	363,642,954口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	第4期 自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,301,896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(5,839,778円)、信託約款に規定される収益調整金(8,250,760円)及び分配準備積立金(474,217円)より分配対象収益は15,866,651円(1万口当たり1,049.32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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,582,975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(24,636,159円)及び分配準備積立金(5,717,856円)より分配対象収益は31,936,990円(1万口当たり878.25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。

（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3期 自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	第4期 自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成27年1月13日現在	第4期 平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 平成27年1月13日現在	第4期 平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,171,120	2,232,220
合計	3,171,120	2,232,220

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第3期 平成27年1月13日 現在				第4期 平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	68,874,511	-	69,003,248	128,737	46,177,266	-	46,468,560	291,294
アメリカ・ドル	18,757,016	-	19,195,346	438,330	9,979,990	-	10,031,060	51,070
イギリス・ポンド	20,821,093	-	20,727,042	94,051	16,110,810	-	16,304,740	193,930
オーストラリア・ドル	7,910,248	-	7,853,391	56,857	7,977,728	-	7,956,960	20,768
カナダ・ドル	9,077,114	-	8,931,229	145,885	8,050,518	-	8,085,000	34,482
ユーロ	12,309,040	-	12,296,240	12,800	4,058,220	-	4,090,800	32,580
買 建	52,085,286	-	51,003,720	1,081,566	-	-	-	-
アメリカ・ドル	14,197,278	-	14,287,378	90,100	-	-	-	-
イギリス・ポンド	14,451,925	-	14,122,311	329,614	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	5,405,908	-	5,341,073	64,835	-	-	-	-
カナダ・ドル	5,901,409	-	5,711,260	190,149	-	-	-	-
ユーロ	12,128,766	-	11,541,698	587,068	-	-	-	-
合計	120,959,797	-	120,006,968	1,210,303	46,177,266	-	46,468,560	291,294

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 平成27年1月13日現在	第4期 平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.1049円	1.0878円
(1万口当たり純資産額)	(11,049円)	(10,878円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化 法）・マザーファンド	10,399,168	24,062,634	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	139,816,158	171,162,940	
	J - R E I Tインデックスファンド・マ ザーファンド	3,553,582	5,671,161	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	3,430,343	10,217,276	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザー ファンド	5,472,193	6,269,491	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	61,903,371	79,830,587	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	13,059,934	13,847,448	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	15,453,480	28,587,392	
親投資信託受益証券 合計		253,088,229	339,648,929	
合計		253,088,229	339,648,929	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,144,078,193	6,929,438,458
株式	2	310,021,808,430	315,699,614,616
派生商品評価勘定		8,725,236	2,617,084
未収配当金		360,610,366	298,154,084
前払金		263,403,000	143,547,000
流動資産合計		319,798,625,225	323,073,371,242
資産合計		319,798,625,225	323,073,371,242
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		287,544,680	72,741,556
未払金		28,653,456	-
未払解約金		134,159,000	2,328,014,000
流動負債合計		450,357,136	2,400,755,556
負債合計		450,357,136	2,400,755,556
純資産の部			
元本等			
元本	1	163,582,012,277	138,587,667,315
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		155,766,255,812	182,084,948,371
元本等合計		319,348,268,089	320,672,615,686
純資産合計		319,348,268,089	320,672,615,686
負債純資産合計		319,798,625,225	323,073,371,242

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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	180,455,345,013円	163,582,012,277円
同期中追加設定元本額	11,165,178,087円	9,763,833,161円
同期中一部解約元本額	28,038,510,823円	34,758,178,123円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	4,050,936,134円	4,362,404,421円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,668,247,005円	1,529,860,430円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	36,410,499,984円	35,429,218,983円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	761,856,710円	684,915,524円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,874,848,892円	2,641,508,603円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,083,858,969円	2,776,171,231円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	397,344,864円	345,968,388円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,320,795,677円	1,219,714,464円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,145,795,156円	1,060,913,826円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	79,034,540円	63,921,903円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,242,527,851円	1,181,223,508円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	28,285,705円	26,322,530円

D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	16,523,767円	17,299,081円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	31,567,277円	36,031,952円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	77,789,847円	89,203,441円
投資のソムリエ	145,126,893円	756,128,700円
クルーズコントロール	715,684,317円	140,012,301円
投資のソムリエ<DC年金>	2,119,892円	10,399,168円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	31,437,441円	46,400,295円
D I A M D C バランス・F (成長型)	4,310,499円	16,893,023円
クルーズコントロール<DC年 金>	156,681円	41,111円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	423,890,044円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	133,832,298円	110,619,477円
D I A Mグローバル・バラン スファンド25VA(適格機関投 資家限定)	2,351,220,226円	1,202,685,119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)	635,341,939円	502,571,390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)	72,672,077円	44,077,447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)	306,900,165円	203,591,769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)	63,142,007円	46,860,062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)	120,735,185円	74,467,407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)	10,603,997,795円	6,938,509,908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)	3,748,124,949円	2,641,592,306円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,017,936,362円	2,284,966,402円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	2,080,118,791円	1,607,489,058円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	5,208,226,785円	4,197,637,341円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	441,450,309円	330,395,030円
D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	1,193,777,005円	867,775,378円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,285,199,215円	996,950,326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)	5,670,823,408円	4,137,523,941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)	93,432,732円	41,335,811円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	2,000,498,285円	1,372,939,277円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	6,655,657,141円	5,328,123,989円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	212,459,752円	42,257,264円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	24,462,739,747円	20,173,972,938円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投 資家限定)	1,039,739,874円	815,084,480円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	2,809,479,751円	2,348,889,165円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	15,371,060,815円	12,747,730,166円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	38,223円	32,872円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	91,866円	79,718円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	65,471,021円	30,821,108円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	13,766,293,963円	11,362,729,500円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	129,858,692円	108,420,018円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	45,696,398円	39,657,049円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	35,334円	30,381円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	110,635,704円	85,457,525円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	122,223円	2,616,293円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	818,354,088円	706,709,914円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	2,114,709,804円	1,838,513,776円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	2,751,007,520円	2,406,210,855円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	112,382,727円	89,899,928円
	計	163,582,012,277円	138,587,667,315円
2 .	受益権の総数	163,582,012,277口	138,587,667,315口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,759,500,000円	株式 4,056,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	41,054,501,257	36,798,017,926
合計	41,054,501,257	36,798,017,926

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年2月8日から平成27年1月13日まで及び平成27年2月10日から平成27年7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	8,951,710,000	-	8,673,095,000	278,615,000	6,169,032,000	-	6,099,030,000	70,002,000
合計	8,951,710,000	-	8,673,095,000	278,615,000	6,169,032,000	-	6,099,030,000	70,002,000

（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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.9522円	2.3139円
（1万口当たり純資産額）	（19,522円）	（23,139円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年7月13日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	66,000	281.00	18,546,000	
日本水産	185,700	366.00	67,966,200	
マルハニチロ	29,900	2,153.00	64,374,700	
ハウスイ	14,000	144.00	2,016,000	
サカタのタネ	24,300	2,259.00	54,893,700	
ホクト	16,700	2,463.00	41,132,100	
ショーボンドホールディングス	14,500	5,120.00	74,240,000	
ミライト・ホールディングス	46,300	1,390.00	64,357,000	
タマホーム	11,100	526.00	5,838,600	
サンヨーホームズ	1,600	620.00	992,000	
住石ホールディングス	42,900	121.00	5,190,900	
日鉄鉱業	42,000	544.00	22,848,000	
三井松島産業	99,000	133.00	13,167,000	
国際石油開発帝石	788,500	1,338.00	1,055,013,000	
日本海洋掘削	4,500	3,240.00	14,580,000	
石油資源開発	21,300	3,660.00	77,958,000	
K & Oエナジーグループ	10,200	1,753.00	17,880,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,900	2,146.00	4,077,400	
安藤・間	100,400	640.00	64,256,000	
東急建設	53,300	908.00	48,396,400	
コムシスホールディングス	66,500	1,835.00	122,027,500	
ミサワホーム	17,800	1,072.00	19,081,600	
高松コンストラクショングループ	11,400	2,620.00	29,868,000	
東建コーポレーション	5,600	8,000.00	44,800,000	
ヤマウラ	7,800	500.00	3,900,000	
大成建設	777,000	724.00	562,548,000	
大林組	449,000	949.00	426,101,000	
清水建設	458,000	1,057.00	484,106,000	
飛鳥建設	102,500	205.00	21,012,500	
長谷工コーポレーション	187,300	1,540.00	288,442,000	
松井建設	2,000	619.00	1,238,000	
銭高組	22,000	341.00	7,502,000	
鹿島建設	658,000	606.00	398,748,000	
不動テトラ	114,000	194.00	22,116,000	
大末建設	5,900	742.00	4,377,800	
鉄建建設	91,000	353.00	32,123,000	
日鉄住金テックスエンジ	29,000	616.00	17,864,000	
西松建設	162,000	467.00	75,654,000	
三井住友建設	608,500	150.00	91,275,000	
大豊建設	41,000	576.00	23,616,000	
前田建設工業	100,000	824.00	82,400,000	
佐田建設	54,000	130.00	7,020,000	
ナカノフドー建設	12,000	621.00	7,452,000	

奥村組	142,000	618.00	87,756,000
大和小田急建設	8,400	1,176.00	9,878,400
東鉄工業	18,000	2,422.00	43,596,000
イチケン	18,000	254.00	4,572,000
浅沼組	49,000	179.00	8,771,000
戸田建設	188,000	548.00	103,024,000
熊谷組	189,000	333.00	62,937,000
青木あすなろ建設	9,900	829.00	8,207,100
北野建設	32,000	320.00	10,240,000
植木組	20,000	240.00	4,800,000
三井ホーム	20,000	552.00	11,040,000
矢作建設工業	18,700	837.00	15,651,900
ピーエス三菱	15,700	403.00	6,327,100
日本ハウスホールディングス	19,500	587.00	11,446,500
大東建託	55,900	12,495.00	698,470,500
新日本建設	18,300	582.00	10,650,600
N I P P O	35,000	2,062.00	72,170,000
東亜道路工業	28,000	448.00	12,544,000
前田道路	47,000	2,175.00	102,225,000
日本道路	45,000	605.00	27,225,000
東亜建設工業	112,000	200.00	22,400,000
若築建設	88,000	165.00	14,520,000
東洋建設	44,100	460.00	20,286,000
五洋建設	166,500	497.00	82,750,500
大林道路	18,000	657.00	11,826,000
世紀東急工業	21,900	537.00	11,760,300
福田組	23,000	781.00	17,963,000
日本ドライケミカル	2,100	2,385.00	5,008,500
住友林業	110,500	1,489.00	164,534,500
日本基礎技術	18,500	406.00	7,511,000
日成ビルド工業	42,000	386.00	16,212,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	71,000	93.00	6,603,000
巴コーポレーション	18,800	417.00	7,839,600
パナホーム	56,000	837.00	46,872,000
大和ハウス工業	438,500	2,943.50	1,290,724,750
ライト工業	24,100	927.00	22,340,700
積水ハウス	470,700	1,905.50	896,918,850
日特建設	20,500	453.00	9,286,500
北陸電気工事	8,000	1,268.00	10,144,000
ユアテック	24,000	871.00	20,904,000
西部電気工業	13,000	457.00	5,941,000
四電工	6,000	430.00	2,580,000
中電工	21,700	2,291.00	49,714,700
関電工	68,000	763.00	51,884,000
きんでん	100,000	1,596.00	159,600,000
東京エネシス	17,000	1,381.00	23,477,000
トーエネック	21,000	762.00	16,002,000
住友電設	12,000	1,672.00	20,064,000
日本電設工業	24,400	2,186.00	53,338,400
協和エクシオ	63,400	1,454.00	92,183,600

新日本空調	13,000	1,051.00	13,663,000
日本工営	47,000	456.00	21,432,000
N D S	25,000	333.00	8,325,000
九電工	27,000	2,104.00	56,808,000
三機工業	30,400	934.00	28,393,600
日揮	150,000	2,225.00	333,750,000
中外炉工業	45,000	272.00	12,240,000
ヤマト	14,000	388.00	5,432,000
太平電業	20,000	1,246.00	24,920,000
高砂熱学工業	41,200	1,522.00	62,706,400
三晃金属工業	16,000	233.00	3,728,000
N E C ネットズエスアイ	16,500	2,575.00	42,487,500
朝日工業社	17,000	439.00	7,463,000
明星工業	24,900	594.00	14,790,600
大気社	21,400	2,885.00	61,739,000
ダイダン	20,000	804.00	16,080,000
日比谷総合設備	19,300	1,639.00	31,632,700
東芝プラントシステム	24,100	1,396.00	33,643,600
日本製粉	92,000	791.00	72,772,000
日清製粉グループ本社	164,300	1,692.00	277,995,600
日東富士製粉	8,000	337.00	2,696,000
昭和産業	63,000	490.00	30,870,000
鳥越製粉	12,900	719.00	9,275,100
中部飼料	14,700	943.00	13,862,100
フィード・ワンホールディングス	93,200	174.00	16,216,800
東洋精糖	28,000	119.00	3,332,000
日本甜菜製糖	78,000	202.00	15,756,000
三井製糖	60,000	489.00	29,340,000
塩水港精糖	16,700	258.00	4,308,600
ネクスト	33,100	824.00	27,274,400
日本M & Aセンター	21,700	5,270.00	114,359,000
ノバレーゼ	3,800	876.00	3,328,800
アコーディア・ゴルフ	52,100	1,195.00	62,259,500
タケエイ	13,900	1,334.00	18,542,600
トラスト・テック	2,500	2,452.00	6,130,000
パソナグループ	10,700	1,097.00	11,737,900
C D S	3,500	989.00	3,461,500
リンクアンドモチベーション	19,900	156.00	3,104,400
G C A サヴィアン	11,200	1,564.00	17,516,800
エス・エム・エス	15,800	1,620.00	25,596,000
テンブホールディングス	27,600	4,700.00	129,720,000
リニカル	3,900	1,286.00	5,015,400
クックパッド	26,700	2,442.00	65,201,400
エスクリ	5,100	1,126.00	5,742,600
アイ・ケイ・ケイ	7,800	576.00	4,492,800
森永製菓	136,000	536.00	72,896,000
中村屋	36,000	469.00	16,884,000
江崎グリコ	34,600	6,220.00	215,212,000
名糖産業	6,900	1,323.00	9,128,700
不二家	87,000	195.00	16,965,000

山崎製パン	110,000	1,963.00	215,930,000
第一屋製パン	24,000	117.00	2,808,000
モロゾフ	25,000	393.00	9,825,000
亀田製菓	8,500	4,875.00	41,437,500
寿スピリッツ	3,700	3,775.00	13,967,500
カルビー	55,500	5,240.00	290,820,000
森永乳業	134,000	449.00	60,166,000
六甲バター	7,200	1,757.00	12,650,400
ヤクルト本社	80,300	7,260.00	582,978,000
明治ホールディングス	44,400	16,440.00	729,936,000
雪印メグミルク	35,300	1,556.00	54,926,800
プリマハム	86,000	367.00	31,562,000
日本ハム	110,000	2,970.00	326,700,000
伊藤ハム	83,000	667.00	55,361,000
林兼産業	51,000	159.00	8,109,000
丸大食品	78,000	465.00	36,270,000
米久	5,100	2,663.00	13,581,300
S Foods	9,600	2,560.00	24,576,000
学情	5,400	1,257.00	6,787,800
スタジオアリス	6,600	2,180.00	14,388,000
シミックホールディングス	5,700	1,608.00	9,165,600
システナ	13,500	1,117.00	15,079,500
N J S	3,300	1,485.00	4,900,500
デジタルアーツ	7,300	1,776.00	12,964,800
新日鉄住金ソリューションズ	11,100	4,005.00	44,455,500
総合警備保障	46,600	4,965.00	231,369,000
キューブシステム	6,300	648.00	4,082,400
日本駐車場開発	145,700	178.00	25,934,600
コア	6,000	859.00	5,154,000
カカクコム	92,200	1,845.00	170,109,000
アイロムグループ	3,600	1,927.00	6,937,200
ルネサンス	7,500	1,353.00	10,147,500
ディップ	3,100	13,440.00	41,664,000
S B Sホールディングス	10,300	994.00	10,238,200
オプトホールディング	6,400	650.00	4,160,000
新日本科学	13,300	695.00	9,243,500
ツクイ	16,900	965.00	16,308,500
総合臨床ホールディングス	6,800	479.00	3,257,200
キャリアデザインセンター	4,200	1,425.00	5,985,000
エムスリー	121,000	2,567.00	310,607,000
ツカダ・グローバルホールディング	10,500	739.00	7,759,500
アウトソーシング	5,500	2,171.00	11,940,500
ウェルネット	3,800	2,950.00	11,210,000
ディー・エヌ・エー	68,900	2,208.00	152,131,200
博報堂D Yホールディングス	193,500	1,365.00	264,127,500
ぐるなび	16,300	1,863.00	30,366,900
エスアールジータカミヤ	11,700	698.00	8,166,600
一休	11,100	2,563.00	28,449,300
ジャパンベストレスキューシステム	12,000	247.00	2,964,000
ファンコミュニケーションズ	32,500	857.00	27,852,500

ジェイコムホールディングス	3,500	995.00	3,482,500	
P G Mホールディングス	19,800	1,362.00	26,967,600	
W D Bホールディングス	5,200	1,302.00	6,770,400	
ティア	4,000	748.00	2,992,000	
バリューコマース	11,800	582.00	6,867,600	
サッポロホールディングス	246,000	461.00	113,406,000	
アサヒグループホールディングス	300,900	3,901.50	1,173,961,350	
麒麟ホールディングス	606,600	1,732.00	1,050,631,200	
宝ホールディングス	117,800	1,001.00	117,917,800	
オエノンホールディングス	40,000	217.00	8,680,000	
養命酒製造	3,000	1,003.00	3,009,000	
コカ・コーラウエスト	50,800	2,134.00	108,407,200	
コカ・コーライーストジャパン	45,700	2,114.00	96,609,800	
サントリー食品インターナショナル	89,800	5,150.00	462,470,000	
ダイドードリンコ	7,600	5,280.00	40,128,000	
伊藤園	44,500	2,533.00	112,718,500	
キーコーヒー	13,400	2,031.00	27,215,400	
ユニカフェ	4,500	888.00	3,996,000	
ジャパンフーズ	2,600	1,108.00	2,880,800	
日清オイリオグループ	72,000	497.00	35,784,000	
不二製油	40,100	2,127.00	85,292,700	
J - オイルミルズ	64,000	407.00	26,048,000	
ローソン	49,800	8,320.00	414,336,000	
サンエー	10,000	5,380.00	53,800,000	
ダイユーエイト	3,000	815.00	2,445,000	
カワチ薬品	10,000	1,832.00	18,320,000	
エービーシー・マート	18,800	6,850.00	128,780,000	
ハードオフコーポレーション	6,700	1,473.00	9,869,100	
高千穂交易	5,200	1,091.00	5,673,200	
アスクル	13,800	4,150.00	57,270,000	
ゲオホールディングス	25,000	1,574.00	39,350,000	
アダストリア	11,200	5,520.00	61,824,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	17,000	168.00	2,856,000	
伊藤忠食品	3,400	4,140.00	14,076,000	
くらコーポレーション	7,900	3,935.00	31,086,500	
キャンドウ	6,300	1,544.00	9,727,200	
エレマテック	6,300	2,810.00	17,703,000	
パル	7,800	3,920.00	30,576,000	
J A L U X	3,900	2,286.00	8,915,400	
エディオン	60,400	857.00	51,762,800	
あらた	29,000	407.00	11,803,000	
サーラコーポレーション	11,600	587.00	6,809,200	
ワッツ	5,500	1,010.00	5,555,000	
トーメンデバイス	1,900	2,095.00	3,980,500	
J Pホールディングス	35,800	320.00	11,456,000	
あみやき亭	2,300	5,050.00	11,615,000	
東京エレクトロン デバイス	2,600	1,662.00	4,321,200	
ひらまつ	18,600	810.00	15,066,000	
フィールズ	8,800	1,925.00	16,940,000	
双日	883,600	291.00	257,127,600	

ゲンキー	1,400	10,170.00	14,238,000
アルフレッサ ホールディングス	155,900	1,914.00	298,392,600
大黒天物産	3,200	4,645.00	14,864,000
ハニーズ	11,700	980.00	11,466,000
キッコーマン	122,000	4,135.00	504,470,000
味の素	345,000	2,768.00	954,960,000
キュービー	76,300	2,497.00	190,521,100
ハウス食品グループ本社	55,400	2,308.00	127,863,200
カゴメ	58,000	1,981.00	114,898,000
焼津水産化学工業	7,900	1,005.00	7,939,500
アリアケジャパン	13,700	5,280.00	72,336,000
ニチレイ	160,000	926.00	148,160,000
横浜冷凍	33,400	986.00	32,932,400
東洋水産	78,200	4,545.00	355,419,000
イートアンド	1,800	2,026.00	3,646,800
日清食品ホールディングス	63,300	5,410.00	342,453,000
永谷園	7,000	1,088.00	7,616,000
フジッコ	15,000	2,329.00	34,935,000
ロック・フィールド	8,000	3,050.00	24,400,000
日本たばこ産業	829,600	4,383.00	3,636,136,800
ケンコーマヨネーズ	5,300	1,690.00	8,957,000
わらべや日洋	8,900	3,050.00	27,145,000
なとり	7,300	1,473.00	10,752,900
ユーグレナ	50,300	1,677.00	84,353,100
片倉工業	17,500	1,334.00	23,345,000
グンゼ	112,000	326.00	36,512,000
ヒューリック	245,100	1,101.00	269,855,100
神栄	21,000	183.00	3,843,000
山下医科器械	1,200	1,811.00	2,173,200
ラサ商事	7,300	601.00	4,387,300
アルペン	11,700	1,940.00	22,698,000
クオール	13,600	1,656.00	22,521,600
アルコニックス	7,800	1,876.00	14,632,800
神戸物産	4,300	8,090.00	34,787,000
ジェイアイエヌ	9,000	5,540.00	49,860,000
ビックカメラ	65,000	1,370.00	89,050,000
D C Mホールディングス	63,900	1,095.00	69,970,500
MonotaRO	25,800	5,340.00	137,772,000
あい ホールディングス	21,300	2,000.00	42,600,000
ディー・ブイエックス	4,100	1,288.00	5,280,800
きちり	2,900	706.00	2,047,400
アークランドサービス	1,600	5,840.00	9,344,000
J.フロント リテイリング	166,900	2,316.00	386,540,400
ドトール・日レスホールディングス	23,200	2,071.00	48,047,200
マツモトキヨシホールディングス	29,500	5,330.00	157,235,000
ブロンコピラー	4,800	2,547.00	12,225,600
スタートトゥデイ	41,100	3,530.00	145,083,000
物語コーポレーション	3,700	4,370.00	16,169,000
ココカラファイン	13,800	4,180.00	57,684,000
三越伊勢丹ホールディングス	262,200	2,185.00	572,907,000

東洋紡	554,000	184.00	101,936,000
ユニチカ	416,000	57.00	23,712,000
富士紡ホールディングス	68,000	263.00	17,884,000
日清紡ホールディングス	89,000	1,347.00	119,883,000
倉敷紡績	144,000	249.00	35,856,000
ダイワボウホールディングス	121,000	227.00	27,467,000
シキボウ	81,000	126.00	10,206,000
日東紡績	103,000	612.00	63,036,000
トヨタ紡織	46,800	2,097.00	98,139,600
マクニカ・富士エレホールディングス	23,700	1,450.00	34,365,000
ウエルシアホールディングス	11,400	5,690.00	64,866,000
クリエイトSDホールディングス	6,400	6,360.00	40,704,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,800	894.00	22,171,200
八洲電機	10,800	605.00	6,534,000
UKCホールディングス	8,500	2,466.00	20,961,000
丸善CHIホールディングス	16,000	401.00	6,416,000
TOKAIホールディングス	64,700	495.00	32,026,500
エー・ピーカンパニー	2,000	2,059.00	4,118,000
三洋貿易	7,600	1,650.00	12,540,000
チムニー	2,500	3,120.00	7,800,000
ウイン・パートナーズ	4,200	1,596.00	6,703,200
ネクステージ	1,400	938.00	1,313,200
ジョイフル本田	19,400	2,540.00	49,276,000
キリン堂ホールディングス	4,500	1,339.00	6,025,500
すかいらく	64,600	1,600.00	103,360,000
日本毛織	44,000	918.00	40,392,000
大東紡織	24,000	83.00	1,992,000
トーア紡コーポレーション	6,500	681.00	4,426,500
ダイドーリミテッド	15,100	509.00	7,685,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,500	1,077.00	46,849,500
三栄建築設計	5,600	1,107.00	6,199,200
野村不動産ホールディングス	79,200	2,600.00	205,920,000
三重交通グループホールディングス	24,100	462.00	11,134,200
日本商業開発	4,400	2,250.00	9,900,000
プレサンスコーポレーション	4,600	3,910.00	17,986,000
ユニゾホールディングス	7,400	5,550.00	41,070,000
日本管理センター	6,700	2,090.00	14,003,000
エストラスト	1,500	641.00	961,500
フージャースホールディングス	20,300	494.00	10,028,200
オープンハウス	17,200	1,936.00	33,299,200
東急不動産ホールディングス	345,800	968.00	334,734,400
飯田グループホールディングス	85,500	2,135.00	182,542,500
帝国繊維	14,800	1,711.00	25,322,800
ブックオフコーポレーション	7,900	901.00	7,117,900
日本コークス工業	124,800	114.00	14,227,200
ミタチ産業	3,300	738.00	2,435,400
あさひ	8,800	1,419.00	12,487,200

日本調剤	1,700	6,590.00	11,203,000
コスモス薬品	6,700	17,900.00	119,930,000
シップヘルスケアホールディングス	24,100	2,488.00	59,960,800
トーエル	7,400	782.00	5,786,800
一六堂	3,600	437.00	1,573,200
ソフトクリエイイトホールディングス	4,700	925.00	4,347,500
セブン&アイ・ホールディングス	551,500	5,373.00	2,963,209,500
薬王堂	1,900	3,260.00	6,194,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディング	9,300	2,847.00	26,477,100
ツルハホールディングス	28,200	10,220.00	288,204,000
スターティア	1,200	1,732.00	2,078,400
サンマルクホールディングス	9,600	4,040.00	38,784,000
フェリシモ	3,400	1,237.00	4,205,800
トリドール	14,400	1,589.00	22,881,600
クスリのアオキ	10,500	5,890.00	61,845,000
帝人	572,000	463.00	264,836,000
東レ	1,083,000	980.10	1,061,448,300
クラレ	238,200	1,448.00	344,913,600
旭化成	873,000	933.60	815,032,800
サカイオーベックス	38,000	204.00	7,752,000
稲葉製作所	6,200	1,466.00	9,089,200
宮地エンジニアリンググループ	40,000	173.00	6,920,000
トーカロ	9,200	2,695.00	24,794,000
アルファ	5,000	1,277.00	6,385,000
SUMCO	109,000	1,355.00	147,695,000
川田テクノロジーズ	2,700	4,620.00	12,474,000
住江織物	36,000	321.00	11,556,000
日本フェルト	8,200	520.00	4,264,000
イチカワ	10,000	350.00	3,500,000
日本バイリーン	20,000	801.00	16,020,000
エコナックホールディングス	49,000	131.00	6,419,000
日東製網	18,000	158.00	2,844,000
芦森工業	31,000	208.00	6,448,000
アツギ	116,000	114.00	13,224,000
ダイニック	29,000	183.00	5,307,000
共和レザー	9,700	923.00	8,953,100
セーレン	35,000	1,256.00	43,960,000
東海染工	22,000	128.00	2,816,000
小松精練	23,200	570.00	13,224,000
ワコールホールディングス	83,000	1,420.00	117,860,000
ホギメディカル	8,800	6,210.00	54,648,000
レナウン	34,300	185.00	6,345,500
クラウディア	3,600	619.00	2,228,400
T S Iホールディングス	62,700	822.00	51,539,400
I Tホールディングス	43,800	2,786.00	122,026,800
ネオス	3,700	672.00	2,486,400
電算システム	4,800	1,727.00	8,289,600
グリー	79,800	688.00	54,902,400
コーエーテクモホールディングス	30,100	2,048.00	61,644,800

三菱総合研究所	5,200	2,891.00	15,033,200
ボルテージ	2,400	1,895.00	4,548,000
電算	1,600	2,264.00	3,622,400
A G S	2,400	1,008.00	2,419,200
ファインデックス	5,900	1,345.00	7,935,500
ヒト・コミュニケーションズ	1,700	1,988.00	3,379,600
ブレインパッド	1,600	825.00	1,320,000
K L a b	14,200	1,470.00	20,874,000
ポルトウウィン・ピットクルー ホールディングス	8,900	1,204.00	10,715,600
イーブックイニシアティブジャパン	3,200	968.00	3,097,600
ネクソン	126,100	1,609.00	202,894,900
アイスタイル	5,000	1,182.00	5,910,000
エムアップ	3,700	720.00	2,664,000
エイチーム	3,400	2,293.00	7,796,200
e n i s h	3,600	1,141.00	4,107,600
コロプラ	36,400	2,348.00	85,467,200
モバイルクリエイト	6,500	804.00	5,226,000
オルトプラス	2,600	777.00	2,020,200
ブロードリーフ	10,900	1,204.00	13,123,600
ハーツユナイテッドグループ	4,100	2,036.00	8,347,600
特種東海製紙	81,000	302.00	24,462,000
ベリサーブ	1,700	1,120.00	1,904,000
ティーガイア	13,200	2,143.00	28,287,600
豆蔵ホールディングス	10,800	628.00	6,782,400
テクマトリックス	6,000	943.00	5,658,000
GMOペイメントゲートウェイ	11,600	4,025.00	46,690,000
ザッパラス	7,500	558.00	4,185,000
インターネットイニシアティブ	21,400	2,151.00	46,031,400
GMOクラウド	2,300	924.00	2,125,200
ビットアイル	15,600	477.00	7,441,200
S R Aホールディングス	7,100	2,393.00	16,990,300
システムインテグレータ	1,800	713.00	1,283,400
パイブドピッツ	1,400	1,666.00	2,332,400
朝日ネット	13,900	518.00	7,200,200
コムチュア	2,400	2,239.00	5,373,600
王子ホールディングス	574,000	518.00	297,332,000
日本製紙	67,500	2,098.00	141,615,000
三菱製紙	212,000	88.00	18,656,000
北越紀州製紙	87,100	690.00	60,099,000
中越パルプ工業	54,000	221.00	11,934,000
巴川製紙所	22,000	248.00	5,456,000
大王製紙	62,000	1,147.00	71,114,000
g u m i	10,300	1,378.00	14,193,400
レンゴー	123,000	472.00	58,056,000
トモク	45,000	274.00	12,330,000
ザ・バック	9,900	2,360.00	23,364,000
コープケミカル	22,000	109.00	2,398,000
昭和電工	933,000	152.00	141,816,000
住友化学	1,030,000	686.00	706,580,000

日本化成	27,000	145.00	3,915,000	
住友精化	29,000	801.00	23,229,000	
日産化学工業	91,800	2,803.00	257,315,400	
ラサ工業	53,000	142.00	7,526,000	
クレハ	98,000	450.00	44,100,000	
多木化学	8,000	699.00	5,592,000	
テイカ	24,000	468.00	11,232,000	
石原産業	236,000	117.00	27,612,000	
片倉チッカリン	10,000	302.00	3,020,000	
日本曹達	90,000	758.00	68,220,000	
東ソー	349,000	639.00	223,011,000	
トクヤマ	218,000	222.00	48,396,000	
セントラル硝子	143,000	507.00	72,501,000	
東亜合成	87,500	937.00	81,987,500	
ダイソー	56,000	435.00	24,360,000	
関東電化工業	34,000	835.00	28,390,000	
電気化学工業	290,000	511.00	148,190,000	
イビデン	87,500	1,998.00	174,825,000	
信越化学工業	250,900	7,375.00	1,850,387,500	
日本カーバイド工業	48,000	211.00	10,128,000	
堺化学工業	57,000	412.00	23,484,000	
エア・ウォーター	124,000	2,070.00	256,680,000	
大陽日酸	179,700	1,378.00	247,626,600	
日本化学工業	53,000	218.00	11,554,000	
日本パーカラライジング	65,900	1,153.00	75,982,700	
高压ガス工業	21,000	644.00	13,524,000	
チタン工業	17,000	221.00	3,757,000	
四国化成工業	20,000	950.00	19,000,000	
戸田工業	28,000	341.00	9,548,000	
ステラ ケミファ	7,200	1,288.00	9,273,600	
保土谷化学工業	41,000	176.00	7,216,000	
日本触媒	110,000	1,610.00	177,100,000	
大日精化工業	58,000	575.00	33,350,000	
カネカ	189,000	850.00	160,650,000	
協和発酵キリン	167,000	1,708.00	285,236,000	
三菱瓦斯化学	241,000	639.00	153,999,000	
三井化学	636,000	425.00	270,300,000	
J S R	138,100	2,076.00	286,695,600	
東京応化工業	29,000	3,395.00	98,455,000	
大阪有機化学工業	10,500	716.00	7,518,000	
三菱ケミカルホールディングス	875,000	747.20	653,800,000	
日本合成化学工業	33,000	801.00	26,433,000	
ダイセル	196,800	1,518.00	298,742,400	
住友ベークライト	131,000	509.00	66,679,000	
積水化学工業	324,000	1,482.00	480,168,000	
日本ゼオン	120,000	1,071.00	128,520,000	
アイカ工業	42,100	2,736.00	115,185,600	
宇部興産	705,000	219.00	154,395,000	
積水樹脂	21,600	1,526.00	32,961,600	
タキロン	30,000	524.00	15,720,000	

旭有機材工業	50,000	255.00	12,750,000
日立化成	69,100	2,110.00	145,801,000
ニチバン	14,000	571.00	7,994,000
リケンテクノス	22,800	498.00	11,354,400
大倉工業	34,000	324.00	11,016,000
積水化成品工業	40,000	438.00	17,520,000
群栄化学工業	37,000	322.00	11,914,000
タイガースポリマー	7,400	783.00	5,794,200
ミライアル	4,800	1,295.00	6,216,000
ダイキョーニシカワ	3,500	4,475.00	15,662,500
日本化薬	91,000	1,275.00	116,025,000
カーリットホールディングス	11,700	583.00	6,821,100
E P Sホールディングス	12,900	1,533.00	19,775,700
パナソニック インフォメーション システムズ	3,200	4,035.00	12,912,000
プレステージ・インターナショナル	11,000	985.00	10,835,000
フェイス	4,100	1,553.00	6,367,300
アミューズ	4,300	3,990.00	17,157,000
野村総合研究所	74,700	4,895.00	365,656,500
ドリームインキュベータ	4,800	2,282.00	10,953,600
サイバネットシステム	11,400	440.00	5,016,000
クイック	5,100	1,070.00	5,457,000
T A C	6,900	211.00	1,455,900
ケネディクス	198,400	450.00	89,280,000
電通	155,600	6,710.00	1,044,076,000
インテージホールディングス	7,700	1,987.00	15,299,900
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,500	806.00	4,433,000
東邦システムサイエンス	4,500	655.00	2,947,500
ぴあ	4,300	2,292.00	9,855,600
イオンファンタジー	4,700	2,007.00	9,432,900
ソースネクスト	6,900	696.00	4,802,400
ネクシィーズ	5,200	769.00	3,998,800
メディカルシステムネットワーク	12,400	465.00	5,766,000
ティー・ワイ・オー	13,600	203.00	2,760,800
日本精化	11,900	906.00	10,781,400
A D E K A	64,500	1,623.00	104,683,500
日油	114,000	1,004.00	114,456,000
ミヨシ油脂	54,000	149.00	8,046,000
新日本理化	22,800	262.00	5,973,600
ハリマ化成グループ	12,700	483.00	6,134,100
花王	376,300	6,016.00	2,263,820,800
第一工業製薬	30,000	355.00	10,650,000
三洋化成工業	44,000	854.00	37,576,000
武田薬品工業	524,200	6,058.00	3,175,603,600
アステラス製薬	1,567,200	1,815.50	2,845,251,600
大日本住友製薬	99,200	1,394.00	138,284,800
塩野義製薬	218,500	5,020.00	1,096,870,000
田辺三菱製薬	162,700	1,984.00	322,796,800
わかもと製薬	7,000	267.00	1,869,000
あすか製薬	16,700	1,300.00	21,710,000

日本新薬	32,000	3,825.00	122,400,000
ビオフェルミン製薬	2,400	2,856.00	6,854,400
中外製薬	139,300	4,430.00	617,099,000
科研製薬	48,000	4,585.00	220,080,000
エーザイ	184,600	8,130.00	1,500,798,000
理研ビタミン	4,500	3,850.00	17,325,000
ロート製薬	63,600	2,027.00	128,917,200
小野薬品工業	63,600	13,950.00	887,220,000
久光製薬	39,400	4,500.00	177,300,000
有機合成薬品工業	10,000	283.00	2,830,000
持田製薬	9,600	6,810.00	65,376,000
参天製薬	257,200	1,703.00	438,011,600
扶桑薬品工業	48,000	290.00	13,920,000
日本ケミファ	18,000	680.00	12,240,000
ツムラ	44,000	2,673.00	117,612,000
日医工	32,800	3,495.00	114,636,000
テルモ	204,800	3,055.00	625,664,000
みらかホールディングス	35,600	5,950.00	211,820,000
キッセイ薬品工業	26,000	2,952.00	76,752,000
生化学工業	26,900	1,985.00	53,396,500
栄研化学	11,800	2,433.00	28,709,400
日水製薬	6,000	1,378.00	8,268,000
鳥居薬品	9,600	3,205.00	30,768,000
J C Rファーマ	10,800	2,848.00	30,758,400
東和薬品	7,200	8,030.00	57,816,000
富士製薬工業	4,100	2,142.00	8,782,200
沢井製薬	22,200	7,070.00	156,954,000
ゼリア新薬工業	28,600	1,732.00	49,535,200
第一三共	470,600	2,489.00	1,171,323,400
キョーリン製薬ホールディングス	37,300	2,437.00	90,900,100
大幸薬品	6,300	1,895.00	11,938,500
ダイト	6,300	2,551.00	16,071,300
大塚ホールディングス	277,600	4,262.50	1,183,270,000
大正製薬ホールディングス	33,600	8,230.00	276,528,000
大日本塗料	81,000	183.00	14,823,000
日本ペイントホールディングス	121,200	3,660.00	443,592,000
関西ペイント	170,000	1,930.00	328,100,000
神東塗料	11,000	215.00	2,365,000
中国塗料	40,000	934.00	37,360,000
日本特殊塗料	11,300	864.00	9,763,200
藤倉化成	19,500	558.00	10,881,000
太陽ホールディングス	11,400	4,770.00	54,378,000
D I C	560,000	284.00	159,040,000
サカタインクス	28,700	1,025.00	29,417,500
東洋インキS Cホールディングス	138,000	479.00	66,102,000
T & K T O K A	4,700	2,196.00	10,321,200
アルプス技研	5,800	2,847.00	16,512,600
サニックス	16,600	338.00	5,610,800
ダイオーズ	3,300	1,187.00	3,917,100
日本空調サービス	7,200	1,066.00	7,675,200

オリエンタルランド	150,900	7,540.00	1,137,786,000
ダスキン	39,300	2,076.00	81,586,800
パーク24	66,400	2,153.00	142,959,200
明光ネットワークジャパン	14,300	1,412.00	20,191,600
ファルコホールディングス	6,400	1,494.00	9,561,600
クレスコ	3,200	2,119.00	6,780,800
フジ・メディア・ホールディングス	137,100	1,607.00	220,319,700
秀英予備校	3,500	842.00	2,947,000
田谷	3,000	779.00	2,337,000
ラウンドワン	39,400	583.00	22,970,200
リゾートトラスト	52,900	3,020.00	159,758,000
オービック	45,500	5,780.00	262,990,000
ジャストシステム	18,600	753.00	14,005,800
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,200	1,241.00	3,971,200
ヤフー	945,300	476.00	449,962,800
ビー・エム・エル	8,300	3,680.00	30,544,000
ワタベウエディング	4,800	511.00	2,452,800
トレンドマイクロ	69,900	4,140.00	289,386,000
もしもしホットライン	26,100	1,317.00	34,373,700
インフォメーション・ディベロプメント	2,900	985.00	2,856,500
リソー教育	22,300	309.00	6,890,700
日本オラクル	21,100	4,940.00	104,234,000
早稲田アカデミー	2,400	865.00	2,076,000
アルファシステムズ	4,500	1,813.00	8,158,500
フューチャーアーキテクト	14,400	801.00	11,534,400
CAC Holdings	9,300	1,081.00	10,053,300
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	1,367.00	5,057,900
トーセ	3,600	911.00	3,279,600
ユー・エス・エス	168,900	2,123.00	358,574,700
オービックビジネスコンサルタント	8,400	4,945.00	41,538,000
伊藤忠テクノソリューションズ	29,900	2,973.00	88,892,700
アイティフォー	16,600	464.00	7,702,400
東京個別指導学院	7,100	640.00	4,544,000
東計電算	2,600	2,066.00	5,371,600
サイバーエージェント	34,100	5,600.00	190,960,000
楽天	652,400	2,005.50	1,308,388,200
エクスネット	1,600	1,536.00	2,457,600
テー・オー・ダブリュー	9,000	572.00	5,148,000
大塚商会	35,500	6,190.00	219,745,000
総合メディカル	6,500	3,420.00	22,230,000
サイボウズ	18,100	337.00	6,099,700
ソフトブレーン	19,100	169.00	3,227,900
セントラルスポーツ	5,000	2,282.00	11,410,000
パラカ	4,800	1,632.00	7,833,600
電通国際情報サービス	8,400	1,397.00	11,734,800
イーエムシステムズ	1,600	2,216.00	3,545,600
ウェザーニューズ	4,100	4,230.00	17,343,000
C I J	12,800	524.00	6,707,200

東洋ビジネスエンジニアリング	1,600	1,414.00	2,262,400
日本エンタープライズ	9,200	330.00	3,036,000
WOWOW	6,400	3,670.00	23,488,000
フュージョンパートナー	7,700	685.00	5,274,500
フルキャストホールディングス	14,700	870.00	12,789,000
富士フイルムホールディングス	320,200	4,382.50	1,403,276,500
コニカミノルタ	318,500	1,481.00	471,698,500
資生堂	248,900	2,809.00	699,160,100
ライオン	161,000	1,023.00	164,703,000
高砂香料工業	46,000	519.00	23,874,000
マングラム	14,100	5,080.00	71,628,000
ミルボン	8,300	4,060.00	33,698,000
ファンケル	32,400	1,702.00	55,144,800
コーセー	22,600	10,590.00	239,334,000
コタ	5,100	1,359.00	6,930,900
ドクターシーラボ	9,600	4,445.00	42,672,000
シーボン	1,600	2,672.00	4,275,200
ポーラ・オルビスホールディングス	16,700	7,050.00	117,735,000
ノエビアホールディングス	8,900	2,626.00	23,371,400
アジュバンコスメジャパン	2,800	895.00	2,506,000
エステー	9,600	1,079.00	10,358,400
アグロ カネショウ	4,000	935.00	3,740,000
コニシ	11,000	2,230.00	24,530,000
長谷川香料	17,600	1,714.00	30,166,400
星光PMC	7,700	912.00	7,022,400
小林製薬	22,900	9,190.00	210,451,000
荒川化学工業	12,000	1,428.00	17,136,000
メック	11,000	833.00	9,163,000
日本高純度化学	4,100	2,455.00	10,065,500
JCU	3,900	4,800.00	18,720,000
新田ゼラチン	8,800	719.00	6,327,200
アース製薬	10,100	4,570.00	46,157,000
イハラケミカル工業	21,700	1,425.00	30,922,500
北興化学工業	16,000	476.00	7,616,000
大成ラミック	4,100	2,888.00	11,840,800
クミアイ化学工業	29,000	935.00	27,115,000
日本農薬	32,100	1,108.00	35,566,800
昭和シェル石油	125,200	1,088.00	136,217,600
コスモ石油	387,000	190.00	73,530,000
富士興産	5,500	551.00	3,030,500
ニチレキ	17,000	1,006.00	17,102,000
東燃ゼネラル石油	211,000	1,157.00	244,127,000
ユシロ化学工業	7,700	1,393.00	10,726,100
ビーピー・カストロール	6,000	1,329.00	7,974,000
富士石油	32,800	458.00	15,022,400
MORESCO	3,700	2,005.00	7,418,500
出光興産	66,300	2,402.00	159,252,600
JXホールディングス	1,551,900	506.10	785,416,590
横浜ゴム	77,500	2,346.00	181,815,000
東洋ゴム工業	63,400	2,517.00	159,577,800

ブリヂストン	438,500	4,515.50	1,980,046,750	
住友ゴム工業	109,200	1,796.00	196,123,200	
藤倉ゴム工業	11,800	678.00	8,000,400	
オカモト	48,000	503.00	24,144,000	
アキレス	119,000	154.00	18,326,000	
フコク	6,200	1,153.00	7,148,600	
ニッタ	13,900	3,175.00	44,132,500	
クリエートメディック	4,600	1,015.00	4,669,000	
住友理工	25,800	944.00	24,355,200	
三ツ星ベルト	34,000	907.00	30,838,000	
バンドー化学	51,000	500.00	25,500,000	
鬼怒川ゴム工業	31,000	633.00	19,623,000	
旭硝子	689,000	693.00	477,477,000	
日本板硝子	675,000	123.00	83,025,000	
石塚硝子	19,000	212.00	4,028,000	
有沢製作所	23,800	856.00	20,372,800	
日本山村硝子	54,000	185.00	9,990,000	
日本電気硝子	268,000	586.00	157,048,000	
オハラ	5,300	605.00	3,206,500	
住友大阪セメント	260,000	462.00	120,120,000	
太平洋セメント	872,000	373.00	325,256,000	
デイ・シイ	14,400	427.00	6,148,800	
リゾートソリューション	15,000	311.00	4,665,000	
日本ヒューム	15,100	758.00	11,445,800	
日本コンクリート工業	24,200	510.00	12,342,000	
三谷セキサン	7,200	1,668.00	12,009,600	
ジャパンパイル	18,900	800.00	15,120,000	
東海カーボン	122,000	362.00	44,164,000	
日本カーボン	74,000	372.00	27,528,000	
東洋炭素	7,700	1,889.00	14,545,300	
ノリタケカンパニーリミテド	79,000	272.00	21,488,000	
TOTO	206,000	2,037.00	419,622,000	
日本碍子	177,000	3,100.00	548,700,000	
日本特殊陶業	120,500	3,170.00	381,985,000	
ダントーホールディングス	21,000	193.00	4,053,000	
MARUWA	4,100	2,635.00	10,803,500	
品川リフラクトリーズ	35,000	283.00	9,905,000	
黒崎播磨	30,000	264.00	7,920,000	
ヨータイ	9,000	360.00	3,240,000	
イソライト工業	7,400	214.00	1,583,600	
東京窯業	17,000	208.00	3,536,000	
ニッカトー	5,500	429.00	2,359,500	
フジインコーポレーテッド	13,700	1,749.00	23,961,300	
エーアンドエーマテリアル	31,000	105.00	3,255,000	
ニチアス	62,000	743.00	46,066,000	
新日鐵住金	5,911,000	294.70	1,741,971,700	
神戸製鋼所	2,418,000	190.00	459,420,000	
中山製鋼所	101,000	88.00	8,888,000	
合同製鐵	72,000	207.00	14,904,000	

ジェイ エフ イー ホールディングス	356,800	2,430.50	867,202,400	
日新製鋼	59,300	1,413.00	83,790,900	
東京製鐵	70,800	858.00	60,746,400	
共英製鋼	14,900	2,056.00	30,634,400	
大和工業	31,700	2,540.00	80,518,000	
東京鐵鋼	27,000	568.00	15,336,000	
大阪製鐵	8,700	2,142.00	18,635,400	
淀川製鋼所	97,000	500.00	48,500,000	
東洋鋼鈑	33,100	568.00	18,800,800	
丸一鋼管	42,800	3,040.00	130,112,000	
モリ工業	22,000	369.00	8,118,000	
大同特殊鋼	234,000	473.00	110,682,000	
日本高周波鋼業	56,000	110.00	6,160,000	
日本冶金工業	108,000	220.00	23,760,000	
山陽特殊製鋼	83,000	500.00	41,500,000	
愛知製鋼	82,000	514.00	42,148,000	
日立金属	142,000	1,739.00	246,938,000	
日本金属	37,000	148.00	5,476,000	
大平洋金属	89,000	352.00	31,328,000	
新日本電工	84,100	275.00	23,127,500	
栗本鐵工所	72,000	249.00	17,928,000	
虹 技	21,000	196.00	4,116,000	
日本鑄鉄管	14,000	220.00	3,080,000	
日本製鋼所	200,000	476.00	95,200,000	
三菱製鋼	91,000	248.00	22,568,000	
日亜鋼業	19,300	304.00	5,867,200	
日本精線	11,000	554.00	6,094,000	
大紀アルミニウム工業所	24,000	379.00	9,096,000	
日本軽金属ホールディングス	339,700	201.00	68,279,700	
三井金属鉱業	381,000	296.00	112,776,000	
東邦亜鉛	79,000	356.00	28,124,000	
三菱マテリアル	873,000	443.00	386,739,000	
住友金属鉱山	386,000	1,725.00	665,850,000	
D O W Aホールディングス	167,000	1,125.00	187,875,000	
古河機械金属	219,000	226.00	49,494,000	
エス・サイエンス	70,700	50.00	3,535,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,800	3,095.00	42,711,000	
東邦チタニウム	23,800	1,279.00	30,440,200	
U A C J	160,000	286.00	45,760,000	
古河電気工業	410,000	204.00	83,640,000	
住友電気工業	527,000	1,882.00	991,814,000	
フジクラ	195,000	653.00	127,335,000	
昭和電線ホールディングス	153,000	93.00	14,229,000	
東京特殊電線	1,900	1,210.00	2,299,000	
タツタ電線	26,100	494.00	12,893,400	
沖電線	15,000	271.00	4,065,000	
カナレ電気	2,300	2,042.00	4,696,600	
平河ヒューテック	3,500	1,331.00	4,658,500	
リョービ	79,000	462.00	36,498,000	

アーレスティ	12,600	999.00	12,587,400
アサヒホールディングス	21,100	2,013.00	42,474,300
東洋製罐グループホールディングス	99,300	1,884.00	187,081,200
ホッカンホールディングス	33,000	279.00	9,207,000
コロナ	7,300	1,203.00	8,781,900
横河ブリッジホールディングス	26,400	1,195.00	31,548,000
OSJBホールディングス	20,800	244.00	5,075,200
駒井ハルテック	24,000	242.00	5,808,000
高田機工	12,000	233.00	2,796,000
三和ホールディングス	131,800	1,028.00	135,490,400
文化シャッター	39,500	909.00	35,905,500
三協立山	18,400	1,864.00	34,297,600
アルインコ	6,200	1,110.00	6,882,000
東洋シャッター	3,900	953.00	3,716,700
LIXILグループ	207,700	2,497.00	518,626,900
日本フィルコン	10,600	534.00	5,660,400
ノーリツ	27,400	1,941.00	53,183,400
長府製作所	14,900	2,810.00	41,869,000
リンナイ	26,000	9,340.00	242,840,000
ユニプレス	25,700	2,353.00	60,472,100
ダイニチ工業	7,500	745.00	5,587,500
日東精工	20,000	330.00	6,600,000
三洋工業	20,000	211.00	4,220,000
岡部	27,500	959.00	26,372,500
ジーテクト	9,900	1,151.00	11,394,900
中国工業	2,500	811.00	2,027,500
東プレ	27,000	2,164.00	58,428,000
高周波熱錬	24,300	842.00	20,460,600
東京製網	95,000	233.00	22,135,000
モリテックスチール	7,800	322.00	2,511,600
パイオラックス	7,100	7,120.00	50,552,000
日本発条	121,500	1,274.00	154,791,000
中央発條	18,000	324.00	5,832,000
アドバネクス	27,000	176.00	4,752,000
三浦工業	62,300	1,382.00	86,098,600
タクマ	45,000	735.00	33,075,000
テクノプロ・ホールディング	19,900	3,225.00	64,177,500
リブセンス	8,400	575.00	4,830,000
ジャパンマテリアル	6,000	1,673.00	10,038,000
ウチヤマホールディングス	6,300	495.00	3,118,500
サクセスホールディングス	1,200	1,249.00	1,498,800
アサンテ	3,700	1,569.00	5,805,300
N・フィールド	3,300	1,760.00	5,808,000
ERIホールディングス	3,900	909.00	3,545,100
リクルートホールディングス	211,100	3,600.00	759,960,000
ツガミ	41,000	612.00	25,092,000
オークマ	91,000	1,291.00	117,481,000
東芝機械	76,000	515.00	39,140,000
アマダホールディングス	208,600	1,243.00	259,289,800
アイダエンジニアリング	30,900	1,284.00	39,675,600

滝澤鉄工所	46,000	237.00	10,902,000
富士機械製造	45,700	1,225.00	55,982,500
牧野フライス製作所	70,000	1,187.00	83,090,000
オーエスジー	63,800	2,527.00	161,222,600
ダイジェット工業	17,000	214.00	3,638,000
旭ダイヤモンド工業	38,300	1,287.00	49,292,100
D M G 森精機	88,400	2,238.00	197,839,200
ソディック	26,800	943.00	25,272,400
ディスコ	16,300	9,510.00	155,013,000
日東工器	8,200	2,677.00	21,951,400
パンチ工業	3,500	1,182.00	4,137,000
豊田自動織機	121,600	6,710.00	815,936,000
豊和工業	8,100	734.00	5,945,400
大阪機工	56,000	177.00	9,912,000
石川製作所	36,000	102.00	3,672,000
東洋機械金属	9,800	491.00	4,811,800
津田駒工業	35,000	138.00	4,830,000
エンシュウ	36,000	116.00	4,176,000
島精機製作所	19,800	1,873.00	37,085,400
日阪製作所	17,700	1,080.00	19,116,000
やまびこ	5,500	5,130.00	28,215,000
ベガサスミシン製造	12,800	595.00	7,616,000
ナブテスコ	85,200	2,880.00	245,376,000
三井海洋開発	14,000	1,824.00	25,536,000
レオン自動機	11,000	545.00	5,995,000
S M C	41,900	34,720.00	1,454,768,000
新川	11,700	997.00	11,664,900
ホソカワミクロン	23,000	568.00	13,064,000
ユニオンツール	6,900	3,745.00	25,840,500
オイレス工業	16,500	2,209.00	36,448,500
日精エー・エス・ピー機械	4,600	2,255.00	10,373,000
サトーホールディングス	17,400	3,170.00	55,158,000
日本エアテック	4,400	686.00	3,018,400
日精樹脂工業	10,400	1,085.00	11,284,000
ワイエイシイ	5,900	991.00	5,846,900
小松製作所	685,300	2,282.00	1,563,854,600
住友重機械工業	383,000	656.00	251,248,000
日立建機	62,500	2,011.00	125,687,500
日工	19,000	432.00	8,208,000
巴工業	5,200	1,647.00	8,564,400
井関農機	142,000	229.00	32,518,000
T O W A	11,600	1,032.00	11,971,200
丸山製作所	30,000	227.00	6,810,000
北川鉄工所	65,000	304.00	19,760,000
シンニッタン	15,100	588.00	8,878,800
クボタ	672,000	2,029.50	1,363,824,000
荏原実業	4,000	1,424.00	5,696,000
東洋エンジニアリング	72,000	304.00	21,888,000
三菱化工機	47,000	366.00	17,202,000
月島機械	24,600	1,232.00	30,307,200

帝国電機製作所	9,300	985.00	9,160,500
東京機械製作所	52,000	77.00	4,004,000
新東工業	33,000	1,125.00	37,125,000
澁谷工業	11,700	2,074.00	24,265,800
アイチコーポレーション	20,100	756.00	15,195,600
小森コーポレーション	34,000	1,503.00	51,102,000
鶴見製作所	10,500	1,880.00	19,740,000
住友精密工業	22,000	458.00	10,076,000
酒井重工業	27,000	242.00	6,534,000
荏原製作所	290,000	561.00	162,690,000
石井鐵工所	21,000	211.00	4,431,000
西島製作所	13,500	920.00	12,420,000
北越工業	10,800	865.00	9,342,000
千代田化工建設	108,000	1,066.00	115,128,000
ダイキン工業	194,600	8,496.00	1,653,321,600
オルガノ	26,000	518.00	13,468,000
トーヨーカネツ	80,000	219.00	17,520,000
栗田工業	78,900	2,855.00	225,259,500
椿本チエイン	72,000	1,086.00	78,192,000
大同工業	28,000	238.00	6,664,000
日本コンベヤ	45,000	191.00	8,595,000
日機装	43,300	1,226.00	53,085,800
木村化工機	12,800	493.00	6,310,400
新興プラントック	30,600	1,060.00	32,436,000
アネスト岩田	21,300	752.00	16,017,600
ダイフク	66,100	1,850.00	122,285,000
サムコ	1,800	1,163.00	2,093,400
加藤製作所	30,000	703.00	21,090,000
油研工業	28,000	260.00	7,280,000
タダノ	65,000	1,805.00	117,325,000
フジテック	39,000	1,390.00	54,210,000
C K D	37,500	1,341.00	50,287,500
キトー	14,800	1,178.00	17,434,400
平和	29,400	2,533.00	74,470,200
理想科学工業	16,300	2,277.00	37,115,100
S A N K Y O	37,200	4,435.00	164,982,000
日本金銭機械	12,500	1,635.00	20,437,500
マースエンジニアリング	7,800	2,098.00	16,364,400
福島工業	7,400	2,242.00	16,590,800
オーイズミ	4,900	778.00	3,812,200
ダイコク電機	5,700	1,750.00	9,975,000
竹内製作所	5,600	7,620.00	42,672,000
アマノ	44,700	1,655.00	73,978,500
J U K I	20,000	1,510.00	30,200,000
サンデンホールディングス	82,000	531.00	43,542,000
蛇の目ミシン工業	132,000	124.00	16,368,000
ブラザー工業	172,700	1,691.00	292,035,700
マックス	21,000	1,255.00	26,355,000
モリタホールディングス	23,400	1,158.00	27,097,200
グローリー	42,700	3,450.00	147,315,000

新晃工業	9,400	1,272.00	11,956,800
大和冷機工業	19,200	773.00	14,841,600
セガサミーホールディングス	143,600	1,496.00	214,825,600
日本ピストンリング	54,000	217.00	11,718,000
リケン	58,000	450.00	26,100,000
T P R	15,000	3,590.00	53,850,000
ホンザキ電機	29,300	7,600.00	222,680,000
大豊工業	11,000	1,504.00	16,544,000
日本精工	274,500	1,710.00	469,395,000
N T N	310,000	724.00	224,440,000
ジェイテクト	142,500	2,186.00	311,505,000
不二越	124,000	663.00	82,212,000
ミネベア	199,000	1,904.00	378,896,000
日本トムソン	46,000	630.00	28,980,000
T H K	88,800	2,464.00	218,803,200
ユーシン精機	6,000	2,640.00	15,840,000
前澤給装工業	5,300	1,595.00	8,453,500
イーグル工業	18,700	2,552.00	47,722,400
前澤工業	10,300	426.00	4,387,800
日本ピラー工業	14,700	1,028.00	15,111,600
キッツ	59,700	589.00	35,163,300
日立製作所	3,207,000	767.30	2,460,731,100
東芝	2,812,000	372.50	1,047,470,000
三菱電機	1,336,000	1,475.00	1,970,600,000
富士電機	371,000	512.00	189,952,000
東洋電機製造	27,000	418.00	11,286,000
安川電機	163,300	1,563.00	255,237,900
シンフォニア テクノロジー	93,000	227.00	21,111,000
明電舎	123,000	429.00	52,767,000
オリジン電気	20,000	399.00	7,980,000
山洋電気	30,000	911.00	27,330,000
デンヨー	11,500	1,997.00	22,965,500
日立工機	35,700	968.00	34,557,600
三櫻工業	17,600	803.00	14,132,800
マキタ	87,100	6,880.00	599,248,000
東芝テック	96,000	623.00	59,808,000
芝浦メカトロニクス	22,000	260.00	5,720,000
マブチモーター	38,300	7,510.00	287,633,000
日本電産	146,700	9,414.00	1,381,033,800
東光高岳	6,900	1,604.00	11,067,600
宮越ホールディングス	4,800	573.00	2,750,400
ダイヘン	73,000	624.00	45,552,000
田淵電機	11,700	1,075.00	12,577,500
ヤーマン	1,800	1,554.00	2,797,200
J V C ケンウッド	98,800	290.00	28,652,000
ミマキエンジニアリング	8,200	854.00	7,002,800
第一精工	4,900	1,819.00	8,913,100
日新電機	31,400	817.00	25,653,800
大崎電気工業	23,000	654.00	15,042,000
オムロン	144,300	5,240.00	756,132,000

日東工業	21,500	2,737.00	58,845,500
I D E C	16,000	1,072.00	17,152,000
不二電機工業	1,400	1,521.00	2,129,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	257,000	466.00	119,762,000
サクサホールディングス	35,000	285.00	9,975,000
メルコホールディングス	7,400	2,169.00	16,050,600
テクノメディカ	3,100	2,805.00	8,695,500
日本電気	1,729,000	373.00	644,917,000
富士通	1,288,000	686.00	883,568,000
沖電気工業	472,000	253.00	119,416,000
岩崎通信機	60,000	90.00	5,400,000
電気興業	38,000	557.00	21,166,000
サンケン電気	68,000	719.00	48,892,000
ナカヨ	14,000	355.00	4,970,000
アイホン	7,900	2,032.00	16,052,800
ルネサスエレクトロニクス	68,800	792.00	54,489,600
セイコーエプソン	182,400	2,230.00	406,752,000
ワコム	105,800	449.00	47,504,200
アルバック	22,500	1,750.00	39,375,000
アクセル	6,200	1,747.00	10,831,400
E I Z O	12,300	2,782.00	34,218,600
ジャパンディスプレイ	274,700	421.00	115,648,700
日本信号	36,900	1,301.00	48,006,900
京三製作所	31,000	371.00	11,501,000
能美防災	17,500	1,417.00	24,797,500
ホーチキ	9,900	935.00	9,256,500
エレコム	4,300	2,750.00	11,825,000
日本無線	29,000	397.00	11,513,000
パナソニック	1,628,000	1,620.00	2,637,360,000
シャープ	1,129,000	179.00	202,091,000
アンリツ	79,900	820.00	65,518,000
富士通ゼネラル	41,000	1,527.00	62,607,000
日立国際電気	35,000	1,672.00	58,520,000
ソニー	873,600	3,526.50	3,080,750,400
T D K	80,700	8,750.00	706,125,000
帝国通信工業	33,000	217.00	7,161,000
ミツミ電機	47,400	780.00	36,972,000
タムラ製作所	52,000	454.00	23,608,000
アルプス電気	105,600	3,565.00	376,464,000
池上通信機	47,000	167.00	7,849,000
パイオニア	201,400	229.00	46,120,600
日本電波工業	12,000	901.00	10,812,000
鈴木	3,800	701.00	2,663,800
日本トリム	3,300	3,120.00	10,296,000
ローランド ディー・ジー	5,400	3,195.00	17,253,000
日本コロムビア	4,500	402.00	1,809,000
フォスター電機	14,500	2,587.00	37,511,500
クラリオン	71,000	333.00	23,643,000
S M K	40,000	537.00	21,480,000

ヨコオ	10,900	776.00	8,458,400
東光	32,000	327.00	10,464,000
ティアック	73,000	45.00	3,285,000
ホシデン	40,500	706.00	28,593,000
ヒロセ電機	22,600	16,170.00	365,442,000
日本航空電子工業	38,000	2,914.00	110,732,000
TOA	14,400	1,331.00	19,166,400
日立マクセル	26,700	1,911.00	51,023,700
古野電気	16,200	852.00	13,802,400
ユニデンホールディングス	37,000	218.00	8,066,000
アルパイン	32,000	2,127.00	68,064,000
スミダコーポレーション	12,300	877.00	10,787,100
アイコム	7,500	2,947.00	22,102,500
リオン	3,900	1,834.00	7,152,600
船井電機	13,600	1,408.00	19,148,800
横河電機	133,800	1,445.00	193,341,000
新電元工業	52,000	573.00	29,796,000
アズビル	43,500	3,075.00	133,762,500
東亜ディーケーケー	5,900	558.00	3,292,200
日本光電工業	57,000	2,791.00	159,087,000
チノー	5,000	1,244.00	6,220,000
共和電業	16,700	493.00	8,233,100
日本電子材料	6,000	725.00	4,350,000
堀場製作所	24,700	4,995.00	123,376,500
アドバンテスト	91,100	1,232.00	112,235,200
小野測器	6,800	977.00	6,643,600
エスベック	15,000	1,399.00	20,985,000
パナソニック デバイスSUNX	12,200	805.00	9,821,000
キーエンス	30,300	65,580.00	1,987,074,000
日置電機	7,100	2,697.00	19,148,700
シスメックス	103,500	7,330.00	758,655,000
メガチップス	14,200	1,397.00	19,837,400
OBARA GROUP	8,700	6,060.00	52,722,000
イマジカ・ロボットホールディングス	7,300	545.00	3,978,500
澤藤電機	9,000	229.00	2,061,000
デンソー	330,000	5,862.00	1,934,460,000
コーセル	19,300	1,416.00	27,328,800
新日本無線	10,000	699.00	6,990,000
オブテックス	9,200	2,589.00	23,818,800
千代田インテグレ	6,100	2,812.00	17,153,200
レーザーテック	13,800	1,595.00	22,011,000
スタンレー電気	95,800	2,426.00	232,410,800
岩崎電気	46,000	262.00	12,052,000
ウシオ電機	81,100	1,508.00	122,298,800
岡谷電機産業	7,300	412.00	3,007,600
ヘリオス テクノホールディング	12,900	410.00	5,289,000
日本セラミック	7,600	1,715.00	13,034,000
遠藤照明	6,300	1,355.00	8,536,500
日本デジタル研究所	11,400	1,667.00	19,003,800

古河電池	10,000	767.00	7,670,000	
双信電機	6,900	404.00	2,787,600	
山一電機	15,600	1,184.00	18,470,400	
図研	9,900	1,188.00	11,761,200	
日本電子	57,000	527.00	30,039,000	
カシオ計算機	134,100	2,463.00	330,288,300	
ファナック	139,100	23,995.00	3,337,704,500	
日本シイエムケイ	33,800	305.00	10,309,000	
エンプラス	6,100	5,010.00	30,561,000	
大真空	24,000	269.00	6,456,000	
ローム	65,800	7,490.00	492,842,000	
浜松ホトニクス	104,200	3,300.00	343,860,000	
三井ハイテック	17,800	793.00	14,115,400	
新光電気工業	50,400	816.00	41,126,400	
京セラ	219,300	6,309.00	1,383,563,700	
協栄産業	17,000	201.00	3,417,000	
太陽誘電	70,100	1,603.00	112,370,300	
村田製作所	140,200	19,190.00	2,690,438,000	
ユーシン	19,400	690.00	13,386,000	
双葉電子工業	22,900	2,100.00	48,090,000	
日東電工	108,100	9,659.00	1,044,137,900	
北陸電気工業	58,000	171.00	9,918,000	
東海理化電機製作所	35,300	2,888.00	101,946,400	
ニチコン	42,100	925.00	38,942,500	
日本ケミコン	108,000	352.00	38,016,000	
K O A	18,500	1,222.00	22,607,000	
三井造船	517,000	211.00	109,087,000	
日立造船	104,700	684.00	71,614,800	
三菱重工業	2,239,000	707.50	1,584,092,500	
川崎重工業	971,000	546.00	530,166,000	
I H I	962,000	545.00	524,290,000	
名村造船所	37,300	1,001.00	37,337,300	
サノヤスホールディングス	16,600	242.00	4,017,200	
日本車輛製造	48,000	333.00	15,984,000	
ニチユ三菱フォークリフト	16,000	564.00	9,024,000	
近畿車輛	20,000	349.00	6,980,000	
F P G	39,400	925.00	36,445,000	
島根銀行	3,100	1,561.00	4,839,100	
じもとホールディングス	96,700	216.00	20,887,200	
全国保証	34,400	4,385.00	150,844,000	
足利ホールディングス	82,900	507.00	42,030,300	
東京T Yフィナンシャルグループ	17,000	4,020.00	68,340,000	
日産自動車	1,875,200	1,197.00	2,244,614,400	
いすゞ自動車	422,400	1,563.00	660,211,200	
トヨタ自動車	1,843,200	8,113.00	14,953,881,600	*
日野自動車	190,800	1,424.00	271,699,200	
三菱自動車工業	489,600	1,033.00	505,756,800	
エフテック	8,000	1,218.00	9,744,000	
レシップホールディングス	4,700	865.00	4,065,500	
G M B	2,200	1,252.00	2,754,400	

武蔵精密工業	14,300	2,148.00	30,716,400
日産車体	58,600	1,560.00	91,416,000
新明和工業	54,000	1,087.00	58,698,000
極東開発工業	24,900	1,284.00	31,971,600
日信工業	24,500	1,996.00	48,902,000
トビー工業	111,000	294.00	32,634,000
ティラド	52,000	232.00	12,064,000
曙ブレーキ工業	56,200	385.00	21,637,000
タチエス	21,200	1,681.00	35,637,200
N O K	64,700	3,750.00	242,625,000
フタバ産業	41,100	566.00	23,262,600
カヤバ工業	149,000	407.00	60,643,000
シロキ工業	30,000	355.00	10,650,000
市光工業	33,000	282.00	9,306,000
大同メタル工業	18,800	1,150.00	21,620,000
プレス工業	66,900	532.00	35,590,800
ミクニ	13,100	547.00	7,165,700
カルソニックカンセイ	102,000	833.00	84,966,000
太平洋工業	27,500	1,165.00	32,037,500
ケーヒン	30,800	1,602.00	49,341,600
河西工業	16,700	1,398.00	23,346,600
アイシン精機	122,200	4,960.00	606,112,000
富士機工	15,900	690.00	10,971,000
マツダ	398,200	2,408.00	958,865,600
ダイハツ工業	159,100	1,693.00	269,356,300
今仙電機製作所	11,500	1,229.00	14,133,500
本田技研工業	1,202,000	3,875.00	4,657,750,000
スズキ	279,300	4,036.00	1,127,254,800
富士重工業	454,700	4,450.00	2,023,415,000
安永	5,000	571.00	2,855,000
ヤマハ発動機	203,200	2,622.00	532,790,400
ショーワ	31,700	1,169.00	37,057,300
小糸製作所	80,100	4,720.00	378,072,000
T B K	17,700	539.00	9,540,300
エクセディ	18,200	2,934.00	53,398,800
ミツバ	24,700	2,912.00	71,926,400
豊田合成	43,200	2,738.00	118,281,600
愛三工業	21,100	1,125.00	23,737,500
盟和産業	13,000	142.00	1,846,000
ヨロズ	12,600	2,498.00	31,474,800
エフ・シー・シー	19,800	1,808.00	35,798,400
新家工業	30,000	172.00	5,160,000
シマノ	57,700	17,160.00	990,132,000
タカタ	24,100	1,204.00	29,016,400
テイ・エス テック	28,300	3,150.00	89,145,000
ジャムコ	5,100	3,735.00	19,048,500
小野建	11,500	1,141.00	13,121,500
はるやま商事	5,700	742.00	4,229,400
佐島電機	10,200	842.00	8,588,400

カップ・クリエイトホールディングス	20,600	1,177.00	24,246,200	
エコートレーディング	3,400	667.00	2,267,800	
伯東	9,200	1,445.00	13,294,000	
コンドーテック	10,200	779.00	7,945,800	
中山福	8,000	872.00	6,976,000	
ライトオン	10,100	995.00	10,049,500	
ナガイレーベン	18,900	2,527.00	47,760,300	
ジーンズメイト	4,600	262.00	1,205,200	
三菱食品	14,600	2,691.00	39,288,600	
良品計画	16,300	26,720.00	435,536,000	
三城ホールディングス	15,700	466.00	7,316,200	
松田産業	9,800	1,427.00	13,984,600	
メディカルホールディングス	131,900	1,945.00	256,545,500	
アドヴァン	7,000	1,758.00	12,306,000	
S P K	3,100	2,330.00	7,223,000	
萩原電気	3,800	2,005.00	7,619,000	
アズワン	9,500	4,080.00	38,760,000	
スズデン	4,600	912.00	4,195,200	
尾家産業	5,100	892.00	4,549,200	
シモジマ	7,900	1,032.00	8,152,800	
ドウシシャ	17,200	2,138.00	36,773,600	
小津産業	2,800	2,035.00	5,698,000	
コナカ	15,800	678.00	10,712,400	
高速	7,900	890.00	7,031,000	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,417.00	2,408,900	
G - 7ホールディングス	3,000	1,497.00	4,491,000	
たけびし	4,900	1,092.00	5,350,800	
イオン北海道	8,400	668.00	5,611,200	
コジマ	19,100	383.00	7,315,300	
ヒマラヤ	3,200	1,129.00	3,612,800	
コーナン商事	20,400	1,590.00	32,436,000	
黒田電気	22,900	2,446.00	56,013,400	
ネットワンシステムズ	53,900	811.00	43,712,900	
エコス	5,000	1,018.00	5,090,000	
ワタミ	15,600	1,017.00	15,865,200	
マルシェ	3,600	897.00	3,229,200	
ドンキホーテホールディングス	85,200	5,180.00	441,336,000	
丸文	11,900	919.00	10,936,100	
西松屋チェーン	26,100	1,224.00	31,946,400	
ゼンショーホールディングス	67,800	1,148.00	77,834,400	
ハピネット	8,200	1,272.00	10,430,400	
幸楽苑ホールディングス	8,500	1,552.00	13,192,000	
ハークスレイ	4,000	1,027.00	4,108,000	
橋本総業	2,600	1,407.00	3,658,200	
サイゼリヤ	20,100	2,716.00	54,591,600	
エクセル	6,200	1,427.00	8,847,400	
V Tホールディングス	40,900	684.00	27,975,600	
マルカキカイ	4,500	1,946.00	8,757,000	
アルゴグラフィックス	5,700	1,910.00	10,887,000	

魚力	3,700	2,402.00	8,887,400
ガリバーインターナショナル	40,000	1,131.00	45,240,000
日本エム・ディ・エム	11,500	507.00	5,830,500
ポブラ	4,100	546.00	2,238,600
ユナイテッドアローズ	17,300	4,230.00	73,179,000
進和	8,000	2,202.00	17,616,000
エスケイジャパン	3,900	229.00	893,100
ダイトエレクトロン	6,200	876.00	5,431,200
ハイデイ日高	10,200	2,978.00	30,375,600
シークス	8,400	3,035.00	25,494,000
京都きもの友禅	7,900	1,029.00	8,129,100
コロワイド	44,000	1,879.00	82,676,000
田中商事	4,900	754.00	3,694,600
オーハシテクニカ	8,500	1,566.00	13,311,000
壱番屋	6,000	5,060.00	30,360,000
白銅	4,400	1,449.00	6,375,600
トップカルチャー	5,900	519.00	3,062,100
P L A N T	3,300	1,495.00	4,933,500
スギホールディングス	23,600	6,150.00	145,140,000
島津製作所	160,000	1,825.00	292,000,000
J M S	25,000	299.00	7,475,000
クボテック	3,000	853.00	2,559,000
モリテックス	3,200	245.00	784,000
長野計器	8,900	779.00	6,933,100
ブイ・テクノロジー	2,600	3,750.00	9,750,000
スター精密	25,500	1,884.00	48,042,000
東京計器	47,000	254.00	11,938,000
愛知時計電機	19,000	367.00	6,973,000
オーバル	10,600	288.00	3,052,800
東京精密	24,100	2,516.00	60,635,600
マニー	3,800	8,210.00	31,198,000
ニコン	249,400	1,451.00	361,879,400
トプコン	40,400	2,705.00	109,282,000
オリンパス	198,900	4,490.00	893,061,000
理研計器	11,900	1,358.00	16,160,200
S C R E E Nホールディングス	127,000	719.00	91,313,000
キヤノン電子	12,200	2,340.00	28,548,000
タムロン	10,300	2,569.00	26,460,700
H O Y A	317,900	4,903.00	1,558,663,700
ノーリツ鋼機	12,500	661.00	8,262,500
エー・アンド・デイ	12,600	496.00	6,249,600
キヤノン	774,400	3,928.50	3,042,230,400
リコー	401,700	1,229.50	493,890,150
シチズンホールディングス	164,700	840.00	138,348,000
リズム時計工業	59,000	176.00	10,384,000
大研医器	9,500	1,146.00	10,887,000
パラマウントベッドホールディングス	14,100	3,620.00	51,042,000
S H O B I	5,000	411.00	2,055,000
前田工織	13,700	1,039.00	14,234,300

永大産業	20,000	454.00	9,080,000
アートネイチャー	9,800	1,060.00	10,388,000
ダンロップスポーツ	8,600	1,167.00	10,036,200
バンダイナムコホールディングス	147,500	2,341.00	345,297,500
共立印刷	25,500	304.00	7,752,000
フランスベッドホールディングス	93,000	186.00	17,298,000
マーベラス	22,700	1,444.00	32,778,800
パイロットコーポレーション	23,400	4,815.00	112,671,000
萩原工業	3,000	2,009.00	6,027,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	26,200	2,042.00	53,500,400
トッパン・フォームズ	24,000	1,648.00	39,552,000
フジシールインターナショナル	16,300	3,545.00	57,783,500
タカラトミー	48,300	671.00	32,409,300
廣済堂	12,800	566.00	7,244,800
アーク	40,300	125.00	5,037,500
レック	5,000	1,345.00	6,725,000
タカノ	6,200	820.00	5,084,000
プロネクサス	13,700	780.00	10,686,000
ホクシン	13,100	139.00	1,820,900
ウッドワン	23,000	274.00	6,302,000
大建工業	55,000	319.00	17,545,000
きもと	25,000	283.00	7,075,000
凸版印刷	377,000	1,037.00	390,949,000
大日本印刷	395,000	1,284.50	507,377,500
図書印刷	22,000	429.00	9,438,000
共同印刷	42,000	348.00	14,616,000
日本写真印刷	22,500	2,055.00	46,237,500
光村印刷	3,000	256.00	768,000
藤森工業	12,000	3,540.00	42,480,000
宝印刷	7,300	1,239.00	9,044,700
前澤化成工業	10,100	1,256.00	12,685,600
アシックス	132,800	3,185.00	422,968,000
ツツミ	6,700	2,724.00	18,250,800
J S P	10,500	1,944.00	20,412,000
ニチハ	18,700	1,723.00	32,220,100
エフピコ	12,400	4,270.00	52,948,000
小松ウオール工業	4,200	2,373.00	9,966,600
ヤマハ	98,300	2,629.00	258,430,700
河合楽器製作所	4,700	2,231.00	10,485,700
クリナップ	12,300	862.00	10,602,600
ピジョン	75,800	3,660.00	277,428,000
天馬	10,900	1,982.00	21,603,800
兼松日産農林	19,000	155.00	2,945,000
キングジム	11,500	830.00	9,545,000
リンテック	31,700	2,647.00	83,909,900
T A S A K I	2,600	2,464.00	6,406,400
信越ポリマー	27,500	544.00	14,960,000
東リ	37,000	305.00	11,285,000
イトーキ	28,200	671.00	18,922,200

任天堂	82,300	19,805.00	1,629,951,500
三菱鉛筆	11,000	5,680.00	62,480,000
松風	6,800	1,311.00	8,914,800
タカスタンダード	55,000	833.00	45,815,000
コクヨ	69,600	1,040.00	72,384,000
ナカバヤシ	30,000	231.00	6,930,000
ニフコ	31,300	5,100.00	159,630,000
グロープライド	67,000	170.00	11,390,000
岡村製作所	51,400	1,064.00	54,689,600
日本バルカー工業	58,000	322.00	18,676,000
M U T O Hホールディングス	19,000	370.00	7,030,000
伊藤忠商事	1,103,700	1,495.00	1,650,031,500
丸紅	1,153,100	683.10	787,682,610
スクロール	18,100	294.00	5,321,400
高島	26,000	273.00	7,098,000
ヨンドシーホールディングス	10,100	2,834.00	28,623,400
三陽商会	74,000	333.00	24,642,000
長瀬産業	73,900	1,591.00	117,574,900
ナイガイ	52,000	64.00	3,328,000
蝶理	8,600	1,833.00	15,763,800
豊田通商	147,000	3,185.00	468,195,000
オンワードホールディングス	100,000	775.00	77,500,000
三共生興	22,700	509.00	11,554,300
兼松	264,000	220.00	58,080,000
美津濃	72,000	574.00	41,328,000
ツカモトコーポレーション	24,000	147.00	3,528,000
ファミリーマート	44,500	5,760.00	256,320,000
ルック	24,000	207.00	4,968,000
三井物産	1,117,200	1,605.50	1,793,664,600
日本紙パルプ商事	67,000	340.00	22,780,000
東京エレクトロン	112,400	7,698.00	865,255,200
日立ハイテクノロジーズ	45,700	3,140.00	143,498,000
カメイ	17,300	1,080.00	18,684,000
東都水産	24,000	199.00	4,776,000
O U Gホールディングス	24,000	255.00	6,120,000
スターゼン	53,000	387.00	20,511,000
セイコーホールディングス	95,000	654.00	62,130,000
山善	51,000	1,036.00	52,836,000
椿本興業	15,000	359.00	5,385,000
住友商事	777,500	1,372.50	1,067,118,750
日本ユニシス	36,700	1,304.00	47,856,800
内田洋行	33,000	423.00	13,959,000
三菱商事	1,010,300	2,650.50	2,677,800,150
第一実業	33,000	649.00	21,417,000
キヤノンマーケティングジャパン	37,600	2,061.00	77,493,600
西華産業	43,000	305.00	13,115,000
佐藤商事	12,100	802.00	9,704,200
菱洋エレクトロ	15,300	1,518.00	23,225,400
東京産業	13,100	495.00	6,484,500
ユアサ商事	11,700	2,797.00	32,724,900

神鋼商事	35,000	258.00	9,030,000
小林産業	10,300	243.00	2,502,900
阪和興業	132,000	527.00	69,564,000
カナデン	2,000	981.00	1,962,000
菱電商事	22,000	939.00	20,658,000
ニプロ	85,500	1,224.00	104,652,000
フルサト工業	7,500	1,779.00	13,342,500
岩谷産業	147,000	764.00	112,308,000
すてきナイスグループ	57,000	204.00	11,628,000
昭光通商	49,000	113.00	5,537,000
ニチモウ	24,000	191.00	4,584,000
極東貿易	16,000	308.00	4,928,000
イワキ	21,000	230.00	4,830,000
兼松エレクトロニクス	8,700	1,947.00	16,938,900
三愛石油	34,000	796.00	27,064,000
稲畑産業	32,100	1,270.00	40,767,000
G S Iクレオス	36,000	135.00	4,860,000
明和産業	11,000	398.00	4,378,000
キムラタン	644,000	9.00	5,796,000
ゴールドウイン	32,000	844.00	27,008,000
ユニ・チャーム	283,300	2,835.50	803,297,150
デサント	32,100	1,766.00	56,688,600
キング	7,200	435.00	3,132,000
ワキタ	28,200	1,189.00	33,529,800
ヤマトインターナショナル	8,500	428.00	3,638,000
東邦ホールディングス	45,500	2,925.00	133,087,500
サンゲツ	46,100	1,904.00	87,774,400
ミツウロコグループホールディングス	21,600	616.00	13,305,600
シナネン	29,000	464.00	13,456,000
伊藤忠エネクス	29,300	1,138.00	33,343,400
サンリオ	37,000	3,245.00	120,065,000
サンワ テクノス	8,600	1,330.00	11,438,000
リョーサン	22,200	3,115.00	69,153,000
新光商事	15,500	1,287.00	19,948,500
トーホー	31,000	494.00	15,314,000
三信電気	18,400	1,251.00	23,018,400
東陽テクニカ	19,200	998.00	19,161,600
モスフードサービス	17,300	2,539.00	43,924,700
加賀電子	11,900	1,516.00	18,040,400
三益半導体工業	10,300	1,178.00	12,133,400
ソーダニッカ	2,000	517.00	1,034,000
立花エレテック	9,900	1,360.00	13,464,000
木曽路	16,100	2,027.00	32,634,700
サトレストランシステムズ	12,800	914.00	11,699,200
千趣会	23,800	839.00	19,968,200
タカキュー	9,900	212.00	2,098,800
ケーヨー	24,900	562.00	13,993,800
アデランス	15,500	1,024.00	15,872,000
上新電機	28,000	949.00	26,572,000

日本瓦斯	21,200	4,120.00	87,344,000
ベスト電器	40,800	160.00	6,528,000
ロイヤルホールディングス	22,200	2,028.00	45,021,600
東天紅	10,000	182.00	1,820,000
いなげや	14,800	1,474.00	21,815,200
島忠	34,100	3,485.00	118,838,500
チヨダ	15,500	3,010.00	46,655,000
ライフコーポレーション	8,300	3,410.00	28,303,000
リンガーハット	13,000	2,670.00	34,710,000
さが美	11,000	193.00	2,123,000
MR MAX	13,600	414.00	5,630,400
テンアライド	11,900	390.00	4,641,000
AOKIホールディングス	30,400	1,615.00	49,096,000
オークワ	20,000	968.00	19,360,000
コメリ	22,500	2,692.00	60,570,000
青山商事	33,100	4,780.00	158,218,000
しまむら	15,300	12,010.00	183,753,000
CFSコーポレーション	8,900	1,139.00	10,137,100
はせがわ	4,800	555.00	2,664,000
高島屋	192,000	1,114.00	213,888,000
松屋	26,600	2,313.00	61,525,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	62,400	2,586.00	161,366,400
近鉄百貨店	49,000	342.00	16,758,000
丸栄	21,000	132.00	2,772,000
ニッセンホールディングス	28,100	226.00	6,350,600
パルコ	12,800	1,179.00	15,091,200
丸井グループ	138,800	1,744.00	242,067,200
クレディセゾン	107,700	2,782.00	299,621,400
アクシアル リテイリング	10,300	3,525.00	36,307,500
井筒屋	75,000	80.00	6,000,000
イオン	543,900	1,798.50	978,204,150
ユニーグループ・ホールディングス	126,200	792.00	99,950,400
イズミ	29,500	5,520.00	162,840,000
東武ストア	18,000	324.00	5,832,000
フォーバル	2,700	1,755.00	4,738,500
平和堂	26,800	2,647.00	70,939,600
フジ	14,600	2,380.00	34,748,000
ヤオコー	15,000	5,340.00	80,100,000
ゼビオ	17,900	2,200.00	39,380,000
ケーズホールディングス	30,400	3,870.00	117,648,000
PALTAC	21,200	2,125.00	45,050,000
三谷産業	14,400	470.00	6,768,000
Olympicグループ	7,400	754.00	5,579,600
日産東京販売ホールディングス	22,900	358.00	8,198,200
新生銀行	1,255,000	255.00	320,025,000
あおぞら銀行	891,000	463.00	412,533,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,579,500	872.00	9,225,324,000
りそなホールディングス	1,542,200	660.90	1,019,239,980

三井住友トラスト・ホールディングス	2,916,000	552.60	1,611,381,600	
三井住友フィナンシャルグループ	997,100	5,346.00	5,330,496,600	
第四銀行	166,000	518.00	85,988,000	
北越銀行	143,000	246.00	35,178,000	
西日本シティ銀行	462,000	356.00	164,472,000	
千葉銀行	508,000	935.00	474,980,000	
横浜銀行	884,000	781.90	691,199,600	
常陽銀行	475,000	695.00	330,125,000	
群馬銀行	312,000	890.00	277,680,000	
武蔵野銀行	21,000	4,700.00	98,700,000	
千葉興業銀行	27,500	825.00	22,687,500	
筑波銀行	55,000	399.00	21,945,000	
七十七銀行	222,000	746.00	165,612,000	
青森銀行	104,000	396.00	41,184,000	
秋田銀行	88,000	382.00	33,616,000	
山形銀行	79,000	523.00	41,317,000	
岩手銀行	9,200	5,320.00	48,944,000	
東邦銀行	118,000	547.00	64,546,000	
東北銀行	75,000	170.00	12,750,000	
みちのく銀行	63,000	214.00	13,482,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	535,000	635.00	339,725,000	
静岡銀行	386,000	1,298.00	501,028,000	
十六銀行	165,000	483.00	79,695,000	
スルガ銀行	139,200	2,593.00	360,945,600	
八十二銀行	238,000	911.00	216,818,000	
山梨中央銀行	81,000	565.00	45,765,000	
大垣共立銀行	165,000	438.00	72,270,000	
福井銀行	112,000	258.00	28,896,000	
北國銀行	146,000	440.00	64,240,000	
清水銀行	4,500	3,375.00	15,187,500	
滋賀銀行	132,000	642.00	84,744,000	
南都銀行	126,000	425.00	53,550,000	
百五銀行	127,000	585.00	74,295,000	
京都銀行	252,000	1,404.00	353,808,000	
紀陽銀行	51,700	1,830.00	94,611,000	
三重銀行	59,000	284.00	16,756,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	895,000	271.00	242,545,000	
広島銀行	389,000	712.00	276,968,000	
山陰合同銀行	80,000	1,194.00	95,520,000	
中国銀行	93,100	1,889.00	175,865,900	
鳥取銀行	43,000	226.00	9,718,000	
伊予銀行	140,900	1,486.00	209,377,400	
百十四銀行	145,000	426.00	61,770,000	
四国銀行	101,000	271.00	27,371,000	
阿波銀行	108,000	771.00	83,268,000	
鹿児島銀行	91,000	831.00	75,621,000	
大分銀行	81,000	524.00	42,444,000	
宮崎銀行	88,000	431.00	37,928,000	
肥後銀行	108,000	744.00	80,352,000	

佐賀銀行	81,000	296.00	23,976,000	
十八銀行	82,000	371.00	30,422,000	
沖縄銀行	10,400	5,150.00	53,560,000	
琉球銀行	27,400	1,787.00	48,963,800	
セブン銀行	445,200	556.00	247,531,200	
みずほフィナンシャルグループ	18,387,200	262.00	4,817,446,400	
高知銀行	53,000	162.00	8,586,000	
山口フィナンシャルグループ	131,000	1,541.00	201,871,000	
アクリーティブ	9,500	700.00	6,650,000	
芙蓉総合リース	13,800	5,040.00	69,552,000	
興銀リース	24,800	2,819.00	69,911,200	
東京センチュリーリース	31,000	3,815.00	118,265,000	
S B Iホールディングス	158,500	1,658.00	262,793,000	
日本証券金融	57,700	698.00	40,274,600	
アイフル	220,400	379.00	83,531,600	
日本アジア投資	96,000	58.00	5,568,000	
ポケットカード	10,000	546.00	5,460,000	
長野銀行	45,000	231.00	10,395,000	
名古屋銀行	119,000	481.00	57,239,000	
北洋銀行	198,400	544.00	107,929,600	
愛知銀行	4,800	6,840.00	32,832,000	
第三銀行	73,000	196.00	14,308,000	
中京銀行	54,000	231.00	12,474,000	
東日本銀行	58,000	461.00	26,738,000	
大光銀行	47,000	237.00	11,139,000	
愛媛銀行	77,000	267.00	20,559,000	
トマト銀行	53,000	197.00	10,441,000	
みなと銀行	120,000	315.00	37,800,000	
京葉銀行	108,000	618.00	66,744,000	
関西アーバン銀行	18,100	1,398.00	25,303,800	
栃木銀行	67,000	688.00	46,096,000	
北日本銀行	4,200	3,475.00	14,595,000	
東和銀行	186,000	117.00	21,762,000	
福島銀行	168,000	100.00	16,800,000	
大東銀行	87,000	172.00	14,964,000	
リコーリース	10,500	3,675.00	38,587,500	
イオンフィナンシャルサービス	86,600	3,490.00	302,234,000	
アコム	264,400	503.00	132,993,200	
ジャックス	73,000	558.00	40,734,000	
オリエン트コーポレーション	304,500	210.00	63,945,000	
日立キャピタル	26,000	3,200.00	83,200,000	
アプラスフィナンシャル	62,700	133.00	8,339,100	
オリックス	933,400	1,765.00	1,647,451,000	
三菱UFJリース	333,900	655.00	218,704,500	
ジャフコ	18,100	5,150.00	93,215,000	
トモニホールディングス	101,900	548.00	55,841,200	
大和証券グループ本社	1,233,000	908.80	1,120,550,400	
野村ホールディングス	2,694,600	855.20	2,304,421,920	
岡三証券グループ	112,000	854.00	95,648,000	
丸三証券	42,200	1,355.00	57,181,000	

東洋証券	52,000	368.00	19,136,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	150,800	895.00	134,966,000
光世証券	33,000	220.00	7,260,000
水戸証券	42,300	430.00	18,189,000
いちよし証券	27,700	1,150.00	31,855,000
松井証券	67,000	1,092.00	73,164,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	293,000	4,204.00	1,231,772,000
だいこう証券ビジネス	7,000	990.00	6,930,000
日本取引所グループ	193,600	4,045.00	783,112,000
マネックスグループ	155,900	328.00	51,135,200
カブドットコム証券	118,000	408.00	48,144,000
極東証券	17,900	1,795.00	32,130,500
岩井コスモホールディングス	13,700	1,507.00	20,645,900
藍澤証券	19,000	833.00	15,827,000
フィデアホールディングス	78,300	268.00	20,984,400
池田泉州ホールディングス	124,600	547.00	68,156,200
アニコムホールディングス	5,800	2,034.00	11,797,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	420,500	3,751.50	1,577,505,750
マネースクウェアHD	4,300	1,496.00	6,432,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	126,600	2,309.00	292,319,400
マネーパートナーズグループ	14,300	422.00	6,034,600
小林洋行	4,700	315.00	1,480,500
第一生命保険	844,900	2,312.50	1,953,831,250
東京海上ホールディングス	534,200	5,008.00	2,675,273,600
イー・ギャランティ	4,000	2,414.00	9,656,000
アサックス	2,500	1,527.00	3,817,500
NECキャピタルソリューション	5,400	1,840.00	9,936,000
T & Dホールディングス	480,600	1,792.00	861,235,200
三井不動産	699,000	3,403.00	2,378,697,000
三菱地所	980,000	2,695.00	2,641,100,000
平和不動産	25,200	1,764.00	44,452,800
東京建物	146,257	1,638.00	239,568,966
ダイビル	34,000	1,102.00	37,468,000
京阪神ビルディング	22,600	734.00	16,588,400
住友不動産	316,000	4,269.00	1,349,004,000
太平洋興発	54,000	93.00	5,022,000
大京	208,000	207.00	43,056,000
テーオーシー	45,600	800.00	36,480,000
東京楽天地	22,000	504.00	11,088,000
レオパレス21	144,400	655.00	94,582,000
スターツコーポレーション	15,400	1,957.00	30,137,800
フジ住宅	17,400	685.00	11,919,000
空港施設	16,000	664.00	10,624,000
明和地所	7,800	600.00	4,680,000
住友不動産販売	9,400	3,055.00	28,717,000
ゴールドクレスト	11,800	2,475.00	29,205,000

リロ・ホールディング	4,800	12,980.00	62,304,000
日本エスリード	5,400	1,261.00	6,809,400
日神不動産	18,300	428.00	7,832,400
タカラレーベン	59,000	695.00	41,005,000
サンヨーハウジング名古屋	7,800	1,233.00	9,617,400
イオンモール	84,900	2,331.00	197,901,900
ファースト住建	5,100	1,365.00	6,961,500
ランド	54,300	20.00	1,086,000
東祥	3,100	2,823.00	8,751,300
トーセイ	18,500	831.00	15,373,500
穴吹興産	13,000	234.00	3,042,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	81,900	1,187.00	97,215,300
サンフロンティア不動産	14,500	932.00	13,514,000
エフ・ジェー・ネクスト	10,400	600.00	6,240,000
ランドビジネス	7,100	389.00	2,761,900
グランディハウス	12,100	400.00	4,840,000
東武鉄道	713,000	562.00	400,706,000
相鉄ホールディングス	229,000	689.00	157,781,000
東京急行電鉄	725,000	869.00	630,025,000
京浜急行電鉄	365,000	978.00	356,970,000
小田急電鉄	428,000	1,204.00	515,312,000
京王電鉄	373,000	946.00	352,858,000
京成電鉄	200,000	1,469.00	293,800,000
富士急行	37,000	1,056.00	39,072,000
新京成電鉄	18,000	414.00	7,452,000
東日本旅客鉄道	244,800	11,470.00	2,807,856,000
西日本旅客鉄道	128,600	8,475.00	1,089,885,000
東海旅客鉄道	119,600	21,375.00	2,556,450,000
西武ホールディングス	106,500	2,832.00	301,608,000
鴻池運輸	16,700	1,441.00	24,064,700
西日本鉄道	173,000	565.00	97,745,000
ハマキョウレックス	4,200	4,500.00	18,900,000
サカイ引越センター	2,400	5,200.00	12,480,000
近鉄グループホールディングス	1,343,000	434.00	582,862,000
阪急阪神ホールディングス	896,000	755.00	676,480,000
南海電気鉄道	300,000	568.00	170,400,000
京阪電気鉄道	300,000	732.00	219,600,000
神戸電鉄	34,000	359.00	12,206,000
名糖運輸	6,000	729.00	4,374,000
名古屋鉄道	485,000	464.00	225,040,000
山陽電気鉄道	49,000	470.00	23,030,000
トランコム	3,900	6,440.00	25,116,000
日本通運	517,000	587.00	303,479,000
ヤマトホールディングス	234,800	2,452.00	575,729,600
山九	162,000	622.00	100,764,000
日新	51,000	356.00	18,156,000
丸運	8,600	264.00	2,270,400
丸全昭和運輸	45,000	425.00	19,125,000
センコー	59,000	763.00	45,017,000
トナミホールディングス	28,000	420.00	11,760,000

日本梱包運輸倉庫	43,800	2,047.00	89,658,600
日本石油輸送	17,000	235.00	3,995,000
福山通運	81,000	656.00	53,136,000
セイノーホールディングス	103,400	1,333.00	137,832,200
神奈川中央交通	16,000	598.00	9,568,000
日立物流	28,000	2,032.00	56,896,000
日本郵船	1,130,000	334.00	377,420,000
商船三井	701,000	380.00	266,380,000
川崎汽船	586,000	280.00	164,080,000
N S ユナイテッド海運	59,000	263.00	15,517,000
明治海運	12,500	413.00	5,162,500
飯野海運	69,900	561.00	39,213,900
共栄タンカー	12,000	202.00	2,424,000
第一中央汽船	113,000	37.00	4,181,000
日本航空	255,800	4,340.00	1,110,172,000
A N A ホールディングス	2,627,000	353.90	929,695,300
パスコ	13,000	343.00	4,459,000
三菱倉庫	88,000	1,694.00	149,072,000
三井倉庫ホールディングス	79,000	404.00	31,916,000
住友倉庫	98,000	676.00	66,248,000
澁澤倉庫	35,000	350.00	12,250,000
ヤマタネ	68,000	204.00	13,872,000
東陽倉庫	25,000	281.00	7,025,000
乾汽船	9,300	940.00	8,742,000
日本トランスシティ	32,000	429.00	13,728,000
ケイヒン	26,000	204.00	5,304,000
中央倉庫	8,100	968.00	7,840,800
安田倉庫	10,700	1,006.00	10,764,200
東洋埠頭	42,000	209.00	8,778,000
宇徳	11,400	544.00	6,201,600
上組	159,000	1,099.00	174,741,000
サンリツ	1,700	557.00	946,900
キムラユニティー	3,700	1,288.00	4,765,600
キューソー流通システム	3,900	2,317.00	9,036,300
郵船ロジスティクス	12,700	1,353.00	17,183,100
近鉄エクスプレス	12,000	5,320.00	63,840,000
東海運	8,300	288.00	2,390,400
エーアイティー	6,500	1,171.00	7,611,500
東京放送ホールディングス	79,100	1,768.00	139,848,800
日本テレビホールディングス	120,400	2,201.00	265,000,400
朝日放送	13,400	970.00	12,998,000
テレビ朝日ホールディングス	36,000	1,930.00	69,480,000
スカパー J S A T ホールディングス	100,600	637.00	64,082,200
テレビ東京ホールディングス	10,900	1,859.00	20,263,100
コネクシオ	9,800	1,330.00	13,034,000
クロップス	1,400	515.00	721,000
日本電信電話	1,031,800	4,476.00	4,618,336,800
K D D I	1,339,600	3,060.50	4,099,845,800
光通信	11,900	8,430.00	100,317,000
N T T ドコモ	1,016,700	2,433.00	2,473,631,100

エムティーアイ	17,200	819.00	14,086,800
GMOインターネット	44,200	1,776.00	78,499,200
KADOKAWA・DWANGO	32,300	1,446.00	46,705,800
学研ホールディングス	45,000	248.00	11,160,000
ゼンリン	17,600	1,540.00	27,104,000
昭文社	8,200	952.00	7,806,400
インプレスホールディングス	9,900	198.00	1,960,200
東京電力	1,133,400	701.00	794,513,400
中部電力	408,800	1,892.00	773,449,600
関西電力	545,200	1,430.50	779,908,600
中国電力	184,600	1,790.00	330,434,000
北陸電力	130,800	1,831.00	239,494,800
東北電力	333,700	1,684.00	561,950,800
四国電力	120,200	1,880.00	225,976,000
九州電力	295,000	1,560.00	460,200,000
北海道電力	125,100	1,476.00	184,647,600
沖縄電力	13,200	3,090.00	40,788,000
電源開発	96,800	4,225.00	408,980,000
東京瓦斯	1,624,000	661.50	1,074,276,000
大阪瓦斯	1,382,000	484.80	669,993,600
東邦瓦斯	340,000	734.00	249,560,000
北海道瓦斯	28,000	289.00	8,092,000
広島ガス	21,800	471.00	10,267,800
西部瓦斯	150,000	291.00	43,650,000
静岡ガス	38,100	846.00	32,232,600
メタウォーター	8,300	3,160.00	26,228,000
アイネット	7,200	1,164.00	8,380,800
松竹	87,000	1,091.00	94,917,000
東宝	94,100	2,920.00	274,772,000
エイチ・アイ・エス	22,800	4,265.00	97,242,000
東映	49,000	834.00	40,866,000
AOI Pro.	6,500	1,056.00	6,864,000
エヌ・ティ・ティ・データ	81,500	5,420.00	441,730,000
共立メンテナンス	8,300	7,470.00	62,001,000
イチネンホールディングス	15,100	1,120.00	16,912,000
建設技術研究所	8,500	1,138.00	9,673,000
スペース	8,000	1,176.00	9,408,000
アインファーマシーズ	15,900	5,270.00	83,793,000
燦ホールディングス	2,900	1,745.00	5,060,500
スバル興業	3,000	430.00	1,290,000
東京テアトル	54,000	140.00	7,560,000
よみうりランド	28,000	420.00	11,760,000
東京都競馬	95,000	282.00	26,790,000
常盤興産	53,000	154.00	8,162,000
カナモト	19,500	2,890.00	56,355,000
東京ドーム	96,000	503.00	48,288,000
D T S	13,700	2,644.00	36,222,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,900	2,893.00	147,253,700
シーイーシー	9,000	1,098.00	9,882,000

カブコン	33,900	2,409.00	81,665,100
西尾レントオール	11,200	2,970.00	33,264,000
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	61,000	44.00	2,684,000
日本空港ビルデング	45,600	6,200.00	282,720,000
トランス・コスモス	18,300	3,075.00	56,272,500
乃村工藝社	27,600	1,589.00	43,856,400
ジャステック	8,100	1,121.00	9,080,100
S C S K	31,500	3,765.00	118,597,500
藤田観光	51,000	391.00	19,941,000
K N T - C Tホールディングス	69,000	156.00	10,764,000
日本管財	7,000	2,687.00	18,809,000
トーカイ	6,300	4,180.00	26,334,000
白洋舎	5,000	273.00	1,365,000
セコム	135,500	8,056.00	1,091,588,000
日本システムウエア	5,300	1,103.00	5,845,900
セントラル警備保障	6,500	1,457.00	9,470,500
アイネス	18,200	1,308.00	23,805,600
丹青社	16,400	1,196.00	19,614,400
メイテック	18,800	4,635.00	87,138,000
T K C	11,500	3,480.00	40,020,000
アサツー ディ・ケイ	26,400	2,776.00	73,286,400
富士ソフト	18,200	2,446.00	44,517,200
応用地質	14,800	1,621.00	23,990,800
船井総研ホールディングス	15,400	1,585.00	24,409,000
N S D	31,100	1,609.00	50,039,900
進学会	6,300	631.00	3,975,300
丸紅建材リース	12,000	253.00	3,036,000
コナミ	53,700	2,368.00	127,161,600
ベネッセホールディングス	50,900	3,155.00	160,589,500
イオンディライト	13,600	3,885.00	52,836,000
ナック	9,600	1,002.00	9,619,200
福井コンピュータホールディングス	3,900	887.00	3,459,300
ニチイ学館	27,400	1,069.00	29,290,600
ダイセキ	22,600	2,436.00	55,053,600
ステップ	5,000	1,023.00	5,115,000
日鉄住金物産	87,000	421.00	36,627,000
元気寿司	4,200	2,425.00	10,185,000
トラスコ中山	16,600	4,210.00	69,886,000
ヤマダ電機	520,900	468.00	243,781,200
オートバックスセブン	48,400	2,027.00	98,106,800
アーランドサカモト	9,500	2,589.00	24,595,500
ニトリホールディングス	57,000	10,080.00	574,560,000
グルメ杵屋	10,000	976.00	9,760,000
愛眼	11,000	257.00	2,827,000
ケーユーホールディングス	7,500	747.00	5,602,500
吉野家ホールディングス	37,100	1,397.00	51,828,700
加藤産業	19,700	2,722.00	53,623,400
イノテック	12,000	476.00	5,712,000
イエローハット	12,500	2,291.00	28,637,500

松屋フーズ	6,500	2,326.00	15,119,000
J B C Cホールディングス	11,600	787.00	9,129,200
J Kホールディングス	14,000	590.00	8,260,000
サガミチェーン	17,000	1,241.00	21,097,000
日伝	5,500	2,921.00	16,065,500
関西スーパーマーケット	9,600	817.00	7,843,200
ミロク情報サービス	9,200	790.00	7,268,000
北沢産業	11,000	186.00	2,046,000
杉本商事	7,300	1,408.00	10,278,400
因幡電機産業	19,600	4,120.00	80,752,000
王将フードサービス	9,700	4,040.00	39,188,000
プレナス	14,700	2,170.00	31,899,000
ミニストップ	9,900	2,256.00	22,334,400
アークス	23,000	2,500.00	57,500,000
パロー	28,500	2,881.00	82,108,500
バイテック	4,700	1,368.00	6,429,600
ミスミグループ本社	147,900	1,716.00	253,796,400
アルテック	10,300	248.00	2,554,400
ベルク	6,000	3,915.00	23,490,000
大 庄	6,300	1,549.00	9,758,700
タキヒヨー	22,000	464.00	10,208,000
ファーストリテイリング	26,400	54,530.00	1,439,592,000
ソフトバンクグループ	697,400	6,925.00	4,829,495,000
スズケン	60,000	4,065.00	243,900,000
サンドラッグ	27,900	6,850.00	191,115,000
サックスパー ホールディングス	10,000	2,127.00	21,270,000
ジェコス	9,300	1,236.00	11,494,800
ヤマザワ	2,900	1,737.00	5,037,300
やまや	2,300	2,099.00	4,827,700
ルネサスイーストン	6,700	578.00	3,872,600
ペルーナ	33,200	684.00	22,708,800
合計	224,702,557		315,699,614,616

*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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,634,847,374	3,934,112,077
国債証券		356,864,761,900	339,419,433,800
地方債証券		28,477,614,128	27,806,378,865
特殊債券		28,012,463,691	26,394,939,609
社債券		24,240,352,600	22,467,211,060
未収利息		1,166,808,153	1,082,770,376
前払費用		33,009,293	22,151,015
流動資産合計		441,429,857,139	421,126,996,802
資産合計		441,429,857,139	421,126,996,802
負債の部			
流動負債			
未払解約金		219,016,000	2,918,128,000
流動負債合計		219,016,000	2,918,128,000
負債合計		219,016,000	2,918,128,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	355,706,109,986	341,625,978,311
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		85,504,731,153	76,582,890,491
元本等合計		441,210,841,139	418,208,868,802
純資産合計		441,210,841,139	418,208,868,802
負債純資産合計		441,429,857,139	421,126,996,802

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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	364,816,328,000円 28,609,940,707円 37,720,158,721円	355,706,109,986円 32,021,080,215円 46,101,211,890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	8,382,784,644円	10,194,070,381円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 >	10,855,812,915円	10,964,684,981円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	4,226,550,798円	4,504,016,816円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	6,556,972,539円	7,051,594,720円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	2,709,546,666円	2,885,281,806円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	1,654,448,516円	1,727,685,920円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,773,518,243円	1,922,594,428円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	258,526,847円	285,162,823円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	121,943,264円	124,568,526円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,935,623,071円	2,344,669,637円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	7,965,036円	6,016,165円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 1 0)	153,360,119円	182,328,817円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 2 0)	106,659,104円	141,269,796円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 3 0)	30,926,406円	42,287,045円
投資のソムリエ	3,643,791,819円	9,912,612,951円
クルーズコントロール	1,274,868,230円	333,830,632円
投資のソムリエ< D C 年金 >	55,337,003円	139,816,158円
D I A M 8 資産バランスファンド N < D C 年金 >	290,351,381円	505,119,320円

D I A M D C バランス・F(成長型)	3,715,649円	17,797,024円
クルーズコントロール<DC年金>	279,469円	94,924円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	12,736,663,724円	12,027,510,061円
D I A Mアクティブアロケーション私 募ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	24,226,043円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	713,490,099円	695,661,130円
D I A Mグローバル・バランスファン ド25VA(適格機関投資家限定)	4,576,994,987円	2,756,649,468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)	411,769,532円	383,538,547円
D I A M国際分散バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	275,098,932円	196,961,758円
D I A M国際分散バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	746,440,714円	583,185,967円
D I A M国内重視バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	255,985,978円	224,202,904円
D I A M国内重視バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	261,050,260円	189,733,936円
D I A M世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	25,790,521,333円	19,874,418,620円
D I A M世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	9,115,933,857円	7,566,552,491円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	13,055,910,431円	11,638,320,717円
D I A Mバランスファンド37.5V A(適格機関投資家限定)	5,059,949,119円	4,614,755,065円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,443,676,938円	8,013,294,102円
D I A Mグローバル・アセット・バラ ンスVA(適格機関投資家限定)	1,075,116,553円	947,817,654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)	4,837,898,699円	4,155,687,596円
D I A M アクサ グローバル バラ ンスファンド30VA(適格機関投資 家限定)	6,251,610,037円	5,746,873,429円
D I A M世界アセットバランスファン ドVA(適格機関投資家向け)	9,193,418,931円	7,904,120,989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)	492,774,489円	900,011,011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)	9,735,911,951円	7,874,894,570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)	8,722,859,092円	8,201,760,441円
D I A Mグローバル分散ファンドV A (適格機関投資家限定)	1,163,837,203円	260,636,911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)	105,848,232,159円	102,773,581,647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)	1,685,556,270円	1,557,161,668円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	9,113,269,251円	8,971,992,352円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	33,245,672,660円	32,496,632,249円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	496,271円	502,014円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	372,604円	380,784円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	106,141,365円	58,836,852円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	37,214,558,363円	36,228,782,319円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	699,496,865円	681,242,814円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	172,879,508円	176,716,604円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	575,601円	578,700円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	628,772,729円	575,067,603円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	330,923円	8,325,586円
計	355,706,109,986円	341,625,978,311円
2 . 受益権の総数	355,706,109,986口	341,625,978,311口

(金融商品に関する注記)

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	11,180,843,600	991,042,600
地方債証券	236,727,508	69,832,134
特殊債証券	37,489,733	58,685,468
社債証券	37,778,400	81,562,520
合計	11,417,282,441	780,962,478

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成26年2月15日から平成27年1月13日まで及び平成27年2月17日から平成27年7月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.2404円	1.2242円
（1万口当たり純資産額）	（12,404円）	（12,242円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 4 3 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,501,620,000	
	3 4 4 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,320,000	
	3 4 5 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,500,000	
	3 4 8 回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,503,750,000	
	3 4 9 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,502,370,000	
	3 5 0 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,320,000	
	9 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,014,190,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,011,460,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,515,015,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,522,635,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,517,370,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,518,630,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,319,307,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,004,000,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,014,720,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,516,245,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,527,650,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,537,890,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,524,660,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,523,940,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,523,805,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,015,000,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,501,245,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,002,200,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,000,000,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	706,626,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,178,500,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,179,120,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,123,620,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	984,294,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	827,016,000	
	8 回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	849,096,000	
	2 8 2 回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,468,408,000	
	2 8 4 回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,331,655,000	
	2 8 5 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,542,825,000	
	2 8 6 回 利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,690,376,000	
	2 8 8 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,555,335,000	
	2 8 9 回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,315,136,000	
	2 9 0 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,036,810,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,839,968,000	

296回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,139,740,000	
297回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,453,252,000	
299回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,718,846,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,591,318,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,426,569,000	
305回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,686,970,000	
306回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,181,620,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,375,530,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,096,600,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,927,680,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,858,166,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,198,780,000	
315回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,870,046,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,588,275,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,789,624,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,121,040,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,581,225,000	
321回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,164,430,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,604,325,000	
325回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,164,040,000	
326回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,789,667,000	
328回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,074,460,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,871,172,000	
330回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,325,120,000	
332回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,577,525,000	
333回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,757,996,000	
334回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,367,056,000	
335回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,040,800,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,009,080,000	
337回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,476,125,000	
338回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	3,992,520,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,259,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	122,037,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	241,412,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,658,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,538,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	244,326,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	361,704,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	562,065,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	441,232,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	350,232,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	344,811,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	606,830,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,186,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	491,824,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	242,208,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	977,604,000	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,066,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	367,548,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	594,640,000	

2 2 回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	575,519,700
2 3 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	735,408,000
2 4 回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	367,734,000
2 5 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	713,124,000
2 6 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,207,480,000
2 7 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,104,975,000
2 8 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	983,648,000
2 9 回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,574,378,000
3 0 回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,549,392,000
3 1 回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,406,472,000
3 2 回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,670,942,000
3 3 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,695,990,000
3 4 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,759,905,000
3 5 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,695,165,000
3 6 回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,920,507,000
3 7 回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,769,712,000
3 8 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,083,030,000
3 9 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	883,864,000
4 0 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,080,830,000
4 1 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,162,381,000
4 2 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,055,980,000
4 3 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,056,330,000
4 4 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,161,149,000
4 5 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,107,909,000
4 6 回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,207,428,000
3 7 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	640,332,000
3 9 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	427,576,000
4 0 回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	771,854,400
4 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	874,760,000
4 3 回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	961,514,400
4 5 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	996,642,000
4 6 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	551,310,000
4 7 回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,052,381,500
4 8 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	564,415,000
5 0 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	858,631,800
5 1 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	666,264,000
5 2 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	616,115,500
5 4 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	791,679,000
5 5 回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	908,536,500
5 7 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,262,187,400
5 8 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	671,754,000
6 0 回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,074,249,000
6 1 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	844,568,000
6 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,351,922,000
6 4 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	676,950,000
6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,243,726,000
6 7 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,151,693,000
7 0 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,473,200,000
7 2 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,443,350,000
7 3 回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,366,167,600

75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,623,286,000	
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,655,378,000	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,613,654,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,629,376,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,982,778,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,783,545,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,652,938,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,756,695,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	812,728,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	938,136,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,794,915,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,898,192,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,645,812,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,020,484,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,064,718,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,766,250,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,003,280,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,190,092,000	
111回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,385,340,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,240,309,000	
114回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,359,300,000	
116回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,623,566,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,164,710,000	
119回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,363,692,000	
121回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,414,370,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,237,763,000	
125回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,385,100,000	
128回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,033,317,000	
129回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,133,290,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,922,904,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,117,588,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,015,992,000	
135回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,336,308,000	
137回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,446,004,000	
140回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,108,943,000	
141回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,437,644,000	
143回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,614,368,000	
145回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,097,429,000	
146回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,203,520,000	
147回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,381,346,000	
148回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,125,600,000	
149回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,438,414,000	
150回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,290,024,000	
151回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,507,900,000	
152回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,300,000,000	
国債証券 合計		317,120,000,000	339,419,433,800	
地方債証券	640回 東京都公募公債	150,000,000	153,706,500	
	641回 東京都公募公債	100,000,000	102,514,000	
	659回 東京都公募公債	203,500,000	212,714,480	
	664回 東京都公募公債	300,000,000	313,365,000	

667回	東京都公募公債	300,000,000	316,077,000	
680回	東京都公募公債	200,000,000	211,482,000	
685回	東京都公募公債	500,000,000	523,605,000	
688回	東京都公募公債	200,000,000	207,914,000	
697回	東京都公募公債	500,000,000	527,140,000	
701回	東京都公募公債	700,000,000	733,992,000	
708回	東京都公募公債	500,000,000	522,000,000	
720回	東京都公募公債	300,000,000	312,168,000	
726回	東京都公募公債	400,000,000	411,276,000	
19年度4回	北海道公募公債	300,000,000	310,896,000	
21年度6回	北海道公募公債	200,000,000	211,586,000	
22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	211,606,000	
166回	神奈川県公募公債	300,000,000	315,171,000	
194回	神奈川県公募公債	300,000,000	310,491,000	
208回	神奈川県公募公債	300,000,000	303,120,000	
301回	大阪府公募公債	100,000,000	103,066,000	
307回	大阪府公募公債	100,000,000	103,973,000	
310回	大阪府公募公債	240,000,000	249,184,800	
319回	大阪府公募公債	200,000,000	210,198,000	
336回	大阪府公募公債	200,000,000	211,764,000	
345回	大阪府公募公債	300,000,000	316,809,000	
356回	大阪府公募公債	200,000,000	210,290,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	309,825,000	
374回	大阪府公募公債	300,000,000	312,573,000	
83回	大阪府公募公債 5年	300,000,000	301,068,000	
18年度1回	京都府公募公債	100,000,000	102,343,000	
26年度11回	京都府公募公債	350,000,000	350,339,500	
19年度2回	兵庫県公募公債	200,000,000	206,302,000	
26年度17回	兵庫県公募公債	200,000,000	199,076,000	
1回	兵庫県公募公債（12年）	300,000,000	316,785,000	
18年度5回	静岡県公募公債	129,800,000	132,763,334	
21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	207,015,480	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	208,914,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	210,428,000	
20年度4回	愛知県公募公債	100,000,000	104,805,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	209,980,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	527,980,000	
25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	311,640,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	211,490,000	
21年度4回	埼玉県公募公債	440,000,000	463,447,600	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	211,540,000	
26年度5回	埼玉県公募公債	400,000,000	406,120,000	
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	211,558,000	
25年度11回	福岡県公募公債	200,000,000	204,730,000	
19年度5回	千葉県公募公債	300,000,000	312,168,000	
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	210,564,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	309,273,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	207,408,000	
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	173,147,260	
47回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	166,094,096	

54回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	414,336,000		
55回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,112,000		
57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,684,000		
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,204,000		
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,753,000		
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	529,675,000		
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	742,056,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	528,765,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	740,152,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,394,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	527,035,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	730,345,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,465,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,525,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	821,376,879		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,840,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,561,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,290,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,730,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,830,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,064,000		
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	140,128,650		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	456,070,500		
18年度3回	京都市公募公債	101,700,000	104,708,286		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	210,148,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	211,578,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	473,332,500		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	416,428,000		
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	311,211,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	206,790,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	107,128,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	210,548,000		
18年度4回	福岡市公募公債	100,000,000	102,217,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	213,412,000		
地方債証券 合計		26,771,500,000	27,806,378,865		
特殊債券	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	208,430,000	
	25回	高速道路機構債	300,000,000	311,235,000	
	35回	高速道路機構債	400,000,000	416,432,000	
	48回	高速道路機構債	700,000,000	739,886,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	722,400,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	102,309,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,799,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,861,000	
	21回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	384,045,000	
	23回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	307,200,000	

3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,442,000	
3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	305,731,800	
3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	356,315,200	
4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	344,074,500	
4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,092,000	
5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,085,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,440,000	
6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	743,368,080	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	169,392,060	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	421,106,140	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	627,048,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	734,426,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,500,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,778,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	420,428,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,032,420,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,395,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	521,215,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	344,764,200	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	499,290,000	
8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	103,250,280	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	104,423,520	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	496,710,640	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	518,330,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	685,939,170	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,698,420	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,755,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,705,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	526,885,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,530,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,995,000	

24回	地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,821,000		
36回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,686,000		
44回	政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	415,868,000		
50回	政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	522,445,000		
64回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,279,000		
24回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	307,884,000		
19回	都市再生機構債券	200,000,000	210,304,000		
11回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,538,000		
37回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	315,213,000		
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	70,995,000	76,829,369		
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	49,232,000	53,103,112		
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	72,960,000	78,798,988		
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	79,065,000	85,806,872		
13回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,929,000	37,948,209		
14回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	183,845,000	192,584,991		
4回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,362,000	48,307,813		
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,218,000	33,943,955		
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	115,548,000	125,720,845		
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	92,988,000	100,805,501		
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,100,000	170,036,550		
29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,385,000	278,817,654		
36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	508,544,000	540,851,800		
736号	利付商工債	300,000,000	301,047,000		
740号	利付商工債	300,000,000	301,338,000		
755号	利付商工債	260,000,000	260,863,200		
737号	利附農林債	300,000,000	301,197,000		
743号	利附農林債	300,000,000	301,389,000		
753号	利附農林債	300,000,000	300,429,000		
760号	利附農林債	300,000,000	301,764,000		
764号	利附農林債	500,000,000	502,100,000		
275回	利附信金中金債	400,000,000	401,396,000		
282回	利附信金中金債	300,000,000	301,197,000		
302回	利附信金中金債	300,000,000	299,451,000		
171号	利附商工債(3年)	200,000,000	200,142,000		
10回	政保中日本高速道路債券	215,000,000	220,063,250		
21回	政保中日本高速道路債券	300,000,000	314,022,000		
5回	中日本高速道路債券	200,000,000	210,922,000		
5回	政保西日本高速道路債券	259,000,000	265,941,200		
6回	政保西日本高速道路債券	117,000,000	120,319,290		
55回	鉄道建設運輸施設債	500,000,000	517,635,000		
特殊債券 合計		25,440,171,000	26,394,939,609		
社債券	9回	J Pモルガン・チェース円貨債	200,000,000	203,586,000	
	12回	ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	103,737,000	
	22回	中日本高速道路債券	300,000,000	312,147,000	
	7回	麒麟ホールディングス社債	100,000,000	105,893,000	
	3回	セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	105,244,000	

4 1 回	住友化学社債	100,000,000	105,497,000	
3 7 回	三菱化学社債	100,000,000	105,655,000	
1 2 回	武田薬品工業社債	100,000,000	100,528,000	
8 回	ブリヂストン社債	200,000,000	200,424,000	
2 9 回	新日本製鐵社債	100,000,000	105,251,000	
6 4 回	新日本製鐵社債	100,000,000	105,587,000	
1 回	日本電産社債	100,000,000	100,503,000	
1 1 回	パナソニック社債	100,000,000	102,404,000	
1 9 回	三菱重工業社債	100,000,000	102,199,000	
5 6 回	日産自動車社債	100,000,000	101,084,000	
1 4 回	トヨタ自動車社債	200,000,000	208,550,000	
1 6 回	トヨタ自動車社債	100,000,000	101,501,000	
4 9 回	伊藤忠商事社債	100,000,000	106,052,000	
6 6 回	伊藤忠商事社債	200,000,000	200,848,000	
9 1 回	丸紅社債	100,000,000	100,624,000	
4 7 回	住友商事社債	100,000,000	100,984,000	
6 9 回	三菱商事社債	300,000,000	315,558,000	
4 8 回	クレディセゾン社債	100,000,000	102,749,000	
7 回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	311,511,000	
2 7 回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,236,000	
2 9 回	みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	502,385,000	
3 1 回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	300,918,000	
3 2 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,348,000	
7 回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	108,138,000	
1 3 4 回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,323,000	
1 4 0 回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,564,000	
7 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	215,424,000	
1 1 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,318,000	
1 2 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	207,880,000	
2 5 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,560,000	
2 8 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,594,000	
3 2 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	321,030,000	
4 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,223,000	
6 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,459,000	
7 回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,504,000	
9 回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,177,000	
7 回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	103,050,000	
1 2 回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,858,000	
1 0 回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	200,200,000	
1 0 回	セブン銀行社債	100,000,000	102,655,000	
5 7 回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,810,000	
1 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,000,000	
1 1 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	209,200,000	
2 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	215,018,000	
2 2 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,622,000	
2 3 回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	425,824,000	
6 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,555,000	
1 0 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	104,341,000	
1 4 回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	214,420,000	
4 1 回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,545,000	

20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,699,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,509,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,352,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	215,632,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	103,171,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	203,454,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,264,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,510,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,882,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,737,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,707,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	199,540,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	103,926,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	211,798,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	205,640,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	104,207,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	211,540,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,410,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,174,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	105,025,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,756,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	336,642,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,525,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	312,249,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	315,744,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	209,592,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	338,352,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,709,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,664,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	195,456,800	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	214,718,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,560,000	
3回	東京地下鉄社債	100,000,000	102,125,000	
5回	KDDI社債	100,000,000	105,469,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	209,014,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	317,046,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	210,544,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	207,638,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	510,710,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	105,508,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	102,055,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	204,998,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	521,410,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	315,624,000	
486回	関西電力社債	154,000,000	155,569,260	
492回	関西電力社債	200,000,000	201,114,000	
493回	関西電力社債	200,000,000	200,902,000	
310回	中国電力社債	200,000,000	212,308,000	
377回	中国電力社債	200,000,000	207,742,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	109,420,000	

281回	北陸電力社債	200,000,000	209,422,000	
380回	東北電力社債	300,000,000	313,728,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	302,475,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	105,935,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	205,908,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	204,194,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	205,658,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	405,560,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	200,364,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	306,351,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	107,208,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	107,042,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	107,964,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,766,000	
社債券 合計		21,644,000,000	22,467,211,060	
合計		390,975,671,000	416,087,963,334	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		90,967,370	514,592,003
投資証券		29,378,877,000	20,592,277,900
未収入金		201,772,800	-
未収配当金		220,408,007	203,063,456
流動資産合計		29,892,025,177	21,309,933,359
資産合計		29,892,025,177	21,309,933,359
負債の部			
流動負債			
未払金		-	432,153,693
未払解約金		202,740,000	2,791,000
流動負債合計		202,740,000	434,944,693
負債合計		202,740,000	434,944,693
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,405,369,329	13,080,131,931
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		13,283,915,848	7,794,856,735
元本等合計		29,689,285,177	20,874,988,666
純資産合計		29,689,285,177	20,874,988,666
負債純資産合計		29,892,025,177	21,309,933,359

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,574,800,459円	16,405,369,329円
同期中追加設定元本額	4,941,270,166円	7,771,120,284円
同期中一部解約元本額	10,110,701,296円	11,096,357,682円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,580,500円	19,617,425円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	498,552,758円	361,892,952円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	4,134,070円	3,559,190円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	5,774,762円	7,439,572円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	14,676,677円	20,152,377円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	39,950,229円	56,381,518円
投資のソムリエ	160,194,756円	273,099,340円
投資のソムリエ<DC年金>	2,357,889円	3,553,582円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	10,739,939円	19,370,382円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201210（適格機関投資家限定）	2,085,521,517円	2,053,707,555円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212（適格機関投資家限定）	1,126,860,320円	1,109,657,775円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401（適格機関投資家限定）	2,196,070,750円	2,161,914,672円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）	9,195,588,058円	6,177,926,213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）	133,968,705円	56,348,609円

	D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	164,822,352円	40,588,147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)	270,176,885円	273,826,779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)	138,455,191円	403,618,175円
	D I A M リスクコントロール J - R E I Tファンド(適格機 関投資家限定)	325,943,971円	37,477,668円
	計	16,405,369,329円	13,080,131,931円
2 .	受益権の総数	16,405,369,329口	13,080,131,931口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	5,589,717,470	1,538,429,072
合計	5,589,717,470	1,538,429,072

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成26年6月7日から平成27年1月13日まで及び平成27年6月9日から平成27年7月13日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.8097円	1.5959円
(1万口当たり純資産額)	(18,097円)	(15,959円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	4,941	576,120,600	
	MCUBS MidCity投資法人	397	138,751,500	
	SIA不動産投資法人	155	72,927,500	
	いちご不動産投資法人	2,927	238,257,800	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	573	554,091,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,687	737,044,100	
	イオンリート投資法人	2,253	333,218,700	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,121	111,203,200	
	インヴィンシブル投資法人	5,515	344,687,500	
	オリックス不動産投資法人	4,620	765,996,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	400	160,800,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	837	464,535,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	721	240,453,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	539	139,169,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	979	235,645,300	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,490	482,856,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,506	329,037,800	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,706	1,434,180,000	
	スターツプロシード投資法人	359	66,486,800	
	トーセイ・リート投資法人	198	25,324,200	
	トップリート投資法人	364	177,268,000	
	ヒューリックリート投資法人	1,614	249,685,800	
	フロンティア不動産投資法人	1,025	524,800,000	
	プレミア投資法人	544	344,896,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	249	29,830,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,465	927,957,000	
	阪急リート投資法人	1,235	159,932,500	
	産業ファンド投資法人	729	378,351,000	
	森トラスト総合リート投資法人	2,728	591,976,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,245	470,200,500	
	星野リゾート・リート投資法人	103	132,355,000	
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	2,104	244,064,000	
	積水ハウス・リート投資法人	1,641	208,242,900	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,545	389,340,000	
大和ハウスリート投資法人	725	350,537,500		
大和証券オフィス投資法人	1,000	566,000,000		
東急リアル・エステート投資法人	2,020	288,456,000		
日本アコモデーションファンド投資法人	1,001	444,444,000		
日本ビルファンド投資法人	2,918	1,511,524,000		

日本プライムリアルティ投資法人	1,804	672,892,000	
日本プロロジスリート投資法人	3,577	810,905,900	
日本ヘルスケア投資法人	126	28,942,200	
日本リート投資法人	802	223,597,600	
日本リートファンド投資法人	5,022	1,163,597,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,715	406,455,000	
日本賃貸住宅投資法人	3,389	267,392,100	
福岡リート投資法人	1,544	310,035,200	
平和不動産リート投資法人	1,966	169,665,800	
野村不動産オフィスファンド投資法人	770	391,160,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	3,441	495,504,000	
野村不動産レジデンシャル投資法人	332	211,484,000	
投資証券 合計	95,667	20,592,277,900	
合計	95,667	20,592,277,900	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,318,013,164	1,752,765,889
コール・ローン		108,708,644	1,282,659,298
株式		286,112,610,214	291,030,892,832
投資信託受益証券		905,249,900	848,351,630
投資証券		6,475,558,260	6,279,970,441
派生商品評価勘定		1,509,601	15,327,722
未収入金		-	69,728,729
未収配当金		310,992,682	364,321,040
差入委託証拠金		1,478,157,835	1,063,368,206
流動資産合計		300,710,800,300	302,707,385,787
資産合計		300,710,800,300	302,707,385,787
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		197,368,051	7,277,394
未払解約金		103,764,000	1,591,118,000
流動負債合計		301,132,051	1,598,395,394
負債合計		301,132,051	1,598,395,394
純資産の部			
元本等			
元本	1	109,595,049,033	101,093,625,635
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		190,814,619,216	200,015,364,758
元本等合計		300,409,668,249	301,108,990,393
純資産合計		300,409,668,249	301,108,990,393
負債純資産合計		300,710,800,300	302,707,385,787

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	127,193,032,969円	109,595,049,033円
同期中追加設定元本額	4,209,083,697円	7,048,160,386円
同期中一部解約元本額	21,807,067,633円	15,549,583,784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	967,569,789円	1,057,710,072円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C年金>	34,130,353,349円	33,874,452,407円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	142,401,445円	140,592,583円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	826,694,029円	828,101,362円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,036,116,296円	1,037,093,422円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	141,615,188円	137,192,322円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	404,789,618円	403,472,656円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	322,188,869円	330,112,172円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	51,106,864円	46,028,751円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	795,210,482円	842,449,000円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	212,134,966円	230,975,699円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国1 0)	11,580,508円	13,626,492円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国2 0)	22,293,003円	28,038,338円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国3 0)	55,218,896円	70,469,211円
投資のソムリエ	161,486,875円	246,196,365円
クルーズコントロール	259,259,955円	48,135,914円
投資のソムリエ< D C年金>	2,415,761円	3,430,343円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	22,120,203円	36,616,505円
D I A M D C バランス・F (成長型)	1,434,718円	6,359,319円
クルーズコントロール< D C年 金>	56,934円	13,159円
D I A M外国株式インデックス ファンドV A(適格機関投資家 専用)	359,550,244円	307,689,726円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,395,213,038円	3,402,793,462円

D I A Mアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	248,285,051円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	39,602,290円	37,428,332円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	1,627,167,742円	951,806,758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)	439,590,284円	397,074,310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)	50,186,746円	34,876,695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)	317,924,792円	241,092,306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)	21,792,015円	18,508,821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)	55,688,057円	39,300,546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)	7,323,098,894円	5,490,210,710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)	3,883,246,591円	3,135,710,029円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,390,488,703円	1,204,917,500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)	1,258,021,391円	1,112,676,523円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	3,600,959,018円	3,321,021,838円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	1,545,547,137円	1,305,925,295円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	2,485,691,766円	2,062,752,135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)	1,778,266,700円	1,582,584,702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)	1,305,107,887円	1,085,198,775円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	28,088,225円	11,130,233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)	6,278,827,547円	4,894,631,283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)	1,865,824,960円	1,660,483,001円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	49,556,839円	11,112,697円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	11,272,588,735円	10,638,721,878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)	718,334,219円	644,913,031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)	1,940,746,945円	1,858,539,067円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	7,083,202,420円	6,721,777,124円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	132,536円	128,952円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	254,447円	249,413円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	165,877,353円	89,390,196円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	9,518,527,609円	8,990,836,536円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	73,879円	69,952円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	229,568,347円	204,545,606円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	253,929円	6,177,060円
計	109,595,049,033円	101,093,625,635円
2 . 受益権の総数	109,595,049,033口	101,093,625,635口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	16,547,641,933	946,604,121
投資信託受益証券	164,999,404	57,578,495
投資証券	1,164,217,058	514,353,609
合計	17,876,858,395	1,518,536,225

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年2月18日から平成27年1月13日まで及び平成27年2月17日から平成27年7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	432,311,540	-	432,108,000	203,540	321,761,660	-	324,334,900	2,573,240
アメリカ・ドル	271,602,040	-	271,400,000	202,040	254,237,632	-	256,004,100	1,766,468
イギリス・ポンド	71,625,200	-	71,624,000	1,200	14,955,424	-	15,199,200	243,776
オーストラリア・ドル	19,224,600	-	19,224,000	600	8,173,260	-	8,190,900	17,640
カナダ・ドル	-	-	-	-	6,699,056	-	6,754,300	55,244
ユーロ	69,859,700	-	69,860,000	300	37,696,288	-	38,186,400	490,112
買 建	-	-	-	-	154,787,648	-	154,779,300	8,348
アメリカ・ドル	-	-	-	-	95,548,596	-	95,542,200	6,396
イギリス・ポンド	-	-	-	-	15,199,632	-	15,199,200	432
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	7,280,736	-	7,280,000	736
カナダ・ドル	-	-	-	-	6,754,776	-	6,754,300	476
ユーロ	-	-	-	-	30,003,908	-	30,003,600	308
合計	432,311,540	-	432,108,000	203,540	476,549,308	-	479,114,200	2,581,588

（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27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	6,635,183,872	-	6,439,121,882	196,061,990	3,035,394,383	-	3,046,026,299	10,631,916
合計	6,635,183,872	-	6,439,121,882	196,061,990	3,035,394,383	-	3,046,026,299	10,631,916

(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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	2.7411円	2.9785円
(1万口当たり純資産額)	(27,411円)	(29,785円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年7月13日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,972	443.510	13,736,391.720	
	ABBOTT LABORATORIES	120,464	49.930	6,014,767.520	
	AES CORP	45,320	13.100	593,692.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,472	166.950	12,266,150.400	
	ADOBE SYSTEMS INC	39,348	80.590	3,171,055.320	
	ACE LTD	25,323	103.840	2,629,540.320	
	AGCO CORP	6,536	53.970	352,747.920	
	AIRGAS INC	6,292	103.060	648,453.520	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,942	135.930	2,166,996.060	
	ENERGEN CORP	7,454	61.720	460,060.880	
	ALLEGHANY CORP	1,575	495.210	779,955.750	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	71,143	58.250	4,144,079.750	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	129.700	686,113.000	
	ALLSTATE CORP	32,138	66.190	2,127,214.220	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,283	102.410	5,968,762.030	
	ALTERA CORPORATION	23,108	49.750	1,149,623.000	
	ALCOA INC	102,779	10.630	1,092,540.770	
	AMGEN INC	59,217	154.100	9,125,339.700	
	HESS CORP	20,456	64.340	1,316,139.040	
	AMERICAN EXPRESS CO	72,327	77.310	5,591,600.370	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	40,601	55.560	2,255,791.560	
	AFLAC INC	33,588	61.710	2,072,715.480	
	AMERICAN INTL GROUP	107,501	62.620	6,731,712.620	
	JARDEN CORP	14,140	52.310	739,663.400	
	ANALOG DEVICES	25,145	61.510	1,546,668.950	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	40,656	75.710	3,078,065.760	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,254	192.530	3,514,442.620	
	NABORS INDUSTRIES LTD	19,674	13.360	262,844.640	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	35,093	37.720	1,323,707.960	
	TIME WARNER	66,060	88.630	5,854,897.800	
	JONES LANG LASALLE INC	2,687	174.490	468,854.630	
	VALERO ENERGY CORP	42,012	65.850	2,766,490.200	
	APACHE CORP	29,768	52.940	1,575,917.920	
ANSYS INC	7,266	92.430	671,596.380		
APPLE INC	456,623	123.280	56,292,483.440		
APPLIED MATERIALS INC	99,730	18.770	1,871,932.100		
ALBEMARLE CORP	7,690	54.000	415,260.000		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	50,255	47.210	2,372,538.550	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	60.320	564,595.200	
AMEREN CORP	19,716	39.020	769,318.320	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	54.540	423,612.180	
ASHLAND INC	5,128	118.430	607,309.040	
AUTOLIV INC	7,264	107.180	778,555.520	
AUTODESK INC	18,164	52.510	953,791.640	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	36,504	81.520	2,975,806.080	
AUTOZONE INC	2,607	682.300	1,778,756.100	
AVERY DENNISON CORP	8,865	61.600	546,084.000	
AVNET INC	10,288	40.490	416,561.120	
BAKER HUGHES INC	34,030	59.710	2,031,931.300	
BALL CORP	12,188	70.150	854,988.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	90,089	139.730	12,588,135.970	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	87,268	41.710	3,639,948.280	
CR BARD INC	5,892	174.540	1,028,389.680	
BAXTER INTERNATIONAL INC	44,320	37.610	1,666,875.200	
BED BATH & BEYOND INC	14,763	67.920	1,002,702.960	
BECTON DICKINSON & CO	16,883	144.270	2,435,710.410	
AMETEK INC	21,508	55.100	1,185,090.800	
BE AEROSPACE INC	7,540	54.450	410,553.000	
VERIZON COMM INC	325,720	47.000	15,308,840.000	
WR BERKLEY CORP	11,053	56.260	621,841.780	
BEST BUY CO INC	23,778	33.930	806,787.540	
YUM! BRANDS INC	34,836	90.860	3,165,198.960	
FIRSTENERGY CORP	33,446	33.660	1,125,792.360	
H&R BLOCK INC	22,530	31.180	702,485.400	
ENSCO PLC-CL A	16,993	20.390	346,487.270	
BOEING CO	52,772	144.480	7,624,498.560	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	56.170	609,219.820	
BORGWARNER INC	17,824	53.630	955,901.120	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,849	17.600	1,898,142.400	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	63.550	736,671.600	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	334.640	737,211.920	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,226	69.270	9,159,295.020	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	213.820	914,294.320	
ONEOK INC	16,401	39.540	648,495.540	
UNITED RENTALS INC	7,795	81.390	634,435.050	
SEMPRA ENERGY	19,340	101.100	1,955,274.000	
FEDEX CORP	21,204	168.460	3,572,025.840	
VERISIGN INC	9,291	63.190	587,098.290	

AMPHENOL CORP	24,751	54.510	1,349,177.010	
BROWN-FORMAN CORP	9,803	101.700	996,965.100	
QUANTA SERVICES INC	20,095	28.090	564,468.550	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	23,243	51.920	1,206,776.560	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	209,556	3.725	780,596.100	
CSX CORP	77,207	32.130	2,480,660.910	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	12,039	26.670	321,080.130	
CABOT OIL & GAS CORP	33,871	29.300	992,420.300	
CAMPBELL SOUP CO	15,612	47.620	743,443.440	
SEAGATE TECHNOLOGY	26,728	45.950	1,228,151.600	
WHITING PETROLEUM CORP	15,410	30.110	463,995.100	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,019	116.040	1,626,764.760	
CARDINAL HEALTH INC	25,805	85.480	2,205,811.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	50.580	1,642,433.760	
CATERPILLAR INC	44,532	82.150	3,658,303.800	
CELGENE CORP	63,569	118.840	7,554,539.960	
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	109.780	346,795.020	
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	69.160	863,808.400	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	11.370	507,170.220	
CENTURYLINK INC	48,563	29.760	1,445,234.880	
CERNER CORP	24,936	69.920	1,743,525.120	
JPMORGAN CHASE & CO	292,268	67.050	19,596,569.400	
CHUBB CORP	18,142	121.500	2,204,253.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,603	84.110	891,818.330	
CIGNA CORP	20,588	157.210	3,236,639.480	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	53.660	634,905.120	
CINTAS CORP	8,876	85.050	754,903.800	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	79,229	4.900	388,222.100	
CISCO SYSTEMS INC	402,185	27.280	10,971,606.800	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	9,607	46.450	446,245.150	
CLOROX COMPANY	9,288	107.670	1,000,038.960	
COCA-COLA CO/THE	322,938	40.390	13,043,465.820	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	18,074	44.430	803,027.820	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,425	66.640	4,559,842.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	18,147	75.970	1,378,627.590	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	30,923	62.950	1,946,602.850	
COMERICA INC	13,912	49.580	689,756.960	
NRG ENERGY, INC.	23,703	21.760	515,777.280	
COMCAST CORP-CL A	166,991	63.190	10,552,161.290	
CA INC	26,267	30.340	796,940.780	

COMPUTER SCIENCES CORP	12,846	66.740	857,342.040	
CONAGRA FOODS INC	34,469	44.830	1,545,245.270	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,429	60.810	1,485,527.490	
CMS ENERGY CORP	20,017	33.720	674,973.240	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,553	50.860	740,165.580	
COOPER COS INC	3,794	176.120	668,199.280	
MOLSON COORS BREWING CO	12,219	71.090	868,648.710	
CORNING INC	102,972	19.280	1,985,300.160	
DIRECTV	38,639	92.400	3,570,243.600	
SEALED AIR CORP	14,883	51.770	770,492.910	
BROADCOM CORP-CL A	42,632	52.060	2,219,421.920	
CUMMINS INC	14,022	128.740	1,805,192.280	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	120.220	795,736.180	
DR HORTON INC	30,691	28.190	865,179.290	
DANAHER CORP	49,054	86.650	4,250,529.100	
MOODY'S CORP	14,341	110.480	1,584,393.680	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,507	59.710	2,836,642.970	
TARGET CORP	47,898	83.910	4,019,121.180	
DEERE & CO	24,921	95.170	2,371,731.570	
MORGAN STANLEY	116,024	38.640	4,483,167.360	
REPUBLIC SERVICES INC	19,941	39.740	792,455.340	
THE WALT DISNEY CO	126,384	116.440	14,716,152.960	
DOLLAR TREE INC	17,831	80.470	1,434,860.570	
DOVER CORP	13,192	65.280	861,173.760	
DOW CHEMICAL	91,137	51.410	4,685,353.170	
OMNICOM GROUP	21,059	72.690	1,530,778.710	
DTE ENERGY CO	14,055	77.510	1,089,403.050	
XL GROUP PLC	19,925	37.960	756,353.000	
DUKE ENERGY CORP	55,649	74.370	4,138,616.130	
FLOWERVE CORP	12,469	49.250	614,098.250	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	72.160	680,901.760	
EBAY INC	85,724	62.370	5,346,605.880	
EMC CORP/MASS	156,090	25.790	4,025,561.100	
BANK OF AMERICA CORP	823,920	16.700	13,759,464.000	
CITIGROUP INC	238,174	54.560	12,994,773.440	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,209	77.190	1,019,602.710	
E*TRADE FINANCIAL CORP	19,301	29.040	560,501.040	
EATON CORP PLC	36,792	65.770	2,419,809.840	
EATON VANCE CORP	9,128	38.610	352,432.080	
DISH NETWORK CORP	16,800	68.810	1,156,008.000	
ECOLAB INC	21,285	112.280	2,389,879.800	
ELECTRONIC ARTS INC	25,957	72.070	1,870,720.990	
SALESFORCE.COM INC	46,896	71.140	3,336,181.440	
EMERSON ELECTRIC CO	52,695	53.830	2,836,571.850	
WEATHERFORD INTL PLC	58,791	11.330	666,102.030	
ENTERGY CORP	13,984	72.490	1,013,700.160	

EOG RESOURCES INC	43,598	84.540	3,685,774.920	
EQUIFAX INC	9,161	97.770	895,670.970	
EQT CORP	12,314	76.550	942,636.700	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,656	87.420	1,630,907.520	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	45.170	644,982.430	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	57,654	89.750	5,174,446.500	
EXXON MOBIL CORP	328,338	82.220	26,995,950.360	
FMC CORP	9,724	49.520	481,532.480	
NEXTERA ENERGY INC	35,820	101.640	3,640,744.800	
ASSURANT INC	6,227	70.200	437,135.400	
FASTENAL CO	21,351	42.330	903,787.830	
FIFTH THIRD BANCORP	64,871	20.895	1,355,479.540	
M&T BANK CORP	9,572	126.210	1,208,082.120	
FISERV INC	19,533	86.350	1,686,674.550	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	30.570	440,880.540	
MACY'S INC	27,089	66.480	1,800,876.720	
FORD MOTOR CO	297,897	14.480	4,313,548.560	
FRANKLIN RESOURCES INC	30,571	48.780	1,491,253.380	
FREEMPORT-MCMORAN INC	85,535	16.740	1,431,855.900	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	11.090	491,985.670	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,532	47.580	358,372.560	
TEGNA INC	14,570	31.370	457,060.900	
GAP INC/THE	16,693	37.580	627,322.940	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,729	51.440	551,899.760	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,706	146.100	3,317,346.600	
GENERAL MILLS INC	48,035	57.270	2,750,964.450	
GENUINE PARTS CO	12,396	88.980	1,102,996.080	
GILEAD SCIENCES INC	116,712	113.740	13,274,822.880	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	14,991	81.760	1,225,664.160	
GARTNER INC	5,772	86.120	497,084.640	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,413	28.990	533,792.870	
MCKESSON CORP	18,663	229.560	4,284,278.280	
NVIDIA CORP	43,024	19.750	849,724.000	
GENERAL ELECTRIC CO	790,396	26.270	20,763,702.920	
WW GRAINGER INC	4,603	236.500	1,088,609.500	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	9,838	70.240	691,021.120	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	16.830	374,231.880	
HALLIBURTON CO	68,949	41.330	2,849,662.170	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,539	136.110	1,570,573.290	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,864	207.190	6,394,712.160	
HARLEY-DAVIDSON INC	17,507	55.680	974,789.760	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,014	113.890	571,044.460	
HARRIS CORP	7,832	79.350	621,469.200	

CONSOL ENERGY INC	22,051	19.640	433,081.640	
HASBRO INC	8,909	77.220	687,952.980	
HENRY SCHEIN INC	7,142	145.470	1,038,946.740	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	64.110	636,548.190	
HERSHEY FOODS CORP	12,284	91.870	1,128,531.080	
HEWLETT-PACKARD CO	144,306	30.650	4,422,978.900	
F5 NETWORKS INC	5,817	116.390	677,040.630	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	53.890	696,204.910	
REYNOLDS AMERICAN INC	34,719	76.870	2,668,849.530	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	116.610	1,209,129.090	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	171.570	591,401.790	
JUNIPER NETWORKS INC	30,722	26.150	803,380.300	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	45.260	628,570.880	
HOLOGIC INC	12,273	38.710	475,087.830	
UNUM GROUP	19,821	35.860	710,781.060	
HOME DEPOT INC	102,721	113.100	11,617,745.100	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,549	141.670	1,636,146.830	
HORMEL FOODS CORP	11,661	57.310	668,291.910	
HUDSON CITY BANCORP INC	43,137	9.900	427,056.300	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	19.120	610,922.240	
HUMANA INC	11,754	187.250	2,200,936.500	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	84.620	561,622.940	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	11.210	673,272.600	
RED HAT INC	14,283	78.540	1,121,786.820	
BIOGEN INC	18,627	388.230	7,231,560.210	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,400	92.580	2,444,112.000	
INTUIT INC	20,568	104.360	2,146,476.480	
ISIS PHARMACEUTICALS INC	9,222	53.500	493,377.000	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	66.410	1,398,793.830	
INTEL CORP	374,383	29.170	10,920,752.110	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,632	111.150	625,996.800	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,541	46.940	1,480,534.540	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	19.650	724,534.800	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	40.150	373,274.550	
INCYTE CORP	12,683	108.330	1,373,949.390	
JOHNSON & JOHNSON	218,340	99.530	21,731,380.200	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,070	43.780	1,535,364.600	
JOHNSON CONTROLS INC	50,971	49.030	2,499,108.130	
KLA-TENCOR CORP	12,621	55.110	695,543.310	
DEVON ENERGY CORP	32,345	55.850	1,806,468.250	
KELLOGG CO	22,425	63.750	1,429,593.750	

KEYCORP	66,833	14.920	997,148.360	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,054	109.720	3,187,804.880	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,796	339.460	3,325,350.160	
KOHL'S CORP	15,787	63.950	1,009,578.650	
KROGER CO	36,321	76.340	2,772,745.140	
LAM RESEARCH CORP	12,091	78.530	949,506.230	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,007	62.980	378,320.860	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	69.980	1,005,402.660	
LEGG MASON INC	9,375	49.340	462,562.500	
LEGGETT & PLATT INC	8,522	50.020	426,270.440	
LENNAR CORP	12,932	53.300	689,275.600	
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,186	24.760	747,405.360	
ELI LILLY & CO	78,466	88.290	6,927,763.140	
L BRANDS INC	20,969	84.440	1,770,622.360	
LINCOLN NATIONAL CORP	21,084	58.430	1,231,938.120	
LINEAR TECH CORP	18,324	43.040	788,664.960	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,126	96.960	5,345,016.960	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,779	39.400	1,055,092.600	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,541	194.190	4,183,046.790	
LOEWS CORP	27,349	38.830	1,061,961.670	
RANGE RESOURCES CORP	12,431	45.270	562,751.370	
LOWE'S COS INC	76,988	67.850	5,223,635.800	
DOMINION RESOURCES INC/VA	46,529	68.960	3,208,639.840	
SCANA CORP	9,574	53.020	507,613.480	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,355	19.070	159,329.850	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	18.150	612,181.350	
MCCORMICK & CO INC	9,163	80.000	733,040.000	
MCDONALD'S CORPORATION	76,737	97.650	7,493,368.050	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	22,594	103.160	2,330,797.040	
EVEREST RE GROUP LTD	2,661	187.620	499,256.820	
MANPOWERGROUP INC	5,703	91.890	524,048.670	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	8,263	147.160	1,215,983.080	
MARSH & MCLENNAN COS	44,032	57.170	2,517,309.440	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,542	98.710	547,050.820	
MASCO CORP	30,441	23.480	714,754.680	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	152.900	780,095.800	
MATTEL INC	25,152	25.380	638,357.760	
METLIFE INC	74,474	55.960	4,167,565.040	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,714	32.270	797,520.780	
MEDTRONIC PLC	110,472	74.370	8,215,802.640	

ACTIVISION BLIZZARD INC	40,499	25.360	1,027,054.640	
CVS HEALTH CORP	89,266	107.440	9,590,739.040	
MERCK & CO. INC.	222,844	57.950	12,913,809.800	
SUNEDISON INC	20,428	30.410	621,215.480	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,509	120.260	782,772.340	
MICROSOFT CORP	612,348	44.610	27,316,844.280	
MICRON TECH INC	83,952	17.570	1,475,036.640	
RACKSPACE HOSTING INC	10,000	35.770	357,700.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,799	44.850	708,585.150	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	12.510	386,408.880	
3M CO	49,293	154.950	7,637,950.350	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,675	194.010	906,996.750	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,244	57.480	1,048,665.120	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	94.510	822,142.490	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	40.060	498,466.580	
ENDO INTERNATIONAL PLC	12,378	83.120	1,028,859.360	
MYLAN NV	30,218	71.220	2,152,125.960	
ILLUMINA INC	11,266	219.450	2,472,323.700	
XCEL ENERGY INC	41,914	33.550	1,406,214.700	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	32,114	44.990	1,444,808.860	
NETAPP INC	24,525	30.600	750,465.000	
NEWELL RUBBERMAID INC	24,567	41.830	1,027,637.610	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	124.210	456,720.170	
NEWMONT MINING CORP	37,881	22.520	853,080.120	
NIKE INC-CL B	54,337	110.520	6,005,325.240	
NOBLE ENERGY INC	28,642	39.060	1,118,756.520	
NORDSTROM INC	11,509	77.380	890,566.420	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,184	86.350	2,088,288.400	
EVERSOURCE ENERGY	26,416	46.890	1,238,646.240	
NISOURCE INC	25,231	16.910	426,656.210	
COACH INC	21,436	33.380	715,533.680	
TOWERS WATSON & COMPANY	4,459	129.730	578,466.070	
NORTHERN TRUST CORP	17,989	76.380	1,373,999.820	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,459	165.370	2,556,454.830	
WELLS FARGO & CO	384,089	56.080	21,539,711.120	
NUCOR CORP	24,612	43.350	1,066,930.200	
MONSANTO CO	37,900	108.810	4,123,899.000	
CHENIERE ENERGY INC	17,814	65.640	1,169,310.960	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,198	87.670	3,787,168.660	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	60,615	73.310	4,443,685.650	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	44.300	402,288.300	
OGE ENERGY CORP	16,028	28.760	460,965.280	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,409	235.900	1,983,683.100	

OMNICARE INC	8,889	94.750	842,232.750	
ORACLE CORP	274,939	40.360	11,096,538.040	
PACCAR INC	27,939	63.390	1,771,053.210	
PALL CORP	8,443	125.450	1,059,174.350	
EXELON CORP	67,643	32.750	2,215,308.250	
PARKER HANNIFIN CORP	11,757	113.240	1,331,362.680	
PARTNERRE LTD	3,890	131.750	512,507.500	
PATTERSON COS INC	4,032	49.190	198,334.080	
PAYCHEX INC	25,896	47.780	1,237,310.880	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	56.030	477,319.570	
PPL CORPORATION	52,418	31.030	1,626,530.540	
PEPSICO INC	115,840	95.550	11,068,512.000	
PENTAIR PLC	15,841	63.900	1,012,239.900	
PFIZER INC	480,952	34.360	16,525,510.720	
CONOCOPHILLIPS	97,354	59.130	5,756,542.020	
PVH CORP	6,479	113.600	736,014.400	
PG&E CORP	36,973	51.120	1,890,059.760	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,237	134.460	1,645,387.020	
ALTRIA GROUP INC	156,235	51.310	8,016,417.850	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,969	96.300	3,945,314.700	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	151.050	752,229.000	
GARMIN LTD	9,959	44.170	439,889.030	
AETNA INC	28,020	114.600	3,211,092.000	
FLUOR CORP (NEW)	14,048	50.740	712,795.520	
PPG INDUSTRIES INC	21,222	114.900	2,438,407.800	
PRAXAIR INC	23,432	117.370	2,750,213.840	
PRECISION CASTPARTS CORP	11,186	190.870	2,135,071.820	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,337	142.720	4,900,576.640	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,526	77.430	1,589,328.180	
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	71.580	791,388.480	
PROCTER & GAMBLE CO	211,167	80.950	17,093,968.650	
PROGRESSIVE CORP	45,883	29.390	1,348,501.370	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,038	41.260	1,734,487.880	
PULTE GROUP INC	25,477	20.690	527,119.130	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	37,710	18.250	688,207.500	
QUALCOMM INC	129,991	62.730	8,154,335.430	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	58.650	608,435.100	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	103.340	365,306.900	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,984	526.010	3,147,643.840	
AUTONATION INC	3,445	62.210	214,313.450	
RESMED INC	11,376	57.050	649,000.800	

US BANCORP	140,827	43.440	6,117,524.880	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,051	69.400	766,939.400	
RITE AID CORP	73,930	8.710	643,930.300	
ROSS STORES INC	33,898	50.860	1,724,052.280	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,066	172.350	1,390,175.100	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,943	122.170	1,336,906.310	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,330	82.410	1,098,525.300	
RAYTHEON COMPANY	24,336	98.710	2,402,206.560	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	301.930	1,382,839.400	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	37.450	701,775.550	
ACCENTURE PLC-CL A	48,786	98.780	4,819,081.080	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	130,251	41.410	5,393,693.910	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	13,685	46.990	643,058.150	
SANDISK CORP	18,229	53.530	975,798.370	
ROCKWELL COLLINS INC	9,506	92.550	879,780.300	
ST JUDE MEDICAL INC	21,273	75.330	1,602,495.090	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	25,685	101.000	2,594,185.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,950	63.570	1,458,931.500	
PRICELINE GROUP INC	4,095	1,143.190	4,681,363.050	
SCHLUMBERGER LTD	101,269	83.960	8,502,545.240	
SCHWAB (CHARLES) CORP	93,316	32.830	3,063,564.280	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,008	106.810	1,496,194.480	
BUNGE LTD	10,172	85.720	871,943.840	
SEI INVESTMENTS CO	10,402	49.350	513,338.700	
ANTHEM INC	21,291	159.730	3,400,811.430	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,490	109.460	1,804,995.400	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	51.230	1,196,271.730	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,362	278.210	1,769,972.020	
CENTENE CORP	7,708	72.910	561,990.280	
SIGMA-ALDRICH	9,766	139.360	1,360,989.760	
ACUITY BRANDS INC	2,888	191.430	552,849.840	
SNAP-ON INC	4,354	160.870	700,427.980	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,630	87.360	3,199,996.800	
ADVANCE AUTO PARTS	6,001	164.110	984,824.110	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	20.920	592,621.760	
EDISON INTERNATIONAL	26,497	57.950	1,535,501.150	
SOUTHERN CO	71,178	43.360	3,086,278.080	
BB&T CORP	59,553	40.700	2,423,807.100	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	33.830	465,027.180	
AT&T INC	405,459	34.650	14,049,154.350	
CHEVRON CORP	146,490	94.410	13,830,120.900	

STANLEY BLACK & DECKER INC	12,011	106.660	1,281,093.260	
STAPLES INC	50,301	15.390	774,132.390	
STATE STREET CORP	33,563	75.970	2,549,781.110	
STARBUCKS CORP	117,301	54.570	6,401,115.570	
STRYKER CORP	27,838	96.370	2,682,748.060	
NETFLIX INC	4,541	680.600	3,090,604.600	
STERICYCLE INC	6,853	134.770	923,578.810	
SUNTRUST BANKS INC	42,848	43.870	1,879,741.760	
SYMANTEC CORP	55,527	23.320	1,294,889.640	
SYNOPSIS INC	14,312	50.380	721,038.560	
SYSCO CORP	47,889	36.050	1,726,398.450	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,954	487.870	1,441,167.980	
TESORO CORP	10,250	98.400	1,008,600.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	81,566	49.010	3,997,549.660	
TEXTRON INC	21,846	43.680	954,233.280	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,297	130.630	4,088,327.110	
TIFFANY & CO	10,305	91.950	947,544.750	
TOLL BROTHERS INC	12,654	38.870	491,860.980	
TORCHMARK CORP	10,414	58.750	611,822.500	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	42.340	577,390.580	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	79.300	1,105,917.800	
TRACTOR SUPPLY CO	11,181	91.150	1,019,148.150	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	23.060	539,327.280	
TYSON FOODS INC	25,091	42.980	1,078,411.180	
MARATHON OIL CORP	52,743	24.460	1,290,093.780	
UNION PACIFIC CORP	69,569	97.820	6,805,239.580	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	63,998	110.180	7,051,299.640	
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,620	122.150	9,114,833.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	141.760	1,054,836.160	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	86.800	720,092.800	
VF CORP	28,415	71.260	2,024,852.900	
CBS CORP	36,310	54.850	1,991,603.500	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,936	122.950	2,451,131.200	
VULCAN MATERIALS CO	10,233	90.360	924,653.880	
URBAN OUTFITTERS INC	8,777	35.360	310,354.720	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	69,191	93.110	6,442,374.010	
WAL-MART STORES INC	125,954	73.120	9,209,756.480	
WASTE MANAGEMENT INC	37,795	47.750	1,804,711.250	
WATERS CORP	6,779	128.530	871,304.870	
ALLERGAN PLC	29,881	312.130	9,326,756.530	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,059	107.590	867,067.810	

WESTERN DIGITAL CORP	18,200	77.100	1,403,220.000	
WABTEC CORP	7,250	94.180	682,805.000	
WHIRLPOOL CORP	6,288	174.420	1,096,752.960	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,330	100.200	1,536,066.000	
WYNN RESORTS LTD	6,279	103.900	652,388.100	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	40.800	1,185,444.000	
NASDAQ OMX GROUP	6,550	50.480	330,644.000	
CME GROUP INC	24,875	98.510	2,450,436.250	
WILLIAMS COS INC	57,448	57.890	3,325,664.720	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	51.190	446,172.040	
LKQ CORP	22,850	30.330	693,040.500	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	26.850	488,535.750	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	60.090	637,494.810	
WEC ENERGY GROUP INC	27,551	47.260	1,302,060.260	
FOOT LOCKER INC	11,034	69.560	767,525.040	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,310	36.740	782,929.400	
CARMAX INC	17,598	66.920	1,177,658.160	
XEROX CORP	88,088	10.380	914,353.440	
XILINX INC	22,098	41.940	926,790.120	
YAHOO! INC	68,605	37.920	2,601,501.600	
CIMAREX ENERGY CO	6,901	105.280	726,537.280	
TJX COMPANIES INC	54,044	68.130	3,682,017.720	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,740	121.770	698,959.800	
HOSPIRA INC	13,747	89.150	1,225,545.050	
CBRE GROUP INC	20,788	37.600	781,628.800	
LIBERTY GLOBAL PLC	17,106	50.860	870,011.160	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,419	10.140	1,089,228.660	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,276	65.390	83,437.640	
GOOGLE INC-CL A	22,703	556.110	12,625,365.330	
T-MOBILE US INC	19,411	39.030	757,611.330	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,776	54.840	1,852,275.840	
MEDIVATION INC	6,237	106.810	666,173.970	
MOSAIC CO/THE	25,355	45.040	1,141,989.200	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	32.540	1,173,945.580	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	103,349	33.105	3,421,368.640	
CELANESE CORP	11,777	68.300	804,369.100	
IHS INC-CLASS A	5,758	127.690	735,239.020	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- A	13,414	33.380	447,759.320	
EXPEDIA INC	8,139	107.970	878,767.830	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,830	61.710	1,223,709.300	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,183	123.680	1,754,153.440	

LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	51,510	47.780	2,461,147.800	
GAMESTOP CORP. - CL. A	11,417	46.960	536,142.320	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,848	229.470	2,030,350.560	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,591	86.240	1,172,087.840	
VIACOM INC-CLASS B	29,086	61.800	1,797,514.800	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,613	639.420	1,670,804.460	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	55.510	386,405.110	
TRANSDIGM GROUP INC	4,061	223.520	907,714.720	
MASTERCARD INC	79,238	94.620	7,497,499.560	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	35,147	28.070	986,576.290	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,179	84.340	858,496.860	
HANESBRANDS INC	32,964	33.690	1,110,557.160	
WESTERN UNION CO	41,207	19.030	784,169.210	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	35,460	16.870	598,210.200	
SPECTRA ENERGY CORP	56,039	31.280	1,752,899.920	
TIME WARNER CABLE INC	22,329	183.500	4,097,371.500	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,191	16.150	309,934.650	
DELTA AIR LINES INC	17,405	42.460	739,016.300	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,164	37.360	192,927.040	
DISCOVER FINANCIAL	36,588	57.380	2,099,419.440	
TE CONNECTIVITY LTD	33,444	62.410	2,087,240.040	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	108.440	1,092,749.880	
WABCO HOLDING INC	3,250	120.340	391,105.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	62.995	483,801.600	
VMWARE INC	6,605	82.070	542,072.350	
TERADATA CORP	12,117	35.930	435,363.810	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	163.110	800,380.770	
INVESCO LTD	34,162	36.930	1,261,602.660	
NETSUITE INC	3,281	90.070	295,519.670	
CALPINE CORP NPR	26,738	17.370	464,439.060	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,307	82.160	9,966,583.120	
VISA INC	155,225	68.420	10,620,494.500	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,483	77.180	1,194,977.940	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	50.790	827,318.310	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	65.840	477,932.560	

SIGNET JEWELERS LTD	6,095	121.640	741,395.800	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,028	31.320	658,596.960	
MARATHON PETROLEUM CORP	42,666	54.490	2,324,870.340	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,122	45.040	455,894.880	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	141,625	38.090	5,394,496.250	
XYLEM INC	11,028	35.390	390,280.920	
ALKERMES PLC	11,218	64.220	720,419.960	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	31,960	98.380	3,144,224.800	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	20,087	129.840	2,608,096.080	
LINKEDIN CORP	8,789	209.950	1,845,250.550	
SPLUNK INC	9,277	71.840	666,459.680	
FREESCALE SEMICONDUCTOR LIMITED	7,437	37.790	281,044.230	
ZILLOW GROUP INC	4,067	78.670	319,950.890	
HCA HOLDINGS INC	23,874	92.970	2,219,565.780	
NIELSEN NV	26,310	45.270	1,191,053.700	
VERISK ANALYTICS INC	13,285	73.240	972,993.400	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	178.770	871,324.980	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,223	154.250	959,897.750	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	16,743	88.450	1,480,918.350	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	63.520	501,299.840	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	30,557	9.060	276,846.420	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,012	177.390	1,066,468.680	
CIT GROUP INC	13,340	47.720	636,584.800	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	330,000	0.615	202,950.000	
LEAR CORP	4,712	104.210	491,037.520	
DOLLAR GENERAL CORP	24,796	79.470	1,970,538.120	
AON PLC	21,841	101.780	2,222,976.980	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	48.210	552,679.440	
TESLA MOTORS INC	7,149	259.150	1,852,663.350	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	50.450	776,576.850	
GENERAL MOTORS CO	109,374	31.400	3,434,343.600	
VANTIV INC	12,141	38.980	473,256.180	
TRIPADVISOR INC	9,263	88.440	819,219.720	
ALLY FINANCIAL INC	29,357	22.180	651,138.260	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,570	42.490	704,059.300	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	45.990	764,997.660	

DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,647	79.200	1,793,642.400	
PHILLIPS 66	42,882	81.490	3,494,454.180	
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,200	106.250	233,750.000	
LIBERTY MEDIA CORP	5,006	35.740	178,914.440	
FACEBOOK INC	159,501	87.950	14,028,112.950	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	5,356	74.170	397,254.520	
ADT CORP	15,211	32.640	496,487.040	
SERVICENOW INC	10,829	76.740	831,017.460	
WHITEWAVE FOODS CO	12,239	49.880	610,481.320	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,339	180.800	965,291.200	
WORKDAY INC	7,948	79.520	632,024.960	
ABBVIE INC	135,862	69.230	9,405,726.260	
ZOETIS INC	37,899	46.960	1,779,737.040	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	6,507	57.650	375,128.550	
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	14.250	471,760.500	
MALLINCKRODT PLC	9,419	122.440	1,153,262.360	
SPRINT CORP	84,196	3.780	318,260.880	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	12,129	38.980	472,788.420	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,766	41.210	608,506.860	
FIREEYE INC	5,217	49.690	259,232.730	
ANTERO RESOURCES CORP	1,568	30.190	47,337.920	
TWITTER INC	37,478	34.910	1,308,356.980	
PERRIGO CO PLC	11,364	180.860	2,055,293.040	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	36,830	27.890	1,027,188.700	
ARAMARK	11,947	31.590	377,405.730	
GOOGLE INC-CL C	23,917	530.130	12,679,119.210	
NAVIENT CORP	28,699	18.370	527,200.630	
FNF GROUP	21,690	38.760	840,704.400	
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	35.210	645,399.300	
SYNCHRONY FINANCIAL	14,261	33.070	471,611.270	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	17,038	27.300	465,137.400	
CDK GLOBAL INC	9,646	53.290	514,035.340	
QORVO INC	12,235	76.160	931,817.600	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,174	32.550	233,513.700	
LIBERTY LILAC GROUP-A	855	44.450	38,004.750	
LIBERTY LILAC GROUP-C	2,575	43.050	110,853.750	
WESTROCK CO	21,156	61.400	1,298,978.400	
KRAFT HEINZ CO	46,578	77.310	3,600,945.180	
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,542	37.000	205,054.000	
COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	25,231	29.800	751,883.800	
CHEMOURS CO	14,228	11.660	165,898.480	

	BAXALTA INC	44,320	30.850	1,367,272.000	
	TOPBUILD CORP	3,382	28.790	97,367.780	
	GANNETT CO INC	7,285	13.370	97,400.450	
アメリカ・ドル 小計		25,161,410		1,494,448,584.450 (183,069,951,596)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	4.036	287,932.270	
	AMEC FOSTER WHEELER PLC	28,599	7.995	228,649.000	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	6.570	170,195.850	
	ASHTED GROUP	38,160	10.500	400,680.000	
	SEVERN TRENT PLC	23,162	21.500	497,983.000	
	BHP BILLITON PLC	164,052	12.275	2,013,738.300	
	BARCLAYS PLC	1,289,770	2.680	3,456,583.600	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	68,386	6.315	431,857.590	
	BT GROUP PLC	657,931	4.551	2,994,243.980	
	SKY PLC	82,222	10.650	875,664.300	
	AGGREKO PLC	18,550	14.420	267,491.000	
	TULLOW OIL PLC	92,627	3.007	278,529.380	
	BUNZL PLC	26,929	17.580	473,411.820	
	EASYJET PLC	13,628	16.730	227,996.440	
	CAPITA PLC	50,523	12.750	644,168.250	
	AVIVA PLC	312,051	5.240	1,635,147.240	
	CRODA INTERNATIONAL	9,774	27.990	273,574.260	
	DIAGEO PLC	195,812	19.255	3,770,360.060	
	SCHRODERS PLC	12,609	31.040	391,383.360	
	NATIONAL GRID PLC	288,774	8.552	2,469,595.240	
	GKN PLC	134,097	3.228	432,865.110	
	KINGFISHER PLC	189,315	3.524	667,146.060	
	BAE SYSTEMS PLC	257,944	4.739	1,222,396.610	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	147,949	36.265	5,365,370.480	
	COBHAM PLC	88,449	2.686	237,574.010	
	NEXT PLC	10,966	75.050	822,998.300	
	REXAM PLC	54,770	5.630	308,355.100	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	74,681	32.600	2,434,600.600	
	IMI PLC	22,272	11.580	257,909.760	
	JOHNSON MATTHEY PLC	18,203	30.170	549,184.510	
	SABMILLER PLC	75,242	34.290	2,580,048.180	
	ANGLO AMERICAN PLC	109,290	8.630	943,172.700	
	COMPASS GROUP PLC	136,931	11.050	1,513,087.550	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,501,385	5.657	8,493,334.940	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.636	1,219,685.100		
ARM HOLDINGS PLC	109,575	10.150	1,112,186.250		
CENTRICA PLC	406,663	2.717	1,104,903.370		
UNILEVER PLC	99,674	28.810	2,871,607.940		
MEGGITT PLC	71,707	4.645	333,079.010		
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	128,338	1.728	221,768.060		

UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,266	8.890	473,534.740	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	4.083	298,822.520	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,107	30.930	931,209.510	
PEARSON PLC	65,464	12.360	809,135.040	
PERSIMMON PLC	23,150	19.880	460,222.000	
PRUDENTIAL PLC	202,322	16.035	3,244,233.270	
RIO TINTO PLC	99,709	25.395	2,532,110.050	
VODAFONE GROUP PLC	2,089,286	2.357	4,924,447.100	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,763	58.050	2,946,792.150	
RELX PLC	91,200	10.770	982,224.000	
OLD MUTUAL PLC	422,993	2.146	907,742.970	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	145,152	7.690	1,116,218.880	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	210,422	3.451	726,166.320	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	21.200	421,774.000	
SSE PLC	76,640	16.000	1,226,240.000	
BP PLC	1,439,141	4.270	6,145,132.070	
SHIRE PLC	46,859	54.000	2,530,386.000	
SAGE GROUP PLC(THE)	98,062	5.240	513,844.880	
SMITHS GROUP PLC	27,324	11.190	305,755.560	
STANDARD CHARTERED PLC	200,569	10.075	2,020,732.670	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,512,496	0.843	3,804,034.120	
TATE & LYLE PLC	20,845	5.105	106,413.720	
BG GROUP PLC	270,805	10.805	2,926,048.020	
TAYLOR WIMPLEY PLC	222,561	1.892	421,085.410	
TESCO PLC	658,849	2.077	1,368,429.370	
3I GROUP PLC	88,649	5.380	476,931.620	
SMITH & NEPHEW PLC	71,822	11.240	807,279.280	
GLAXOSMITHKLINE PLC	387,095	13.700	5,303,201.500	
WEIR GROUP	18,336	15.960	292,642.560	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	18,798	25.460	478,597.080	
BABCOCK INT'L GROUP	24,605	10.960	269,670.800	
WPP PLC	105,982	14.830	1,571,713.060	
WOLSELEY PLC	20,425	42.020	858,258.500	
ASTRAZENECA PLC	100,285	42.845	4,296,710.820	
WHITBREAD PLC	13,806	51.100	705,486.600	
CARNIVAL PLC	14,275	33.890	483,779.750	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	131,038	5.380	704,984.440	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	23.770	319,611.420	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.892	233,889.740	
BURBERRY GROUP PLC	36,044	15.920	573,820.480	
INVESTEC PLC	50,655	5.925	300,130.870	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	26.860	480,310.520	

	ICAP PLC	52,823	5.205	274,943.710	
	ITV PLC	301,405	2.723	820,725.810	
	SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.588	230,782.310	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	41.520	360,102.960	
	G4S PLC	124,374	2.718	338,048.530	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	14.330	227,746.690	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	307,359	18.220	5,600,080.980	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	187,783	18.485	3,471,168.750	
	INMARSAT PLC	34,127	9.250	315,674.750	
	PETROFAC LTD	28,374	8.670	246,002.580	
	TUI AG-DI	19,394	10.770	208,873.380	
	STANDARD LIFE PLC	153,643	4.523	694,927.280	
	EXPERIAN PLC	77,318	11.900	920,084.200	
	MONDI PLC	23,430	14.540	340,672.200	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	11.640	301,790.280	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	84,043	2.525	212,208.570	
	GLENCORE PLC	857,397	2.450	2,100,622.650	
	DIXONS CARPHONE PLC	72,841	4.495	327,420.290	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	98,404	3.396	334,179.980	
	COCA-COLA HBC AG	18,432	13.530	249,384.960	
	ROYAL MAIL PLC	64,647	5.140	332,285.580	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	39,861	4.357	173,674.370	
イギリス・ボンド	小計	22,580,586		132,861,612.800 (25,243,706,432)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,152	20.620	2,106,374.240	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	15.980	1,985,834.600	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	6.699	1,260,952.770	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	38,983	25.390	989,778.370	
	NICE SYSTEMS LTD	3,882	244.200	947,984.400	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	70,784	232.800	16,478,515.200	
イスラエル・シュケル	小計	528,301		23,769,439.580 (773,695,258)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	61.170	782,670.150	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	219,611	32.250	7,082,454.750	
	AMCOR LTD	84,976	13.600	1,155,673.600	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	247,535	33.100	8,193,408.500	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	13.050	439,811.100	

FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	1.815	270,808.890	
TELSTRA CORP LTD	346,377	6.210	2,151,001.170	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	12.580	400,974.920	
AMP LTD	240,810	6.210	1,495,430.100	
ASX LTD	18,724	41.130	770,118.120	
BHP BILLITON LTD	260,104	26.650	6,931,771.600	
CALTEX AUSTRALIA LTD	25,158	32.760	824,176.080	
COMPUTERSHARE LT	34,030	11.770	400,533.100	
CSL LIMITED	38,241	88.060	3,367,502.460	
TRANSURBAN GROUP	159,479	9.650	1,538,972.350	
COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	9.250	559,625.000	
COCHLEAR LTD	5,226	79.520	415,571.520	
ORIGIN ENERGY LTD	84,610	11.360	961,169.600	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	127,149	85.790	10,908,112.710	
BORAL LIMITED	43,430	5.930	257,539.900	
RIO TINTO LIMITED	34,809	52.070	1,812,504.630	
APA GROUP	87,434	8.380	732,696.920	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	174,456	5.550	968,230.800	
TPG TELECOM LTD	12,142	8.850	107,456.700	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	17.780	636,346.200	
ORICA LTD	34,301	20.110	689,793.110	
SYDNEY AIRPORT	115,539	5.390	622,755.210	
MACQUARIE GROUP LTD	22,519	80.600	1,815,031.400	
SUNCORP GROUP LTD	114,181	13.610	1,554,003.410	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	205,868	33.070	6,808,054.760	
NEWCREST MINING LTD	74,849	12.600	943,097.400	
INCITEC PIVOT LTD	165,148	3.710	612,699.080	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	43,622	3.330	145,261.260	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	13.790	1,463,629.230	
SANTOS LTD	84,284	7.620	642,244.080	
SONIC HEALTHCARE	33,734	22.370	754,629.580	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.790	339,017.040	
WESFARMERS LTD	91,567	39.880	3,651,691.960	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.465	270,458.040	
ILUKA RESOURCES LIM I	45,912	7.270	333,780.240	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	33.570	1,944,475.110	
WOOLWORTHS LTD	105,245	26.920	2,833,195.400	
SEEK LTD	29,830	14.430	430,446.900	
TATTS GROUP LTD	141,350	3.890	549,851.500	
AGL ENERGY LTD	48,662	15.600	759,127.200	
BRAMBLES LTD	123,431	10.770	1,329,351.870	
ASCIANO LTD	74,924	7.920	593,398.080	

	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.790	420,292.190	
	AURIZON HOLDINGS LTD	142,831	5.270	752,719.370	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	5.170	291,598.340	
	HEALTHSCOPE LTD	33,982	2.710	92,091.220	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.090	490,834.410	
	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	1.780	769,008.060	
オーストラリア・ドル	小計	5,475,535		85,067,096.320 (7,742,807,108)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,334	35.400	613,623.600	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	33,941	52.730	1,789,708.930	
	BARRICK GOLD CORP	89,708	12.820	1,150,056.560	
	ATCO LTD	7,193	39.000	280,527.000	
	BANK OF MONTREAL	49,807	74.190	3,695,181.330	
	BANK OF NOVA SCOTIA	96,454	63.580	6,132,545.320	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,392	46.860	1,189,869.120	
	BCE INC	9,856	53.360	525,916.160	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	70,096	44.150	3,094,738.400	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,207	294.650	7,427,242.550	
	BOMBARDIER INC 'B'	97,503	1.980	193,055.940	
	SAPUTO INC	25,590	29.130	745,436.700	
	BLACKBERRY LTD	38,780	9.750	378,105.000	
	CGI GROUP INC	17,094	49.380	844,101.720	
	CAE INC	31,436	14.520	456,450.720	
	CAMECO CORP	29,078	17.000	494,326.000	
	ROGERS COMM-CL B	29,459	43.640	1,285,590.760	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,504	91.490	2,790,810.960	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,449	33.010	2,853,681.490	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,877	131.910	907,145.070	
	CANADIAN UTILITIES LTD	8,537	35.150	300,075.550	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,188	72.940	4,608,932.720	
	AGRIUM INC	11,307	130.930	1,480,425.510	
	YAMANA GOLD INC	67,520	3.420	230,918.400	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	42.450	796,277.100	
	OPEN TEXT CORP	12,014	49.610	596,014.540	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.880	228,335.200	
	EMPIRE CO LTD	5,031	87.440	439,910.640	
	KINROSS GOLD CORP	125,461	2.660	333,726.260	
	FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	23.470	402,745.200	
	FORTIS INC	20,884	36.280	757,671.520	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	15.580	739,037.300	
	TELUS CORP	18,945	43.980	833,201.100	

GREAT WEST LIFECO INC	24,837	36.300	901,583.100	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	46.530	1,064,745.990	
ENBRIDGE INC	68,125	57.690	3,930,131.250	
IGM FINANCIAL INC	3,211	39.710	127,508.810	
JEAN COUTU GROUP INC	3,791	20.180	76,502.380	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	74,943	4.480	335,744.640	
MANULIFE FINANCIAL CORP	155,082	23.140	3,588,597.480	
LOBLAW CO LTD	17,936	63.790	1,144,137.440	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	40.770	392,615.100	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,039	70.210	2,249,458.190	
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,112	41.870	2,056,319.440	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,614	640.450	1,033,686.300	
METRO INC	22,860	33.600	768,096.000	
HUSKY ENERGY INC	26,989	23.500	634,241.500	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	23.940	883,864.800	
METHANEX CORP	9,418	62.770	591,167.860	
ONEX CORP	6,646	67.990	451,861.540	
GOLDCORP INC	67,652	20.840	1,409,867.680	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	65,526	36.500	2,391,699.000	
POWER CORP OF CANADA	32,563	31.610	1,029,316.430	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	34.940	821,823.740	
ROYAL BANK OF CANADA	112,807	76.580	8,638,760.060	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,939	43.210	515,884.190	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,278	199.580	2,450,443.240	
SHAW COMM INC-B	30,249	27.110	820,050.390	
SUNCOR ENERGY INC	113,283	34.000	3,851,622.000	
ENCANA CORP	59,596	12.230	728,859.080	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	11.250	491,433.750	
THOMSON REUTERS CORP	29,905	48.540	1,451,588.700	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	144,136	52.360	7,546,960.960	
TRANSCANADA CORP	58,122	49.960	2,903,775.120	
TRANSALTA CORP	34,014	9.440	321,092.160	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,200	67.010	281,442.000	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	100.380	476,102.340	
INTACT FINANCIAL CORP	12,288	89.910	1,104,814.080	
SILVER WHEATON CORP	28,408	19.170	544,581.360	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,344	520.770	699,914.880	
CATAMARAN CORP	16,398	77.690	1,273,960.620	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	11,057	57.970	640,974.290	

	CI FINANCIAL CORP	16,122	33.560	541,054.320	
	VERESEN INC	17,460	15.360	268,185.600	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	35.880	566,150.520	
	KEYERA CORP	17,476	40.390	705,855.640	
	ALTAGAS LTD	12,358	37.660	465,402.280	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,194	39.410	914,075.540	
	DOLLARAMA INC	9,286	76.090	706,571.740	
	MEG ENERGY CORP	14,673	17.350	254,576.550	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	61,276	18.190	1,114,610.440	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	49.170	407,668.470	
	ARC RESOURCES LTD	20,372	20.980	427,404.560	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	8.890	419,848.030	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	29.870	333,588.160	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	27.970	831,184.490	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,330	29.270	273,089.100	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	49.250	811,196.750	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	1,344	0.230	309.120	
カナダ・ドル 小計		3,096,080		118,261,383.570 (11,412,223,515)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.310	413,750.000	
	SEBFCORP INDUSTRIES	92,000	3.840	353,280.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.040	682,760.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	40	0.380	15.200	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	136,700	20.640	2,821,488.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	9.790	362,230.000	
	SEBFCORP MARINE	108,000	2.800	302,400.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	31.770	413,010.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	8.130	707,310.000	
	CAPITALAND LTD	204,000	3.360	685,440.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.895	523,038.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	8.150	867,975.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	202,000	3.030	612,060.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	0.680	279,998.840	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	208,725	10.110	2,110,209.750	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	631,867	4.290	2,710,709.430	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	10.800	706,320.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,000	22.760	2,139,440.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.230	646,000.000	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.315	303,765.000		

	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.430	692,550.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD-RTS	1,444	4.950	7,147.800	
シンガポール・ドル 小計		3,993,839		18,340,897.020 (1,663,335,952)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	123,418	26.980	3,329,817.640	
	SYNGENTA AG	7,218	391.300	2,824,403.400	
	NESTLE SA-REGISTERED	253,803	70.800	17,969,252.400	
	CIE FINANC RICHEMONT	42,493	76.250	3,240,091.250	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	55,560	274.100	15,228,996.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,842	153.900	745,183.800	
	SIKA INHABER	188	3,500.000	658,000.000	
	SGS SA-REG	458	1,717.000	786,386.000	
	SULZER AG-REG	1,118	92.100	102,967.800	
	NOVARTIS AG-REG SHS	181,323	97.450	17,669,926.350	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,687	117.700	433,959.900	
	BARRY CALLEBAUT AG	92	1,028.000	94,576.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,906	540.000	1,029,240.000	
	ABB LTD	169,744	19.390	3,291,336.160	
	ADECCO SA-REG	12,185	77.100	939,463.500	
	GEBERIT AG	3,062	314.000	961,468.000	
	LONZA GROUP AG-REG	3,997	137.100	547,988.700	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	5,250.000	477,750.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	61,585.000	554,265.000	
	GIVAUDAN-REG	758	1,642.000	1,244,636.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,931	294.700	3,516,065.700	
	HOLCIM LTD-REG	17,800	73.250	1,303,850.000	
	ACTELION	8,330	140.900	1,173,697.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	132.300	597,863.700	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	126.700	564,195.100	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,189	375.700	822,407.300	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	72.850	404,463.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,785	219.500	611,307.500	
	EMS-CHEMIE HOLDING	808	422.750	341,582.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	73.450	439,965.500	
DUFREY GROUP	2,121	135.500	287,395.500		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,475	288.250	425,168.750		
ARYZTA AG	8,596	43.510	374,011.960		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,617	53.600	944,271.200		
SWISS RE LTD	26,944	85.250	2,296,976.000		
TRANSOCEAN LTD	26,823	13.690	367,206.870		
UBS GROUP AG	286,204	20.500	5,867,182.000		
スイス・フラン 小計		1,300,089		92,467,317.180 (12,057,738,161)	

スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,851	231.100	12,213,866.100	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,729	208.400	7,029,123.600	
	ELEKTA AB	18,233	54.500	993,698.500	
	ERICSSON LM-B SHS	235,937	88.500	20,880,424.500	
	GETINGE AB-B SHS	14,684	212.000	3,113,008.000	
	SKF AB-B SHS	32,306	190.400	6,151,062.400	
	SANDVIK AB	77,917	91.600	7,137,197.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	125,807	108.300	13,624,898.100	
	SKANSKA AB-B SHS	25,753	178.400	4,594,335.200	
	SWEDBANK AB	70,859	200.000	14,171,800.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	43,424	221.600	9,622,758.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	127,929	131.800	16,861,042.200	
	VOLVO AB-B SHS	118,487	107.000	12,678,109.000	
	SWEDISH MATCH AB	16,323	253.000	4,129,719.000	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	96.900	2,355,154.500	
	NORDEA AB	239,599	107.800	25,828,772.200	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	162.100	2,975,021.300	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	243.800	4,216,764.800	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	121.000	3,298,581.000	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	325.600	11,677,644.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	73,108	328.500	24,015,978.000	
	ASSA ABLOY AB-B	79,488	160.700	12,773,721.600	
	TELIASONERA AB	194,938	49.600	9,668,924.800	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	136.600	2,398,013.000	
BOLIDEN AB	17,761	156.000	2,770,716.000		
ALFA LAVAL AB	31,389	147.100	4,617,321.900		
KINNEVIK INVESTMENT B	18,310	276.900	5,070,039.000		
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	649.000	3,339,105.000		
HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	64.200	1,995,785.400		
HEXAGON AB	21,871	299.400	6,548,177.400		
スウェーデン・クローナ 小計		1,847,570		256,750,762.100 (3,717,751,035)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,563	610.000	4,613,430.000	
	A P MOLLER A/S	550	11,750.000	6,462,500.000	
	AP MOLLER MAERSK A	310	11,440.000	3,546,400.000	
	DANSKE BANK A/S	56,971	201.300	11,468,262.300	
	NOVOZYMES-B SHS	19,620	345.800	6,784,596.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	151,407	384.400	58,200,850.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,857	359.800	6,424,948.600	
	TDC A/S	84,208	51.850	4,366,184.800	
	COLOPLAST-B	10,474	454.000	4,755,196.000	
	DSV A/S	15,918	226.000	3,597,468.000	
	WILLIAM DEMANT	2,595	515.500	1,337,722.500	

	TRYG A/S	2,750	141.600	389,400.000	
	PANDORA A/S	9,254	755.000	6,986,770.000	
	ISS A/S	5,744	230.400	1,323,417.600	
デンマーク・クローネ 小計		385,221		120,257,146.600 (2,198,300,640)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	5.160	505,638.720	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	7.850	580,837.200	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	209,231	2.785	582,708.330	
ニュージーランド・ドル 小計		381,215		1,669,184.250 (137,307,096)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	79,374	133.300	10,580,554.200	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	32.730	3,504,139.260	
	TELENOR ASA	65,096	178.600	11,626,145.600	
	SUBSEA 7 SA	22,609	74.250	1,678,718.250	
	ORKLA ASA	43,472	64.550	2,806,117.600	
	STATOIL ASA	94,525	138.000	13,044,450.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,544	409.500	5,546,268.000	
	SEADRILL LTD	38,772	77.600	3,008,707.200	
ノルウェー・クローネ 小計		464,454		51,795,100.110 (790,393,228)	
ユーロ	CRH PLC	62,226	25.640	1,595,474.640	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	66.770	949,135.550	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.371	898,874.380	
	UMICORE	10,008	42.525	425,590.200	
	AIR LIQUIDE	26,893	116.600	3,135,723.800	
	AIRBUS GROUP SE	46,497	60.400	2,808,418.800	
	AXA	146,133	23.015	3,363,250.990	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,430	19.070	542,160.100	
	ADIDAS AG	16,367	68.780	1,125,722.260	
	ASSICURAZIONI GENERALI	96,101	16.660	1,601,042.660	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	28,481	14.885	423,939.680	
	DANONE	45,362	60.940	2,764,360.280	
	SAFRAN SA	21,780	62.740	1,366,477.200	
	INTESA SANPAOLO	945,546	3.352	3,169,470.190	
	INTESA SANPAOLO-RNC	113,165	2.890	327,046.850	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,395	95.200	2,512,804.000	
	ACCOR SA	15,303	46.575	712,737.220	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	43.730	259,450.090	
	BOUYGUES	12,132	31.575	383,067.900	
	BNP PARIBAS	82,913	54.490	4,517,929.370	
	RELX NV	89,339	14.165	1,265,486.930	
THALES SA	8,128	55.530	451,347.840		
CAP GEMINI SA	12,883	84.740	1,091,705.420		
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	67.290	276,494.610		

CHRISTIAN DIOR SE	4,128	177.400	732,307.200	
ALCATEL-LUCENT	250,589	3.249	814,163.660	
UNICREDIT SPA	376,340	6.135	2,308,845.900	
NATIXIS	70,166	6.716	471,234.850	
KONINKLIJKE DSM NV	13,718	52.520	720,469.360	
DELHAIZE GROUP	8,529	75.970	647,948.130	
COMMERZBANK AG	80,064	11.365	909,927.360	
FRESENIUS SE & CO KGAA	27,811	60.850	1,692,299.350	
UNITED INTERNET	9,768	42.000	410,256.000	
PUBLICIS GROUPE	14,367	69.350	996,351.450	
MAN SE	3,396	93.080	316,099.680	
IBERDROLA SA	433,586	6.196	2,686,498.850	
ENI SPA	194,215	15.850	3,078,307.750	
IMERYS SA	1,101	68.720	75,660.720	
JERONIMO MARTINS	19,517	11.570	225,811.690	
KBC GROUPE	20,590	61.130	1,258,666.700	
LAFARGE SA	14,927	62.580	934,131.660	
HANNOVER RUECK SE	2,391	92.270	220,617.570	
WARTSILA OYJ	13,904	40.290	560,192.160	
L'OREAL	19,633	164.650	3,232,573.450	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,728	158.750	3,608,070.000	
LAGARDERE S.C.A.	7,114	27.630	196,559.820	
GEA GROUP AG	16,205	40.445	655,411.220	
BOLLORE	52,042	4.916	255,838.470	
MEDIOBANCA SPA	55,752	8.840	492,847.680	
MICHELIN(CGDE)-B	14,584	94.150	1,373,083.600	
CONTINENTAL AG	9,083	213.900	1,942,853.700	
DEUTSCHE POST AG-REG	75,581	28.160	2,128,360.960	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	27.800	261,292.200	
AXEL SPRINGER SE	6,021	50.020	301,170.420	
OMV AG	15,010	24.900	373,749.000	
PERNOD-RICARD	17,525	106.250	1,862,031.250	
PEUGEOT SA	38,593	18.530	715,128.290	
PIRELLI & C	14,123	15.150	213,963.450	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,007	75.200	902,926.400	
RENAULT SA	15,554	91.200	1,418,524.800	
REPSOL SA	84,671	16.270	1,377,597.170	
REMY COINTREAU	905	66.600	60,273.000	
MERCK KGAA	9,627	93.410	899,258.070	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	63,055	113.350	7,147,284.250	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,783	41.220	1,474,975.260	
SAIPEM	28,190	8.185	230,735.150	
RWE AG	41,149	19.910	819,276.590	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,745	61.850	850,128.250	

SOCIETE GENERALE-A	56,558	42.450	2,400,887.100	
VINCI S.A.	39,349	54.350	2,138,618.150	
SODEXO	7,368	86.270	635,637.360	
SOLVAY SA	5,034	124.150	624,971.100	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,801	63.100	2,763,843.100	
VIVENDI SA	90,768	23.380	2,122,155.840	
SAP SE	76,018	64.810	4,926,726.580	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	50.890	488,187.770	
TELEFONICA S.A	344,981	13.095	4,517,526.190	
TOTAL SA	169,539	44.345	7,518,206.950	
VALLOUREC	11,847	16.910	200,332.770	
VALEO	6,764	132.000	892,848.000	
E.ON SE	157,708	12.285	1,937,442.780	
VOEST-ALPINE AG	9,875	37.095	366,313.120	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	27.785	424,610.370	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	89.820	773,709.480	
METRO AG	11,655	28.475	331,876.120	
SIEMENS AG-REG	62,714	92.050	5,772,823.700	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	16.390	758,988.120	
ING GROEP NV-CVA	305,501	15.175	4,635,977.670	
BAYER AG	65,965	132.750	8,756,853.750	
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	9.200	410,421.200	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,659	106.650	1,563,382.350	
DAIMLER AG	76,262	82.920	6,323,645.040	
BASF SE	72,627	81.690	5,932,899.630	
BEIERSDORF AG	7,979	77.360	617,255.440	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,463	72.770	834,162.510	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,505	76.650	1,418,408.250	
ORANGE	145,120	14.325	2,078,844.000	
SAMPO OYJ-A SHS	32,912	45.000	1,481,040.000	
RANDSTAD HOLDINGS	8,678	60.600	525,886.800	
ALLIANZ SE	36,052	146.450	5,279,815.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.553	678,956.980	
KONINKLIJKE AHOLD NV	71,470	17.170	1,227,139.900	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	16,917	45.930	776,997.810	
HERMES INTL	1,835	337.000	618,395.000	
ENDESA S.A.	20,780	17.525	364,169.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	12.270	334,958.730	
ERSTE GROUP BANK AG	22,063	26.470	584,007.610	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,359	168.400	2,249,655.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	89,645	8.299	743,963.850	
SOCIETE BIC SA	2,165	145.050	314,033.250	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,074	67.060	742,622.440	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,530	28.705	388,378.650	
HEINEKEN NV	19,005	71.240	1,353,916.200	

AKZO NOBEL	20,652	66.730	1,378,107.960	
ASML HOLDING NV	27,333	92.470	2,527,482.510	
AEGON NV	146,081	6.728	982,832.960	
BANKINTER S.A.	52,241	6.919	361,455.470	
VOLKSWAGEN AG	2,794	203.400	568,299.600	
VOLKSWAGEN AG PFD	12,808	205.800	2,635,886.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	503,291	9.019	4,539,181.520	
KERING	6,033	163.000	983,379.000	
FORTUM OYJ	27,087	16.650	450,998.550	
AGEAS	19,877	34.695	689,632.510	
UCB SA	10,367	67.980	704,748.660	
THYSSENKRUPP AG	29,522	23.405	690,962.410	
UNILEVER NV-CVA	129,161	39.350	5,082,485.350	
CARREFOUR SA	44,554	29.060	1,294,739.240	
GAS NATURAL SDG SA	34,711	20.260	703,244.860	
ATOS	6,025	71.170	428,799.250	
NOKIA OYJ	283,740	6.030	1,710,952.200	
TUI AG	19,196	14.940	286,788.240	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	72,718	23.585	1,715,054.030	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	26.990	665,870.290	
SANOFI	94,577	92.470	8,745,535.190	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	7.181	423,750.810	
ELISA OYJ	13,898	29.550	410,685.900	
BANCO SANTANDER SA	1,142,668	6.478	7,402,203.300	
METSO OYJ	10,879	24.250	263,815.750	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	6,801	71.670	487,427.670	
QIAGEN N.V.	19,737	23.035	454,641.790	
LINDE AG	14,642	176.100	2,578,456.200	
DEUTSCHE BANK AG-REG	111,883	28.530	3,192,021.990	
BMW VORZUG	4,116	73.180	301,208.880	
K & S	13,745	38.015	522,516.170	
ENEL SPA	523,816	4.226	2,213,646.410	
VOPAK (KON.)	5,364	46.430	249,050.520	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.080	270,858.640	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	249,904	16.375	4,092,178.000	
BANCO POPULAR ESPANOL	156,903	4.429	694,923.380	
FINMECCANICA SPA	34,431	11.850	408,007.350	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	91,103	11.205	1,020,809.110	
KONINKLIJKE KPN NV	257,686	3.415	879,997.690	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.214	203,670.280	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,063	79.820	1,361,968.660	
EURAZEO	2,001	60.030	120,120.030	
BANCO SABADELL	350,263	2.217	776,533.070	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,333	74.790	398,855.070	
FRAPORT AG	3,149	58.540	184,342.460	

HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	64.130	513,937.820	
INDITEX	88,260	29.675	2,619,115.500	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	13,468	1.722	23,191.890	
ANDRITZ AG	4,704	51.860	243,949.440	
MAPFRE SA	80,219	3.181	255,176.630	
ESSILOR INTL	16,675	111.600	1,860,930.000	
SNAM SPA	126,865	4.608	584,593.920	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	13.610	1,164,811.850	
ENAGAS	16,043	24.710	396,422.530	
WENDEL	1,994	115.000	229,310.000	
TENARIS SA	33,458	11.610	388,447.380	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	7.385	553,535.290	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	1.190	1,039,711.330	
TELECOM ITALIA-RNC	432,141	0.937	404,916.110	
ATLANTIA SPA	33,870	22.840	773,590.800	
ILIAD SA	2,102	200.050	420,505.100	
PROXIMUS	13,498	32.815	442,936.870	
SES FDR	28,786	29.850	859,262.100	
TERNA SPA	138,625	4.216	584,443.000	
GRIFOLS SA	13,410	36.760	492,951.600	
FERROVIAL SA	34,406	20.425	702,742.550	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	52.960	363,093.760	
EXOR SPA	9,585	44.380	425,382.300	
NESTE OYJ	10,692	23.360	249,765.120	
KONE OYJ	25,273	35.170	888,851.410	
GDF SUEZ	119,536	17.250	2,061,996.000	
ALSTOM	17,252	26.015	448,810.780	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	47.750	239,943.750	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	29.100	507,795.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,174	20.675	334,397.450	
DEUTSCHE WOHNEN AG	22,321	22.175	494,968.170	
ARKEMA SA	5,658	66.160	374,333.280	
LEGRAND SA	20,657	50.920	1,051,854.440	
ORION OYJ	8,051	36.190	291,365.690	
RTL GROUP SA	1,270	85.350	108,394.500	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	10.620	361,271.160	
SYMRISE AG	9,463	57.560	544,690.280	
SCOR SE	14,425	33.040	476,602.000	
REXEL SA	20,799	14.630	304,289.370	
PRYSMIAN SPA	14,445	19.910	287,599.950	
BANCO POPOLARE SC	34,687	14.940	518,223.780	
CAIXABANK	165,497	4.274	707,334.170	
BUREAU VERITAS SA	23,255	20.475	476,146.120	
GROUPE EUROTUNNEL SE	46,533	13.200	614,235.600	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	17.505	396,890.860	

	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	AMADEUS IT HOLDING SA	37,149	37.280	1,384,914.720	
	TNT EXPRESS NV W/I	26,687	7.691	205,249.710	
	ENEL GREEN POWER SPA	71,844	1.861	133,701.680	
	BRENNTAG AG	15,483	52.100	806,664.300	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	67,082	7.369	494,327.250	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.526	382,469.280	
	DELTA LLOYD NV	19,898	14.995	298,370.510	
	EDENRED	18,682	22.245	415,581.090	
	BANKIA SA	431,169	1.125	485,065.120	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	63,554	5.142	326,794.660	
	HUGO BOSS AG -ORD	3,845	102.350	393,535.750	
	OSRAM LICHT AG	9,503	45.565	433,004.190	
	GEMALTO	5,952	80.730	480,504.960	
	DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN SE	30,347	27.165	824,376.250	
	CNH INDUSTRIAL NV	84,201	8.635	727,075.630	
	NUMERICABLE-SFR	9,058	45.505	412,184.290	
	ALTICE SA	6,742	117.050	789,151.100	
	NN GROUP NV	12,746	26.620	339,298.520	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	77,674	12.910	1,002,771.340	
	AENA SA	3,925	95.700	375,622.500	
	IBERDROLA SA-RTS	433,586	0.115	49,862.390	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV-RTS	13,524	0.672	9,088.120	
	REPSOL SA-RTS	84,660	0.471	39,874.860	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA-RTS	28,480	0.740	21,075.200	
	ユーロ 小計	21,621,775		281,624,353.720 (38,407,929,361)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	21.700	4,730,600.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	32.150	3,589,869.000	
	CLP HOLDINGS LTD	177,000	65.100	11,522,700.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	5.910	3,146,484.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	58.700	2,876,300.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	87,000	239.200	20,810,400.000	
	MTR CORP	133,500	34.550	4,612,425.000	
	HANG SENG BANK LTD	69,000	149.700	10,329,300.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	107,657	51.300	5,522,804.100	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	116,000	68.850	7,986,600.000	

(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	51.550	6,173,112.500	
HONG KONG & CHINA GAS	586,535	15.640	9,173,407.400	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	34.100	6,444,900.000	
KERRY PROPERTIES LTD	28,500	27.650	788,025.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	311,500	30.600	9,531,900.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	429,266	9.580	4,112,368.280	
SINO LAND CO	255,400	12.160	3,105,664.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	120.800	16,791,200.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	57,500	97.600	5,612,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	25.950	2,348,475.000	
WHEELLOCK & CO LTD	76,000	39.650	3,013,400.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	8.960	1,756,160.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	14.980	2,540,608.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	16.180	679,560.000	
AIA GROUP LTD	957,800	49.550	47,458,990.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	29.550	5,307,180.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	24.150	2,516,430.000	
WH GROUP LTD	246,500	5.050	1,244,825.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	218,332	111.000	24,234,852.000	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	221,832	61.050	13,542,843.600	
香港・ドル 小計	6,220,032		241,503,382.880 (3,815,753,450)	
合計	93,056,107		291,030,892,832 (291,030,892,832)	

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	638,364.540	
		FEDERATION CENTRES	339,877.000	1,006,035.920	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	972,853.200	
		GPT GROUP	73,257.000	312,807.390	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	703,837.200	
		MIRVAC GROUP	235,066.000	440,748.750	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,572,653.700	
		STOCKLAND	210,736.000	872,447.040	
		WESTFIELD CORP	166,693.000	1,546,911.040	
	オーストラリア・ドル 小計		1,728,348.000	8,066,658.780 (734,227,282)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	319,665.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	294,800.000	627,924.000	
		シンガポール・ドル 小計	633,706.000	1,258,400.580 (114,124,348)	

投資信託受益証券 合計			2,362,054	848,351,630 (848,351,630)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	26,719.000	502,317.200	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	65,404.000	550,047.640	
		AMERICAN TOWER CORP	33,354.000	3,182,638.680	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	88,038.000	837,241.380	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,610.000	1,942,353.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,785.000	1,587,385.600	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,072.000	142,995.600	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	487,464.600	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	27,842.000	2,264,668.280	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	750,337.020	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	552,364.340	
		EQUINIX INC	4,580.000	1,185,212.400	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,194.000	2,180,207.920	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	1,070,281.500	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,745.000	399,737.100	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	769,638.460	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	1,232,473.600	
		HCP INC	39,145.000	1,479,289.550	
		HEALTH CARE REIT INC	25,792.000	1,773,200.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	1,200,714.900	
		IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	429,973.520	
		KIMCO REALTY	32,980.000	787,562.400	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	337,498.230	
		PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	544,361.040	
		PROLOGIS INC	40,935.000	1,578,862.950	
		PUBLIC STORAGE	12,041.000	2,361,601.330	
		REALTY INCOME CORP	16,761.000	777,039.960	
		REGENCY CENTERS CORP	6,286.000	392,183.540	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	25,363.000	4,535,918.920	
		SL GREEN	8,526.000	979,893.180	
		THE MACERICH COMPANY	12,185.000	946,530.800	
		UDR INC	21,797.000	719,954.910	
	VENTAS INC	24,040.000	1,551,782.000		
VORNADO REALTY TRUST	14,028.000	1,362,539.640			
WEYERHAEUSER CO	42,629.000	1,333,861.410			
	アメリカ・ドル 小計		832,733.000	42,730,132.600 (5,234,441,243)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	678,877.120	

	HAMMERSON PLC	68,046.000	440,257.620	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	288,270.850	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	813,782.970	
	SEGRO PLC	42,345.000	178,907.620	
イギリス・ポンド 小計		345,120.000	2,400,096.180 (456,018,274)	
カナダ・ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	429,884.280	
カナダ・ドル 小計		15,764.000	429,884.280 (41,483,833)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	205,882.560	
	GECINA SA	1,083.000	123,570.300	
	ICADE	3,001.000	198,426.120	
	KLEPIERRE	15,834.000	647,610.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,900.000	1,825,295.000	
ユーロ 小計		30,410.000	3,000,784.580 (409,247,001)	
香港・ドル	LINK REIT/THE	196,500.000	8,783,550.000	
香港・ドル 小計		196,500.000	8,783,550.000 (138,780,090)	
投資証券 合計		1,420,527	6,279,970,441 (6,279,970,441)	
合計			7,128,322,071 (7,128,322,071)	

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 610銘柄	60.80%	-%	-%	63.16%
	投資証券 35銘柄	-%	-%	1.74%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	8.38%	-%	-%	8.62%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.15%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.26%	-%	-%	0.26%
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄	2.57%	-%	-%	2.84%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.24%	-%	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.79%	-%	-%	3.84%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 22銘柄	0.55%	-%	-%	0.60%
	投資信託 受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	4.00%	-%	-%	4.04%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.23%	-%	-%	1.25%
デンマーク・クローネ	株式 14銘柄	0.73%	-%	-%	0.74%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.05%	-%	-%	0.05%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.26%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 229銘柄	12.76%	-%	-%	13.02%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 30銘柄	1.27%	-%	-%	1.33%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		73,657,853	38,813,330
コール・ローン		24,814,092	21,768,079
投資信託受益証券		3,018,423,263	3,018,096,857
投資証券		24,057,181,834	24,185,233,460
派生商品評価勘定		265,350	1,148
未収入金		92,334	63,318,366
未収配当金		129,103,083	105,771,519
流動資産合計		27,303,537,809	27,433,002,759
資産合計		27,303,537,809	27,433,002,759
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		138	238,112
未払金		1,895,291	-
未払解約金		23,000,000	32,124,000
流動負債合計		24,895,429	32,362,112
負債合計		24,895,429	32,362,112
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,304,470,195	23,916,186,903
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,974,172,185	3,484,453,744
元本等合計		27,278,642,380	27,400,640,647
純資産合計		27,278,642,380	27,400,640,647
負債純資産合計		27,303,537,809	27,433,002,759

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	30,616,773,967円	23,304,470,195円
	同期中追加設定元本額	5,410,754,528円	10,650,489,002円
	同期中一部解約元本額	12,723,058,300円	10,038,772,294円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	8,682,165円	10,436,797円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	22,069,713円	29,512,945円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	60,330,993円	82,215,705円
	投資のソムリエ	344,186,772円	390,728,517円
	投資のソムリエ＜DC年金＞	5,011,319円	5,472,193円
	D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	16,231,936円	29,242,669円
	D I A M外国リートインデックスファンド＜DC年金＞	- 円	1,061,990円
	為替フルヘッジ型外国リート・パッシブ・ファンド（適格機関投資家限定）	919,073,809円	1,140,701,755円
	D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	- 円	217,556,179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）	6,503,520,422円	5,798,997,982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）	14,024,325,538円	14,126,422,170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）	553,358,537円	620,783,650円
	D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII（適格機関投資家限定）	282,799,528円	898,947,891円
	D I A M海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	564,879,463円	564,106,460円
	計	23,304,470,195円	23,916,186,903円
2 .	受益権の総数	23,304,470,195口	23,916,186,903口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	266,131,774	39,572,815
投資証券	2,703,475,616	32,713,475
合計	2,969,607,390	72,286,290

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年6月24日から平成27年1月13日まで及び平成27年6月23日から平成27年7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	31,010,112	-	30,744,900	265,212	39,893,806	-	40,130,770	236,964
アメリカ・ドル	-	-	-	-	19,460,999	-	19,475,910	14,911
イギリス・ポンド	5,371,890	-	5,371,800	90	-	-	-	-
カナダ・ドル	5,068,150	-	4,928,000	140,150	-	-	-	-
シンガポール・ドル	6,187,790	-	6,187,300	490	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	5,624,820	-	5,500,200	124,620	-	-	-	-
ユーロ	4,191,582	-	4,191,600	18	13,059,071	-	13,228,860	169,789
香港・ドル	4,565,880	-	4,566,000	120	7,373,736	-	7,426,000	52,264
合計	31,010,112	-	30,744,900	265,212	39,893,806	-	40,130,770	236,964

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.1705円	1.1457円
（1万口当たり純資産額）	（11,705円）	（11,457円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	360 CAPITAL GROUP LTD	52,000.000	53,820.000	
		360 CAPITAL OFFICE FUND	17,000.000	35,190.000	
		ABACUS PROPERTY GROUP	64,500.000	186,405.000	
		ALE PROPERTY GROUP	38,091.000	139,032.150	
		ARENA REIT	50,161.000	76,746.330	
		ASPEN GROUP	31,613.000	42,361.420	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	11,000.000	54,890.000	
		AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	23,700.000	54,273.000	
		BWP TRUST	106,407.000	339,438.330	
		CHARTER HALL GROUP	68,721.000	316,803.810	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	67,323.000	285,449.520	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	292,000.000	309,520.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	217,000.000	1,575,420.000	
		FEDERATION CENTRES	736,000.000	2,178,560.000	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	46,000.000	96,600.000	
		GALILEO JAPAN TRUST	25,000.000	44,750.000	
		GDI PROPERTY GROUP	113,280.000	99,686.400	
		GOODMAN GROUP	352,000.000	2,207,040.000	
		GPT GROUP	398,000.000	1,699,460.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	37,537.000	118,616.920	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	34,000.000	86,700.000	
		INDUSTRIA REIT	21,000.000	38,640.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	216,898.000	97,604.100	
		INVESTA OFFICE FUND	135,000.000	514,350.000	
		MIRVAC GROUP	823,000.000	1,543,125.000	
		NATIONAL STORAGE REIT	66,400.000	107,900.000	
		SCENTRE GROUP	1,199,000.000	4,568,190.000	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	164,000.000	347,680.000	
STOCKLAND	529,000.000	2,190,060.000			
WESTFIELD CORP	430,200.000	3,992,256.000			
オーストラリア・ドル 小計			6,365,831.000	23,400,567.980 (2,129,919,697)	

シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	114,395.000	171,592.500	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	181,600.000	124,396.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	464,061.000	1,127,668.230	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	214,000.000	279,270.000	
	CACHE LOGISTICS TRUST	155,800.000	179,170.000	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	279,005.000	188,328.370	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	476,006.000	721,149.090	
	CAPITALAND MALL TRUST	582,064.000	1,239,796.320	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	147,080.000	238,269.600	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	142,800.000	229,908.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	193,000.000	149,575.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	135,500.000	188,345.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	132,100.000	266,842.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	104,080.000	158,201.600	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	103,000.000	81,885.000	
	KEPPEL DC REIT	183,900.000	192,175.500	
	KEPPEL REIT	370,300.000	418,439.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	430,000.000	152,650.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	311,000.000	450,950.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	399,000.000	400,995.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	265,020.000	406,805.700	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	326,020.000	365,142.400	
	QUE COMMERCIAL REIT	76,000.000	55,100.000	
	QUE COMMERCIAL REIT-RTS	34,200.000	5,437.800	
	QUE HOSPITALITY TRUST	153,600.000	142,848.000	
	PARKWAY LIFE REIT	82,000.000	190,240.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	157,000.000	133,450.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	113,100.000	95,569.500	
	SPH REIT	177,400.000	184,496.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	320,000.000	280,000.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	570,091.000	974,855.610		

	シンガポール・ドル 小計		7,393,122.000	9,793,551.220 (888,177,160)	
投資信託受益証券 合計			13,758,953	3,018,096,857 (3,018,096,857)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	15,600.000	486,096.000	
		AGREE REALTY CORP	3,878.000	118,317.780	
		ALEXANDER'S INC.	731.000	309,724.700	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,250.000	1,473,062.500	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,151.000	334,680.060	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	25,340.000	972,295.800	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	31,300.000	511,755.000	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	203,980.000	1,715,471.800	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	7,600.000	141,512.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	35,240.000	1,366,254.800	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	6,200.000	64,356.000	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	5,510.000	84,578.500	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	18,947.000	168,059.890	
		ASSOCIATED ESTATES RLTY CORP	12,704.000	364,604.800	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,780.000	4,982,194.000	
		BIOMED REALTY TRUST INC	45,930.000	921,815.100	
		BOSTON PROPERTIES INC	34,560.000	4,290,969.600	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	40,800.000	558,960.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38,250.000	900,787.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,590.000	1,519,400.400	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	15,300.000	85,833.000	
		CARETRUST REIT INC	6,800.000	92,480.000	
		CBL & ASSOCIATES	38,530.000	630,736.100	
		CEDAR REALTY TRUST INC	15,370.000	104,823.400	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	52,000.000	379,080.000	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,780.000	243,732.800	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	13,380.000	421,737.600	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	28,250.000	710,205.000	
		CORESITE REALTY CORP	6,100.000	292,617.000	

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	21,390.000	519,990.900	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	26,420.000	898,280.000	
COUSINS PROPERTIES INC	45,500.000	481,845.000	
CUBESMART	37,100.000	929,355.000	
CYRUSONE INC	14,400.000	429,408.000	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	19,940.000	665,796.600	
DDR CORP	67,600.000	1,071,460.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	44,500.000	594,965.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	30,610.000	2,116,069.300	
DOUGLAS EMMETT INC	30,950.000	877,123.000	
DUKE REALTY TRUST	77,790.000	1,494,345.900	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	15,100.000	451,792.000	
EAST GROUP	7,330.000	420,302.200	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	2,700.000	42,498.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	10,582.000	338,306.540	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	25,490.000	452,447.500	
EPR PROPERTIES	12,930.000	726,924.600	
EQUITY COMMONWEALTH	29,300.000	760,628.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,070.000	1,014,449.800	
EQUITY ONE INC	17,980.000	440,150.400	
EQUITY RESIDENTIAL	81,960.000	6,120,772.800	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,730.000	3,267,408.600	
EXCEL TRUST INC	14,700.000	232,554.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	25,050.000	1,742,979.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,490.000	2,076,589.400	
FELCOR LODGING TR INC	27,900.000	292,671.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	24,500.000	483,385.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	12,945.000	133,721.850	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	20,290.000	235,566.900	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	20,930.000	742,805.700	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	141,690.000	3,737,782.200	
GEO GROUP INC	16,870.000	597,535.400	
GETTY REALTY CORP	6,120.000	102,999.600	

GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,808.000	81,159.040	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	15,487.000	290,536.120	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	12,500.000	288,375.000	
HCP INC	103,980.000	3,929,404.200	
HEALTH CARE REIT INC	79,050.000	5,434,687.500	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,710.000	545,948.400	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	28,280.000	718,877.600	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,941.000	303,940.980	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	21,240.000	877,424.400	
HOME PROPERTIES INC	13,080.000	955,232.400	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	33,840.000	993,880.800	
HOST HOTELS & RESORTS INC	170,620.000	3,523,303.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	16,000.000	469,760.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	4,200.000	33,516.000	
INLAND REAL ESTATE CORP	20,490.000	200,802.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	26,471.000	194,297.140	
IRON MOUNTAIN INC	42,260.000	1,306,679.200	
KILROY REALTY CORP	19,860.000	1,378,085.400	
KIMCO REALTY	92,990.000	2,220,601.200	
KITE REALTY GROUP TRUST	18,500.000	474,710.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	25,500.000	954,975.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	46,800.000	403,416.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	33,720.000	1,105,004.400	
LTC PROPERTIES INC	7,823.000	345,620.140	
MACK CALI	18,432.000	350,023.680	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	47,210.000	644,888.600	
MID AMERICA	17,000.000	1,303,050.000	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	12,433.000	122,589.380	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	34,943.000	327,066.480	
NATIONAL HEALTH INVS INC	7,400.000	480,334.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	30,240.000	1,108,900.800	

NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	3,900.000	49,530.000	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	18,600.000	253,890.000	
NEW YORK REIT INC	35,699.000	363,772.810	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	4,300.000	57,620.000	
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	61,820.000	984,792.600	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	36,270.000	1,280,331.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,080.000	69,546.400	
PARKWAY PROPERTIES INC	18,534.000	338,430.840	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	16,240.000	725,603.200	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	15,191.000	347,570.080	
PHYSICIANS REALTY TRUST	15,461.000	248,612.880	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	35,100.000	639,171.000	
POST PROPERTIES, INC	12,340.000	709,426.600	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	4,200.000	45,864.000	
PROLOGIS INC	118,000.000	4,551,260.000	
PS BUSINESS PARKS	4,266.000	315,513.360	
PUBLIC STORAGE	32,710.000	6,415,412.300	
QTS REALTY TRUST INC	7,000.000	265,720.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	18,200.000	309,946.000	
REALTY INCOME CORP	52,390.000	2,428,800.400	
REGENCY CENTERS CORP	21,280.000	1,327,659.200	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	20,600.000	338,458.000	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	53,550.000	788,256.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	11,823.000	176,635.620	
RLJ LODGING TRUST	29,840.000	924,144.800	
ROUSE PROPERTIES INC	8,210.000	145,070.700	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,590.000	653,444.200	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	14,500.000	393,820.000	
SAUL CENTERS INC	2,660.000	136,857.000	
SELECT INCOME REIT	8,810.000	190,648.400	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	53,030.000	951,358.200	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	7,700.000	126,742.000	

	SIMON PROPERTY GROUP INC	70,000.000	12,518,800.000	
	SL GREEN	22,440.000	2,579,029.200	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	8,110.000	753,256.800	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	99,590.000	1,009,842.600	
	STAG INDUSTRIAL INC	14,205.000	296,458.350	
	STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST	8,780.000	218,534.200	
	STORE CAPITAL CORP	11,600.000	240,352.000	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	62,160.000	795,648.000	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,670.000	279,117.300	
	SUN COMMUNITIES INC	11,400.000	753,540.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	47,130.000	739,941.000	
	TANGER FACTORY OUTLET	21,650.000	715,532.500	
	TAUBMAN CENTERS INC	13,960.000	993,393.600	
	TERRENO REALTY CORP	9,436.000	195,042.120	
	THE MACERICH COMPANY	31,740.000	2,465,563.200	
	TRADE STREET RESIDENTIAL INC	3,000.000	21,000.000	
	UDR INC	58,360.000	1,927,630.800	
	UMH PROPERTIES INC	4,400.000	44,000.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,928.000	142,740.000	
	URBAN EDGE PROPERTIES	21,100.000	447,742.000	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	6,520.000	125,444.800	
	VENTAS INC	74,510.000	4,809,620.500	
	VORNADO REALTY TRUST	39,440.000	3,830,807.200	
	WASHINGTON REIT	15,440.000	409,777.600	
	WEINGARTEN REALTY INVST	25,740.000	881,595.000	
	WHITESTONE REIT	5,800.000	77,836.000	
	WP CAREY INC	21,890.000	1,314,713.400	
	WP GLIMCHER INC	42,100.000	586,032.000	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	24,961.000	549,890.830	
	アメリカ・ドル 小計	4,357,470.000	156,382,927.770 (19,156,908,652)	
イギリス・ポンド	ASSURA PLC	200,091.000	109,449.770	
	BIG YELLOW GROUP PLC	32,667.000	212,825.500	
	BRITISH LAND CO PLC	230,500.000	1,899,320.000	
	DERWENT LONDON PLC	25,000.000	885,000.000	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	77,800.000	633,292.000	
	HAMMERSON PLC	176,900.000	1,144,543.000	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	150,853.000	173,179.240	

	INTU PROPERTIES PLC	213,500.000	690,672.500	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	180,300.000	2,320,461.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	129,000.000	208,206.000	
	MCKAY SECURITIES PLC	22,000.000	55,440.000	
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	14,220.000	68,540.400	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	25,340.000	98,749.980	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	234,000.000	123,084.000	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	45,551.000	130,275.860	
	SEGRO PLC	167,600.000	708,110.000	
	SHAFTESBURY PLC	62,800.000	546,360.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	148,000.000	167,684.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	25,800.000	231,297.000	
	イギリス・ボンド 小計	2,161,922.000	10,406,490.250 (1,977,233,148)	
	イスラエル・シュケル REIT 1 LTD	34,875.000	378,045.000	
	イスラエル・シュケル 小計	34,875.000	378,045.000 (12,305,365)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	8,500.000	307,955.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,700.000	213,206.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,700.000	341,601.000	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	3,138.000	82,215.600	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	12,711.000	350,823.600	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	8,000.000	336,640.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	11,400.000	125,058.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	18,300.000	325,923.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	14,040.000	176,763.600	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,970.000	100,740.800	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,400.000	119,784.000	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	8,455.000	68,654.600	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,900.000	289,289.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,320.000	221,312.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	30,200.000	679,802.000	
	INVEST REAL ESTATE INV TR	12,300.000	61,008.000	

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,926.000	49,378.980	
	MILESTONE APARTMENTS REIT	8,400.000	106,596.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,477.000	54,167.530	
	MORGUARD REAL ESTATE INV TR	6,100.000	100,772.000	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	3,760.000	82,945.600	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000.000	53,410.000	
	PLAZA RETAIL REIT	12,000.000	51,960.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	22,961.000	107,457.480	
	RETROCOM REIT	9,828.000	33,415.200	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	34,500.000	940,815.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,800.000	467,838.000	
カナダ・ドル 小計		319,786.000	5,849,531.990 (564,479,837)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	160,569.000	175,020.210	
	DNZ PROPERTY FUND LTD	65,137.000	136,787.700	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	232,180.000	280,937.800	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	293,000.000	383,830.000	
	PRECINCT PROPERTIES	205,307.000	234,049.980	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	90,123.000	138,789.420	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	65,000.000	107,250.000	
ニュージーランド・ドル 小計		1,111,316.000	1,456,665.110 (119,825,272)	
ユーロ	AEDIFICA	2,889.000	147,801.240	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	18,116.000	213,497.060	
	ALTAREA	490.000	73,500.000	
	ANF IMMOBILIER	2,270.000	49,940.000	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	15,800.000	182,016.000	
	BEFIMMO	4,440.000	251,037.600	
	BENI STABILI SPA	228,000.000	155,952.000	
	COFINIMMO SA	4,620.000	444,259.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10,680.000	409,097.400	
	FONCIERE DES REGIONS	10,750.000	853,872.500	
	GECINA SA	8,130.000	927,633.000	
	GREEN REIT PLC	154,000.000	228,074.000	
	HAMBORNER REIT AG	10,400.000	90,584.000	
	HAMBORNER REIT AG-RTS	10,398.000	10.390	

	HIBERNIA REIT PLC	147,050.000	184,694.800	
	ICADE	7,200.000	476,064.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	71,000.000	56,090.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	72,094.000	78,942.930	
	KLEPIERRE	48,250.000	1,973,425.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	9,090.000	91,354.500	
	MERCIALYS	12,146.000	248,932.270	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	44,100.000	495,243.000	
	NSI NV	20,800.000	73,632.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	22,100.000	5,106,205.000	
	VASTNED RETAIL	4,400.000	176,770.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	2,839.000	194,528.280	
	WERELDHAVE NV	7,880.000	411,493.600	
	ユーロ 小計	949,932.000	13,594,649.770 (1,854,038,336)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	581,000.000	2,463,440.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	304,000.000	2,349,920.000	
	LINK REIT/THE	516,023.000	23,066,228.100	
	NEW CENTURY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	70,000.000	218,400.000	
	PROSPERITY REIT	309,000.000	859,020.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	180,000.000	390,600.000	
	SPRING REIT	143,000.000	484,770.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	222,000.000	872,460.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	234,000.000	968,760.000	
	香港・ドル 小計	2,559,023.000	31,673,598.100 (500,442,850)	
	投資証券 合計	11,494,324	24,185,233,460 (24,185,233,460)	
	合計		27,203,330,317 (27,203,330,317)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 154銘柄	-%	69.91%	70.42%
イギリス・ポンド	投資証券 19銘柄	-%	7.22%	7.27%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.04%	0.05%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	7.77%	-%	7.83%
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-%	2.06%	2.08%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	3.24%	-%	3.26%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	0.44%	0.44%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	6.77%	6.82%
香港・ドル	投資証券 9銘柄	-%	1.83%	1.84%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		216,222,920	291,548,643
コール・ローン		3,461,441,716	2,799,948,962
国債証券		171,826,023,987	171,703,101,848
派生商品評価勘定		4,970,010,497	405,010,519
未収入金		105,852,152	-
未収利息		1,627,037,030	1,700,017,354
前払費用		214,805,656	96,436,397
流動資産合計		182,421,393,958	176,996,063,723
資産合計		182,421,393,958	176,996,063,723
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,510,156	106,042,707
未払金		1,130,169,048	-
未払解約金		64,665,000	82,830,000
流動負債合計		1,204,344,204	188,872,707
負債合計		1,204,344,204	188,872,707
純資産の部			
元本等			
元本	1	137,483,212,002	137,101,844,489
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		43,733,837,752	39,705,346,527
元本等合計		181,217,049,754	176,807,191,016
純資産合計		181,217,049,754	176,807,191,016
負債純資産合計		182,421,393,958	176,996,063,723

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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	139,254,883,317円 9,471,586,382円 11,243,257,697円	137,483,212,002円 12,453,078,932円 12,834,446,445円
元本の内訳		
ファンド名		
投資のソムリエ	1,718,229,481円	4,368,825,148円
投資のソムリエ<DC年金>	26,109,948円	61,903,371円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	220,536,998円	49,081,687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）	25,054,429,260円	24,409,282,571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）	1,595,857,498円	1,479,670,332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）	8,628,334,289円	8,520,422,751円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	39,351,743,584円	38,571,424,083円
D I A Mバランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	176,330円	177,196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）	35,234,770,299円	34,405,414,499円

D I A Mバランス２０VA(適格機関投資家限定)	162,720円	164,757円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	3,614,869,323円	3,532,589,421円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	9,364,739,804円	9,187,464,016円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	12,174,963,687円	12,023,867,868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)	498,288,781円	491,556,789円
計	137,483,212,002円	137,101,844,489円
2. 受益権の総数	137,483,212,002口	137,101,844,489口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	7,217,539,600	751,254,393
合計	7,217,539,600	751,254,393

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年6月24日から平成27年1月13日まで及び平成27年6月23日から平成27年7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	176,932,283,137	-	171,962,272,640	4,970,010,497	174,387,583,655	-	174,088,615,843	298,967,812
アメリカ・ドル	71,048,089,962	-	69,930,485,966	1,117,603,996	74,153,853,363	-	74,236,047,990	82,194,627
イギリス・ポンド	14,993,118,901	-	14,370,904,899	622,214,002	15,074,226,645	-	14,884,931,700	189,294,945
オーストラリア・ドル	3,015,182,228	-	2,956,593,705	58,588,523	2,933,147,677	-	2,840,587,113	92,560,564
カナダ・ドル	4,089,956,545	-	3,896,362,890	193,593,655	3,848,580,321	-	3,789,670,071	58,910,250
シンガポール・ドル	665,066,938	-	650,415,030	14,651,908	639,522,843	-	638,372,590	1,150,253
スウェーデン・クローナ	881,818,766	-	843,174,696	38,644,070	881,594,225	-	865,456,568	16,137,657
デンマーク・クローネ	1,311,628,052	-	1,264,355,988	47,272,064	1,245,722,308	-	1,245,381,668	340,640
ノルウェー・クローネ	469,083,570	-	449,113,170	19,970,400	487,334,554	-	478,110,804	9,223,750
ポーランド・ズロチ	1,124,554,981	-	1,089,467,712	35,087,269	1,015,484,187	-	1,019,124,459	3,640,272

マレーシ ア ・リン ギット メキシ コ・ペソ	848,880,200	-	837,971,100	10,909,100	828,333,037	-	819,704,700	8,628,337
ユーロ 南アフリ カ ・ランド	75,736,612,082	-	72,949,432,752	2,787,179,330	70,574,082,757	-	70,594,270,296	20,187,539
買 建	931,304,271	-	923,246,184	8,058,087	936,538,049	-	913,584,884	22,953,165
アメリ カ・ドル	833,455,118	-	823,944,962	9,510,156	-	-	-	-
イギリ ス・ボン ド	328,175,352	-	323,839,200	4,336,152	-	-	-	-
オースト ラリア・ ドル	161,773,308	-	160,509,384	1,263,924	-	-	-	-
カナダ・ ドル	18,434,560	-	18,216,635	217,925	-	-	-	-
ユーロ 南アフリ カ ・ランド	28,990,935	-	28,237,440	753,495	-	-	-	-
	276,267,436	-	273,487,928	2,779,508	-	-	-	-
	19,813,527	-	19,654,375	159,152	-	-	-	-
合計	177,765,738,255	-	172,786,217,602	4,960,500,341	174,387,583,655	-	174,088,615,843	298,967,812

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.3181円	1.2896円
(1万口当たり純資産額)	(13,181円)	(12,896円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.625 05/31/17	12,300,000.000	12,296,556.000	
		US T N/B 0.625 08/31/17	19,000,000.000	18,962,000.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	5,000,000.000	4,979,250.000	
		US T N/B 0.75 03/31/18	11,600,000.000	11,538,752.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	9,000,000.000	8,977,770.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	13,900,000.000	13,899,444.000	
		US T N/B 0.875 04/30/17	14,400,000.000	14,470,272.000	
		US T N/B 0.875 05/15/17	4,000,000.000	4,018,560.000	
		US T N/B 0.875 11/30/16	5,500,000.000	5,531,130.000	
		US T N/B 1.0 06/30/19	5,000,000.000	4,921,450.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	10,000,000.000	9,766,400.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	2,600,000.000	2,598,362.000	
		US T N/B 1.25 11/30/18	1,000,000.000	1,001,600.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	10,000,000.000	10,021,800.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	6,660,000.000	6,567,625.800	
		US T N/B 1.5 01/31/22	3,000,000.000	2,893,800.000	
		US T N/B 1.5 02/28/19	5,000,000.000	5,034,350.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	8,400,000.000	8,457,036.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	6,900,000.000	6,984,594.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	5,600,000.000	5,650,736.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	1,500,000.000	1,448,490.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	5,180,000.000	4,986,112.600	
		US T N/B 1.75 05/15/22	14,470,000.000	14,130,823.200	
		US T N/B 1.75 05/15/23	4,400,000.000	4,235,000.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	1,720,000.000	1,735,978.800	
		US T N/B 1.875 09/30/17	6,000,000.000	6,148,800.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	7,710,000.000	7,679,853.900	
		US T N/B 2.0 02/15/23	4,000,000.000	3,937,160.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	13,900,000.000	13,411,276.000	
		US T N/B 2.0 02/28/21	2,980,000.000	2,999,548.800	
		US T N/B 2.0 05/31/21	10,860,000.000	10,898,118.600	
		US T N/B 2.0 08/31/21	7,700,000.000	7,701,463.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	2,960,000.000	2,996,289.600	
		US T N/B 2.0 11/15/21	5,500,000.000	5,491,805.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	5,430,000.000	5,474,091.600			
US T N/B 2.125 08/31/20	1,480,000.000	1,508,327.200			
US T N/B 2.25 03/31/21	5,920,000.000	6,031,888.000			
US T N/B 2.25 07/31/18	4,000,000.000	4,142,160.000			
US T N/B 2.375 06/30/18	4,300,000.000	4,467,614.000			
US T N/B 2.375 07/31/17	10,500,000.000	10,859,205.000			

US T N/B 2.375 08/15/24	9,010,000.000	9,002,882.100	
US T N/B 2.375 12/31/20	1,450,000.000	1,491,006.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,000,000.000	3,444,680.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	7,090,000.000	7,168,628.100	
US T N/B 2.5 06/30/17	6,500,000.000	6,736,340.000	
US T N/B 2.625 04/30/18	4,300,000.000	4,499,348.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	5,150,000.000	5,372,892.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	2,960,000.000	3,083,017.600	
US T N/B 2.75 02/15/19	3,700,000.000	3,891,327.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	4,630,000.000	4,778,993.400	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,920,000.000	1,755,148.800	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,100,000.000	7,341,258.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,950,000.000	1,779,667.500	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,480,000.000	3,251,050.800	
US T N/B 3.0 02/28/17	7,000,000.000	7,281,330.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,110,000.000	1,067,242.800	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,300,000.000	1,248,195.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	6,000,000.000	6,190,020.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	4,400,000.000	4,213,000.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,110,000.000	1,096,125.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,140,000.000	4,065,894.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	4,000,000.000	4,181,680.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,794,930.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	5,430,000.000	5,790,117.600	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,690,000.000	4,599,858.200	
US T N/B 3.125 10/31/16	10,500,000.000	10,860,465.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,400,000.000	2,373,000.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,000,000.000	7,319,620.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	7,000,000.000	7,199,290.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	15,800,000.000	16,435,002.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	2,640,000.000	2,717,536.800	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,500,000.000	4,849,065.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	2,500,000.000	2,666,600.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,472,000.000	1,563,528.960	
US T N/B 3.5 05/15/20	6,910,000.000	7,498,386.500	
US T N/B 3.625 02/15/20	11,890,000.000	12,955,344.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,180,000.000	5,665,987.600	
US T N/B 3.625 02/15/44	3,250,000.000	3,505,417.500	
US T N/B 3.625 08/15/19	17,000,000.000	18,470,160.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,484,000.000	4,839,895.080	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,680,000.000	1,855,072.800	
US T N/B 3.75 11/15/18	6,000,000.000	6,509,520.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,400,000.000	4,857,864.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	5,800,000.000	6,271,424.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,800,000.000	2,022,030.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	790,000.000	939,784.000	
US T N/B 4.25 11/15/17	3,000,000.000	3,242,670.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,920,000.000	2,285,683.200	
US T N/B 4.375 02/15/38	910,000.000	1,103,939.200	

US T N/B 4.375 05/15/40	1,110,000.000	1,345,086.900	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,180,000.000	1,435,446.400	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,200,000.000	2,665,432.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,680,000.000	2,087,400.000	
US T N/B 4.5 05/15/17	4,000,000.000	4,285,440.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	690,000.000	851,825.700	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,080,000.000	1,331,856.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	6,000,000.000	6,390,180.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,820,000.000	2,285,519.600	
US T N/B 4.625 11/15/16	7,000,000.000	7,387,940.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,080,000.000	1,384,635.600	
US T N/B 4.75 08/15/17	3,700,000.000	4,012,021.000	
US T N/B 4.875 08/15/16	8,000,000.000	8,391,840.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	690,000.000	913,491.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,075,621.900	
US T N/B 5.25 11/15/28	740,000.000	957,833.800	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,400,000.000	1,869,210.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	880,000.000	1,161,600.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,068,368.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,310,249.500	
US T N/B 6.25 05/15/30	900,000.000	1,290,087.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,000,000.000	2,597,500.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	700,000.000	978,411.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,854,026.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	11,000,000.000	13,931,280.000	
アメリカ・ドル 小計	577,646,000.000 (70,761,635,000)	598,849,712.040 (73,359,089,725)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	1,970,000.000	1,981,032.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	3,260,000.000	3,282,494.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/17	1,670,000.000	1,699,893.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	2,100,000.000	2,135,763.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,420,000.000	2,401,124.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,000,000.000	1,018,460.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	500,000.000	486,950.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,370,000.000	2,417,068.200	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,320,000.000	2,446,161.600	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,350,000.000	2,553,040.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,480,000.000	1,683,204.000	

UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,030,000.000	1,253,613.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,530,000.000	1,883,430.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	1,870,000.000	2,055,878.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,800,000.000	3,110,240.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,420,000.000	1,592,402.200	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,330,000.000	1,770,629.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,900,000.000	2,168,660.000	
UK TREASURY 4.0 09/07/16	1,490,000.000	1,549,898.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,940,000.000	2,412,778.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,950,000.000	2,394,600.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,260,000.000	1,589,490.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,320,000.000	1,595,616.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,640,000.000	2,080,996.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,630,000.000	2,132,366.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,360,000.000	1,814,920.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,630,000.000	2,243,858.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,250,000.000	2,520,900.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,090,000.000	2,666,213.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,810,000.000	2,410,558.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	2,200,000.000	2,531,100.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,950,000.000	2,513,355.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,169,475.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/18	880,000.000	977,152.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,730,000.000	2,170,112.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,050,000.000	1,497,825.000	

	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,720,000.000	2,334,384.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	1,230,000.000	1,442,052.000	
イギリス・bond 小計		66,060,000.000 (12,551,400,000)	76,987,690.000 (14,627,661,100)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,470,000.000	2,727,448.100	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,750,000.000	3,063,582.500	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	2,370,000.000	2,802,714.600	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	2,160,000.000	2,142,806.400	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	350,000.000	310,282.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	500,000.000	512,945.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,850,000.000	1,897,637.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	950,000.000	949,563.000	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	600,000.000	624,234.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	800,000.000	820,304.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,530,000.000	1,701,405.900	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	540,000.000	564,688.800	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,000,000.000	1,142,600.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,330,000.000	1,547,109.200	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,260,000.000	3,545,771.600	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,300,000.000	2,745,096.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	1,500,000.000	1,801,980.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	1,940,000.000	2,062,666.200	
オーストラリア・ドル 小計		28,200,000.000 (2,566,764,000)	30,962,834.800 (2,818,237,223)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	450,000.000	745,042.500	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,230,000.000	1,255,436.400	
	CANADA 1.25 09/01/18	1,850,000.000	1,895,177.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	2,480,000.000	2,521,936.800	
	CANADA 1.5 03/01/20	650,000.000	670,605.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,500,000.000	1,503,780.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	2,500,000.000	2,554,625.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,350,000.000	1,419,187.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,430,000.000	1,536,563.600	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,310,000.000	1,438,786.100	

	CANADA 2.75 09/01/16	4,500,000.000	4,612,590.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	100,000.000	109,305.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	370,000.000	417,274.900	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,180,000.000	1,328,255.200	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,930,000.000	2,170,439.400	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,950,000.000	2,442,375.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	2,050,000.000	2,295,221.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	1,280,000.000	1,364,876.800	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,540,000.000	2,031,922.200	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,200,000.000	1,329,780.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,280,000.000	1,874,227.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,100,000.000	1,597,200.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,280,000.000	1,953,369.600	
カナダ・ドル 小計		34,510,000.000 (3,330,215,000)	39,067,976.200 (3,770,059,703)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	690,000.000	683,445.000	
	SINGAPORE 1.625 10/01/19	500,000.000	500,000.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	420,000.000	401,667.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	200,414.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	270,000.000	268,920.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	340,000.000	353,260.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	890,000.000	935,835.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,040,760.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	270,000.000	285,009.300	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	540,000.000	584,010.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	250,000.000	258,775.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,380,000.000	1,500,750.000	
シンガポール・ドル 小計		6,730,000.000 (610,343,700)	7,012,845.300 (635,994,940)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	7,400,000.000	7,880,408.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,500,000.000	6,352,720.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	5,650,000.000	5,843,851.500	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,210,000.000	5,589,869.600	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	8,080,000.000	9,739,712.800	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	6,060,000.000	6,586,008.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,080,000.000	9,374,092.800	
SWEDEN 5.0 12/01/20	5,640,000.000	7,096,812.000		
スウェーデン・クローナ 小計		50,620,000.000 (732,977,600)	58,463,474.700 (846,551,114)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	6,570,000.000	6,964,200.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	4,600,000.000	4,887,638.000	
	DENMARK 2.5 11/15/16	3,740,000.000	3,884,812.800	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,830,000.000	10,178,782.500	
	DENMARK 4.0 11/15/17	6,060,000.000	6,663,212.400	

	DENMARK 4.0 11/15/19	10,110,000.000	11,811,513.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	11,930,000.000	18,529,795.300	
	DENMARK 7.0 11/10/24	2,300,000.000	3,554,650.000	
デンマーク・クローネ	小計	54,140,000.000 (989,679,200)	66,474,604.000 (1,215,155,761)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.75 03/13/25	1,600,000.000	1,601,840.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	4,600,000.000	4,750,006.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	4,400,000.000	4,875,860.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	6,560,000.000	7,298,000.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	5,500,000.000	5,853,100.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	5,960,000.000	6,770,560.000	
ノルウェー・クローネ	小計	28,620,000.000 (436,741,200)	31,149,366.000 (475,339,325)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.25 07/25/19	2,000,000.000	2,070,900.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,600,000.000	2,644,720.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	3,930,000.000	4,109,208.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,570,000.000	2,767,761.500	
	POLAND 4.75 04/25/17	700,000.000	736,085.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	4,160,000.000	4,316,832.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	3,430,000.000	3,688,896.400	
	POLAND 5.25 10/25/20	1,880,000.000	2,134,552.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,110,000.000	2,381,346.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	900,000.000	1,144,026.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	2,180,000.000	2,592,892.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	1,780,000.000	2,092,479.000	
ポーランド・ズロチ	小計	28,240,000.000 (922,036,000)	30,679,697.900 (1,001,692,136)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.172 07/15/16	1,700,000.000	1,700,374.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,090,000.000	1,057,180.100	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,580,000.000	1,483,683.200	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	2,170,000.000	2,173,450.300	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	2,670,000.000	2,694,804.300	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	340,000.000	320,596.200	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,159,302.800	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	3,960,000.000	4,024,389.600	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	690,000.000	695,664.900	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	2,970,000.000	3,023,994.600	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,960,000.000	4,085,056.800	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,523,260.400	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	100,000.000	103,406.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,630,989.600	
マレーシア・リングギット	小計	25,370,000.000 (819,704,700)	25,676,152.800 (829,596,497)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	9,880,000.000	13,651,986.400	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	25,720,000.000	33,256,988.800	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	3,450,000.000	3,464,110.500	

	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	10,860,000.000	11,437,969.200	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/15/16	21,700,000.000	22,765,470.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	7,940,000.000	8,954,890.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	9,880,000.000	11,116,976.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	34,580,000.000	37,405,186.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	24,610,000.000	27,726,364.300	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	12,500,000.000	14,165,250.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	21,730,000.000	26,228,544.600	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	14,320,000.000	17,313,452.800	
	メキシコ・ペソ 小計	197,170,000.000 (1,532,010,900)	227,487,189.400 (1,767,575,462)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	330,000.000	331,221.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	920,000.000	964,058.800	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	820,000.000	876,170.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	540,000.000	579,690.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	450,000.000	497,493.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	560,000.000	711,334.400	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	830,000.000	874,737.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,000,000.000	1,188,410.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,350,000.000	1,597,725.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	850,000.000	1,021,700.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	315,000.000	484,170.750	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,247,000.000	1,471,460.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	830,000.000	870,670.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,100,000.000	1,567,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	1,130,000.000	1,239,045.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,720,000.000	1,989,954.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	980,000.000	1,097,600.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,000,000.000	1,356,900.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	710,000.000	1,087,755.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	950,000.000	908,703.500	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	350,000.000	308,994.000	
	BELGIUM 1.25 06/22/18	1,150,000.000	1,193,309.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,370,000.000	1,504,424.400	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	1,550,000.000	1,739,317.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	600,000.000	702,336.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,230,000.000	1,374,279.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	370,000.000	385,795.300	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	980,000.000	1,050,275.800	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	610,000.000	816,009.200	

BELGIUM 3.75 09/28/20	1,920,000.000	2,253,273.600	
BELGIUM 4.0 03/28/17	1,820,000.000	1,950,184.600	
BELGIUM 4.0 03/28/18	490,000.000	544,355.700	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,300,000.000	1,488,825.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,350,000.000	1,642,680.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	830,000.000	1,088,005.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,450,000.000	2,071,615.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,600,000.000	1,956,288.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,500,000.000	1,862,790.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	900,000.000	1,180,917.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,730,000.000	2,595,380.600	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,694,000.000	2,454,622.940	
BELGIUM 5.5 09/28/17	880,000.000	989,824.000	
BUNDESUBL 0.25 04/13/18	400,000.000	404,676.000	
BUNDESUBL 0.5 02/23/18	2,000,000.000	2,035,740.000	
BUNDESUBL 0.5 04/07/17	2,020,000.000	2,045,734.800	
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	2,300,000.000	2,348,760.000	
BUNDESUBL 0.5 10/13/17	2,230,000.000	2,266,148.300	
BUNDESUBL 04/17/20	2,200,000.000	2,185,502.000	
BUNDESUBL 1.0 10/12/18	900,000.000	932,769.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,500,000.000	2,413,250.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,100,000.000	1,116,797.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,300,000.000	1,388,660.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,070,000.000	2,209,393.800	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,810,000.000	1,921,387.400	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,600,000.000	1,711,408.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	300,000.000	325,536.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,510,000.000	2,730,127.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,000,000.000	2,206,400.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,800,000.000	3,097,388.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	1,900,000.000	2,105,390.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,400,000.000	1,566,950.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	800,000.000	900,400.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,500,000.000	1,807,200.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	880,000.000	1,062,784.800	

DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	2,710,000.000	3,096,717.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,800,000.000	3,202,640.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,000,000.000	2,354,400.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,500,000.000	2,040,000.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	2,910,000.000	3,319,728.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	3,940,000.000	4,174,705.800	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	3,000,000.000	3,403,200.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,550,000.000	3,923,105.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,150,000.000	3,110,835.000	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	2,450,000.000	2,551,675.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	3,200,000.000	3,483,232.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	2,960,000.000	3,350,720.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,400,000.000	2,146,340.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,080,000.000	1,547,532.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,900,000.000	2,928,660.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,550,000.000	2,560,910.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,700,000.000	2,687,360.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,450,000.000	2,211,975.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,722,564.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	860,000.000	1,429,578.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,090,000.000	1,755,554.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	200,000.000	200,904.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	70,000.000	62,063.400	
FINLAND 1.125 09/15/18	540,000.000	560,039.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	500,000.000	524,350.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	550,000.000	585,722.500	
FINLAND 1.875 04/15/17	500,000.000	518,225.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	390,000.000	423,270.900	
FINLAND 2.625 07/04/42	410,000.000	496,756.000	

FINLAND 2.75 07/04/28	480,000.000	559,272.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	580,000.000	666,855.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	560,000.000	658,252.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	500,000.000	542,500.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	500,000.000	638,875.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	400,000.000	468,060.000	
FR TREASURY 1.0 07/25/17	2,480,000.000	2,537,982.400	
FR TREASURY 2.5 07/25/16	1,510,000.000	1,551,947.800	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,337,808.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	1,400,000.000	1,300,446.000	
FRANCE OAT 05/25/20	700,000.000	687,505.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	1,720,000.000	1,771,634.400	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,720,000.000	1,778,566.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	240,000.000	247,812.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,870,000.000	3,048,456.600	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,500,000.000	3,673,040.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,450,000.000	3,783,511.500	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	1,700,000.000	1,872,975.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,450,000.000	2,686,547.500	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,290,000.000	4,762,329.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,300,000.000	3,733,785.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	3,100,000.000	3,571,107.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,440,000.000	1,757,808.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,000,000.000	4,647,000.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	4,128,000.000	4,751,988.480	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,070,000.000	2,523,744.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	6,370,000.000	6,814,689.700	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	3,450,000.000	4,088,664.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	3,260,000.000	3,751,216.800	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	3,450,000.000	3,839,574.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,470,000.000	2,133,411.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	950,000.000	1,387,104.500	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,420,000.000	3,280,092.200	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	4,690,000.000	5,422,296.600	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	2,950,000.000	3,244,439.500	

FRANCE OAT 4.25 10/25/18	4,400,000.000	5,013,800.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,260,000.000	4,109,360.400	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,400,000.000	3,533,520.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,100,000.000	3,064,908.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	4,440,000.000	4,736,059.200	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,900,000.000	4,277,645.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,600,000.000	4,114,786.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,800,000.000	4,082,932.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	2,005,696.000	
IRISH 0.8 03/15/22	500,000.000	495,650.000	
IRISH 2.0 02/18/45	460,000.000	404,800.000	
IRISH 2.4 05/15/30	440,000.000	457,270.000	
IRISH 3.4 03/18/24	750,000.000	868,200.000	
IRISH 3.9 03/20/23	500,000.000	596,900.000	
IRISH 4.4 06/18/19	790,000.000	914,701.500	
IRISH 4.5 04/18/20	840,000.000	993,568.800	
IRISH 4.5 10/18/18	980,000.000	1,116,857.000	
IRISH 5.0 10/18/20	780,000.000	951,366.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,050,000.000	1,403,199.000	
IRISH 5.5 10/18/17	300,000.000	336,804.000	
IRISH 5.9 10/18/19	740,000.000	907,832.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	300,000.000	294,336.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	600,000.000	566,388.000	
ITALY BTPS 1.5 08/01/19	3,450,000.000	3,532,696.500	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	800,000.000	700,488.000	
ITALY BTPS 2.5 05/01/19	1,000,000.000	1,062,490.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	900,000.000	918,018.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,400,000.000	1,551,480.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,730,000.000	2,987,766.600	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,700,000.000	3,066,390.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	1,100,000.000	1,244,650.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	1,200,000.000	1,245,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,624,320.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	3,700,000.000	4,199,759.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	7,310,000.000	7,738,366.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,400,000.000	2,772,240.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	2,660,000.000	3,034,794.000	

ITALY BTPS 4.25 02/01/19	1,920,000.000	2,154,432.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,310,000.000	2,642,871.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	3,600,000.000	4,078,080.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	5,882,000.000	6,478,434.800	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	1,820,000.000	2,100,644.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	5,900,000.000	6,684,700.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,200,000.000	2,623,786.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,310,000.000	2,784,705.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,720,000.000	2,044,787.600	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,480,000.000	1,792,428.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	4,650,000.000	5,538,150.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.000	2,239,686.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,450,000.000	1,874,618.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,620,000.000	1,966,842.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,600,000.000	3,237,650.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,100,000.000	2,757,510.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,880,000.000	2,495,512.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,900,000.000	2,513,130.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	5,530,000.000	6,085,212.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,910,000.000	3,812,682.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,360,000.000	2,954,554.800	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,700,000.000	2,129,658.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	2,146,590.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,850,000.000	4,035,885.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,560,000.000	3,633,664.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	950,000.000	1,400,585.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,970,000.000	3,020,207.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	1,300,000.000	1,304,316.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	900,000.000	825,255.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	2,500,000.000	2,586,725.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	1,930,000.000	2,014,244.500	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,500,000.000	1,605,435.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,480,000.000	1,608,552.800	

NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,640,000.000	1,818,874.800	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	2,280,000.000	2,373,844.800	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	950,000.000	1,088,538.500	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	770,000.000	948,393.600	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,600,000.000	1,870,560.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,490,000.000	1,733,615.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,240,000.000	1,518,876.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,400,000.000	2,021,684.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,300,000.000	1,859,650.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/16	800,000.000	833,520.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	1,290,000.000	1,447,896.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,490,000.000	1,721,546.000	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	1,250,000.000	1,366,500.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,250,000.000	1,853,250.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	500,000.000	508,875.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,500,000.000	1,432,290.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	750,000.000	682,800.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	1,800,000.000	1,933,614.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,200,000.000	2,312,530.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	1,500,000.000	1,653,990.000	
SPAIN 3.8 01/31/17	3,950,000.000	4,169,225.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	2,070,000.000	2,359,820.700	
SPAIN 4.0 04/30/20	2,570,000.000	2,913,994.500	
SPAIN 4.1 07/30/18	2,120,000.000	2,343,130.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,700,000.000	1,996,038.000	
SPAIN 4.25 10/31/16	3,100,000.000	3,269,105.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	2,120,000.000	2,412,348.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	1,800,000.000	2,127,510.000	
SPAIN 4.5 01/31/18	2,420,000.000	2,663,210.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	3,110,000.000	3,562,038.500	
SPAIN 4.65 07/30/25	2,100,000.000	2,560,740.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,160,000.000	1,472,040.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	1,580,000.000	1,921,043.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	1,800,000.000	2,132,910.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,300,000.000	1,712,100.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	1,400,000.000	1,808,100.000	

	SPAIN 5.15 10/31/44	900,000.000	1,215,756.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,800,000.000	2,254,572.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,310,000.000	2,826,862.500	
	SPAIN 5.5 07/30/17	2,960,000.000	3,275,092.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,700,000.000	2,370,752.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,906,050.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,350,000.000	1,810,552.500	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,950,000.000	2,697,162.000	
ユーロ 小計		433,586,000.000 (59,132,458,680)	509,403,828.570 (69,472,494,140)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	16,940,000.000	19,765,761.400	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,410,000.000	5,610,629.700	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,780,000.000	5,937,229.200	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	17,150,000.000	16,295,930.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	8,690,000.000	7,468,186.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	6,020,000.000	5,699,013.600	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	12,500,000.000	12,691,375.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	2,500,000.000	2,393,650.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	5,100,000.000	4,920,939.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	2,000,000.000	1,963,800.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	7,460,000.000	7,330,419.800	
南アフリカ・ランド 小計		93,550,000.000 (917,725,500)	90,076,933.700 (883,654,720)	
国債証券 合計		155,303,691,480 (155,303,691,480)	171,703,101,848 (171,703,101,848)	
合計		155,303,691,480 (155,303,691,480)	171,703,101,848 (171,703,101,848)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 114銘柄	41.49%	42.72%
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	8.27%	8.52%
オーストラリア・ドル	国債証券 18銘柄	1.59%	1.64%
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	2.13%	2.20%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.36%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.48%	0.49%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.69%	0.71%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.27%	0.28%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.57%	0.58%
マレーシア・リングgit	国債証券 14銘柄	0.47%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	1.00%	1.03%
ユーロ	国債証券 242銘柄	39.29%	40.46%
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	0.50%	0.51%

(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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,428,844,217	248,464,699
コール・ローン		44,695,119	658,287,423
株式		38,353,170,787	36,292,364,793
投資信託受益証券		297,864,319	274,130,570
投資証券		91,615,781	96,583,938
派生商品評価勘定		20,925,632	544,512
未収入金		76,392	74,409
未収配当金		24,764,588	201,554,902
差入委託証拠金		421,436,133	112,423,029
流動資産合計		40,683,392,968	37,884,428,275
資産合計		40,683,392,968	37,884,428,275
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,359,020	8,084,635
未払金		57,551,435	-
未払解約金		11,211,000	896,208,000
流動負債合計		71,121,455	904,292,635
負債合計		71,121,455	904,292,635
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,367,301,761	34,877,056,190
剰余金			
剰余金又は欠損金()		1,244,969,752	2,103,079,450
元本等合計		40,612,271,513	36,980,135,640
純資産合計		40,612,271,513	36,980,135,640
負債純資産合計		40,683,392,968	37,884,428,275

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</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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	40,840,815,210円	39,367,301,761円
	同期中追加設定元本額	4,190,227,870円	5,795,099,854円
	同期中一部解約元本額	5,663,741,319円	10,285,345,425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 >	425,843,375円	624,375,460円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	352,069,381円	471,911,104円
	D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国10）	15,920,298円	19,255,615円
	D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国20）	40,474,103円	52,387,010円
	D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国30）	110,434,511円	143,956,918円
	投資のソムリエ	163,231,034円	993,644,405円
	クルーズコントロール	635,058,506円	128,593,567円
	投資のソムリエ< D C 年金 >	2,424,454円	13,059,934円
	D I A M 8 資産バランスマ ンドN< D C 年金 >	29,770,153円	49,802,281円
	クルーズコントロール< D C 年 金 >	139,333円	27,835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）	7,257,789,094円	6,483,405,232円
	新興国株式パッシブ私募ファン ド（適格機関投資家限定）	3,074,267,724円	192,233,956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）	2,127,223,667円	2,125,053,586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）	15,436,504,597円	14,453,464,848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）	9,696,151,531円	9,125,884,439円
	計	39,367,301,761円	34,877,056,190円
2 .	受益権の総数	39,367,301,761口	34,877,056,190口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	188,136,370	3,390,798,067
投資信託受益証券	11,347,956	3,193,243
投資証券	1,496,459	2,292,501
合計	178,284,873	3,396,283,811

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年4月19日から平成27年1月13日まで及び平成27年4月21日から平成27年7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	330,420,160	-	330,400,000	20,160	-	-	-	-
アメリカ・ドル	330,420,160	-	330,400,000	20,160	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	159,247,660	-	159,237,000	10,660
アメリカ・ドル	-	-	-	-	159,247,660	-	159,237,000	10,660
合計	330,420,160	-	330,400,000	20,160	159,247,660	-	159,237,000	10,660

（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27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 先物取引 買 建	1,504,858,799	-	1,523,405,251	18,546,452	726,028,713	-	718,499,250	7,529,463
合計	1,504,858,799	-	1,523,405,251	18,546,452	726,028,713	-	718,499,250	7,529,463

(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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.0316円	1.0603円
(1万口当たり純資産額)	(10,316円)	(10,603円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年7月13日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,373	9.160	159,136.680	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	56,600	6.940	392,804.000	
	CREDICORP LTD	5,049	139.560	704,638.440	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	42,325	8.730	369,497.250	
	SOUTHERN COPPER CORP	13,580	28.480	386,758.400	
	LUKOIL SPON ADR	40,874	43.670	1,784,967.580	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	56,215	1.650	92,754.750	
	OAQ GAZPROM ADR	470,714	5.088	2,394,992.830	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	66,427	6.700	445,060.900	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	84,200	1.164	98,008.800	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	63,693	5.555	353,814.610	
	SISTEMA JSFC GDR	15,837	8.130	128,754.810	
	NOVATEK OAQ GDR	7,565	101.500	767,847.500	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	44,174	16.200	715,618.800	
	ROSTELECOM SPON ADR	13,980	9.200	128,616.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	93,455	3.983	372,231.260	
	URALKALI PJSC-SPON GDR	11,685	12.800	149,568.000	
	SEVERSTAL GDR	17,468	10.250	179,047.000	
	TATNEFT GDR	19,847	30.700	609,302.900	
	VTB BANK OJSC GDR	209,238	2.575	538,787.850	
DP WORLD LTD	11,999	21.650	259,778.350		
MAGNIT PJSC GDR	21,128	52.630	1,111,966.640		
FEDERAL HYDROGENERATING ADR	97,416	0.947	92,252.950		
SBERBANK ADR	219,551	5.137	1,127,833.480		
MEGAFON PJSC GDR	7,699	13.950	107,401.050		
アメリカ・ドル 小計		1,708,092		13,471,440.830 (1,650,251,503)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	76,779	14.900	1,144,007.100	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	77,215	6.800	525,062.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	165,316	7.600	1,256,401.600	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	48,127	10.600	510,146.200	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	265,447	7.600	2,017,397.200	
	ARABTEC HOLDING CO	158,592	2.490	394,894.080	

	ALDAR PROPERTIES PJSC	225,829	2.610	589,413.690	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	190,449	1.920	365,662.080	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	140,177	3.220	451,369.940	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,347,931		7,254,353.890 (242,367,964)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	102,149	1,001.800	102,332,868.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	12,744	881.750	11,237,022.000	
	ASIAN PAINTS LTD	22,408	795.300	17,821,082.400	
	EICHER MOTORS LTD	796	20,765.050	16,528,979.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	30,014	1,249.550	37,503,993.700	
	SHREE CEMENT LTD	621	10,971.850	6,813,518.850	
	ICICI BANK LTD	83,076	313.150	26,015,249.400	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,701	1,882.150	5,083,687.150	
	STATE BANK OF INDIA LTD	112,811	270.550	30,521,016.050	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,805	1,718.450	8,257,152.250	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	19,577	455.600	8,919,281.200	
	TATA STEEL LTD	25,639	280.900	7,201,995.100	
	TATA MOTORS LTD	60,977	401.900	24,506,656.300	
	JSW STEEL LTD	6,621	829.900	5,494,767.900	
	TATA POWER CO LTD	97,018	71.500	6,936,787.000	
	NESTLE INDIA LTD	1,704	5,963.400	10,161,633.600	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	42,288	268.600	11,358,556.800	
	GAIL INDIA LTD	28,769	360.900	10,382,732.100	
	VEDANTA LTD	64,847	146.200	9,480,631.400	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	64,693	293.900	19,013,272.700	
	GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	1,065	6,064.650	6,458,852.250	
	LUPIN LTD	17,906	1,871.150	33,504,811.900	
	ACC LTD	3,257	1,472.200	4,794,955.400	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	117,374	1,283.350	150,631,922.900	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	44,467	361.150	16,059,257.050	
	INFOSYS LTD	144,500	937.500	135,468,750.000	
	WIPRO LTD	49,951	548.650	27,405,616.150	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,902	900.250	53,926,775.500	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,049	1,328.550	8,036,398.950	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,009	925.650	41,662,580.850	
	DABUR INDIA LTD	44,319	282.250	12,509,037.750	
	HERO MOTOCORP LTD	3,870	2,571.550	9,951,898.500	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,477	3,750.500	35,543,488.500	
BHARTI AIRTEL LTD	95,477	419.300	40,033,506.100		
UNITED SPIRITS LTD	4,252	3,488.250	14,832,039.000		

	SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	66,811	901.550	60,233,457.050	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	2,562	1,876.450	4,807,464.900	
	AUROBINDO PHARMA LTD	9,787	1,452.850	14,219,042.950	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	32,302	84.700	2,735,979.400	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	14,995	504.050	7,558,229.750	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	10,890	939.600	10,232,244.000	
	CIPLA LTD/INDIA	26,746	648.000	17,331,408.000	
	LARSEN & TOUBRO LTD	24,486	1,876.400	45,945,530.400	
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,609	3,129.800	8,165,648.200	
	BOSCH LTD	615	23,072.550	14,189,618.250	
	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	37,015	2,474.350	91,588,065.250	
	NTPC LTD	84,783	129.850	11,009,072.550	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,020	940.550	4,721,561.000	
	AMBUJA CEMENTS LTD	55,970	241.950	13,541,941.500	
	BHARAT FORGE LTD	7,677	1,071.500	8,225,905.500	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	85,994	104.600	8,994,972.400	
	ITC LTD	176,711	309.900	54,762,738.900	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	20,287	518.700	10,522,866.900	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	84,596	66.750	5,646,783.000	
	SIEMENS INDIA LTD	5,734	1,440.950	8,262,407.300	
	UNITED BREWERIES LTD	5,209	987.650	5,144,668.850	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	8,780	1,169.300	10,266,454.000	
	TECH MAHINDRA LTD	18,673	474.000	8,851,002.000	
	CAIRN INDIA LTD	32,844	168.800	5,544,067.200	
	IDEA CELLULAR LTD	81,695	174.900	14,288,455.500	
	MARICO LTD	16,300	430.100	7,010,630.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	257.750	6,640,928.750	
	DLF LTD	14,996	114.650	1,719,291.400	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	49,321	317.100	15,639,689.100	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	25,236	284.150	7,170,809.400	
	BAJAJ AUTO LTD	6,084	2,466.800	15,008,011.200	
	OIL INDIA LTD	7,865	438.900	3,451,948.500	
	COAL INDIA LTD	53,400	419.950	22,425,330.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	20,882	276.850	5,781,181.700	
	BHARTI INFRATEL LTD	34,521	437.550	15,104,663.550	
	インド・ルビー 小計	2,588,294		1,513,132,843.050 (2,950,609,044)	
インドネシア・ルピア	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	25,575.000	895,125,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	122,001	18,800.000	2,293,618,800.000	

	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	372,500	6,550.000	2,439,875,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	120,900	40,200.000	4,860,180,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,608,100	6,675.000	10,734,067,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,006,600	2,875.000	11,518,975,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	516,600	2,675.000	1,381,905,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	35,500	46,000.000	1,633,000,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	103,400	21,050.000	2,176,570,000.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	734,100	1,760.000	1,292,016,000.000	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	30,800	7,250.000	223,300,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	4,140.000	1,202,322,240.000	
	BANK MANDIRI	712,500	10,000.000	7,125,000,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	169,100	17,300.000	2,925,430,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	882,900	10,475.000	9,248,377,500.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	913,700	3,980.000	3,636,526,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	602,600	5,450.000	3,284,170,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,632,000	1,640.000	2,676,480,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	238,200	11,200.000	2,667,840,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	976,100	13,300.000	12,982,130,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	188,000	3,275.000	615,700,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,601,200	1,200.000	1,921,440,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	396,300	1,135.000	449,800,500.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	1,860.000	871,410,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	5,700.000	1,068,750,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	1,785.000	1,058,148,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	635.000	692,467,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	84,500	12,125.000	1,024,562,500.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	151,500	8,500.000	1,287,750,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	393,500	2,920.000	1,149,020,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	19,257,317		95,335,956,540.000 (877,090,801)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	8,193	97.500	798,817.500	
	QATAR NATIONAL BANK	13,406	186.400	2,498,878.400	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	5,557	55.500	308,413.500	
	OOREDOO QSC	5,297	84.200	446,007.400	

	DOHA BANK QSC	12,089	52.700	637,090.300	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,398	222.600	533,794.800	
	INDUSTRIES QATAR QSC	11,629	135.500	1,575,729.500	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	4,485	106.300	476,755.500	
	MASRAF AL RAYAN	28,618	45.500	1,302,119.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	8,004	50.600	405,002.400	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	48,273	17.600	849,604.800	
	GULF INTERNATIONAL SERVICES	3,626	76.600	277,751.600	
	VODAFONE QATAR	26,910	16.400	441,324.000	
カタール・リアル	小計	178,485		10,551,288.700 (355,578,429)	
コロンビア・ペソ	ALMACENES EXITO SA	18,289	22,000.000	402,358,000.000	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	26,730	7,240.000	193,525,200.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	6,465	36,180.000	233,903,700.000	
	ISAGEN SA ESP	62,351	2,765.000	172,400,515.000	
	ECOPETROL SA	367,811	1,625.000	597,692,875.000	
	BANCO DAVIVIENDA SA-PREF	7,054	26,300.000	185,520,200.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	7,333	35,800.000	262,521,400.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	248,658	1,265.000	314,552,370.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,062	9,260.000	343,194,120.000	
	GRUPO ARGOS SA	19,665	16,720.000	328,798,800.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,515	27,700.000	983,765,500.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	17,220	36,400.000	626,808,000.000	
コロンビア・ペソ	小計	854,153		4,645,040,680.000 (212,742,863)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	12,300	177.500	2,183,250.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	36.750	3,167,850.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	298,500	17.200	5,134,200.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	121,800	153.000	18,635,400.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	686,125	11.600	7,959,050.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	55,700	187.000	10,415,900.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	904,300	2.340	2,116,062.000	
	IRPC PCL NVDR	819,000	4.320	3,538,080.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	115,000	24.500	2,817,500.000	
	BANGKOK BANK PCL NVDR	25,500	178.000	4,539,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	234,500	22.500	5,276,250.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	82,000	242.000	19,844,000.000	

	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	361,920	6.400	2,316,288.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	32,100	84.750	2,720,475.000	
	PTT PCL	78,700	341.000	26,836,700.000	
	THAI UNION FROZEN PROD-NVDR	112,400	20.300	2,281,720.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	7,900	512.000	4,044,800.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	33,100	309.000	10,227,900.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	22,400	512.000	11,468,800.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	87,000	187.000	16,269,000.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	124,400	49.000	6,095,600.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	268,400	20.600	5,529,040.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	197.000	5,969,100.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	125,510	30.000	3,765,300.000	
	THAI OIL PCL NVDR	64,600	54.500	3,520,700.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	85.750	3,567,200.000	
	CP ALL PCL NVDR	353,700	46.500	16,447,050.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	10.100	5,204,530.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	103,245	102.000	10,530,990.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	75,722	27.000	2,044,494.000	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	27.000	1,483,191.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	127,208	66.500	8,459,332.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	78,800	22.200	1,749,360.000	
	タイ・パーツ 小計	6,140,163		236,158,112.000 (850,169,203)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,156	5,401.000	6,243,556.000	
	CEZ	13,038	572.600	7,465,558.800	
	チェコ・コルナ 小計	14,194		13,709,114.800 (68,956,847)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	4,972,380	33.170	164,933,844.600	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,604	28,894.000	75,239,976.000	
	BANCO DE CHILE	1,692,507	70.550	119,406,368.850	
	EMPRESAS CMPC SA	108,611	1,685.400	183,052,979.400	
	EMPRESAS COPEC SA	34,651	6,806.100	235,838,171.100	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	7,227.200	95,326,768.000	
	ENTEL CHILE SA	8,743	7,018.800	61,365,368.400	
	ENDESA CHILE	268,589	908.980	244,142,029.220	
	ENERSIS SA	1,476,634	204.840	302,473,708.560	

	COLBUN SA	555,279	185.990	103,276,341.210	
	AGUAS ANDINAS SA	180,079	359.870	64,805,029.730	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,098.800	44,872,344.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,045	4,514.000	104,025,130.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	7,931	9,232.500	73,222,957.500	
	SACI FALABELLA	35,320	4,370.000	154,348,400.000	
	CORPBANCA	11,078,151	6.849	75,874,256.190	
	VINA CONCHA Y TORO SA	39,636	1,148.100	45,506,091.600	
	CENCOSUD SA	87,695	1,466.300	128,587,178.500	
	SONDA SA	51,765	1,251.000	64,758,015.000	
	AES GENER SA	209,506	362.900	76,029,727.400	
	チリ・ペソ 小計	20,867,696		2,417,084,685.260 (457,795,839)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	165,854	7.770	1,288,685.580	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	14,563	25.550	372,084.650	
	ARCELIK	15,880	14.300	227,084.000	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	48,763	5.140	250,641.820	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	103,641	4.270	442,547.070	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	34.700	193,764.800	
	KOC HOLDING AS	54,199	12.350	669,357.650	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	32,248	4.250	137,054.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	52,710	3.160	166,563.600	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	12,826	19.200	246,259.200	
	TURK HAVA YOLLARI	44,435	9.290	412,801.150	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	66,860	12.550	839,093.000	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	183,059	8.420	1,541,356.780	
	TURKIYE IS BANKASI	128,792	5.720	736,690.240	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	9,552	68.550	654,789.600	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	11,216	17.100	191,793.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	50,659	3.950	200,103.050	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	77,557	10.050	779,447.850	
	COCA-COLA ICECEK AS	5,353	44.400	237,673.200	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	16,151	48.000	775,248.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	57,549	4.310	248,036.190	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	11,519	22.600	260,329.400	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	48,926	12.550	614,021.300	

	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	31,721	6.970	221,095.370	
トルコ・リラ 小計		1,249,617		11,706,521.100 (537,095,188)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	10,937	4,255.000	46,536,935.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,094	14,355.000	44,414,370.000	
	OTP BANK NYRT	17,721	5,755.000	101,984,355.000	
ハンガリー・フォロント 小計		31,752		192,935,660.000 (84,235,710)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	594,800	36.850	21,918,380.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	163,780	57.250	9,376,405.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	59,536	94.500	5,626,152.000	
	AYALA CORP	16,503	747.000	12,327,741.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	190,100	22.000	4,182,200.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	13.100	4,609,235.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,470	2,384.000	5,888,480.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	110.400	4,491,072.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	201,450	70.500	14,202,225.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	37,710	189.000	7,127,190.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	22,601	90.000	2,034,090.000	
	BDO UNIBANK INC	124,238	103.100	12,808,937.800	
	MEGAWORLD CORP	887,000	4.750	4,213,250.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	7,560	2,830.000	21,394,800.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	619,475	20.150	12,482,421.250	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	65,700	185.000	12,154,500.000	
	SM INVESTMENTS CORP	12,462	862.000	10,742,244.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	748,500	7.280	5,449,080.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	847,500	4.690	3,974,775.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	43.400	5,333,860.000	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,930	1,315.000	7,797,950.000		
フィリピン・ペソ 小計		5,122,745		188,134,988.050 (511,727,167)	
ブラジル・リアル	BRF SA	51,692	69.260	3,580,187.920	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA	26,630	9.530	253,783.900	
	VALE SA	103,627	17.110	1,773,057.970	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	35.350	283,436.300	
	VALE SA-PREF A	146,296	14.410	2,108,125.360	
	RAIA DROGASIL SA	16,200	41.440	671,328.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	61,400	9.580	588,212.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	8.600	199,950.000	

BANCO DO BRASIL SA	65,200	23.760	1,549,152.000	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	37,962	4.100	155,644.200	
AES TIETE SA	7,100	17.990	127,729.000	
INVESTIMENTOS ITAU SA	280,617	8.980	2,519,940.660	
LOJAS AMERICANAS SA	35,595	18.150	646,049.250	
LOJAS AMERICANAS SA	14,925	14.000	208,950.000	
GERDAU SA	71,130	6.740	479,416.200	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	11,806	69.480	820,280.880	
PETROLEO BRASILEIRO SA	238,910	13.270	3,170,335.700	
PETROLEO BRASILEIRO SA	299,012	11.790	3,525,351.480	
SOUZA CRUZ SA	27,800	24.300	675,540.000	
KROTON EDUCACIONAL SA	109,968	11.650	1,281,127.200	
CCR SA	71,320	15.530	1,107,599.600	
WEG SA	44,140	19.720	870,440.800	
BANCO BRADESCO SA PREF	197,378	28.460	5,617,377.880	
BANCO BRADESCO SA	59,592	27.660	1,648,314.720	
NATURA COSMETICOS SA	14,400	28.180	405,792.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	43,206	4.540	196,155.240	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	25,600	15.830	405,248.000	
CPFL ENERGIA SA	12,947	19.300	249,877.100	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	216,008	34.680	7,491,157.440	
PORTO SEGURO SA	9,400	40.800	383,520.000	
FIBRIA CELULOSE SA	19,990	41.230	824,187.700	
B2W CIA DIGITAL	10,300	21.320	219,596.000	
BRASKEM SA	14,130	13.300	187,929.000	
TRACTEBEL ENERGIA SA	12,870	36.110	464,735.700	
LOCALIZA RENT A CAR	10,205	29.810	304,211.050	
TELEFONICA BRASIL S.A.	25,728	43.000	1,106,304.000	
LOJAS RENNER SA	9,500	115.670	1,098,865.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	11.650	210,865.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	29,352	66.770	1,959,833.040	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	6,800	23.420	159,256.000	
TOTVS SA	9,900	37.540	371,646.000	
EMBRAER SA	51,360	23.640	1,214,150.400	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	11,700	19.900	232,830.000	
M DIAS BRANCO SA	3,300	81.000	267,300.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	6,800	21.190	144,092.000	
ODONTOPREV SA	22,300	11.100	247,530.000	

BR MALLS PARTICIPACOES SA	30,600	14.410	440,946.000	
JBS SA	53,600	15.900	852,240.000	
OI SA-PREFERENCE	25,192	5.310	133,769.520	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	56,249	11.190	629,426.310	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,898	16.800	468,686.400	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	5,500	47.900	263,450.000	
BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL	18,300	8.700	159,210.000	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	18.000	435,600.000	
DURATEX SA	17,637	7.480	131,924.760	
SUL AMERICA SA	15,448	15.240	235,427.520	
HYPERMARCAS SA	29,900	21.150	632,385.000	
BM&FBOVESPA SA	130,000	11.790	1,532,700.000	
QUALICORP SA	17,800	22.000	391,600.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	32,900	16.850	554,365.000	
CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,159	35.150	708,588.850	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	17,300	7.270	125,771.000	
CIELO SA	67,536	44.230	2,987,117.280	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	53,200	33.510	1,782,732.000	
AMBEV SA	368,695	19.500	7,189,552.500	
VIA VAREJO SA	9,300	10.040	93,372.000	
KLABIN SA	43,400	19.430	843,262.000	
ブラジル・リアル 小計	3,658,278		72,598,537.830 (2,814,645,311)	
ポーランド・ズロチ				
BANK MILLENNIUM SA	43,979	5.980	262,994.420	
MBANK	1,021	395.050	403,346.050	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,084	90.000	187,560.000	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,275	103.500	1,063,462.500	
BANK PEKAO SA	10,152	164.500	1,670,004.000	
ORANGE POLSKA SA	55,813	7.740	431,992.620	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	25,917	72.810	1,887,016.770	
LPP SA	94	7,050.000	662,700.000	
BANK ZACHODNI WBK SA	2,841	304.000	863,664.000	
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	64,318	31.020	1,995,144.360	
CCC SA	1,709	179.000	305,911.000	
SYNTHOS SA	60,398	4.510	272,394.980	

	EUROCASH SA	7,580	37.440	283,795.200	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	29.300	233,726.100	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	147,281	6.770	997,092.370	
	CYFROWY POLSAT SA	14,022	22.900	321,103.800	
	GRUPA AZOTY SA	4,565	78.660	359,082.900	
	ENEA SA	18,176	15.210	276,456.960	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	61,257	17.600	1,078,123.200	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	4.160	343,299.840	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	4,395	450.000	1,977,750.000	
	GETIN NOBLE BANK SA	89,202	1.200	107,042.400	
	ALIOR BANK SA	4,463	87.500	390,512.500	
	ENERGA SA	16,930	21.470	363,487.100	
ポーランド・ズロチ	小計	736,973		16,737,663.070 (546,484,699)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	174,000	5.630	979,620.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	30,100	10.200	307,020.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	378,200	5.400	2,042,280.000	
	DIGI.COM BHD	269,700	5.530	1,491,441.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	6.200	428,544.000	
	RHB CAPITAL BHD	38,900	7.400	287,860.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	43,035	3.300	142,015.500	
	GAMUDA BHD	113,900	4.820	548,998.000	
	GENTING BHD	181,600	8.140	1,478,224.000	
	YTL CORP BHD	303,210	1.550	469,975.500	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,400	15.140	278,576.000	
	HONG LEONG BANK BHD	43,800	13.480	590,424.000	
	IJM CORP BHD	128,180	6.790	870,342.200	
	IOI CORP BHD	212,813	4.250	904,455.250	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	31,000	22.680	703,080.000	
	MALAYAN BANKING BHD	346,075	9.200	3,183,890.000	
	LAFARGE MALAYSIA BHD	27,200	9.000	244,800.000	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	85,100	4.310	366,781.000	
	MISC BHD	88,480	8.030	710,494.400	
	PPB GROUP BHD	38,000	15.400	585,200.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,300	20.500	395,650.000	
	PETRONAS GAS BHD	50,400	21.140	1,065,456.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	227,100	4.200	953,820.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	62.700	714,780.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	102,700	6.750	693,225.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	270,550	12.540	3,392,697.000	
	UMW HOLDINGS BHD	40,300	10.220	411,866.000	

	DIALOG GROUP BHD	292,144	1.570	458,666.080	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	196,830	18.820	3,704,340.600	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	125,463	1.560	195,722.280	
	AIRASIA BHD	83,400	1.340	111,756.000	
	SIME DARBY BERHAD	254,300	8.540	2,171,722.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	201,000	6.310	1,268,310.000	
	BUMI ARMADA BHD	195,350	1.100	214,885.000	
	MAXIS BHD	141,300	6.440	909,972.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,300	6.200	1,303,860.000	
	SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	248,600	2.380	591,668.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	142,900	3.020	431,558.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	195,500	5.880	1,149,540.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	1.630	194,296.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	71,900	4.230	304,137.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	81,639	1.840	150,215.760	
	マレーシア・リンギット 小計	5,902,389		37,402,163.570 (1,208,463,906)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	209,500	32.140	6,733,330.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	37,100	127.030	4,712,813.000	
	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV	31,900	49.030	1,564,057.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	13,900	186.090	2,586,651.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	134,600	29.240	3,935,704.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	193,300	112.000	21,649,600.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	123,300	42.580	5,250,114.000	
	GRUMA SAB DE CV	15,500	199.120	3,086,360.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,300	174.610	3,544,583.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	39,400	73.060	2,878,564.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	196,700	89.430	17,590,881.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	72,888	44.060	3,211,445.280	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	11,990	256.780	3,078,792.200	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	126,600	35.800	4,532,280.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	16,200	231.380	3,748,356.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	304,452	44.230	13,465,911.960	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,562,278	16.310	41,790,754.180	

	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	170,000	35.920	6,106,400.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	33,800	89.920	3,039,296.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	411,300	38.920	16,007,796.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,200	115.700	3,031,340.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	51,600	21.010	1,084,116.000	
	GENTERA SAB DE CV	90,100	27.880	2,511,988.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	29,000	44.700	1,296,300.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	43,400	34.500	1,497,300.000	
メキシコ・ペソ 小計		4,965,308		177,934,732.620 (1,382,552,872)	
ユーロ	NATIONAL BANK OF GREECE	59,981	1.200	71,977.200	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	21.400	75,285.200	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	8.200	82,032.800	
	FF GROUP	3,130	24.200	75,746.000	
	EUROBANK ERGASIAS	163,082	0.144	23,483.800	
	OPAP SA	8,501	7.810	66,392.810	
	JUMBO SA	5,623	7.420	41,722.660	
ユーロ 小計		253,839		436,640.470 (59,549,027)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,090	17,600.000	124,784,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,067	86,700.000	265,908,900.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,705	286,500.000	774,982,500.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	3,798	56,400.000	214,207,200.000	
	COWAY CO LTD	4,199	93,000.000	390,507,000.000	
	KT&G CORP	8,345	98,200.000	819,479,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,432	76,700.000	109,834,400.000	
	KOREA GAS CORP	1,927	43,650.000	84,113,550.000	
	CJ CORP	1,220	279,500.000	340,990,000.000	
	DAUM KAKAO CORP	1,937	130,500.000	252,778,500.000	
	DOOSAN INFRACORE CO.,LTD	10,180	9,700.000	98,746,000.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	7,274	13,200.000	96,016,800.000	
	SK TELECOM CO LTD	688	256,000.000	176,128,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	1,948	80,300.000	156,424,400.000	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	15,692	14,350.000	225,180,200.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,152	209,500.000	241,344,000.000	
	LG UPLUS CORP	15,104	10,400.000	157,081,600.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	24,850.000	100,642,500.000		
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	6,539	6,150.000	40,214,850.000		

DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	25,050.000	108,992,550.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	750	710,000.000	532,500,000.000	
LG CHEM LTD	3,531	259,000.000	914,529,000.000	
LG CHEM LTD	726	163,000.000	118,338,000.000	
LS CORP	1,350	44,200.000	59,670,000.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,008	51,000.000	51,408,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	33,663	39,150.000	1,317,906,450.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	4,681	70,200.000	328,606,200.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	6,704	6,840.000	45,855,360.000	
S-OIL CORP	3,342	62,300.000	208,206,600.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,261	19,900.000	164,393,900.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,188	51,300.000	214,844,400.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,258	268,500.000	337,773,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,383	128,000.000	305,024,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,017	120,000.000	362,040,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,382	195,500.000	1,052,181,000.000	
SK HYNIX INC	45,831	40,850.000	1,872,196,350.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,979	40,500.000	242,149,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,758	85,300.000	149,957,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	12,070	124,000.000	1,496,680,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	987	67,100.000	66,227,700.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,487	62,800.000	407,383,600.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	20,219	13,350.000	269,923,650.000	
KCC CORP	444	471,000.000	209,124,000.000	
KIA MOTORS CORP	20,853	40,800.000	850,802,400.000	
KOREA ZINC CO LTD	662	510,000.000	337,620,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	20,422	47,400.000	968,002,800.000	
HANWHA CORP	3,206	49,100.000	157,414,600.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,427	39,750.000	96,473,250.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	118,500.000	177,750,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	533	185,500.000	98,871,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,410	70,800.000	99,828,000.000	
KT CORP	2,020	29,300.000	59,186,000.000	
LG ELECTRONICS INC	7,959	44,750.000	356,165,250.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	51	1,918,000.000	97,818,000.000	
HANSSEM CO LTD	699	284,500.000	198,865,500.000	
LG CORP	7,791	57,000.000	444,087,000.000	

NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	11,500.000	133,285,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	26,800.000	105,726,000.000	
NAVER CORP	2,212	612,000.000	1,353,744,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	24,150.000	78,994,650.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,195	139,500.000	166,702,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,479	61,100.000	212,566,900.000	
DOOSAN CORP	404	109,000.000	44,036,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,041	171,500.000	350,031,500.000	
KANGWON LAND INC	9,398	38,650.000	363,232,700.000	
POSCO	5,510	208,000.000	1,146,080,000.000	
SAMSUNG C&T CORP	10,087	64,400.000	649,602,800.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,454	108,500.000	483,259,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,214	50,300.000	211,964,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,630	1,259,000.000	10,865,170,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	10,489	17,950.000	188,277,550.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,606	940,000.000	1,509,640,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	463	233,500.000	108,110,500.000	
HYOSUNG CORP	1,783	143,500.000	255,860,500.000	
ORION CORP	296	1,160,000.000	343,360,000.000	
YUHAN CORP	699	252,000.000	176,148,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	1,532	210,500.000	322,486,000.000	
HALLA CLIMATE CONTROL	3,292	36,150.000	119,005,800.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	28,400.000	162,164,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,288	48,700.000	208,825,600.000	
LG DISPLAY CO LTD	17,845	24,900.000	444,340,500.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	8,260.000	84,912,800.000	
CELLTRION INC	5,006	76,100.000	380,956,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	21,798	28,850.000	628,872,300.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,421	188,500.000	267,858,500.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,841	46,550.000	85,698,550.000	
LOTTE SHOPPING CO	846	229,000.000	193,734,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,149	102,500.000	630,272,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,553	382,000.000	975,246,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	657	178,500.000	117,274,500.000	
SAMSUNG CARD CO	2,256	37,700.000	85,051,200.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,199	109,000.000	566,691,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	609	410,500.000	249,994,500.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,826	113,000.000	206,338,000.000	

	LG INNOTEK CO LTD	945	94,400.000	89,208,000.000	
	SK C&C CO LTD	1,473	290,000.000	427,170,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	30,652	35,600.000	1,091,211,200.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,167	91,500.000	106,780,500.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,381	78,800.000	266,422,800.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	16,642	13,800.000	229,659,600.000	
	HANMI PHARM CO LTD	374	560,000.000	209,440,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	17,057	8,170.000	139,355,690.000	
	E-MART CO LTD	1,584	233,000.000	369,072,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	11,300.000	152,990,700.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	5,435	40,550.000	220,389,250.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,329	252,000.000	586,908,000.000	
	WOORI BANK	27,755	9,310.000	258,399,050.000	
	CHEIL INDUSTRIES INC	1,990	178,000.000	354,220,000.000	
韓国・ウォン 小計		649,447		48,424,899,300.000 (5,254,101,575)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	103,000	11.360	1,170,080.000	
	JIANGSU EXPRESS	110,000	9.910	1,090,100.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	128,000	8.270	1,058,560.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	480,000	95.850	46,008,000.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	90,500	26.000	2,353,000.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	192,000	3.430	658,560.000	
	BEIJING ENTERPRISES	40,500	55.100	2,231,550.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	272,000	9.410	2,559,520.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	176,000	7.160	1,260,160.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	142,000	5.100	724,200.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	56,500	85.850	4,850,525.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	128,000	7.620	975,360.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	63,400	19.900	1,261,660.000	
	NEW WORLD CHINA LAND LTD	200,000	4.340	868,000.000	
	CNOOC LTD	1,403,000	10.140	14,226,420.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	242,000	11.420	2,763,640.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	320,000	7.480	2,393,600.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	313,120	25.900	8,109,808.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	220,888	22.100	4,881,624.800	
	CITIC LTD	164,000	13.760	2,256,640.000	

BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	8.500	1,105,000.000	
LENOVO GROUP LTD	534,000	9.760	5,211,840.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,658,000	8.080	13,396,640.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	452,742	11.220	5,079,765.240	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	122,590	24.550	3,009,584.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,007,200	6.220	12,484,784.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	56,000	45.650	2,556,400.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	232,000	7.080	1,642,560.000	
COSCO PACIFIC LTD	138,000	9.750	1,345,500.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	696,180	1.510	1,051,231.800	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	88,000	29.600	2,604,800.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	296,000	3.220	953,120.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	21.500	1,677,000.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	126,000	11.880	1,496,880.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	385,000	3.580	1,378,300.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	68,000	21.500	1,462,000.000	
BYD CO LTD	48,000	38.150	1,831,200.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,104,000	4.370	4,824,480.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	136,000	10.840	1,474,240.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	740,000	2.450	1,813,000.000	
SINOTRANS LTD	147,000	5.120	752,640.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	204,000	13.140	2,680,560.000	
GOLDIN PROPERTIES HOLDINGS LTD	104,000	6.960	723,840.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	265,192	16.500	4,375,668.000	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	176,000	6.970	1,226,720.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	145,200	19.940	2,895,288.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	75,000	38.000	2,850,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	583,000	31.450	18,335,350.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	455,000	2.320	1,055,600.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.150	824,000.000	

SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,973,000	0.780	1,538,940.000	
WEICHAI POWER CO LTD	42,360	23.850	1,010,286.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	3.420	1,015,740.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	38,000	23.900	908,200.000	
TINGYI HOLDING CORP	162,000	15.540	2,517,480.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	26,000	45.150	1,173,900.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	238,000	10.000	2,380,000.000	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	86,000	23.250	1,999,500.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	128,000	9.480	1,213,440.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	216,000	8.520	1,840,320.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	2.570	727,310.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	111,000	37.350	4,145,850.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	403,200	148.900	60,036,480.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	204,000	95.850	19,553,400.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	366,000	5.920	2,166,720.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	869,240	1.420	1,234,320.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	229,000	5.580	1,277,820.000	
AIR CHINA / HONG KONG	134,000	8.760	1,173,840.000	
ZTE CORP	68,888	15.900	1,095,319.200	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	224,000	5.440	1,218,560.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	256,500	15.700	4,027,050.000	
COSCO HOLDINGS	174,500	4.300	750,350.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	694,205	7.330	5,088,522.650	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	152,000	12.520	1,903,040.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	60,000	42.600	2,556,000.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,577,530	6.520	42,885,495.600	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	44,000	36.900	1,623,600.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	226,000	9.550	2,158,300.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	106,000	6.400	678,400.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	206,000	6.490	1,336,940.000	
BANK OF CHINA LTD	6,221,200	4.450	27,684,340.000	
SHUI ON LAND LTD	345,600	2.000	691,200.000	

SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	117,500	14.100	1,656,750.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	68,400	8.390	573,876.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	360,970	21.400	7,724,758.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,772,235	5.660	32,670,850.100	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	3.490	731,504.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	338,000	10.620	3,589,560.000	
CHINA COAL ENERGY CO	202,000	4.070	822,140.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	44,000	14.980	659,120.000	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	39,500	55.300	2,184,350.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	93,000	19.280	1,793,040.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	215,800	3.690	796,302.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	434,142	3.090	1,341,498.780	
CHINA CITIC BANK-H	620,800	5.760	3,575,808.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	376,000	8.350	3,139,600.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	78,000	17.620	1,374,360.000	
FOSUN INTERNATIONAL	142,500	17.020	2,425,350.000	
FRANSHION PROPERTIES CHINA LTD	274,000	2.590	709,660.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	5.380	1,544,060.000	
SOHO CHINA LTD	213,500	4.810	1,026,935.000	
KINGSOFT CORP LTD	61,000	21.550	1,314,550.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	816,000	1.560	1,272,960.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	298,000	7.500	2,235,000.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	148,000	10.880	1,610,240.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	457,000	8.060	3,683,420.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	208,600	33.750	7,040,250.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	400,000	4.480	1,792,000.000	
CRRC CORP LTD - H	329,450	10.760	3,544,882.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	88,000	10.660	938,080.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	179,500	6.800	1,220,600.000	
BBMG CORP	82,000	6.690	548,580.000	

SINOPHARM GROUP CO	91,200	32.300	2,945,760.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	128,000	4.210	538,880.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	161,805	6.180	999,954.900	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	197,000	5.590	1,101,230.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	269,000	8.400	2,259,600.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	49,700	19.220	955,234.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	286,000	3.030	866,580.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	320,000	4.410	1,411,200.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	136,000	7.400	1,006,400.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	114,500	11.360	1,300,720.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	60,700	38.750	2,352,125.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	470,380	9.120	4,289,865.600	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	252,000	4.250	1,071,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,819,000	3.710	6,748,490.000	
FAR EAST HORIZON LTD	130,000	7.350	955,500.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	173,000	23.750	4,108,750.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	193,600	15.180	2,938,848.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	35,300	16.300	575,390.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	514,000	4.340	2,230,760.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	26.050	872,675.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	82,500	6.880	567,600.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	244,000	8.280	2,020,320.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	404,000	2.010	812,040.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	718,000	3.780	2,714,040.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	51,000	16.460	839,460.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	98,161	19.000	1,865,059.000	

	LUYE PHARMA GROUP LTD	98,000	8.030	786,940.000	
	CGN POWER CO LTD	502,000	3.730	1,872,460.000	
	DALIAN WANDA COMMERCIAL PROPERTIES CO LTD	23,700	59.200	1,403,040.000	
	GF SECURITIES CO LTD	69,200	16.960	1,173,632.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	63,600	17.240	1,096,464.000	
香港・ドル	小計	59,146,578		555,505,024.970 (8,776,979,395)	
台湾・ドル	ACER INC	220,532	13.900	3,065,394.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	54,554	275.000	15,002,350.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,616	76.300	2,717,500.800	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	484,729	39.500	19,146,795.500	
	ASIA CEMENT CORP	173,928	35.000	6,087,480.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	271,957	9.330	2,537,358.810	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	52,000	49.500	2,574,000.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	40.800	3,182,400.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	33,853	81.100	2,745,478.300	
	QUANTA COMPUTER INC	208,858	65.900	13,763,742.200	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	53,900	69.000	3,719,100.000	
	EVA AIRWAYS CORP	139,624	21.750	3,036,822.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	51,760	380.000	19,668,800.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	387,284	17.500	6,777,470.000	
	CHINA AIRLINES	232,156	13.600	3,157,321.600	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	126,169	64.900	8,188,368.100	
	CHINA STEEL CORP	930,058	23.750	22,088,877.500	
	CHINA MOTORS CO	57,000	23.550	1,342,350.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	215,178	29.150	6,272,438.700	
	ADVANTECH CO LTD	23,264	203.500	4,734,224.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	303,304	20.750	6,293,558.000	
	CTCI CORP	39,000	49.900	1,946,100.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	145,448	153.000	22,253,544.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	298,327	97.700	29,146,547.900	
	AU OPTRONICS CORP	654,194	12.850	8,406,392.900	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	127,800	100.000	12,780,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	99,399	16.850	1,674,873.150	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	288,063	31.950	9,203,612.850	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,000	154.500	3,244,500.000	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	14,640	465.000	6,807,600.000	

NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,285	138.500	6,548,972.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	310,633	69.800	21,682,183.400	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	53,000	31.200	1,653,600.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	253,594	69.600	17,650,142.400	
TRANSCEND INFORMATION INC	11,897	99.000	1,177,803.000	
EPISTAR CORP	69,149	35.750	2,472,076.750	
GIANT MANUFACTURING	21,151	258.500	5,467,533.500	
MEDIATEK INC	116,507	400.000	46,602,800.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	531,936	58.200	30,958,675.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	498,295	17.550	8,745,077.250	
HOTAI MOTOR CO LTD	19,000	409.500	7,780,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	124,000	75.000	9,300,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	19,088	135.000	2,576,880.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	693,940	15.250	10,582,585.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	641,920	49.950	32,063,904.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,037,403	10.200	10,581,510.600	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	501,528	20.300	10,181,018.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,044,781	93.400	97,582,545.400	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	779,075	26.900	20,957,117.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,220	3,285.000	23,717,700.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	624,751	12.600	7,871,862.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	623,276	9.130	5,690,509.880	
INVENTEC CO LTD	211,005	20.500	4,325,602.500	
HTC CORPORATION	52,832	67.800	3,582,009.600	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	149,974	35.250	5,286,583.500	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	29,496	106.000	3,126,576.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	676,214	13.300	8,993,646.200	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,086,450	23.500	25,531,575.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	634,793	18.600	11,807,149.800	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	14,950	203.500	3,042,325.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,560	62.200	2,958,232.000	

NAN YA PLASTICS CORP	374,828	65.600	24,588,716.800	
WISTRON CORP	181,035	23.100	4,181,908.500	
KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	15,020	75.800	1,138,516.000	
POU CHEN CORP	158,990	39.000	6,200,610.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	355,171	54.000	19,179,234.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,392	208.000	9,649,536.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	87,480	76.800	6,718,464.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	13,658	255.000	3,482,790.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	44,569	44.800	1,996,691.200	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	52,715	66.200	3,489,733.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	66,130	110.000	7,274,300.000	
SILICONWARE PRECISION INDS	221,743	44.500	9,867,563.500	
STANDARD FOODS CORP	35,564	87.000	3,094,068.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	91,666	43.650	4,001,220.900	
TAIWAN CEMENT CORP	281,874	37.700	10,626,649.800	
TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP	61,301	14.050	861,279.050	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	142,000	23.100	3,280,200.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,926,083	136.500	262,910,329.500	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	20,000	40.750	815,000.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	916,525	12.450	11,410,736.250	
WAN HAI LINES LTD	31,000	25.500	790,500.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	86,668	11.250	975,015.000	
YULON MOTOR CO	63,149	32.950	2,080,759.550	
INOTERA MEMORIES INC	166,000	21.000	3,486,000.000	
INNOLUX CORPORATION	693,345	13.950	9,672,162.750	
WPG HOLDINGS CO LTD	111,526	36.500	4,070,699.000	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,504	209.500	2,619,588.000	
HERMES MICROVISION INC	3,000	1,950.000	5,850,000.000	
PEGATRON CORP	124,554	87.300	10,873,564.200	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	73,150	70.300	5,142,445.000	
TPK HOLDING CO LTD	20,494	158.000	3,238,052.000	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	141,000	11.500	1,621,500.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	27,385	102.500	2,806,962.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	574,690	15.900	9,137,571.000	

	CASETEK HOLDINGS LTD	9,000	184.000	1,656,000.000	
台湾・ドル 小計		23,984,507		1,160,852,063.590 (4,585,365,652)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	8,785	76.910	675,654.350	
	BARLOWORLD LTD	18,561	92.000	1,707,612.000	
	BIDVEST GROUP LTD	25,632	311.000	7,971,552.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	32,765	82.400	2,699,836.000	
	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	182,209	76.100	13,866,104.900	
	DISCOVERY LTD	26,366	134.200	3,538,317.200	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	277,408	10.780	2,990,458.240	
	MASSMART HOLDINGS LTD	7,187	146.630	1,053,829.810	
	GOLD FIELDS LTD	63,646	38.030	2,420,457.380	
	REMGRO LTD	37,011	259.070	9,588,439.770	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	14,130	146.280	2,066,936.400	
	MMI HOLDINGS LTD	79,939	31.000	2,478,109.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	181,468	26.930	4,886,933.240	
	EXXARO RESOURCES LTD	12,410	76.900	954,329.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,559	449.800	1,151,038.200	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	7,902	148.680	1,174,869.360	
	MTN GROUP LTD	129,742	216.910	28,142,337.220	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,591	101.480	3,713,254.680	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	60.850	1,230,812.950	
	FIRSTRAND LTD	266,694	53.360	14,230,791.840	
	PSG GROUP LTD	6,736	192.000	1,293,312.000	
	NASPERS LTD	31,026	1,818.960	56,435,052.960	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	16,510	83.000	1,370,330.000	
	NEDBANK GROUP LTD	14,544	251.440	3,656,943.360	
	NETCARE LTD	74,053	38.150	2,825,121.950	
	PICK'N PAY STORES LTD	17,613	57.150	1,006,582.950	
	RMB HOLDINGS LTD	52,647	66.670	3,509,975.490	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,361	250.000	1,090,250.000	
	SAPPI LTD	38,820	42.300	1,642,086.000	
	SASOL LTD	43,212	426.500	18,429,918.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	35,425	172.750	6,119,668.750	
	MR PRICE GROUP LTD	20,467	248.000	5,075,816.000	
BRAIT SE	24,736	126.000	3,116,736.000		
STANDARD BANK GROUP LTD	94,865	160.000	15,178,400.000		
SPAR GROUP LTD/THE	13,119	192.500	2,525,407.500		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	78,788	95.630	7,534,496.440		
IMPERIAL HOLDINGS LTD	14,898	184.500	2,748,681.000		

ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	27,151	365.600	9,926,405.600	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	25,226	188.590	4,757,371.340	
TIGER BRANDS LTD	13,021	299.900	3,904,997.900	
NAMPAK LTD	47,491	34.050	1,617,068.550	
SANLAM LTD	137,157	70.610	9,684,655.770	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	31,964	105.020	3,356,859.280	
INVESTEC LTD	18,814	113.130	2,128,427.820	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	42,923	49.000	2,103,227.000	
KUMBA IRON ORE LTD	4,785	121.660	582,143.100	
MONDI LTD	10,400	280.850	2,920,840.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	70,253	37.000	2,599,361.000	
RMI HOLDINGS	48,588	44.080	2,141,759.040	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	19,472	23.950	466,354.400	
VODACOM GROUP PTY LTD	26,281	141.250	3,712,191.250	
RESILIENT PROPERTY INCOME FUND LTD	21,223	97.690	2,073,274.870	
南アフリカ・ランド 小計	2,670,337		292,110,275.020 (2,865,601,798)	
合計	161,328,095		36,292,364,793 (36,292,364,793)	

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,023,153.000	14,549,235.660	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	145,300.000	20,731,404.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,168,453.000	35,280,639.660 (274,130,570)	
投資信託受益証券	合計		1,168,453	274,130,570 (274,130,570)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	173,951.000	483,583.780	
	トルコ・リラ	小計	173,951.000	483,583.780 (22,186,823)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	172,700.000	6,595,413.000	
	メキシコ・ペソ	小計	172,700.000	6,595,413.000 (51,246,359)	
	南アフリカ・ラ ンド	HYPROP INVESTMENTS LTD	18,582.000	2,359,914.000	
	南アフリカ・ランド	小計	18,582.000	2,359,914.000 (23,150,756)	
投資証券	合計		365,233	96,583,938 (96,583,938)	
合計				370,714,508 (370,714,508)	

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 25銘柄	4.46%	-%	-%	4.50%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.66%	-%	-%	0.66%
インド・ルピー	株式 70銘柄	7.98%	-%	-%	8.05%
インドネシア・ルピア	株式 30銘柄	2.37%	-%	-%	2.39%
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.96%	-%	-%	0.97%
コロンビア・ペソ	株式 12銘柄	0.58%	-%	-%	0.58%
タイ・バーツ	株式 33銘柄	2.30%	-%	-%	2.32%
チェコ・コルナ	株式 2銘柄	0.19%	-%	-%	0.19%
チリ・ペソ	株式 20銘柄	1.24%	-%	-%	1.25%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.45% -%	-% -%	-% 0.06%	1.53%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.23%	-%	-%	0.23%
フィリピン・ペソ	株式 21銘柄	1.38%	-%	-%	1.40%
ブラジル・レアル	株式 67銘柄	7.61%	-%	-%	7.68%
ポーランド・ズロチ	株式 24銘柄	1.48%	-%	-%	1.49%
マレーシア・リンギット	株式 42銘柄	3.27%	-%	-%	3.30%
メキシコ・ペソ	株式 25銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	3.74% -% -%	-% 0.74% -%	-% -% 0.14%	4.66%
ユーロ	株式 7銘柄	0.16%	-%	-%	0.16%
韓国・ウォン	株式 108銘柄	14.21%	-%	-%	14.33%
香港・ドル	株式 144銘柄	23.73%	-%	-%	23.94%
台湾・ドル	株式 96銘柄	12.40%	-%	-%	12.51%
南アフリカ・ランド	株式 53銘柄 投資証券 1銘柄	7.75% -%	-% -%	-% 0.06%	7.88%

(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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		685,209,686	623,791,834
コール・ローン		443,812,212	982,056,029
国債証券		40,303,011,312	48,532,599,607
派生商品評価勘定		22,176	-
未収利息		686,705,887	767,284,639
前払費用		72,571,702	161,039,789
流動資産合計		42,191,332,975	51,066,771,898
資産合計		42,191,332,975	51,066,771,898
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,423,900	27,880
未払解約金		9,628,000	955,732,000
流動負債合計		16,051,900	955,759,880
負債合計		16,051,900	955,759,880
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,920,411,405	27,089,131,404
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		18,254,869,670	23,021,880,614
元本等合計		42,175,281,075	50,111,012,018
純資産合計		42,175,281,075	50,111,012,018
負債純資産合計		42,191,332,975	51,066,771,898

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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	26,672,684,439円	23,920,411,405円
同期中追加設定元本額	7,947,613,154円	16,203,857,560円
同期中一部解約元本額	10,699,886,188円	13,035,137,561円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド	57,510,133円	75,276,928円
エボリューション		
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	9,269,550円	10,713,973円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	23,576,273円	30,173,185円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	64,534,061円	83,712,861円
投資のソムリエ	317,759,242円	1,107,588,380円
クルーズコントロール	388,706,635円	82,664,940円
投資のソムリエ＜DC年金＞	4,658,413円	15,453,480円
D I A M 8 資産バランスファンドN＜DC年金＞	17,435,324円	29,537,927円
クルーズコントロール＜DC年金＞	85,282円	22,814円
グローバル債券ファンド（適格機関投資家限定）	321,885,428円	- 円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	2,179,089,966円	4,780,408,947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)	717,844,856円	430,579,099円
エマージング債券パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	4,168,767,002円	3,864,258,176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)	9,023,579,707円	8,553,729,531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)	5,668,623,377円	5,402,368,452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)	633,964,361円	1,061,772,771円
D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	323,121,795円	1,560,869,940円
計	23,920,411,405円	27,089,131,404円
2 . 受益権の総数	23,920,411,405口	27,089,131,404口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	165,254,919	1,567,189,560
合計	165,254,919	1,567,189,560

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年4月19日から平成27年1月13日まで及び平成27年4月21日から平成27年7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	363,462,176	-	363,440,000	22,176	-	-	-	-
アメリカ・ドル	363,462,176	-	363,440,000	22,176	-	-	-	-
買 建	413,523,900	-	407,100,000	6,423,900	416,493,880	-	416,466,000	27,880
アメリカ・ドル	413,523,900	-	407,100,000	6,423,900	416,493,880	-	416,466,000	27,880
合計	776,986,076	-	770,540,000	6,401,724	416,493,880	-	416,466,000	27,880

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.7632円	1.8499円
（1万口当たり純資産額）	（17,632円）	（18,499円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 10.125 05/15/27	1,700,000.000	2,479,960.000		
		BRAZIL 11.0 08/17/40	2,700,000.000	2,746,440.000		
		BRAZIL 2.625 01/05/23	2,400,000.000	2,133,600.000		
		BRAZIL 4.25 01/07/25	7,700,000.000	7,420,875.000		
		BRAZIL 4.875 01/22/21	4,000,000.000	4,205,000.000		
		BRAZIL 5.0 01/27/45	5,200,000.000	4,524,000.000		
		BRAZIL 5.625 01/07/41	2,900,000.000	2,784,000.000		
		BRAZIL 5.875 01/15/19	3,300,000.000	3,671,250.000		
		BRAZIL 6.0 01/17/17	3,400,000.000	3,634,090.000		
		BRAZIL 7.125 01/20/37	3,300,000.000	3,753,750.000		
		BRAZIL 8.25 01/20/34	2,400,000.000	2,988,480.000		
		BRAZIL 8.75 02/04/25	600,000.000	789,600.000		
		BRAZIL 8.875 04/15/24	2,000,000.000	2,618,400.000		
		BRAZIL 8.875 10/14/19	1,200,000.000	1,479,000.000		
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,217,970.000		
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,700,000.000	1,557,625.000		
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	2,700,000.000	2,683,125.000		
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	3,600,000.000	3,757,500.000		
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	4,000,000.000	4,030,000.000		
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	4,200,000.000	4,536,000.000		
		COLOMBIA 7.375 01/27/17	2,850,000.000	3,120,750.000		
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	3,700,000.000	4,314,200.000		
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	2,600,000.000	3,194,750.000		
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	1,700,000.000	2,161,890.000		
		CROATIA 5.5 04/04/23	2,200,000.000	2,284,414.000		
		CROATIA 6.0 01/26/24	2,000,000.000	2,125,000.000		
		CROATIA 6.25 04/27/17	1,900,000.000	2,016,850.000		
		CROATIA 6.375 03/24/21	1,900,000.000	2,051,050.000		
		CROATIA 6.625 07/14/20	1,400,000.000	1,537,480.000		
		CROATIA 6.75 11/05/19	2,400,000.000	2,643,120.000		
		HUNGARY 4.0 03/25/19	1,600,000.000	1,662,640.000		
		HUNGARY 4.125 02/19/18	1,500,000.000	1,568,250.000		
		HUNGARY 5.375 02/21/23	3,100,000.000	3,394,500.000		
		HUNGARY 5.375 03/25/24	2,000,000.000	2,191,700.000		
		HUNGARY 5.75 11/22/23	3,000,000.000	3,360,600.000		
		HUNGARY 6.25 01/29/20	2,500,000.000	2,826,575.000		
		HUNGARY 6.375 03/29/21	3,800,000.000	4,365,250.000		
		HUNGARY 7.625 03/29/41	1,500,000.000	2,017,500.000		
		INDONESIA 11.625 03/04/19		2,800,000.000	3,679,900.000	

INDONESIA 3.375 04/15/23	1,300,000.000	1,233,440.000	
INDONESIA 3.75 04/25/22	2,200,000.000	2,178,000.000	
INDONESIA 4.625 04/15/43	2,000,000.000	1,795,000.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	3,900,000.000	4,153,500.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	3,100,000.000	2,991,500.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,100,000.000	1,189,430.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	3,400,000.000	3,765,500.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,300,000.000	2,571,285.000	
INDONESIA 6.625 02/17/37	1,700,000.000	1,928,395.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	2,300,000.000	2,662,250.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	2,200,000.000	2,465,320.000	
INDONESIA 6.875 03/09/17	1,250,000.000	1,358,937.500	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,700,000.000	3,442,230.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	1,900,000.000	2,570,415.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	2,200,000.000	2,440,900.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	3,000,000.000	3,690,600.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,400,000.000	1,774,500.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	1,600,000.000	2,277,360.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,300,000.000	1,937,000.000	
PERU 5.625 11/18/50	3,800,000.000	4,211,350.000	
PERU 6.55 03/14/37	1,800,000.000	2,234,340.000	
PERU 7.125 03/30/19	1,000,000.000	1,172,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	3,000,000.000	3,929,400.000	
PERU 8.75 11/21/33	3,300,000.000	4,963,860.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	2,000,000.000	3,212,500.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	1,600,000.000	1,732,736.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	1,800,000.000	1,982,250.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	2,000,000.000	2,335,000.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	1,400,000.000	1,666,000.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	1,600,000.000	2,098,000.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,600,000.000	4,819,680.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	948,000.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	2,700,000.000	3,921,885.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	1,700,000.000	2,099,500.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	2,600,000.000	4,231,630.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,500,000.000	1,901,250.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	1,800,000.000	1,882,350.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	1,400,000.000	1,508,500.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	1,200,000.000	1,377,000.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	2,900,000.000	3,437,225.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	4,200,000.000	4,364,220.000	

RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	16,937,500.000	19,961,013.090	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	4,600,000.000	5,556,110.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	3,100,000.000	4,858,010.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17	3,000,000.000	3,060,300.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	2,600,000.000	2,571,686.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	2,400,000.000	2,382,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	4,000,000.000	4,010,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	3,400,000.000	3,217,420.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	1,600,000.000	1,555,792.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	1,700,000.000	1,754,791.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	1,400,000.000	1,412,796.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	2,800,000.000	3,072,160.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,600,000.000	1,783,200.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	2,600,000.000	2,901,652.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	1,000,000.000	1,139,420.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,500,000.000	2,863,825.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	1,700,000.000	2,867,900.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	2,700,000.000	2,534,625.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	3,500,000.000	3,228,750.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,580,745.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	2,100,000.000	2,287,950.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	2,700,000.000	2,949,858.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	3,700,000.000	3,945,088.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	3,400,000.000	3,812,590.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	1,900,000.000	2,211,505.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	4,300,000.000	4,746,985.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	2,700,000.000	3,142,125.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	3,000,000.000	3,500,400.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	2,100,000.000	2,373,735.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	1,900,000.000	2,181,580.000	
TURKEY 7.0 09/26/16	3,000,000.000	3,210,000.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,300,000.000	1,592,500.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	4,100,000.000	4,956,900.000	
TURKEY 7.5 07/14/17	2,400,000.000	2,660,520.000	

	TURKEY 7.5 11/07/19	2,200,000.000	2,552,000.000	
	TURKEY 8.0 02/14/34	2,100,000.000	2,727,375.000	
	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16	2,200,000.000	2,457,818.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	600,000.000	614,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	4,200,000.000	4,142,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	3,900,000.000	3,956,550.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	4,900,000.000	5,034,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	6,300,000.000	6,049,575.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	3,200,000.000	3,528,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	4,200,000.000	4,530,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17	3,700,000.000	3,930,140.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	3,800,000.000	3,762,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	3,800,000.000	4,261,700.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	4,700,000.000	5,399,125.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	3,200,000.000	3,992,960.000	
	UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	400,000.000	548,840.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	1,900,000.000	2,831,000.000	
	アメリカ・ドル 小計	351,437,500.000 (43,051,093,750)	396,184,486.590 (48,532,599,607)	
国債証券 合計		43,051,093,750 (43,051,093,750)	48,532,599,607 (48,532,599,607)	
合計		43,051,093,750 (43,051,093,750)	48,532,599,607 (48,532,599,607)	

- (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 131銘柄	96.85%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表
 該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成27年7月31日現在

資産総額	473,452,205円
負債総額	2,638,253円
純資産総額（ - ）	470,813,952円
発行済数量	431,362,350口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0915円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	334,349,814,193円
負債総額	1,392,734,640円
純資産総額（ - ）	332,957,079,553円
発行済数量	139,901,517,046口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3799円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	424,825,443,690円
負債総額	6,583,061,000円
純資産総額（ - ）	418,242,382,690円
発行済数量	340,506,370,999口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2283円

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	23,533,068,990円
負債総額	85,057,364円
純資産総額（ - ）	23,448,011,626円
発行済数量	14,104,450,365口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6625円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	307,804,103,320円
負債総額	552,927,603円
純資産総額（ - ）	307,251,175,717円
発行済数量	100,894,274,261口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0453円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	29,355,396,586円
負債総額	45,353,125円
純資産総額（ - ）	29,310,043,461円
発行済数量	25,055,254,349口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1698円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	177,988,984,329円
負債総額	1,225,967,759円
純資産総額（ - ）	176,763,016,570円
発行済数量	135,269,113,851口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3068円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	37,884,364,639円
負債総額	1,324,245,498円
純資産総額（ - ）	36,560,119,141円
発行済数量	35,461,373,304口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0310円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	58,858,910,364円
負債総額	435,546,000円
純資産総額（ - ）	58,423,364,364円
発行済数量	31,315,412,668口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8656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

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

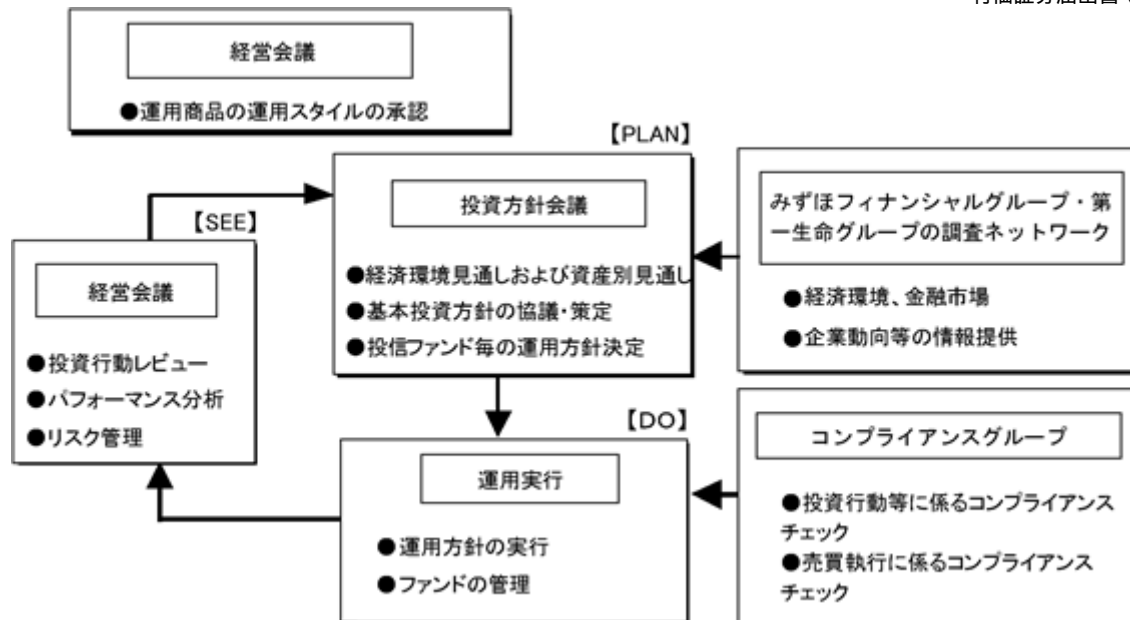
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年7月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は375本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	6	23,992,674,369
追加型株式投資信託	339	5,904,571,221,646
単位型公社債投資信託	30	246,332,588,361
追加型公社債投資信託	0	0
合計	375	6,174,896,484,376

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30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	4,178,284	4,343,365
関係会社株式	617,159	613,137
繰延税金資産	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（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	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
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	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当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 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当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9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

平成27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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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29期（平成26年3月31日現在）

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

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	-

(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29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

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

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

当事業年度において、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29期（平成26年3月31日現在）

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

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	-	-	-

（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29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

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。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

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

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

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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
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	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

(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29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
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	179,840	174,402

(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29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	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29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり
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29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資 産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

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27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27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35.64%から、平成27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33.10%に、平成28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32.34%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89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

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。

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 社 関 係 会 社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有) 直接 50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

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 社 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

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29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

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	-	-

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29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

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 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	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		

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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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) 通常の実取引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25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）に変更）

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及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27年3月末日現在 247,369百万円

c．事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(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
株式会社みずほ銀行	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北越銀行	24,538	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	343,104	日本において保険業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

第一生命保険株式会社は、委託会社の株式を12,000株（持株比率50.00%）所有しています。

この他に、委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

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せん。）
- (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。
（委託会社の略称：D I A M、ファンドの略称：D Cソムリエ）

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年8月27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 あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	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」に掲げられている投資のソムリエ＜DC年金＞の平成27年1月14日から平成27年7月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ＜DC年金＞の平成27年7月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。