

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年9月25日
【計算期間】	第2計算期間 (自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日)
【ファンド名】	投資のソムリエ<DC年金>
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【電話番号】	03-3287-3110
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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。

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。

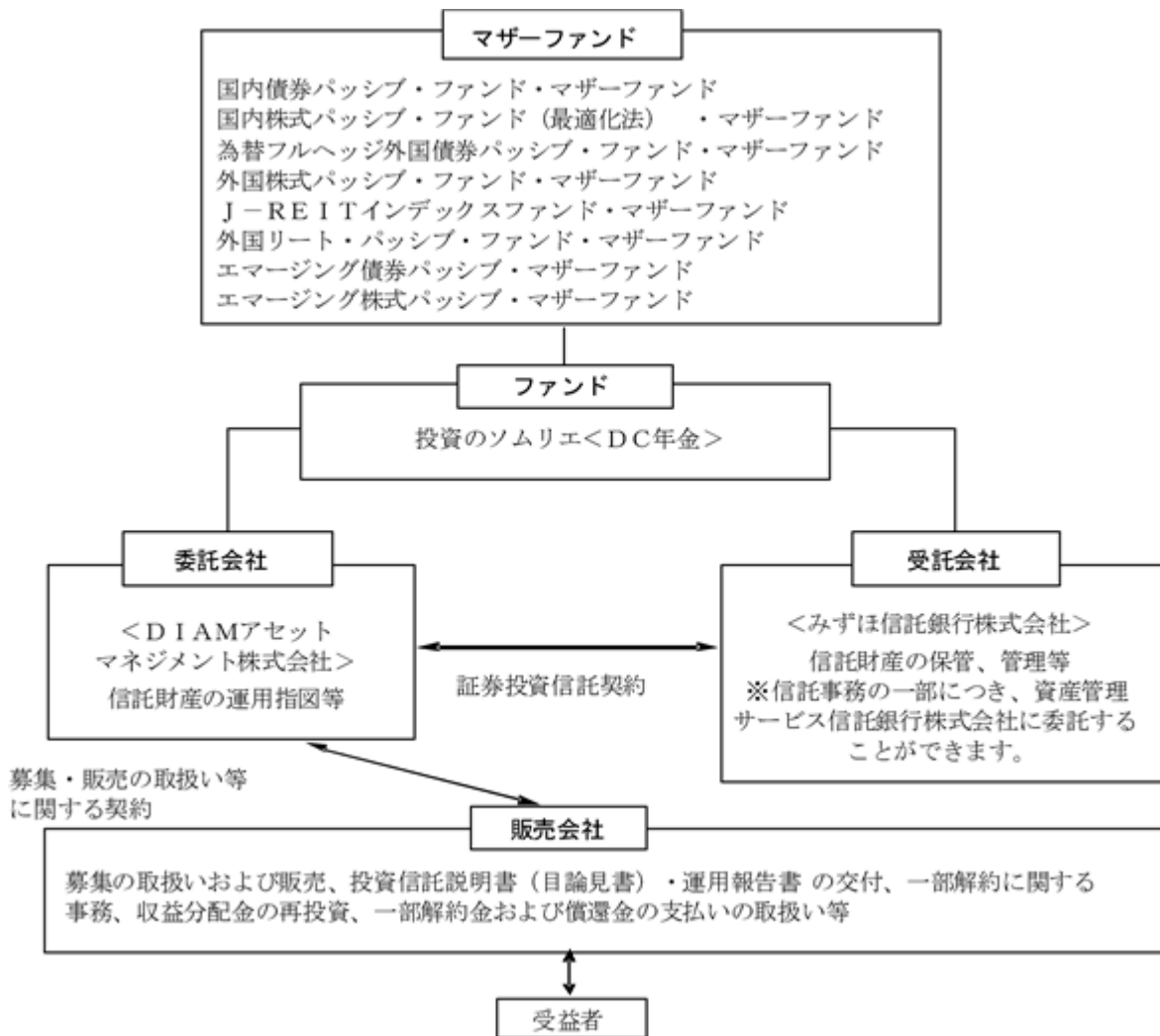
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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。

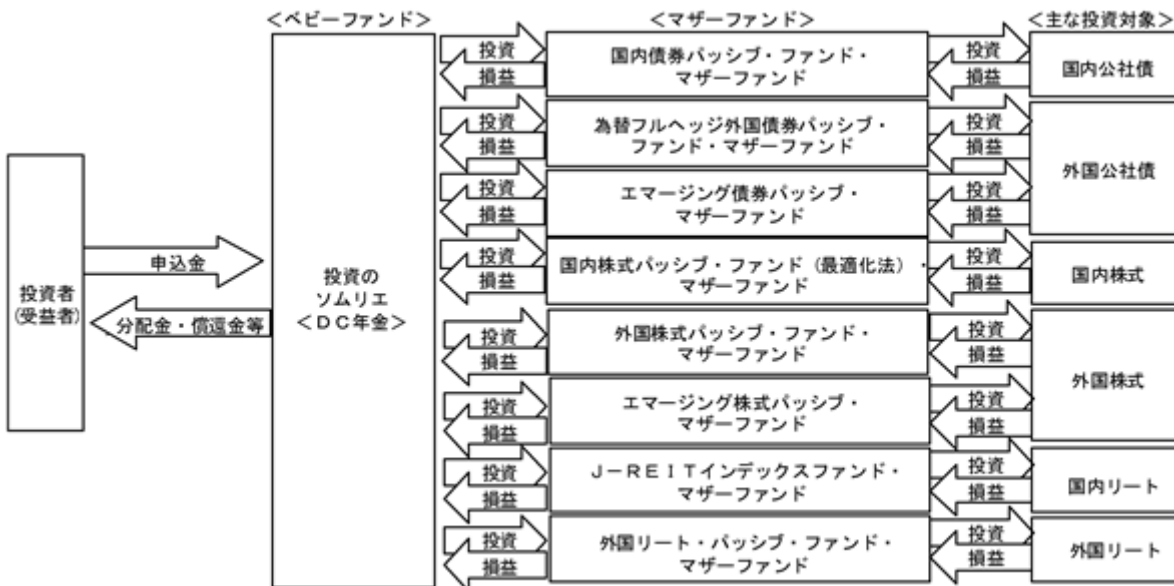
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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26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26年7月31日現在）

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

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(ETF)、短期金融資産へ投資する場合があります。

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

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

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

基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

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

・基本配分戦略は月次で行います。

機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

・機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主として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。

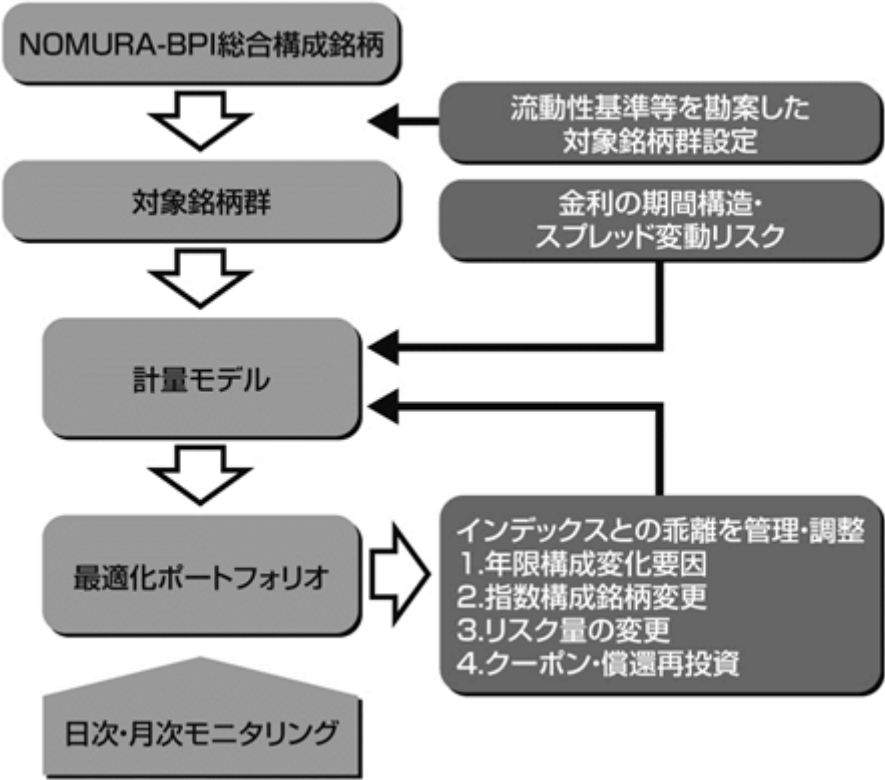
運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

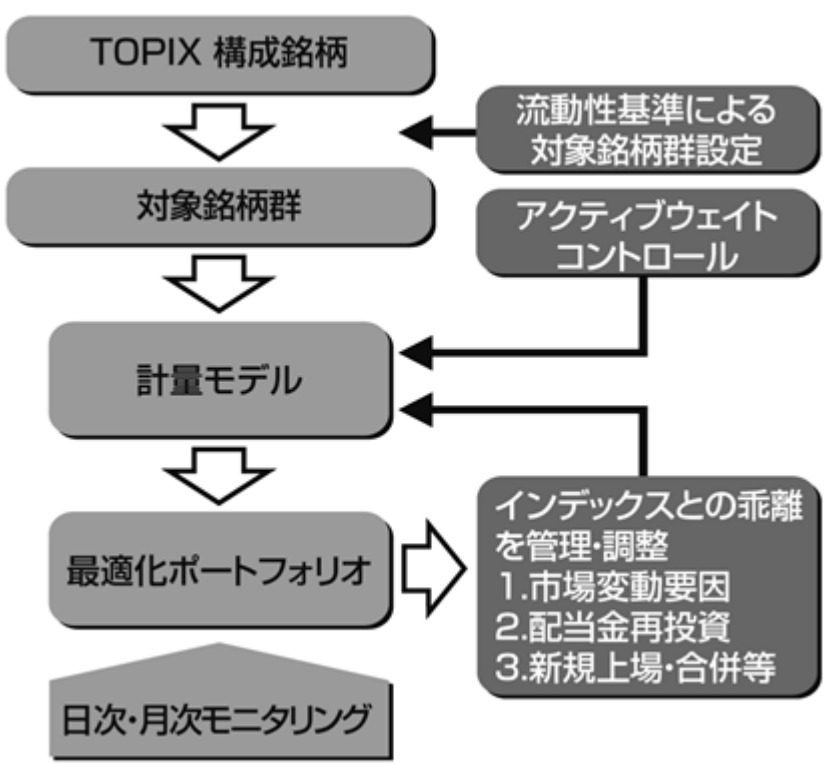
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</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。

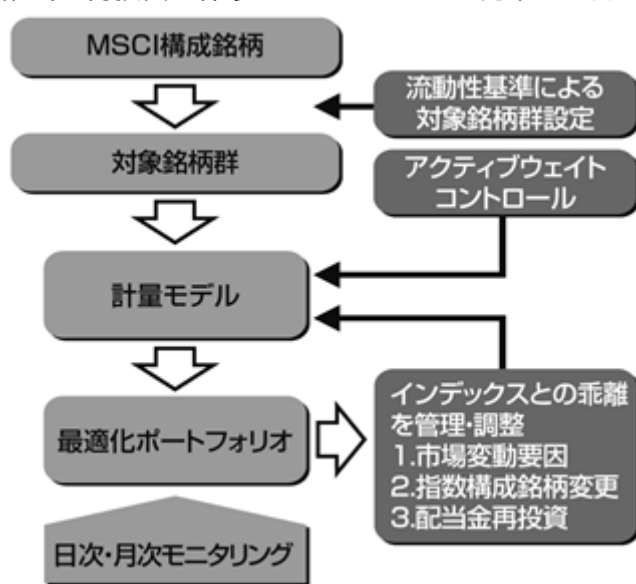
投資態度	<p>1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外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> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。</p> </div>
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します。</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; margin-top: 10px;"> <p>MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。

㈱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。

㈱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。

㈱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㈱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。

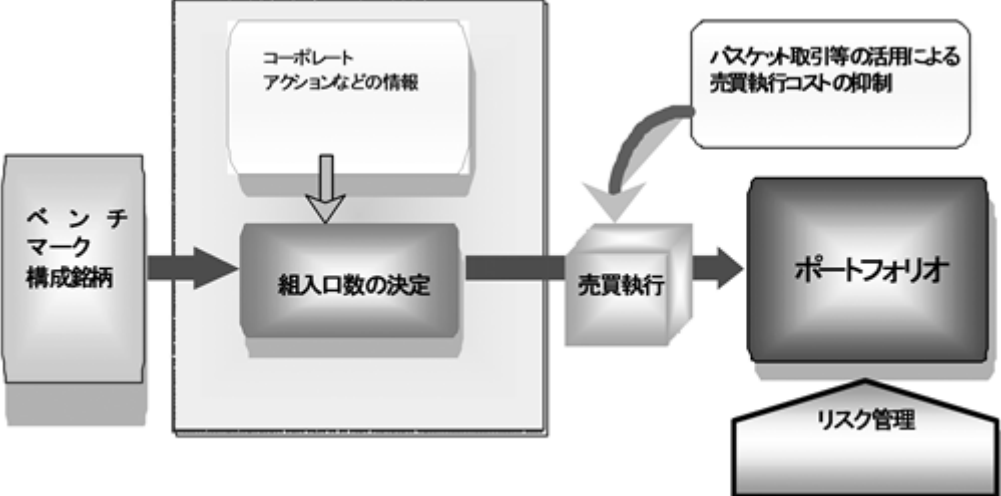
当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

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、㈱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。

㈱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。

㈱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、㈱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>
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 R E I T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 R E I T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。

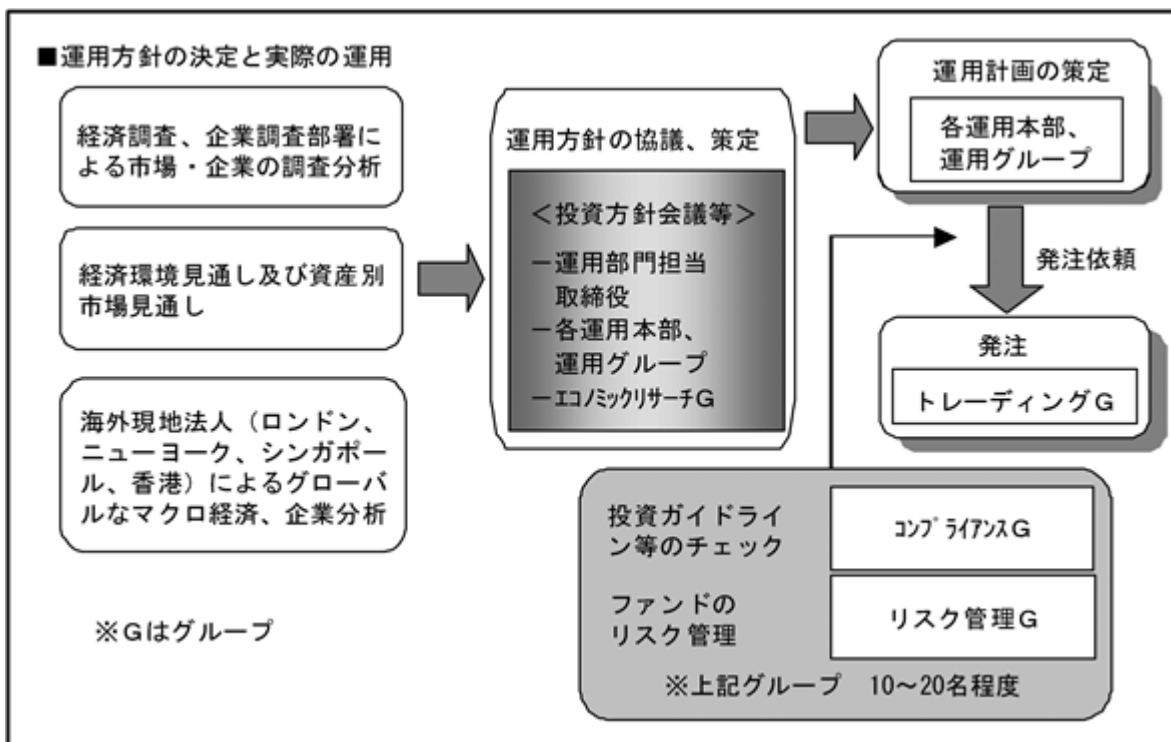
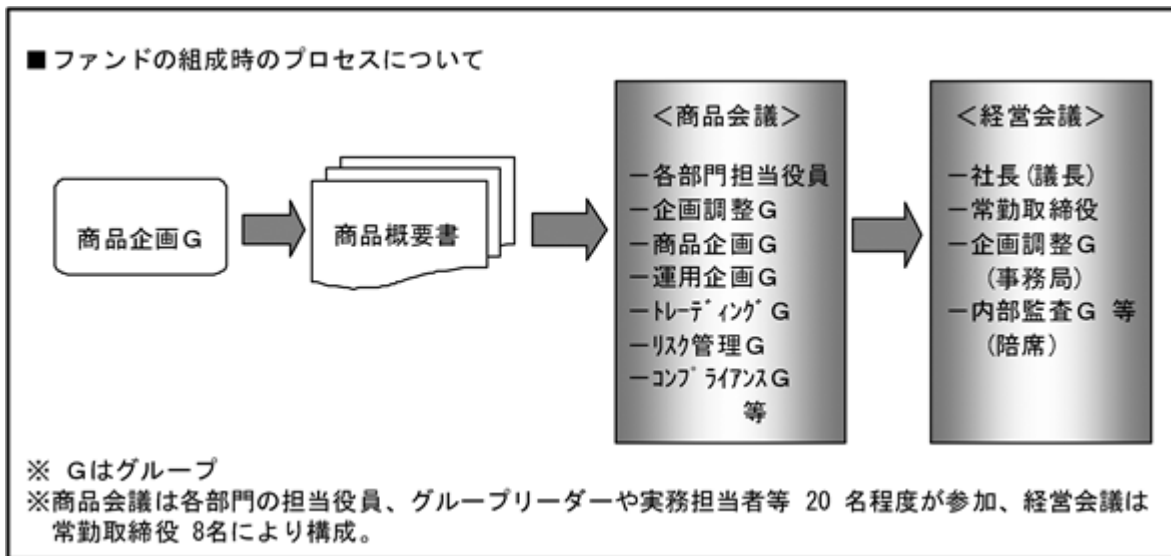
ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 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。 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。 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>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>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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	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。 (*)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。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

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】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

<運用方針の決定と実際の運用>

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

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

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

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

上記体制は平成26年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

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

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

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。

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。

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

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

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が、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追従できない場合があります。

株価変動リスク

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

金利リスク

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

リートの価格変動リスク

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

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

為替リスク

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

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

為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジほか、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。

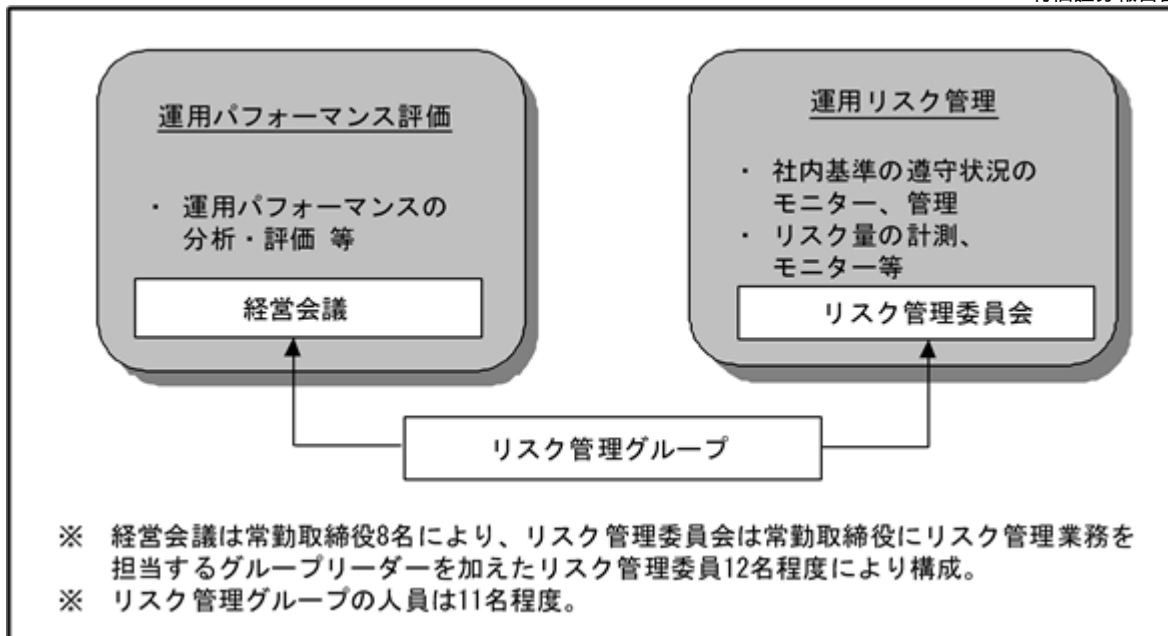
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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ます、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<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26年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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）	
委託会社	年率0.525%
販売会社	年率0.525%
受託会社	年率0.050%

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

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

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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。

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

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。

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26年7月末現在のもので、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26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	88,817,957	96.11
内 日本	88,817,957	96.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,594,186	3.89
純資産総額	92,412,143	100.00

その他資産の投資状況

平成26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）	25,563,083	27.66
-	25,563,083	27.66

（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26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	318,017,234,770	98.32
内 日本	318,017,234,770	98.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,424,990,765	1.68
純資産総額	323,442,225,535	100.00

その他資産の投資状況

平成26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）	4,833,950,000	1.49
内 日本	4,833,950,000	1.49

（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26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	352,580,850,300	80.54
内 日本	352,580,850,300	80.54
地方債証券	29,119,325,303	6.65
内 日本	29,119,325,303	6.65
特殊債券	29,183,278,916	6.67
内 日本	29,183,278,916	6.67
社債券	24,912,920,260	5.69
内 日本	24,501,728,260	5.60
内 アメリカ	411,192,000	0.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,952,929,783	0.45
純資産総額	437,749,304,562	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成26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	32,923,290,620	98.99
内 日本	32,923,290,620	98.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	335,408,217	1.01
純資産総額	33,258,698,837	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26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	297,168,032,745	95.87
内 アメリカ	169,843,449,223	54.79
内 イギリス	27,247,317,778	8.79
内 カナダ	14,442,142,083	4.66
内 スイス	12,869,230,153	4.15
内 フランス	12,037,132,290	3.88
内 ドイツ	11,929,452,430	3.85
内 オーストラリア	10,005,781,051	3.23
内 スペイン	4,920,022,777	1.59
内 オランダ	4,876,573,951	1.57
内 スウェーデン	3,985,775,152	1.29
内 香港	3,423,044,940	1.10
内 アイルランド	3,285,432,228	1.06
内 イタリア	3,217,749,899	1.04
内 ジャージー	2,049,403,140	0.66
内 デンマーク	2,023,948,871	0.65
内 シンガポール	2,014,071,425	0.65
内 ベルギー	1,587,870,085	0.51
内 オランダ領キュラソー	1,414,846,052	0.46
内 フィンランド	1,170,797,025	0.38
内 パミューダ	1,004,253,790	0.32
内 ノルウェー	944,350,407	0.30
内 イスラエル	715,706,014	0.23
内 ルクセンブルグ	532,428,954	0.17
内 ケイマン諸島	364,924,287	0.12
内 オーストリア	286,830,749	0.09
内 ポルトガル	254,481,787	0.08
内 イギリス領バージン諸島	162,544,829	0.05
内 ニューゼーランド	155,545,538	0.05
内 パナマ	142,725,759	0.05
内 リベリア	103,770,178	0.03
内 ガーンジィ	71,071,657	0.02
内 マン島	64,224,332	0.02
内 モーリシャス	21,133,911	0.01
投資信託受益証券	921,313,576	0.30
内 オーストラリア	786,734,098	0.25
内 シンガポール	134,579,478	0.04
投資証券	5,843,150,282	1.89
内 アメリカ	4,795,744,784	1.55
内 イギリス	413,453,666	0.13
内 フランス	390,366,645	0.13
内 香港	139,465,709	0.04
内 カナダ	61,951,314	0.02
内 オランダ	42,168,164	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,034,358,536	1.95

純資産総額	309,966,855,139	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

平成26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)	183,063,000	0.06
-	183,063,000	0.06
株価指数先物取引(買建)	6,009,016,349	1.94
内 アメリカ	3,739,044,897	1.21
内 ドイツ	1,180,174,320	0.38
内 イギリス	562,006,080	0.18
内 カナダ	287,022,260	0.09
内 オーストラリア	240,768,792	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26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	3,674,550,327	13.02
内 オーストラリア	2,682,732,234	9.50
内 シンガポール	991,818,093	3.51
投資証券	24,363,548,055	86.31
内 アメリカ	19,043,009,799	67.46
内 イギリス	1,878,487,521	6.65
内 フランス	1,414,094,935	5.01
内 カナダ	728,263,127	2.58
内 香港	506,866,028	1.80
内 オランダ	337,103,817	1.19
内 ベルギー	153,696,554	0.54
内 ニュージーランド	95,862,832	0.34
内 アイルランド	52,074,166	0.18
内 ドイツ	45,139,407	0.16
内 シンガポール	37,597,094	0.13
内 イタリア	28,199,584	0.10
内 マン島	21,544,941	0.08
内 イスラエル	11,608,036	0.04
内 ギリシャ	10,000,214	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	189,277,090	0.67
純資産総額	28,227,375,472	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26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	171,572,618,106	98.49
内 アメリカ	65,290,537,273	37.48
内 フランス	18,470,053,723	10.60
内 イタリア	18,353,653,378	10.54
内 ドイツ	15,019,198,052	8.62
内 イギリス	14,089,315,050	8.09
内 スペイン	9,877,906,785	5.67
内 オランダ	4,856,033,070	2.79
内 ベルギー	4,846,449,968	2.78
内 カナダ	3,971,680,935	2.28
内 オーストリア	3,019,769,082	1.73
内 オーストラリア	2,910,753,301	1.67
内 メキシコ	1,886,798,383	1.08
内 デンマーク	1,428,433,884	0.82
内 アイルランド	1,419,351,436	0.81
内 ポーランド	1,165,903,537	0.67
内 フィンランド	1,138,723,086	0.65
内 スウェーデン	953,010,316	0.55
内 マレーシア	918,356,867	0.53
内 南アフリカ	848,962,768	0.49
内 シンガポール	620,556,137	0.36
内 ノルウェー	487,171,075	0.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,627,746,847	1.51
純資産総額	174,200,364,953	100.00

その他資産の投資状況

平成26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）	173,177,817,579	99.41
-	173,177,817,579	99.41

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）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26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	38,676,129,838	95.98
内 韓国	6,171,528,461	15.32
内 台湾	4,657,393,940	11.56
内 ブラジル	4,381,835,755	10.87
内 中国	3,885,198,509	9.64
内 南アフリカ	2,967,684,921	7.36
内 インド	2,676,379,334	6.64
内 ロシア	1,857,069,163	4.61
内 ケイマン諸島	1,738,705,602	4.31
内 メキシコ	1,652,472,247	4.10
内 香港	1,635,687,228	4.06
内 マレーシア	1,501,919,354	3.73
内 インドネシア	1,029,385,866	2.55
内 タイ	866,617,826	2.15
内 トルコ	671,653,090	1.67
内 ポーランド	608,625,138	1.51
内 チリ	547,414,924	1.36
内 パミューダ	451,811,279	1.12
内 フィリピン	380,119,751	0.94
内 コロンビア	376,017,020	0.93
内 ギリシャ	284,160,565	0.71
内 エジプト	87,437,008	0.22
内 チェコ	85,770,572	0.21
内 ハンガリー	82,056,680	0.20
内 アメリカ	55,274,449	0.14
内 ペルー	23,911,156	0.06
投資信託受益証券	602,325,285	1.49
内 メキシコ	308,755,697	0.77
内 アメリカ	293,569,588	0.73
投資証券	94,049,595	0.23
内 メキシコ	69,694,368	0.17
内 トルコ	24,355,227	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	922,865,467	2.29
純資産総額	40,295,370,185	100.00

その他資産の投資状況

平成26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）	71,988,000	0.18
-	71,988,000	0.18
株価指数先物取引（買建）	955,664,715	2.37
内 アメリカ	955,664,715	2.37

（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26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	38,735,765,647	95.69
内 ロシア	5,535,492,140	13.67
内 トルコ	5,521,553,977	13.64
内 メキシコ	5,385,074,808	13.30
内 ブラジル	4,425,448,826	10.93
内 コロンビア	3,105,829,844	7.67
内 インドネシア	3,079,504,355	7.61
内 フィリピン	2,843,477,695	7.02
内 ベルギー	2,181,035,043	5.39
内 パナマ	1,776,490,611	4.39
内 ハンガリー	1,655,734,220	4.09
内 南アフリカ	1,039,013,840	2.57
内 クロアチア	1,001,145,910	2.47
内 ルーマニア	806,447,878	1.99
内 リトアニア	379,516,500	0.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,744,034,611	4.31
純資産総額	40,479,800,258	100.00

その他資産の投資状況

平成26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）	41,136,000	0.10
-	41,136,000	0.10
為替予約取引（売建）	30,852,000	0.08
-	30,852,000	0.08

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成26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	18,858,768	1.2027 22,682,932	1.2028 22,683,326	- -	24.55%
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	18,062,862	1.2530 22,633,770	1.2557 22,681,535	- -	24.54%
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	12,052,687	1.5007 18,087,993	1.5213 18,335,752	- -	19.84%
4	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,609,034	2.4217 6,318,429	2.4505 6,393,437	- -	6.92%
5	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	3,503,500	1.7925 6,280,025	1.8156 6,360,954	- -	6.88%
6	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	5,889,003	0.9198 5,416,906	0.9323 5,490,317	- -	5.94%
7	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	4,076,675	0.9912 4,041,156	1.0113 4,122,741	- -	4.46%
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	1,863,704	1.4528 2,707,716	1.4755 2,749,895	- -	2.98%

(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26年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.11%
合計	96.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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26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	2,377,800	5,889.96 14,005,152,500	6,137.00 14,592,558,600	- -	4.51%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	12,886,200	601.09 7,745,790,382	615.60 7,932,744,720	- -	2.45%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	835,300	7,390.46 6,173,256,844	7,572.00 6,324,891,600	- -	1.96%
4	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,551,100	3,674.33 5,699,263,857	3,654.00 5,667,719,400	- -	1.75%
5	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,286,500	4,745.66 6,105,302,807	4,260.00 5,480,490,000	- -	1.69%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	668,400	5,508.47 3,681,864,828	6,860.00 4,585,224,000	- -	1.42%
7	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	22,079,100	213.55 4,715,083,524	201.50 4,448,938,650	- -	1.38%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,070,300	3,190.09 3,414,362,718	3,652.00 3,908,735,600	- -	1.21%
9	ファナック 日本	株式 電気機器	192,300	16,408.23 3,155,304,469	17,990.00 3,459,477,000	- -	1.07%
10	キヤノン 日本	株式 電気機器	999,300	2,991.59 2,989,505,191	3,392.00 3,389,625,600	- -	1.05%
11	日立 日本	株式 電気機器	4,148,000	780.10 3,235,884,600	808.70 3,354,487,600	- -	1.04%
12	武田薬品 日本	株式 医薬品	676,200	4,668.72 3,156,988,954	4,727.00 3,196,397,400	- -	0.99%
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	528,000	5,691.30 3,005,006,720	5,997.00 3,166,416,000	- -	0.98%
14	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	711,600	3,851.07 2,740,425,159	4,330.50 3,081,583,800	- -	0.95%
15	三井不動産 日本	株式 不動産業	893,000	3,258.72 2,910,041,175	3,444.50 3,075,938,500	- -	0.95%
16	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,191,000	2,567.28 3,057,631,020	2,547.50 3,034,072,500	- -	0.94%
17	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	2,056,100	1,235.97 2,541,281,111	1,415.00 2,909,381,500	- -	0.90%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,327,500	1,954.88 2,595,113,524	2,186.00 2,901,915,000	- -	0.90%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	317,100	7,586.98 2,405,832,146	8,322.00 2,638,906,200	- -	0.82%
20	三井物産 日本	株式 卸売業	1,538,400	1,492.64 2,296,278,100	1,666.00 2,562,974,400	- -	0.79%
21	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,401,500	1,608.47 2,254,283,141	1,824.00 2,556,336,000	- -	0.79%
22	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,969,200	1,191.75 2,346,807,667	1,257.50 2,476,269,000	- -	0.77%

23	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,419,500	883.96 2,138,743,946	1,022.00 2,472,729,000	- -	0.76%
24	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	7,629,000	303.00 2,311,650,860	314.10 2,396,268,900	- -	0.74%
25	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,724,000	1,189.87 2,051,351,510	1,376.00 2,372,224,000	- -	0.73%
26	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	3,477,700	691.35 2,404,313,389	660.30 2,296,325,310	- -	0.71%
27	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	154,300	10,965.22 1,691,934,030	14,750.00 2,275,925,000	- -	0.70%
28	東京海上HD 日本	株式 保険業	658,800	2,998.00 1,975,087,680	3,272.00 2,155,593,600	- -	0.67%
29	信越化学 日本	株式 化学	323,700	5,707.58 1,847,544,830	6,580.00 2,129,946,000	- -	0.66%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	565,700	3,597.58 2,035,154,610	3,742.00 2,116,849,400	- -	0.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
株式	98.32%
合計	98.32%

(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26年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.57%
輸送用機器		11.32%
銀行業		8.90%
情報・通信業		7.06%
化学		5.51%
機械		5.26%
卸売業		4.57%
医薬品		4.44%
小売業		4.09%
食料品		3.98%
陸運業		3.96%
不動産業		3.28%
建設業		2.71%
サービス業		2.57%
保険業		2.14%
電気・ガス業		2.01%
鉄鋼		1.64%
証券、商品先物取引業		1.47%
精密機器		1.38%
その他製品		1.38%
その他金融業		1.32%
非鉄金属		1.06%
ガラス・土石製品		1.01%
ゴム製品		0.88%
繊維製品		0.69%
金属製品		0.65%
石油・石炭製品		0.58%
空運業		0.53%
鉱業		0.51%
海運業		0.33%
パルプ・紙		0.25%
倉庫・運輸関連業	0.22%	
水産・農林業	0.07%	
合計	98.32%	

(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26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	117回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.10 6,006,270,000	100.27 6,016,500,000	0.200000 2019/3/20	1.37%
2	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,700,000,000	102.12 5,820,971,000	102.93 5,867,181,000	0.800000 2023/9/20	1.34%
3	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.13 5,507,615,000	100.98 5,554,230,000	0.600000 2023/12/20	1.27%
4	116回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.09 5,505,495,000	100.30 5,516,720,000	0.200000 2018/12/20	1.26%
5	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.11 5,005,610,000	100.82 5,041,250,000	0.600000 2024/3/20	1.15%
6	106回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.26 5,013,350,000	100.34 5,017,150,000	0.200000 2017/9/20	1.15%
7	313回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,600,000,000	106.60 4,903,946,000	106.98 4,921,172,000	1.300000 2021/3/20	1.12%
8	325回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,700,000,000	102.64 4,824,504,000	103.35 4,857,544,000	0.800000 2022/9/20	1.11%
9	114回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.58 4,526,410,000	100.73 4,533,255,000	0.300000 2018/9/20	1.04%
10	103回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.59 4,526,955,000	100.57 4,525,920,000	0.300000 2017/3/20	1.03%
11	105回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.28 4,512,690,000	100.33 4,514,850,000	0.200000 2017/6/20	1.03%
12	107回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.25 4,310,856,000	100.37 4,315,910,000	0.200000 2017/12/20	0.99%
13	305回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.20 4,248,344,000	106.07 4,243,120,000	1.300000 2019/12/20	0.97%
14	296回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.10 4,244,000,000	105.69 4,227,640,000	1.500000 2018/9/20	0.97%
15	297回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	105.87 4,234,920,000	105.55 4,222,040,000	1.400000 2018/12/20	0.96%

16	289回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	105.22 4,103,892,000	104.78 4,086,537,000	1.500000 2017/12/20	0.93%
17	97回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.74 4,029,800,000	100.61 4,024,720,000	0.400000 2016/6/20	0.92%
18	92回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.36 4,014,560,000	100.28 4,011,280,000	0.300000 2015/9/20	0.92%
19	321回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	104.37 3,652,950,000	104.98 3,674,405,000	1.000000 2022/3/20	0.84%
20	301回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	106.97 3,637,116,000	106.56 3,623,074,000	1.500000 2019/6/20	0.83%
21	113回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.60 3,521,070,000	100.73 3,525,655,000	0.300000 2018/6/20	0.81%
22	93回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.78 3,527,580,000	100.61 3,521,420,000	0.500000 2015/12/20	0.80%
23	102回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.58 3,520,305,000	100.53 3,518,690,000	0.300000 2016/12/20	0.80%
24	282回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	104.16 3,541,678,000	103.46 3,517,776,000	1.700000 2016/9/20	0.80%
25	293回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	107.08 3,426,624,000	106.54 3,409,408,000	1.800000 2018/6/20	0.78%
26	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	102.31 3,376,230,000	103.03 3,400,023,000	0.800000 2023/6/20	0.78%
27	312回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	105.95 3,390,624,000	106.23 3,399,360,000	1.200000 2020/12/20	0.78%
28	299回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	105.66 3,275,677,000	105.33 3,265,230,000	1.300000 2019/3/20	0.75%
29	286回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	105.61 3,274,034,000	104.92 3,252,551,000	1.800000 2017/6/20	0.74%
30	306回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	107.01 3,210,510,000	106.85 3,205,560,000	1.400000 2020/3/20	0.73%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	80.54%
地方債証券	6.65%
特殊債券	6.67%
社債券	5.69%
合計	99.55%

（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

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26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	5,397	587,754.41 3,172,110,593	580,000.00 3,130,260,000	- -	9.41%
2	ジャパンリアルエステイト投資 法人 日本	投資証券	4,783	577,758.81 2,763,420,432	582,000.00 2,783,706,000	- -	8.37%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	8,822	221,611.33 1,955,055,198	227,600.00 2,007,887,200	- -	6.04%
4	ユナイテッド・アーバン投資法 人 日本	投資証券	9,602	162,177.90 1,557,232,268	165,900.00 1,592,971,800	- -	4.79%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,977	230,083.87 1,375,211,315	240,300.00 1,436,273,100	- -	4.32%
6	アドバンス・レジデンス投資法 人 日本	投資証券	4,969	247,115.83 1,227,918,577	245,500.00 1,219,889,500	- -	3.67%
7	日本プライムリアルティ投資法 人 日本	投資証券	3,153	358,355.47 1,129,894,819	357,500.00 1,127,197,500	- -	3.39%
8	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,896	553,461.31 1,049,362,645	567,000.00 1,075,032,000	- -	3.23%
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,515	135,827.98 1,020,747,285	141,800.00 1,065,627,000	- -	3.20%
10	G L P投資法人 日本	投資証券	8,018	110,556.33 886,440,683	114,800.00 920,466,400	- -	2.77%
11	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	5,045	164,290.78 828,847,028	176,500.00 890,442,500	- -	2.68%
12	アクティビア・プロパティーズ 投資法人 日本	投資証券	960	856,801.58 822,529,520	918,000.00 881,280,000	- -	2.65%
13	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,670	499,493.83 834,154,711	519,000.00 866,730,000	- -	2.61%
14	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	5,293	137,539.27 727,995,362	151,100.00 799,772,300	- -	2.40%

15	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	6,365	118,440.93 753,876,579	124,900.00 794,988,500	- -	2.39%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,357	518,658.62 703,819,750	562,000.00 762,634,000	- -	2.29%
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	3,172	233,645.82 741,124,551	236,700.00 750,812,400	- -	2.26%
18	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	1,424	466,295.25 664,004,438	488,500.00 695,624,000	- -	2.09%
19	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,764	366,988.40 647,367,540	393,500.00 694,134,000	- -	2.09%
20	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,429	442,010.87 631,633,534	484,000.00 691,636,000	- -	2.08%
21	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	4,635	136,593.89 633,112,694	138,300.00 641,020,500	- -	1.93%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	633	900,044.74 569,728,323	904,000.00 572,232,000	- -	1.72%
23	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	10,019	51,365.82 514,634,167	57,000.00 571,083,000	- -	1.72%
24	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	3,736	139,793.48 522,268,472	140,100.00 523,413,600	- -	1.57%
25	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	1,122	431,691.98 484,358,408	458,000.00 513,876,000	- -	1.55%
26	福岡リート投資法人 日本	投資証券	2,637	169,023.38 445,714,658	187,000.00 493,119,000	- -	1.48%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,631	131,245.03 476,550,734	135,200.00 490,911,200	- -	1.48%
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,492	150,770.48 375,720,060	177,200.00 441,582,400	- -	1.33%
29	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	5,638	64,814.58 365,424,644	75,700.00 426,796,600	- -	1.28%
30	積水ハウス・S Iレジデ投資法人 日本	投資証券	3,498	98,392.25 344,176,107	105,600.00 369,388,800	- -	1.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.99%
合計	98.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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26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	598,883	7,992.76 4,786,733,407	10,092.67 6,044,328,787	- -	1.95%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	414,839	9,679.21 4,015,315,249	10,619.26 4,405,284,236	- -	1.42%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	757,300	3,869.21 2,930,158,034	4,482.20 3,394,372,331	- -	1.10%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	271,522	9,540.36 2,590,419,257	10,521.55 2,856,833,656	- -	0.92%
5	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	481,097	4,744.47 2,282,550,524	5,358.48 2,577,951,058	- -	0.83%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	962,324	2,647.35 2,547,617,102	2,637.07 2,537,719,599	- -	0.82%
7	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	182,973	11,671.41 2,135,554,365	13,630.71 2,494,051,992	- -	0.80%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	309,542	7,468.83 2,311,918,897	7,734.97 2,394,299,631	- -	0.77%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	364,200	5,980.72 2,178,180,955	6,058.89 2,206,649,012	- -	0.71%
10	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	397,874	4,840.52 1,925,919,011	5,323.51 2,118,088,604	- -	0.68%
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	260,260	8,166.28 2,125,358,635	8,038.75 2,092,166,636	- -	0.67%
12	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	67,415	29,784.74 2,007,938,921	30,203.77 2,036,187,491	- -	0.66%
13	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,807,266	1,110.11 2,006,282,131	1,116.20 2,017,288,381	- -	0.65%
14	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	220,606	8,369.17 1,846,290,220	9,099.63 2,007,434,630	- -	0.65%
15	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サー ビス	94,874	18,892.51 1,792,408,610	19,952.89 1,893,011,434	- -	0.61%

16	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	500,342	3,409.47 1,705,904,791	3,739.62 1,871,091,952	- -	0.60%
17	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	611,961	3,285.02 2,010,309,631	3,009.39 1,841,629,925	- -	0.59%
18	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	282,267	5,702.00 1,609,487,563	5,973.52 1,686,129,827	- -	0.54%
19	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	475,279	2,546.05 1,210,084,930	3,532.89 1,679,111,990	- -	0.54%
20	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	27,558	61,721.53 1,700,922,024	60,416.14 1,664,948,179	- -	0.54%
21	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	26,937	61,954.83 1,668,877,448	61,241.00 1,649,648,924	- -	0.53%
22	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	1,016,192	1,717.59 1,745,406,298	1,602.40 1,628,349,109	- -	0.53%
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	376,859	3,694.01 1,392,124,683	4,145.54 1,562,287,826	- -	0.50%
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	380,237	4,003.95 1,522,450,126	4,074.91 1,549,434,215	- -	0.50%
25	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	291,694	5,093.13 1,485,636,045	5,142.50 1,500,036,395	- -	0.48%
26	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,768,685	846.33 1,496,901,791	838.15 1,482,437,481	- -	0.48%
27	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	345,398	3,910.62 1,350,722,978	4,212.73 1,455,070,588	- -	0.47%
28	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	160,092	8,148.80 1,304,558,570	8,969.54 1,435,952,958	- -	0.46%
29	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	148,770	8,352.44 1,242,593,763	9,646.30 1,435,080,274	- -	0.46%
30	SCHLUMBERGER LTD オランダ領キュラソー	株式 エネルギー設 備・サービス	124,752	9,302.78 1,160,540,722	11,341.26 1,414,846,052	- -	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.87%
投資信託受益証券	0.30%
投資証券	1.89%
合計	98.05%

（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26年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.64%
石油・ガス・消耗燃料		9.00%
医薬品		6.92%
保険		4.10%
メディア		2.95%
化学		2.84%
各種電気通信サービス		2.80%
コンピュータ・周辺機器		2.73%
ソフトウェア		2.60%
食品		2.48%
金属・鉱業		2.20%
情報技術サービス		2.13%
資本市場		2.08%
飲料		2.08%
食品・生活必需品小売り		2.06%
インターネットソフトウェア・サービス		2.03%
航空宇宙・防衛		1.95%
コングロマリット		1.89%
バイオテクノロジー		1.73%
ホテル・レストラン・レジャー		1.61%
半導体・半導体製造装置		1.61%
電力		1.58%
機械		1.50%
ヘルスケア・プロバイダー /ヘルスケア・サービス		1.50%
エネルギー設備・サービス		1.48%
専門小売り		1.46%
ヘルスケア機器・用品		1.45%
家庭用品		1.42%
タバコ		1.34%
各種金融サービス		1.30%
総合公益事業		1.30%
自動車		1.14%
繊維・アパレル・贅沢品		1.13%
通信機器		1.13%
陸運・鉄道		0.98%
電気設備		0.81%
インターネット販売・カタログ販売		0.81%
不動産管理・開発		0.61%

自動車部品	0.60%
航空貨物・物流サービス	0.56%
消費者金融	0.55%
複合小売り	0.53%
専門サービス	0.48%
無線通信サービス	0.46%
建設・土木	0.42%
商業サービス・用品	0.42%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.39%
電子装置・機器・部品	0.35%
建設資材	0.30%
商社・流通業	0.28%
家庭用耐久財	0.28%
パーソナル用品	0.25%
容器・包装	0.20%
建設関連製品	0.19%
運送インフラ	0.18%
ガス	0.16%
旅客航空輸送業	0.15%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11%
紙製品・林産品	0.10%
海運業	0.10%
レジャー用品	0.09%
水道	0.09%
販売	0.08%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.87%

(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26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	93,495	17,220.00 1,609,984,704	17,500.95 1,636,251,881	- -	5.80%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	29,236	28,953.58 846,486,998	28,166.31 823,470,531	- -	2.92%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	43,575	17,702.56 771,389,262	18,025.49 785,460,770	- -	2.78%
4	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	100,950	6,385.58 644,624,900	6,828.21 689,307,950	- -	2.44%
5	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	150,170	4,245.57 637,558,710	4,261.07 639,885,707	- -	2.27%
6	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	91,786	6,521.54 598,586,407	6,585.48 604,455,372	- -	2.14%
7	HCP INC アメリカ	投資証券	137,677	4,235.52 583,134,405	4,312.50 593,732,131	- -	2.10%
8	VENTAS INC アメリカ	投資証券	88,436	6,648.07 587,928,940	6,568.00 580,847,736	- -	2.06%
9	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	52,367	10,962.88 574,093,149	11,018.32 576,996,389	- -	2.04%
10	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	45,979	12,176.51 559,864,202	12,442.79 572,107,179	- -	2.03%
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	36,601	14,533.38 531,936,428	15,528.29 568,351,052	- -	2.01%
12	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	227,372	2,300.60 523,093,436	2,323.38 528,271,898	- -	1.87%
13	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	1,548,109	300.03 464,494,129	327.08 506,366,638	- -	1.79%
14	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	234,158	1,775.16 415,670,047	1,825.25 427,399,231	- -	1.51%
15	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託 受益証券	576,267	672.03 387,270,409	727.07 418,988,522	- -	1.48%
16	LINK REIT/THE 香港	投資証券	694,523	536.26 372,447,379	579.89 402,753,193	- -	1.43%
17	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	157,631	2,457.92 387,445,184	2,424.17 382,125,050	- -	1.35%
18	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	309,310	1,194.75 369,548,269	1,234.52 381,852,474	- -	1.35%
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	18,894	18,903.28 357,158,729	19,880.90 375,629,819	- -	1.33%
20	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	272,575	1,294.88 352,953,619	1,361.73 371,174,645	- -	1.31%
21	SL GREEN アメリカ	投資証券	28,822	11,417.38 329,071,753	11,248.70 324,210,161	- -	1.15%
22	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	66,375	4,622.07 306,790,493	4,467.80 296,550,490	- -	1.05%

23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	123,057	2,418.00 297,552,256	2,354.23 289,705,280	- -	1.03%
24	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	42,162	6,909.46 291,316,779	6,799.41 286,676,871	- -	1.02%
25	STOCKLAND オーストラリア	投資信託 受益証券	696,731	386.41 269,227,017	392.31 273,336,489	- -	0.97%
26	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	40,538	5,953.98 241,362,704	6,662.62 270,089,411	- -	0.96%
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	20,146	12,410.90 250,030,182	12,685.51 255,562,465	- -	0.91%
28	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	464,520	493.90 229,430,222	512.21 237,933,089	- -	0.84%
29	UDR INC アメリカ	投資証券	75,228	2,908.59 218,808,010	3,014.53 226,777,326	- -	0.80%
30	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	213,440	975.26 208,161,628	1,050.08 224,131,209	- -	0.79%

（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26年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	13.02%
投資証券	86.31%
合計	99.33%

（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26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 0.375 04/30/16 アメリカ	国債証券	1,902,725,000	99.89 1,900,708,111	99.89 1,900,708,111	0.375000 2016/4/30	1.09%
2	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	1,779,305,000	99.26 1,766,159,330	99.02 1,761,921,190	0.625000 2017/5/31	1.01%
3	US T N/B 0.375 01/15/16 アメリカ	国債証券	1,594,175,000	100.08 1,595,593,815	100.12 1,596,167,718	0.375000 2016/1/15	0.92%
4	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 フランス	国債証券	1,295,320,000	105.82 1,370,811,249	105.51 1,366,769,851	3.250000 2016/4/25	0.78%
5	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,326,765,000	101.56 1,347,595,210	102.10 1,354,640,332	2.750000 2023/11/15	0.78%
6	US T N/B 4.25 08/15/15 アメリカ	国債証券	1,234,200,000	104.65 1,291,664,352	104.26 1,286,789,262	4.250000 2015/8/15	0.74%
7	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	1,223,915,000	99.48 1,217,599,598	99.22 1,214,441,897	1.375000 2018/9/30	0.70%
8	US T N/B 4.5 02/15/16 アメリカ	国債証券	1,131,350,000	106.83 1,208,723,026	106.35 1,203,247,292	4.500000 2016/2/15	0.69%
9	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	1,131,350,000	102.48 1,159,407,480	102.27 1,157,110,839	1.750000 2016/5/31	0.66%
10	US T N/B 1.25 10/31/15 アメリカ	国債証券	1,131,350,000	101.36 1,146,770,300	101.31 1,146,193,312	1.250000 2015/10/31	0.66%
11	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	1,131,350,000	101.28 1,145,842,593	101.18 1,144,733,870	1.250000 2015/8/31	0.66%
12	US T N/B 3.125 10/31/16 アメリカ	国債証券	1,079,925,000	105.83 1,142,906,226	105.51 1,139,439,666	3.125000 2016/10/31	0.65%
13	US T N/B 2.375 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,079,925,000	104.18 1,125,098,262	103.87 1,121,772,093	2.375000 2017/7/31	0.64%
14	US T N/B 1.375 11/30/15 アメリカ	国債証券	1,079,925,000	101.59 1,097,171,402	101.49 1,096,080,678	1.375000 2015/11/30	0.63%
15	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 フランス	国債証券	1,047,280,000	103.95 1,088,658,032	103.64 1,085,432,410	3.000000 2015/10/25	0.62%
16	US T N/B 0.875 11/30/16 アメリカ	国債証券	1,028,500,000	100.48 1,033,477,940	100.33 1,031,945,475	0.875000 2016/11/30	0.59%
17	US T N/B 2.0 04/30/16 アメリカ	国債証券	977,075,000	102.89 1,005,390,633	102.71 1,003,592,815	2.000000 2016/4/30	0.58%
18	US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ	国債証券	935,935,000	103.26 966,455,840	103.25 966,418,402	2.625000 2020/11/15	0.55%
19	ITALY BTPS 3.75 08/01/16 イタリア	国債証券	895,700,000	106.22 951,412,540	106.40 953,033,757	3.750000 2016/8/1	0.55%
20	FRANCE OAT 4.25 10/25/17 フランス	国債証券	840,580,000	113.37 953,007,575	113.13 951,006,994	4.250000 2017/10/25	0.55%
21	US T N/B 0.625 08/31/17 アメリカ	国債証券	956,505,000	98.65 943,611,312	98.54 942,597,417	0.625000 2017/8/31	0.54%
22	US T N/B 1.25 09/30/15 アメリカ	国債証券	925,650,000	101.32 937,905,606	101.24 937,146,573	1.250000 2015/9/30	0.54%
23	US T N/B 1.0 08/31/16 アメリカ	国債証券	905,080,000	100.94 913,596,802	100.77 912,112,471	1.000000 2016/8/31	0.52%

24	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	822,800,000	109.23 898,810,264	108.69 894,342,460	4.875000 2016/8/15	0.51%
25	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 イタリア	国債証券	813,020,000	107.92 877,411,184	108.31 880,581,962	4.000000 2017/2/1	0.51%
26	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	822,800,000	106.30 874,636,400	105.95 871,814,196	3.125000 2017/4/30	0.50%
27	US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ	国債証券	874,225,000	99.59 870,666,904	99.58 870,596,966	2.000000 2020/9/30	0.50%
28	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	802,230,000	106.30 852,834,668	105.98 850,267,532	3.250000 2016/12/31	0.49%
29	FRANCE OAT 5.0 10/25/16 フランス	国債証券	757,900,000	111.43 844,535,549	110.97 841,049,209	5.000000 2016/10/25	0.48%
30	US T N/B 0.875 04/30/17 アメリカ	国債証券	822,800,000	99.97 822,602,528	99.80 821,220,224	0.875000 2017/4/30	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26年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	98.49%
合計	98.49%

(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26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 半導体・半導 体製造装置	10,040	137,685.00 1,382,357,400	140,197.50 1,407,582,900	- -	3.49%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,236,083	411.59 920,371,762	427.03 954,885,703	- -	2.37%
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	465,500	1,394.67 649,222,143	1,705.19 793,768,272	- -	1.97%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	550,000	954.77 525,127,075	1,142.54 628,400,850	- -	1.56%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	6,471,530	72.32 468,030,756	79.08 511,828,130	- -	1.27%
6	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,587,235	63.82 420,454,646	70.59 465,035,076	- -	1.15%
7	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	35,696	10,496.69 374,690,203	12,836.78 458,222,055	- -	1.14%
8	AO GAZPROM ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	540,539	748.74 404,727,495	766.74 414,456,520	- -	1.03%
9	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	247,808	1,479.20 366,558,382	1,640.39 406,503,450	- -	1.01%
10	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,101,878	100.92 313,068,514	122.69 380,588,333	- -	0.94%
11	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,004,769	301.49 302,934,839	358.43 360,144,376	- -	0.89%
12	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	7,072,200	46.34 327,762,527	49.49 350,053,390	- -	0.87%
13	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	376,512	749.71 282,275,790	908.53 342,074,141	- -	0.85%
14	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	13,863	24,120.00 334,375,560	24,572.24 340,645,101	- -	0.85%
15	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サー ビス	151,991	2,080.07 316,153,439	2,149.41 326,691,887	- -	0.81%
16	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	423,895	795.85 337,357,568	750.62 318,187,456	- -	0.79%
17	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	187,149	1,530.09 286,355,019	1,597.83 299,032,417	- -	0.74%

18	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	49,378	5,626.80 277,840,574	6,031.46 297,821,510	- -	0.74%
19	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,596,000	170.91 272,784,489	185.24 295,657,723	- -	0.73%
20	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	47,288	5,386.25 254,705,202	5,790.45 273,819,036	- -	0.68%
21	PETRO CHINA CO LTD 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,890,000	116.51 220,205,034	138.53 261,838,332	- -	0.65%
22	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	134,103	1,522.05 204,112,007	1,881.46 252,309,631	- -	0.63%
23	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	41,576	5,454.85 226,791,254	5,833.90 242,550,475	- -	0.60%
24	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	51,200	3,840.32 196,624,431	4,698.37 240,556,800	- -	0.60%
25	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,289,200	92.89 212,643,788	102.31 234,211,943	- -	0.58%
26	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	271,410	715.38 194,162,669	854.98 232,051,098	- -	0.58%
27	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	254,831	896.85 228,545,692	863.93 220,158,694	- -	0.55%
28	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	127,507	1,582.94 201,836,568	1,721.85 219,549,203	- -	0.54%
29	VALE SA-PREF A ブラジル	株式 金属・鉱業	165,096	1,306.27 215,660,909	1,324.12 218,607,922	- -	0.54%
30	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	1,854	109,545.00 203,096,430	113,364.00 210,176,856	- -	0.52%

(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26年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.98%
投資信託受益証券	1.49%
投資証券	0.23%
合計	97.71%

(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26年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	17.70%
石油・ガス・消耗燃料		9.91%
半導体・半導体製造装置		8.54%
無線通信サービス		5.22%
金属・鉱業		4.66%
保険		3.26%
自動車		2.94%
インターネットソフトウェア・サービス		2.46%
食品		2.38%
電子装置・機器・部品		2.34%
化学		2.12%
食品・生活必需品小売り		2.07%
情報技術サービス		1.83%
メディア		1.81%
コングロマリット		1.76%
各種電気通信サービス		1.68%
各種金融サービス		1.58%
電力		1.55%
不動産管理・開発		1.54%
飲料		1.41%
コンピュータ・周辺機器		1.31%
医薬品		1.18%
建設・土木		1.11%
建設資材		1.09%
運送インフラ		0.86%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.85%
機械		0.78%
自動車部品		0.78%
資本市場		0.77%
タバコ		0.77%
複合小売り		0.76%
専門小売り		0.68%
家庭用耐久財		0.67%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.66%
ガス		0.65%
ホテル・レストラン・レジャー		0.64%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.60%
パーソナル用品		0.57%
家庭用品		0.49%
商社・流通業		0.34%
各種消費者サービス		0.28%
旅客航空輸送業		0.27%
電気設備		0.27%
紙製品・林産品		0.25%
繊維・アパレル・贅沢品		0.25%
エネルギー設備・サービス		0.24%
水道		0.24%

航空宇宙・防衛	0.20%
不動産投資信託	0.19%
消費者金融	0.19%
海運業	0.17%
ソフトウェア	0.16%
陸運・鉄道	0.14%
容器・包装	0.13%
商業サービス・用品	0.11%
レジャー用品	0.11%
販売	0.09%
建設関連製品	0.09%
航空貨物・物流サービス	0.08%
総合公益事業	0.06%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
インターネット販売・カタログ販売	0.04%
通信機器	0.03%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.02%
合計	95.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26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	1,683,808,775	112.37 1,892,112,468	113.57 1,912,436,330	7.500000 2030/3/31	4.72%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	575,960,000	129.60 746,444,160	129.29 744,658,684	11.000000 2018/7/24	1.84%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	647,955,000	97.56 632,167,525	101.24 656,054,437	4.750000 2044/3/8	1.62%
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	534,820,000	115.50 617,717,100	122.00 652,480,400	6.050000 2040/1/11	1.61%
5	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	411,400,000	149.72 615,948,080	153.63 632,033,820	8.750000 2033/11/21	1.56%
6	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	359,975,000	162.18 583,807,455	167.60 603,318,100	12.750000 2028/6/24	1.49%
7	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	421,685,000	130.08 548,570,016	133.42 562,612,127	7.350000 2025/7/21	1.39%
8	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	431,970,000	114.55 494,862,775	120.75 521,603,775	6.125000 2041/1/18	1.29%
9	BRAZIL 7.125 01/20/37 ブラジル	国債証券	411,400,000	122.50 503,965,000	126.75 521,449,500	7.125000 2037/1/20	1.29%
10	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	411,400,000	120.50 495,737,000	124.25 511,164,500	6.700000 2036/1/26	1.26%
11	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	421,685,000	121.50 512,347,275	121.00 510,238,850	7.375000 2019/3/18	1.26%
12	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	401,115,000	116.64 467,900,647	123.54 495,577,582	7.375000 2025/2/5	1.22%
13	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	473,110,000	102.37 484,346,362	104.27 493,335,452	4.000000 2023/10/2	1.22%
14	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19 メキシコ	国債証券	411,400,000	116.35 478,663,900	115.50 475,167,000	5.950000 2019/3/19	1.17%
15	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	473,110,000	97.25 460,099,475	100.00 473,110,000	4.875000 2023/9/16	1.17%
16	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	431,970,000	108.25 467,607,525	108.60 469,119,420	4.875000 2021/1/22	1.16%
17	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	431,970,000	101.73 439,478,050	107.35 463,719,795	5.750000 2110/10/12	1.15%
18	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	401,115,000	110.37 442,730,681	115.24 462,285,037	6.375000 2021/3/29	1.14%

19	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 メキシコ	国債証券	339,405,000	123.36 418,690,008	129.66 440,106,463	6.750000 2034/9/27	1.09%
20	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	411,400,000	103.31 425,037,910	103.92 427,526,880	5.000000 2020/4/29	1.06%
21	RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17 ロシア	国債証券	411,400,000	102.00 419,628,000	103.32 425,079,050	3.250000 2017/4/4	1.05%
22	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	329,120,000	125.00 411,400,000	126.87 417,571,000	6.375000 2034/10/23	1.03%
23	PANAMA 5.2 01/30/20 パナマ	国債証券	359,975,000	111.80 402,452,050	111.14 400,112,212	5.200000 2020/1/30	0.99%
24	BRAZIL 5.625 01/07/41 ブラジル	国債証券	370,260,000	104.75 387,847,350	107.75 398,955,150	5.625000 2041/1/7	0.99%
25	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	277,695,000	137.87 382,871,981	139.62 387,731,643	7.750000 2031/1/14	0.96%
26	BRAZIL 6.0 01/17/17 ブラジル	国債証券	349,690,000	111.38 389,484,722	110.73 387,229,221	6.000000 2017/1/17	0.96%
27	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	349,690,000	101.77 355,896,997	109.75 383,802,259	6.000000 2041/1/14	0.95%
28	REPUBLIC OF LITHUANIA 7.375 02/11/20 リトアニア	国債証券	308,550,000	123.20 380,159,312	123.00 379,516,500	7.375000 2020/2/11	0.94%
29	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17 メキシコ	国債証券	339,405,000	111.48 378,368,694	110.60 375,381,930	5.625000 2017/1/15	0.93%
30	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16 メキシコ	国債証券	308,550,000	124.37 383,759,062	120.98 373,283,790	11.375000 2016/9/15	0.92%

(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26年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	95.69%
合計	95.69%

(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26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・ポンド売/ 円買2014年10月	売建	47,300	8,184,403	8,220,740	8.90%
		ユーロ売/円買2014年10月	売建	46,500	6,382,307	6,405,840	6.93%
		アメリカ・ドル売/円買2014年10月	売建	53,500	5,432,687	5,499,265	5.95%
		カナダ・ドル売/円買2014年10月	売建	28,900	2,730,225	2,718,623	2.94%
		オーストラリア・ドル売/円買2014年10月	売建	28,500	2,703,193	2,718,615	2.94%

(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26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 2609月	買建	374	4,717,522,176	4,833,950,000	1.49%

(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26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2014年08月	買建	1,100,000	112,834,120	113,124,000	0.04%
		ユーロ買/円売201 4年08月	買建	300,000	41,170,150	41,337,000	0.01%
		オーストラリア・ドル 買/円売2014年0 8月	買建	200,000	19,177,300	19,176,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2014年08月	買建	100,000	9,426,900	9,426,000	0.00%
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 4	買建	74	3,709,076,978	3,739,044,897	1.21%
	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 4	買建	270	1,207,819,756	1,180,174,320	0.38%
	N Y S E L I F F E	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 4	買建	48	561,162,180	562,006,080	0.18%
	モン トリア ール取 引所	S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 4	買建	17	274,888,424	287,022,260	0.09%
	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 4	買建	18	233,634,742	240,768,792	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26年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ売/円買2014年08月	売建	564,175,300	78,239,427,796	77,737,714,587	44.63%
		アメリカ・ドル売/円買2014年08月	売建	641,876,300	65,006,743,988	66,010,558,692	37.89%
		イギリス・ポンド売/円買2014年08月	売建	81,092,200	14,038,705,992	14,108,420,956	8.10%
		カナダ・ドル売/円買2014年08月	売建	42,162,300	4,005,262,499	3,974,218,398	2.28%
		オーストラリア・ドル売/円買2014年08月	売建	30,667,600	2,924,112,725	2,940,102,812	1.69%
		メキシコ・ペソ売/円買2014年08月	売建	243,423,000	1,895,632,271	1,903,567,860	1.09%
		デンマーク・クローネ売/円買2014年08月	売建	78,296,800	1,456,502,937	1,446,924,864	0.83%
		ポーランド・ズロチ売/円買2014年08月	売建	36,017,800	1,198,469,515	1,192,909,536	0.68%
		スウェーデン・クローナ売/円買2014年08月	売建	64,690,300	979,490,447	966,473,082	0.55%
		マレーシア・リングgit売/円買2014年08月	売建	28,100,000	886,119,450	906,506,000	0.52%
		南アフリカ・ランド売/円買2014年08月	売建	91,203,400	862,976,711	876,464,674	0.50%
		シンガポール・ドル売/円買2014年08月	売建	7,581,500	615,905,139	626,383,530	0.36%
		ノルウェー・クローネ売/円買2014年08月	売建	29,657,700	488,792,813	487,572,588	0.28%

(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26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2014年08月	買建	700,000	71,994,720	71,988,000	0.18%
株価指数先物 取引	I C E - U S	M I N I M S C I E M G M K T S e p 1 4	買建	173	931,144,761	955,664,715	2.37%

(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26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2014年08月	買建	400,000	41,139,840	41,136,000	0.10%
		アメリカ・ドル売/円 買2014年08月	売建	300,000	30,629,550	30,852,000	0.08%

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成26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
平成25年10月末日	10	-	1.0000	-
11月末日	10	-	1.0131	-
12月末日	10	-	1.0205	-
平成26年1月末日	10	-	1.0041	-
2月末日	10	-	1.0120	-
3月末日	10	-	1.0070	-
4月末日	26	-	1.0074	-
5月末日	28	-	1.0250	-
6月末日	34	-	1.0297	-
7月末日	92	-	1.0387	-

【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

【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

(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

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

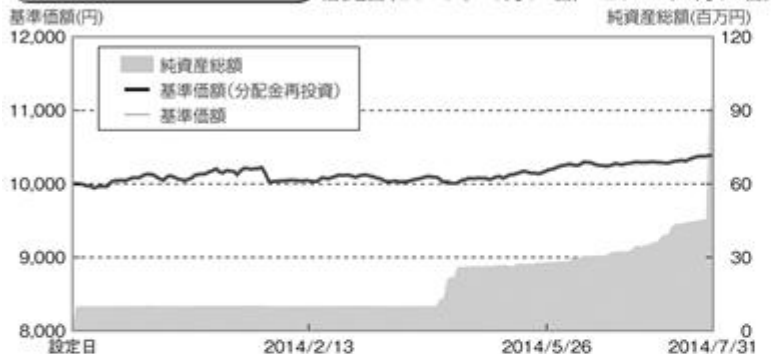
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2014年7月31日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2013年10月31日)~2014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
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	24.55%
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	24.54%
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	19.84%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.92%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.88%
6	外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド	5.94%
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.46%
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	2.98%

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)	△27.66

■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	80.54
内 日本	80.54
地方債証券	6.65
内 日本	6.65
特殊債券	6.67
内 日本	6.67
社債券	5.69
内 日本	5.60
内 アメリカ	0.09
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.45
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	利率(%)	償還日	投資比率
1	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.37%
2	330回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2023/9/20	1.34%
3	332回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/12/20	1.27%
4	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.26%
5	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/3/20	1.15%

■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	98.32
内 日本	98.32
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.68
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	4.51%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.45%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.96%
4	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.75%
5	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.69%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.57%
2	輸送用機器	11.32%
3	銀行業	8.90%
4	情報・通信業	7.06%
5	化学	5.51%

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)	1.49

○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:2014年7月31日

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	98.49
内 アメリカ	37.48
内 フランス	10.60
内 イタリア	10.54
内 ドイツ	8.62
内 イギリス	8.09
内 その他	23.16
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.51
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 0.375 04/30/16	国債証券	アメリカ	0.375000	2016/4/30	1.09%
2	US T N/B 0.625 05/31/17	国債証券	アメリカ	0.625000	2017/5/31	1.01%
3	US T N/B 0.375 01/15/16	国債証券	アメリカ	0.375000	2016/1/15	0.92%
4	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	国債証券	フランス	3.250000	2016/4/25	0.78%
5	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.750000	2023/11/15	0.78%

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)	△99.41

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.87
内 アメリカ	54.79
内 イギリス	8.79
内 カナダ	4.66
内 スイス	4.15
内 フランス	3.88
内 その他	19.60
投資信託受益証券	0.30
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.89
内 アメリカ	1.55
内 イギリス	0.13
内 フランス	0.13
内 香港	0.04
内 カナダ	0.02
内 オランダ	0.01
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.95
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	1.95%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.42%
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.10%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.92%
5	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.83%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	9.64%
2	石油・ガス・消耗燃料	9.00%
3	医薬品	6.92%
4	保険	4.10%
5	メディア	2.95%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.06
株価指数先物取引(買建)	1.94

■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	98.99
内 日本	98.99
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.01
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	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	9.41%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	8.37%
3	日本リテールファンド投資法人	日本	6.04%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.79%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.32%

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	13.02
内 オーストラリア	9.50
内 シンガポール	3.51
投資証券	86.31
内 アメリカ	67.46
内 イギリス	6.65
内 フランス	5.01
内 カナダ	2.58
内 香港	1.80
内 その他	2.81
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.67
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	5.80%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.92%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.78%
4	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.44%
5	PROLOGIS INC	アメリカ	2.27%

○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:2014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	95.69
内 ロシア	13.67
内 トルコ	13.64
内 メキシコ	13.30
内 ブラジル	10.93
内 コロンビア	7.67
内 その他	36.48
コールローン、その他の資産(負債控除後)	4.31
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	4.72%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.07/24/18	国債証券	ロシア	11.000000	2018/7/24	1.84%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.62%
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.050000	2040/1/11	1.61%
5	PERU 8.75 11/21/33	国債証券	ペルー	8.750000	2033/11/21	1.56%

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)	0.10
為替予約取引(売建)	△0.08

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.98
内 韓国	15.32
内 台湾	11.56
内 ブラジル	10.87
内 中国	9.64
内 南アフリカ	7.36
内 その他	41.23
投資信託受益証券	1.49
内 メキシコ	0.77
内 アメリカ	0.73
投資証券	0.23
内 メキシコ	0.17
内 トルコ	0.06
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.29
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	半導体・半導体製造装置	3.49%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	2.37%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェアサービス	1.97%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.56%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	商業銀行	1.27%

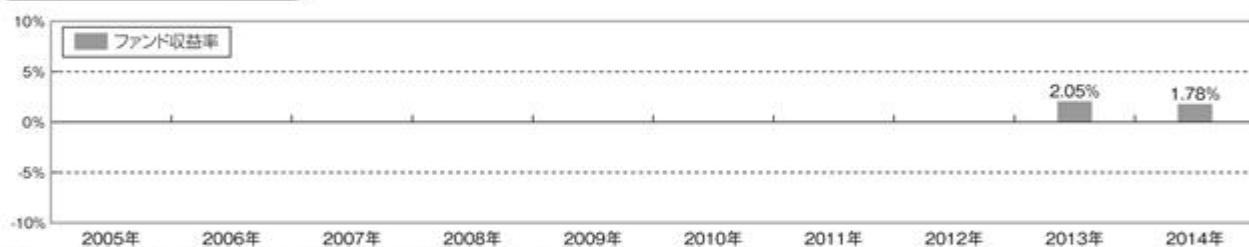
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	17.70%
2	石油・ガス・消耗燃料	9.91%
3	半導体・半導体製造装置	8.54%
4	無線通信サービス	5.22%
5	金属・鉱業	4.66%

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)	0.18
株価指数先物取引(買建)	2.37

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出しております。

※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2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンド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。継続申込期間中のお申込みの受付は、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、継続申込期間中において、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、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、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

当初自己設定

受益権1口当たり1円とします。

継続申込期間

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、設定日以降の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

当初自己設定

委託会社は自らが指定する口座を經由して、当初自己設定にかかる発行価額の総額を受託会社の指定するファンド口座に払い込みます。

継続申込期間

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經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の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、設定日以降の委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されません。

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、設定日以降の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。

ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成26年1月14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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

j. 上記b. に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

八. 関係法人との契約の更改

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

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。）および償還時に運用報告書（交付運用報告書を作成している場合は、交付運用報告書）を作成し、当該信託財産にかかる知っている受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。（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、）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、）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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成25年10月31日から平成26年1月14日までとなっております。

(4) 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2期計算期間(平成26年1月15日から平成26年7月11日まで)の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

投資のソムリエ＜DC年金＞

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成26年1月14日現在	第2期 平成26年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	435,108	1,143,222
親投資信託受益証券	9,705,790	38,220,927
派生商品評価勘定	8,922	72,385
未収入金	-	44,384
流動資産合計	10,149,820	39,480,918
資産合計		
	10,149,820	39,480,918
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	80	28
未払金	-	120,833
未払解約金	-	12,833
未払受託者報酬	1,055	5,160
未払委託者報酬	22,842	109,518
その他未払費用	75	403
流動負債合計	24,052	248,775
負債合計		
	24,052	248,775
純資産の部		
元本等		
元本	10,000,000	38,150,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	125,768	1,081,620
（分配準備積立金）	125,768	697,334
元本等合計	10,125,768	39,232,143
純資産合計		
	10,125,768	39,232,143
負債純資産合計		
	10,149,820	39,480,918

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期		第2期	
	自	平成25年10月31日 至 平成26年1月14日	自	平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
営業収益				
受取利息		77		210
有価証券売買等損益		179,790		728,437
為替差損益		30,127		24,207
営業収益合計		149,740		704,440
営業費用				
受託者報酬		1,055		5,160
委託者報酬		22,842		109,518
その他費用		75		403
営業費用合計		23,972		115,081
営業利益又は営業損失（ ）		125,768		589,359
経常利益又は経常損失（ ）		125,768		589,359
当期純利益又は当期純損失（ ）		125,768		589,359
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（ ）		-		11,122
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		125,768
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		388,347
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		388,347
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		10,732
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		10,732
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		125,768		1,081,620

(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26年1月14日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成26年1月14日現在	第2期 平成26年7月11日現在
1 . 1 期首元本額	10,000,000円	10,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	29,620,308円
期中一部解約元本額	- 円	1,469,785円
2 . 受益権の総数	10,000,000口	38,150,523口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成25年10月31日 至 平成26年1月14日	第2期 自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（37,415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（88,353円）、信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は125,768円（1万口当たり125.77円）ですが、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（243,797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（334,440円）、信託約款に規定される収益調整金（404,176円）及び分配準備積立金（119,097円）より分配対象収益は1,101,510円（1万口当たり288.73円）ですが、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1期 自 平成25年10月31日 至 平成26年1月14日	第2期 自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用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1期 平成26年1月14日現在	第2期 平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 平成26年1月14日現在	第2期 平成26年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	160,724	639,186
合計	160,724	639,186

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 平成26年1月14日 現在				第2期 平成26年7月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	809,004	-	800,162	8,842	11,781,096	-	11,708,739	72,357
アメリカ・ドル	198,506	-	196,194	2,312	2,523,326	-	2,512,488	10,838
イギリス・ボンド	102,893	-	101,520	1,373	3,784,923	-	3,761,478	23,445
オーストラリア・ドル	101,948	-	102,014	66	1,257,751	-	1,246,344	11,407
カナダ・ドル	107,084	-	104,082	3,002	1,256,311	-	1,253,076	3,235
ユーロ	298,573	-	296,352	2,221	2,958,785	-	2,935,353	23,432
合計	809,004	-	800,162	8,842	11,781,096	-	11,708,739	72,357

（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1期 平成26年1月14日現在	第2期 平成26年7月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0126円 (10,126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26年7月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化 法)・マザーファンド	1,531,250	2,706,025	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザー ファンド	8,175,485	9,826,932	
	J - R E I Tインデックスファンド・マ ザーファンド	815,168	1,175,716	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザー ファンド	1,126,108	2,710,429	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マ ザーファンド	2,593,099	2,364,906	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファ ンド・マザーファンド	7,873,826	9,836,770	
	エマージング株式パッシブ・マザーファ ンド	1,794,298	1,757,156	
	エマージング債券パッシブ・マザーファ ンド	5,253,529	7,842,993	
親投資信託受益証券 合計		29,162,763	38,220,927	
合計		29,162,763	38,220,927	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,895,360,972	10,199,176,940
株式	2	320,248,310,210	309,143,700,950
派生商品評価勘定		34,567,358	16,098,752
未収入金		1,288,606	7,059,808
未収配当金		273,846,443	249,042,165
流動資産合計		326,453,373,589	319,615,078,615
資産合計		326,453,373,589	319,615,078,615
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		51,798,776	39,234,836
前受金		117,119,000	46,140,000
未払解約金		110,521,000	626,151,000
流動負債合計		279,438,776	711,525,836
負債合計		279,438,776	711,525,836
純資産の部			
元本等			
元本	1	184,628,470,006	180,455,345,013
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		141,545,464,807	138,448,207,766
元本等合計		326,173,934,813	318,903,552,779
純資産合計		326,173,934,813	318,903,552,779
負債純資産合計		326,453,373,589	319,615,078,615

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	193,864,987,581円	184,628,470,006円
同期中追加設定元本額	3,275,715,327円	17,160,952,585円
同期中一部解約元本額	12,512,232,902円	21,334,077,578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	3,900,764,442円	4,070,156,401円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,308,664,287円	1,302,318,266円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	37,386,437,254円	37,227,116,028円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	726,842,761円	769,441,024円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,805,437,849円	2,906,864,162円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,003,831,153円	3,137,239,124円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	378,149,242円	425,486,727円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,257,889,028円	1,381,957,174円

D I A M D C バラン ス70インデックスファ ンド	1,079,326,406円	1,174,087,366円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	109,772,183円	103,163,094円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	1,356,765,982円	1,323,196,990円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	19,179,120円	23,218,922円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国10)	7,069,809円	8,940,477円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	9,887,126円	17,059,927円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	22,348,148円	41,988,924円
投資のソムリエ	44,112,076円	161,984,072円
クルーズコントロール	86,707,019円	504,644,758円
投資のソムリエ<DC年 金>	508,660円	1,531,250円
D I A M 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	580,141円	9,053,863円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	147,803,854円	147,964,428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)	4,907,354,834円	3,903,483,694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)	978,877,750円	811,007,040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)	126,015,339円	98,861,045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)	419,728,031円	380,247,936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)	108,039,554円	99,556,849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)	179,391,499円	158,327,505円
D I A M世界バラン スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	14,556,133,765円	14,035,129,735円
D I A M世界バラン スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	4,839,311,271円	4,616,697,657円

D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	3,446,603,030円	3,380,316,154円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	2,349,448,692円	2,267,500,550円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	5,676,930,412円	5,497,235,151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)	669,358,539円	567,314,766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)	1,678,633,192円	1,505,150,787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)	1,533,748,826円	1,438,450,480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)	7,967,750,812円	7,292,096,488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)	92,608,020円	87,280,606円
D I A M世界バランス ファンド55VA(適格 機関投資家限定)	2,965,892,961円	2,754,458,034円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	7,262,788,775円	7,082,264,454円
D I A Mグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	280,901,694円	253,965,296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)	27,214,805,359円	26,836,929,960円
D I A M世界アセットバ ランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,420,545,223円	1,266,746,443円
D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,195,419,506円	3,133,081,306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)	16,799,282,422円	16,687,818,103円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	39,341円	40,833円

	D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	111,634,058円	101,926,297円
	D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	83,660,397円	56,698,735円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	14,880,840,688円	14,822,546,216円
	D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	185,393,173円	143,743,419円
	D I A M国内バランス3 0VA(適格機関投資家 限定)	55,660,343円	50,278,069円
	D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	114,554,615円	73,514,460円
	D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	4,903,437円	75,171,627円
	D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	121,576円	126,984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)	952,190,469円	900,296,115円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1303)(適格機関 投資家限定)	2,443,408,346円	2,273,472,480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)	3,341,912,869円	2,945,619,832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)	132,504,648円	120,576,930円
	計	184,628,470,006円	180,455,345,013円
2.	受益権の総数	184,628,470,006口	180,455,345,013口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,072,000,000円	株式 2,990,500,000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25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	74,092,922,661	16,156,134,562
合計	74,092,922,661	16,156,134,562

(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25年2月8日から平成26年1月14日まで及び平成26年2月8日から平成26年7月11日まで)に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成26年1月14日 現在				平成26年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,812,732,000	-	5,795,760,000	16,972,000	9,318,741,000	-	9,295,845,000	22,896,000
合計	5,812,732,000	-	5,795,760,000	16,972,000	9,318,741,000	-	9,295,845,000	22,896,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7667円	1.7672円
（1万口当たり純資産額）	(17,667円)	(17,672円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	78,000	258.00	20,124,000	
日本水産	237,500	320.00	76,000,000	
マルハニチロ	37,400	1,603.00	59,952,200	
ハウスイ	16,000	134.00	2,144,000	
サカタのタネ	28,800	1,364.00	39,283,200	
ホクト	21,500	1,971.00	42,376,500	
ショーボンドHD	17,200	4,415.00	75,938,000	
ミライト・ホールディングス	55,000	993.00	54,615,000	
タマホーム	12,800	713.00	9,126,400	
住石ホールディングス	53,400	122.00	6,514,800	
日鉄鉱業	49,000	443.00	21,707,000	
三井松島	126,000	135.00	17,010,000	
国際石油開発帝石	939,200	1,524.00	1,431,340,800	
日本海洋掘削	4,800	4,915.00	23,592,000	
石油資源開発	27,500	4,000.00	110,000,000	
K&Oエナジーグループ	9,500	1,603.00	15,228,500	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,612.00	2,901,600	
安藤・間	128,900	590.00	76,051,000	
東急建設	68,500	476.00	32,606,000	
コムシスホールディングス	93,800	1,863.00	174,749,400	
ミサワホーム	20,800	1,277.00	26,561,600	
高松コンストラクションGP	14,600	1,655.00	24,163,000	
東建コーポレーション	7,200	4,680.00	33,696,000	
ヤマウラ	9,500	315.00	2,992,500	
大成建設	976,000	558.00	544,608,000	
大林組	579,000	697.00	403,563,000	
清水建設	591,000	697.00	411,927,000	
飛島建設	118,700	146.00	17,330,200	
長谷工コーポレーション	257,500	786.00	202,395,000	
松井建設	2,000	412.00	824,000	
銭高組	28,000	279.00	7,812,000	
鹿島建設	849,000	438.00	371,862,000	
不動テトラ	136,400	196.00	26,734,400	
大末建設	74,000	99.00	7,326,000	
鉄建建設	117,000	315.00	36,855,000	
日鉄住金テックスエンジ	31,000	541.00	16,771,000	
西松建設	253,000	421.00	106,513,000	
三井住友建設	519,200	111.00	57,631,200	
大豊建設	60,000	411.00	24,660,000	
前田建設	119,000	775.00	92,225,000	
佐田建設	67,000	115.00	7,705,000	
ナカノフドー建設	15,100	321.00	4,847,100	
奥村組	171,000	498.00	85,158,000	

大和小田急建設	10,700	371.00	3,969,700
東鉄工業	23,200	2,405.00	55,796,000
イチケン	22,000	175.00	3,850,000
浅沼組	58,000	121.00	7,018,000
戸田建設	225,000	391.00	87,975,000
熊谷組	219,000	257.00	56,283,000
青木あすなる建設	12,300	609.00	7,490,700
北野建設	41,000	257.00	10,537,000
植木組	25,000	209.00	5,225,000
三井ホーム	25,000	482.00	12,050,000
矢作建設	26,300	790.00	20,777,000
ピーエス三菱	15,300	450.00	6,885,000
東日本ハウス	22,200	528.00	11,721,600
大東建託	73,300	11,880.00	870,804,000
新日本建設	23,400	315.00	7,371,000
N I P P O	45,000	1,691.00	76,095,000
東亜道路	36,000	402.00	14,472,000
前田道路	61,000	1,704.00	103,944,000
日本道路	52,000	563.00	29,276,000
東亜建設	169,000	178.00	30,082,000
若築建設	104,000	135.00	14,040,000
東洋建設	60,300	374.00	22,552,200
五洋建設	229,800	344.00	79,051,200
大林道路	23,000	515.00	11,845,000
世紀東急	108,000	115.00	12,420,000
福田組	29,000	536.00	15,544,000
日本ドライケミカル	1,800	2,329.00	4,192,200
住友林業	133,000	1,203.00	159,999,000
日本基礎技術	21,700	352.00	7,638,400
日成ビルド工業	49,000	301.00	14,749,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	88,000	124.00	10,912,000
巴コーポレーション	24,300	418.00	10,157,400
パナホーム	72,000	788.00	56,736,000
大和ハウス	530,000	2,109.00	1,117,770,000
ライト工業	40,300	735.00	29,620,500
積水ハウス	514,700	1,365.00	702,565,500
日特建設	23,800	378.00	8,996,400
北陸電気工事	9,000	518.00	4,662,000
ユアテック	31,000	631.00	19,561,000
西部電気工業	17,000	481.00	8,177,000
四電工	6,000	417.00	2,502,000
中電工	28,000	1,500.00	42,000,000
関電工	88,000	577.00	50,776,000
きんでん	129,000	1,038.00	133,902,000
東京エネシス	20,000	552.00	11,040,000
トーエネック	27,000	579.00	15,633,000
住友電設	13,400	1,137.00	15,235,800
日本電設工業	31,600	1,605.00	50,718,000
協和エクシオ	75,700	1,419.00	107,418,300
新日本空調	16,800	746.00	12,532,800

日本工営	60,000	509.00	30,540,000
N D S	31,000	298.00	9,238,000
九電工	36,000	973.00	35,028,000
三機工業	41,000	741.00	30,381,000
日 揮	194,000	3,046.00	590,924,000
中外炉工業	50,000	220.00	11,000,000
ヤマト	16,000	358.00	5,728,000
太平電業	28,000	743.00	20,804,000
高砂熱学	54,000	1,181.00	63,774,000
三晃金属	22,000	229.00	5,038,000
N E C ネットズエスアイ	18,700	2,456.00	45,927,200
朝日工業社	23,000	413.00	9,499,000
明星工業	38,000	572.00	21,736,000
大 氣 社	25,700	2,349.00	60,369,300
ダイダン	25,000	609.00	15,225,000
日比谷総合設備	21,600	1,597.00	34,495,200
東芝プラントシステム	31,400	1,494.00	46,911,600
日本製粉	119,000	520.00	61,880,000
日清製粉G本社	192,800	1,228.00	236,758,400
日東富士製粉	8,000	313.00	2,504,000
昭和産業	81,000	374.00	30,294,000
鳥越製粉	16,100	699.00	11,253,900
協同飼料	70,000	102.00	7,140,000
中部飼料	18,900	672.00	12,700,800
日本配合飼料	61,000	117.00	7,137,000
東洋精糖	33,000	99.00	3,267,000
日本甜菜糖	100,000	186.00	18,600,000
三井製糖	76,000	380.00	28,880,000
塩水港精糖	15,200	272.00	4,134,400
ネクスト	15,100	808.00	12,200,800
日本M & Aセンター	27,800	2,850.00	79,230,000
ノバレーゼ	4,600	940.00	4,324,000
アコーディア・ゴルフ	73,300	1,311.00	96,096,300
タケエイ	12,500	1,046.00	13,075,000
トラスト・テック	3,100	1,712.00	5,307,200
パソナグループ	13,400	610.00	8,174,000
C D S	3,800	1,056.00	4,012,800
リンクアンドモチベーション	24,000	167.00	4,008,000
G C A サヴィアン	10,700	875.00	9,362,500
エス・エム・エス	10,100	2,819.00	28,471,900
テンプホールディングス	39,300	3,030.00	119,079,000
リニカル	4,700	958.00	4,502,600
クックパッド	8,900	2,636.00	23,460,400
エスクリ	6,400	924.00	5,913,600
アイ・ケイ・ケイ	4,100	845.00	3,464,500
森永製菓	191,000	220.00	42,020,000
中 村 屋	46,000	427.00	19,642,000
江崎グリコ	67,000	1,581.00	105,927,000
名糖産業	9,100	1,164.00	10,592,400
不 二 家	112,000	197.00	22,064,000

山崎製パン	142,000	1,279.00	181,618,000
第一屋製パン	28,000	124.00	3,472,000
モロゾフ	32,000	343.00	10,976,000
亀田製菓	10,900	3,260.00	35,534,000
寿スピリッツ	4,200	2,290.00	9,618,000
カルビー	71,500	2,882.00	206,063,000
森永乳業	164,000	371.00	60,844,000
六甲バター	9,100	881.00	8,017,100
ヤクルト	113,000	5,400.00	610,200,000
明治ホールディングス	57,200	6,890.00	394,108,000
雪印メグミルク	42,100	1,302.00	54,814,200
プリマハム	97,000	268.00	25,996,000
日本ハム	120,000	2,159.00	259,080,000
伊藤ハム	107,000	448.00	47,936,000
林兼産業	65,000	79.00	5,135,000
丸大食品	94,000	340.00	31,960,000
米久	6,500	887.00	5,765,500
S Foods	12,200	1,482.00	18,080,400
学情	5,800	994.00	5,765,200
スタジオアリス	7,400	1,449.00	10,722,600
シミックホールディングス	6,900	1,773.00	12,233,700
システナ	16,700	754.00	12,591,800
デジタルアーツ	6,000	931.00	5,586,000
新日鉄住金SOL	14,200	2,766.00	39,277,200
総合警備保障	65,500	2,415.00	158,182,500
キューブシステム	3,700	892.00	3,300,400
日本駐車場開発	185,400	122.00	22,618,800
コア	6,500	741.00	4,816,500
カカクコム	109,200	1,696.00	185,203,200
アイロムホールディングス	4,000	728.00	2,912,000
ルネサンス	8,300	906.00	7,519,800
ディップ	4,000	3,415.00	13,660,000
SBSホールディングス	11,200	600.00	6,720,000
オプト	9,700	809.00	7,847,300
新日本科学	14,900	892.00	13,290,800
ツクイ	19,400	944.00	18,313,600
総合臨床HLDGS	8,200	492.00	4,034,400
キャリアデザインセンター	5,300	1,073.00	5,686,900
エムスリー	121,100	1,585.00	191,943,500
ツカダ・グローバルHOLD	10,600	676.00	7,165,600
アウトソーシング	7,600	1,522.00	11,567,200
ディー・エヌ・エー	96,800	1,329.00	128,647,200
博報堂DYHLDGS	249,500	1,019.00	254,240,500
ぐるなび	25,000	1,694.00	42,350,000
一休	12,800	1,328.00	16,998,400
ジャパンベストレスキューS	14,800	290.00	4,292,000
ファンコミュニケーションズ	30,900	1,632.00	50,428,800
ジェイコムホールディングス	3,900	739.00	2,882,100
PGMホールディングス	25,500	1,007.00	25,678,500
WDBホールディングス	2,200	1,341.00	2,950,200

バリューコマース	11,100	1,000.00	11,100,000
サッポロホールディングス	317,000	431.00	136,627,000
アサヒグループホールディング	388,300	3,255.00	1,263,916,500
麒麟HD	826,500	1,457.00	1,204,210,500
宝ホールディングス	152,000	895.00	136,040,000
オエノンホールディングス	47,000	239.00	11,233,000
養命酒	3,000	958.00	2,874,000
コカ・コーラウエスト	59,600	1,752.00	104,419,200
コカ・コーライーストジャパン	40,000	2,763.00	110,520,000
サントリー食品インター	132,400	3,855.00	510,402,000
ダイドードリンコ	9,000	4,680.00	42,120,000
伊藤園	52,700	2,556.00	134,701,200
キーコーヒー	18,700	1,634.00	30,555,800
ユニカフェ	5,600	648.00	3,628,800
ジャパンフーズ	2,900	1,201.00	3,482,900
日清オイリオグループ	85,000	358.00	30,430,000
不二製油	46,900	1,506.00	70,631,400
J・オイルミルズ	81,000	329.00	26,649,000
ローソン	69,800	7,740.00	540,252,000
サンエー	12,900	3,130.00	40,377,000
麒麟堂	6,400	689.00	4,409,600
ダイユーエイト	3,700	661.00	2,445,700
カワチ薬品	11,900	1,890.00	22,491,000
エービーシー・マート	24,200	5,450.00	131,890,000
ハードオフコーポレーション	8,300	894.00	7,420,200
高千穂交易	7,200	1,035.00	7,452,000
アスクル	17,600	3,285.00	57,816,000
ゲオホールディングス	29,000	863.00	25,027,000
アダストリアホールディング	13,000	2,538.00	32,994,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	22,000	154.00	3,388,000
伊藤忠食品	4,400	3,600.00	15,840,000
くらコーポレーション	10,000	2,744.00	27,440,000
キャンドウ	8,100	1,561.00	12,644,100
エレマテック	8,000	1,915.00	15,320,000
パル	9,900	2,784.00	27,561,600
JALUX	5,100	1,216.00	6,201,600
エディオン	77,800	669.00	52,048,200
あらた	38,000	342.00	12,996,000
サーラコーポレーション	14,900	571.00	8,507,900
ワッツ	6,700	995.00	6,666,500
トーメンデバイス	2,600	1,786.00	4,643,600
J Pホールディングス	40,300	424.00	17,087,200
あみやき亭	2,900	3,235.00	9,381,500
東京エレクトロンデバイス	3,400	1,468.00	4,991,200
ひらまつ	20,800	659.00	13,707,200
双日	1,139,600	175.00	199,430,000
ゲンキー	1,700	2,963.00	5,037,100
アルフレッサホールディングス	50,300	6,400.00	321,920,000
大黒天物産	4,100	2,688.00	11,020,800
ハニーズ	13,400	1,029.00	13,788,600

キッコーマン	158,000	2,154.00	340,332,000
味の素	460,000	1,575.00	724,500,000
キューピー	98,300	1,717.00	168,781,100
ハウス食品G本社	68,000	1,929.00	131,172,000
カゴメ	75,000	1,776.00	133,200,000
焼津水産化工	8,900	980.00	8,722,000
アリアケジャパン	17,700	2,665.00	47,170,500
ニチレイ	206,000	473.00	97,438,000
横浜冷凍	42,600	828.00	35,272,800
東洋水産	95,000	3,115.00	295,925,000
イトアンド	1,700	1,615.00	2,745,500
日清食品HD	75,500	5,280.00	398,640,000
永谷園	7,000	1,031.00	7,217,000
フジッコ	19,000	1,282.00	24,358,000
ロックフィールド	10,200	1,907.00	19,451,400
日本たばこ産業	1,070,300	3,719.00	3,980,445,700
ケンコーマヨネーズ	6,700	1,030.00	6,901,000
わらべや日洋	11,400	2,005.00	22,857,000
なとり	9,400	1,119.00	10,518,600
片倉工業	20,800	1,295.00	26,936,000
グンゼ	146,000	287.00	41,902,000
ヒューリック	287,100	1,346.00	386,436,600
神栄	23,000	210.00	4,830,000
山下医科器械	1,400	1,770.00	2,478,000
ラサ商事	8,600	484.00	4,162,400
アルペン	15,100	1,731.00	26,138,100
クオール	12,600	602.00	7,585,200
アルコニックス	5,100	2,968.00	15,136,800
神戸物産	2,400	3,215.00	7,716,000
ジェイアイエヌ	11,500	3,410.00	39,215,000
ビックカメラ	73,800	791.00	58,375,800
DCMホールディングス	82,100	711.00	58,373,100
MonotaRO	26,400	3,030.00	79,992,000
あいホールディングス	27,300	1,842.00	50,286,600
J.フロントリテイリング	402,000	679.00	272,958,000
ドトール・日レスHD	29,800	1,748.00	52,090,400
マツモトキヨシHLDS	35,100	3,460.00	121,446,000
ブロンコビリー	2,700	2,796.00	7,549,200
スタートトゥデイ	52,900	2,643.00	139,814,700
物語コーポレーション	4,200	3,025.00	12,705,000
ココカラファイン	17,700	2,912.00	51,542,400
三越伊勢丹HD	338,100	1,245.00	420,934,500
東洋紡	763,000	169.00	128,947,000
ユニチカ	492,000	46.00	22,632,000
富士紡ホールディングス	94,000	299.00	28,106,000
日清紡ホールディングス	115,000	1,002.00	115,230,000
倉敷紡績	185,000	179.00	33,115,000
ダイワボウHD	155,000	193.00	29,915,000
シキボウ	104,000	117.00	12,168,000
日東紡績	133,000	403.00	53,599,000

トヨタ紡織	60,300	1,072.00	64,641,600
ウエルシアHD	7,700	6,290.00	48,433,000
クリエイトSDH	7,200	3,605.00	25,956,000
バイタルKSKHD	32,100	820.00	26,322,000
八洲電機	13,500	528.00	7,128,000
UKCホールディングス	10,900	1,588.00	17,309,200
丸善CHIHHD	15,200	353.00	5,365,600
TOKAIホールディングス	83,400	425.00	35,445,000
エー・ピーカンパニー	2,000	1,960.00	3,920,000
三洋貿易	10,300	1,173.00	12,081,900
チムニー	6,200	1,992.00	12,350,400
ジョイフル本田	9,300	4,220.00	39,246,000
日本毛織	57,000	790.00	45,030,000
大東紡織	29,000	75.00	2,175,000
トーア紡コーポレーション	77,000	73.00	5,621,000
ダイドーリミテッド	20,200	552.00	11,150,400
東京建物不動産販	9,200	403.00	3,707,600
三栄建築設計	7,000	888.00	6,216,000
野村不動産HLDS	112,400	1,873.00	210,525,200
プレサンスコーポレーション	4,100	2,945.00	12,074,500
常和ホールディングス	6,000	3,745.00	22,470,000
フージャースHD	25,200	488.00	12,297,600
オープンハウス	10,500	2,169.00	22,774,500
東急不動産HD	377,300	789.00	297,689,700
飯田GHD	74,500	1,506.00	112,197,000
帝国繊維	18,900	2,176.00	41,126,400
ブックオフコーポレーション	9,300	818.00	7,607,400
日本コークス工業	145,800	117.00	17,058,600
ミタチ産業	4,000	563.00	2,252,000
あさひ	9,800	1,385.00	13,573,000
日本調剤	2,200	2,674.00	5,882,800
コスモス薬品	9,600	11,060.00	106,176,000
シップヘルスケアHD	24,400	3,335.00	81,374,000
トーエル	9,200	652.00	5,998,400
一六堂	3,600	444.00	1,598,400
ソフトクリエイトHD	5,500	851.00	4,680,500
セブン&アイ・HLDS	711,600	4,340.00	3,088,344,000
クリエイト・レストランツ・ホール	2,800	2,994.00	8,383,200
ツルハホールディングス	33,500	5,560.00	186,260,000
スターティア	1,400	1,556.00	2,178,400
サンマルクホールディングス	5,500	5,550.00	30,525,000
フェリシモ	4,900	1,084.00	5,311,600
トリドール	14,800	864.00	12,787,200
クスリのアオキ	7,500	3,410.00	25,575,000
帝人	738,000	246.00	181,548,000
東レ	1,310,000	678.00	888,180,000
クラレ	286,900	1,301.00	373,256,900
旭化成	1,126,000	774.00	871,524,000
サカイオーベックス	47,000	166.00	7,802,000

稲葉製作所	7,800	1,420.00	11,076,000
宮地エンジニアリングG	59,000	198.00	11,682,000
トーカロ	11,100	1,754.00	19,469,400
アルファCO	6,500	1,030.00	6,695,000
SUMCO	110,300	957.00	105,557,100
川田テクノロジーズ	3,700	5,350.00	19,795,000
住江織物	50,000	318.00	15,900,000
日本フェルト	10,700	465.00	4,975,500
イチカワ	12,000	275.00	3,300,000
日本バイリーン	19,000	570.00	10,830,000
エコナックホールディングス	54,000	47.00	2,538,000
日東製網	21,000	154.00	3,234,000
芦森工業	40,000	230.00	9,200,000
アツギ	151,000	109.00	16,459,000
ダイニック	35,000	160.00	5,600,000
共和レザー	12,000	499.00	5,988,000
セーレン	48,500	905.00	43,892,500
東海染工	26,000	117.00	3,042,000
小松精練	30,000	569.00	17,070,000
ワコールホールディングス	107,000	1,091.00	116,737,000
ホギメディカル	11,400	5,570.00	63,498,000
レナウン	43,000	122.00	5,246,000
クラウディア	2,300	1,265.00	2,909,500
T S Iホールディングス	86,800	711.00	61,714,800
I Tホールディングス	61,000	1,901.00	115,961,000
ネオス	3,600	915.00	3,294,000
電算システム	5,400	1,484.00	8,013,600
グリー	102,400	841.00	86,118,400
コーエーテクモHD	33,600	1,365.00	45,864,000
三菱総合研究所	6,600	2,340.00	15,444,000
ボルテージ	3,000	1,356.00	4,068,000
電算	1,600	2,176.00	3,481,600
A G S	3,500	814.00	2,849,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,400	1,930.00	4,632,000
ブレインパッド	1,800	1,347.00	2,424,600
K L a b	11,800	1,308.00	15,434,400
ポルトウウィン・ピットクル	10,200	1,178.00	12,015,600
イーブックイニシアティブ	3,300	1,160.00	3,828,000
ネクソン	141,200	932.00	131,598,400
アイスタイル	5,600	420.00	2,352,000
エムアップ	4,100	857.00	3,513,700
エイチーム	2,100	6,160.00	12,936,000
e n i s h	3,200	1,576.00	5,043,200
コロプラ	29,500	2,680.00	79,060,000
モバイルクリエイト	1,800	3,655.00	6,579,000
オルトプラス	3,100	1,241.00	3,847,100
ブロードリーフ	22,400	1,936.00	43,366,400
ハーツユナイテッドグループ	3,800	2,150.00	8,170,000
特種東海製紙	105,000	222.00	23,310,000
ダウンゴ	19,600	2,456.00	48,137,600

ベリサーブ	1,000	1,794.00	1,794,000
ティーガイア	16,900	916.00	15,480,400
豆蔵ホールディングス	13,200	517.00	6,824,400
テクマトリックス	7,300	639.00	4,664,700
GMOペイメントゲートウェイ	7,400	4,275.00	31,635,000
ザッパラス	9,600	620.00	5,952,000
インターネットイニシアティブ	25,000	2,443.00	61,075,000
ビットアイル	19,100	630.00	12,033,000
SRAホールディングス	8,100	1,583.00	12,822,300
システムインテグレータ	1,800	710.00	1,278,000
朝日ネット	15,800	504.00	7,963,200
コムチュア	2,000	1,883.00	3,766,000
王子ホールディングス	798,000	414.00	330,372,000
日本製紙	93,300	1,862.00	173,724,600
三菱製紙	258,000	89.00	22,962,000
北越紀州製紙	123,300	441.00	54,375,300
中越パルプ	69,000	180.00	12,420,000
巴川製紙	28,000	191.00	5,348,000
大王製紙	69,000	891.00	61,479,000
レンゴー	145,000	472.00	68,440,000
トーモク	57,000	292.00	16,644,000
ザ・パック	12,800	2,066.00	26,444,800
コープケミカル	28,000	115.00	3,220,000
昭和電工	1,202,000	143.00	171,886,000
住友化学	1,329,000	377.00	501,033,000
日本化成	35,000	143.00	5,005,000
住友精化	37,000	692.00	25,604,000
日産化学	120,700	1,664.00	200,844,800
ラサ工業	68,000	144.00	9,792,000
クレハ	127,000	531.00	67,437,000
多木化学	8,000	731.00	5,848,000
テイカ	31,000	343.00	10,633,000
石原産業	324,000	87.00	28,188,000
片倉チツカリン	13,000	265.00	3,445,000
日本曹達	116,000	545.00	63,220,000
東ソー	483,000	463.00	223,629,000
トクヤマ	281,000	321.00	90,201,000
セントラル硝子	173,000	376.00	65,048,000
東亜合成	212,000	450.00	95,400,000
ダイソー	72,000	357.00	25,704,000
関東電化	43,000	249.00	10,707,000
電気化学	349,000	383.00	133,667,000
イビデン	104,900	1,998.00	209,590,200
信越化学	323,700	6,075.00	1,966,477,500
日本カーバイド	53,000	267.00	14,151,000
堺化学	73,000	318.00	23,214,000
エア・ウォーター	149,000	1,644.00	244,956,000
大陽日酸	232,000	897.00	208,104,000
日本化学工業	67,000	140.00	9,380,000
日本パーカラライジング	42,600	2,208.00	94,060,800

高压ガス	27,000	608.00	16,416,000
チタン工業	21,000	232.00	4,872,000
四国化成	26,000	765.00	19,890,000
戸田工業	33,000	294.00	9,702,000
ステラ ケミファ	9,300	1,316.00	12,238,800
保土谷化学	55,000	186.00	10,230,000
日本触媒	153,000	1,305.00	199,665,000
大日精化	70,000	477.00	33,390,000
カネカ	225,000	614.00	138,150,000
協和発酵キリン	216,000	1,396.00	301,536,000
三菱瓦斯化学	285,000	625.00	178,125,000
三井化学	821,000	267.00	219,207,000
J S R	165,600	1,762.00	291,787,200
東京応化工業	34,900	2,385.00	83,236,500
大阪有機化学	12,400	456.00	5,654,400
三菱ケミカルH L D G S	1,129,000	436.00	492,244,000
日本合成化学	37,000	826.00	30,562,000
ダイセル	234,000	975.00	228,150,000
住友ベークライト	141,000	396.00	55,836,000
積水化学	370,000	1,202.00	444,740,000
日本ゼオン	142,000	1,036.00	147,112,000
アイカ工業	50,700	2,186.00	110,830,200
宇部興産	909,000	172.00	156,348,000
積水樹脂	25,500	1,401.00	35,725,500
タキロン	42,000	588.00	24,696,000
旭有機材	64,000	215.00	13,760,000
日立化成	78,100	1,626.00	126,990,600
ニチバン	18,000	368.00	6,624,000
リケンテクノス	29,000	520.00	15,080,000
大倉工業	43,000	335.00	14,405,000
積水化成品	51,000	277.00	14,127,000
群栄化学	48,000	392.00	18,816,000
タイガース ポリマー	8,900	525.00	4,672,500
ミライアル	6,000	1,793.00	10,758,000
ダイキョーニシカワ	4,300	1,966.00	8,453,800
日本化薬	127,000	1,295.00	164,465,000
カーリットホールディングス	14,800	579.00	8,569,200
イーピーエス	21,300	1,332.00	28,371,600
パナソニック インフォシス	3,400	2,732.00	9,288,800
プレステージ・インター	12,400	842.00	10,440,800
フェイス	5,200	1,062.00	5,522,400
アミューズ	5,000	1,973.00	9,865,000
野村総合研究所	96,300	3,070.00	295,641,000
ドリームインキュベータ	4,800	1,581.00	7,588,800
サイバネットシステム	13,900	358.00	4,976,200
T A C	10,900	280.00	3,052,000
ケネディクス	212,100	466.00	98,838,600
電通	169,800	4,065.00	690,237,000
インテージホールディングス	9,300	1,378.00	12,815,400
テイクアンドギヴニーズ	7,700	1,327.00	10,217,900

東邦システムサイエンス	2,900	832.00	2,412,800
ぴあ	5,400	1,800.00	9,720,000
イオンファンタジー	5,900	1,404.00	8,283,600
ソースネクスト	8,500	730.00	6,205,000
ネクシィーズ	6,500	798.00	5,187,000
メディカルシステムネットワーク	14,000	365.00	5,110,000
ティー・ワイ・オー	16,400	185.00	3,034,000
日本精化	15,200	687.00	10,442,400
A D E K A	77,800	1,351.00	105,107,800
日油	150,000	715.00	107,250,000
ミヨシ油脂	68,000	140.00	9,520,000
新日本理化	28,600	258.00	7,378,800
ハリマ化成グループ	16,000	459.00	7,344,000
花 王	469,400	4,192.00	1,967,724,800
第一工業製薬	33,000	445.00	14,685,000
三洋化成	57,000	721.00	41,097,000
武田薬品	676,200	4,663.00	3,153,120,600
アステラス製薬	2,056,100	1,349.00	2,773,678,900
大日本住友製薬	127,700	1,146.00	146,344,200
塩野義製薬	281,900	2,187.00	616,515,300
田辺三菱製薬	150,200	1,492.00	224,098,400
わかもと製薬	7,000	251.00	1,757,000
あすか製薬	21,300	1,130.00	24,069,000
日本新薬	41,000	2,960.00	121,360,000
ピオフェルミン製薬	3,000	2,620.00	7,860,000
中外製薬	179,700	2,846.00	511,426,200
科研製薬	62,000	2,157.00	133,734,000
エーザイ	222,200	4,214.00	936,350,800
ロート製薬	75,800	1,547.00	117,262,600
小野薬品	82,000	8,860.00	726,520,000
久光製薬	56,000	4,275.00	239,400,000
有機合成薬品	13,000	265.00	3,445,000
持田製薬	12,900	7,050.00	90,945,000
参天製薬	66,300	5,780.00	383,214,000
扶桑薬品	61,000	316.00	19,276,000
日本ケミファ	25,000	506.00	12,650,000
ツムラ	53,000	2,389.00	126,617,000
日医工	42,300	1,470.00	62,181,000
テ ル モ	264,200	2,232.00	589,694,400
みらかホールディングス	47,300	4,965.00	234,844,500
キッセイ薬品工業	33,500	2,390.00	80,065,000
生化学工業	37,700	1,266.00	47,728,200
栄研化学	14,000	1,734.00	24,276,000
日水製薬	7,400	1,230.00	9,102,000
鳥居薬品	12,400	3,115.00	38,626,000
J C R ファーマ	13,900	2,431.00	33,790,900
東和薬品	9,200	3,970.00	36,524,000
富士製薬工業	5,200	1,890.00	9,828,000
沢井製薬	28,600	5,930.00	169,598,000

ゼリア新薬工業	28,400	2,461.00	69,892,400
第一三共	569,300	1,858.00	1,057,759,400
キョーリン製薬HD	48,200	2,114.00	101,894,800
大幸薬品	8,600	1,591.00	13,682,600
ダイト	6,000	1,733.00	10,398,000
大塚ホールディングス	358,300	3,201.00	1,146,918,300
大正製薬HD	43,400	7,390.00	320,726,000
大日本塗料	104,000	155.00	16,120,000
日本ペイント	156,000	2,207.00	344,292,000
関西ペイント	219,000	1,731.00	379,089,000
神東塗料	11,000	215.00	2,365,000
中国塗料	52,000	738.00	38,376,000
日本特殊塗料	14,100	603.00	8,502,300
藤倉化成	22,900	525.00	12,022,500
太陽ホールディングス	14,800	3,060.00	45,288,000
D I C	668,000	245.00	163,660,000
サカタインクス	37,000	966.00	35,742,000
東洋インキSCホールディン	162,000	484.00	78,408,000
T & K T O K A	6,600	2,135.00	14,091,000
アルプス技研	7,400	1,138.00	8,421,200
サニックス	26,200	1,183.00	30,994,600
ダイオーズ	3,500	974.00	3,409,000
日本空調サービス	8,900	757.00	6,737,300
オリエンタルランド	48,700	18,220.00	887,314,000
ダスキン	47,600	1,936.00	92,153,600
パーク24	89,300	1,857.00	165,830,100
明光ネットワークジャパン	17,900	1,277.00	22,858,300
ファルコSDホールディングス	9,300	1,226.00	11,401,800
クレスコ	3,900	1,227.00	4,785,300
フジ・メディア・HD	164,400	1,623.00	266,821,200
秀英予備校	3,800	328.00	1,246,400
田谷	3,200	766.00	2,451,200
ラウンドワン	51,000	601.00	30,651,000
リゾートトラスト	60,900	2,084.00	126,915,600
オービック	58,600	3,310.00	193,966,000
ジャストシステム	23,200	876.00	20,323,200
TDCソフトウェアエンジニア	3,800	846.00	3,214,800
ヤフー	1,219,100	446.00	543,718,600
ビー・エム・エル	11,800	3,825.00	45,135,000
ワタベウエディング	6,000	586.00	3,516,000
トレンドマイクロ	75,100	3,525.00	264,727,500
もしもしホットライン	33,500	980.00	32,830,000
リソー教育	20,100	241.00	4,844,100
日本オラクル	27,200	4,400.00	119,680,000
早稲田アカデミー	2,900	799.00	2,317,100
アルファシステムズ	5,500	1,547.00	8,508,500
フューチャーアーキテクト	20,400	590.00	12,036,000
CAC HOLDINGS	10,300	1,111.00	11,443,300
ソフトバンク・テクノ	4,000	1,589.00	6,356,000
トーセ	4,300	750.00	3,225,000

ユー・エス・エス	217,900	1,726.00	376,095,400
オービックビジネスC	8,600	3,280.00	28,208,000
伊藤忠テクノソリューションズ	19,200	4,325.00	83,040,000
アイティフォー	18,900	452.00	8,542,800
東京個別指導学院	8,700	425.00	3,697,500
東計電算	3,100	1,412.00	4,377,200
楽天	781,000	1,328.00	1,037,168,000
エクスネット	1,700	1,392.00	2,366,400
テー・オー・ダブリュー	6,100	680.00	4,148,000
大塚商会	45,600	4,920.00	224,352,000
総合メディカル	4,100	4,705.00	19,290,500
サイボウズ	25,500	385.00	9,817,500
ソフトブレーン	23,500	262.00	6,157,000
アグレックス	4,000	1,100.00	4,400,000
セントラルスポーツ	5,800	1,630.00	9,454,000
パラカ	6,400	778.00	4,979,200
電通国際情報S	10,500	1,284.00	13,482,000
イーエムシステムズ	2,300	1,793.00	4,123,900
ウェザーニューズ	5,100	3,190.00	16,269,000
C I J	15,800	435.00	6,873,000
東洋ビジネスエンジ	1,700	1,394.00	2,369,800
日本エンタープライズ	10,700	258.00	2,760,600
WOWOW	5,200	3,955.00	20,566,000
フルキャストホールディングス	16,400	404.00	6,625,600
富士フイルムHLDGS	413,100	2,866.00	1,183,944,600
コニカミノルタ	455,300	1,004.00	457,121,200
資生堂	321,100	1,864.00	598,530,400
ライオン	208,000	588.00	122,304,000
高砂香料	65,000	472.00	30,680,000
マンダム	18,100	3,755.00	67,965,500
ミルボン	11,500	3,330.00	38,295,000
ファンケル	41,900	1,228.00	51,453,200
コーセー	29,200	3,995.00	116,654,000
コタ	5,200	1,311.00	6,817,200
ドクターシーラボ	12,300	3,820.00	46,986,000
シーボン	1,600	2,295.00	3,672,000
ポーラ・オルビスHD	18,400	4,095.00	75,348,000
ノエビアホールディングス	12,100	2,122.00	25,676,200
アジュバンコスメジャパン	3,100	968.00	3,000,800
エステー	11,300	1,010.00	11,413,000
コニシ	13,100	2,209.00	28,937,900
長谷川香料	22,900	1,540.00	35,266,000
星光PMC	9,800	1,196.00	11,720,800
小林製薬	29,600	6,310.00	186,776,000
荒川化学工業	15,300	1,288.00	19,706,400
メック	14,000	1,066.00	14,924,000
日本高純度化学	5,200	2,145.00	11,154,000
JCU	2,600	6,930.00	18,018,000
新田ゼラチン	11,000	908.00	9,988,000
アース製薬	13,000	3,900.00	50,700,000

イハラケミカル	27,900	862.00	24,049,800
北興化学	18,000	413.00	7,434,000
大成ラミック	4,800	2,693.00	12,926,400
クミアイ化学	37,000	635.00	23,495,000
日本農薬	41,200	1,154.00	47,544,800
昭和シエル石油	161,300	1,161.00	187,269,300
コスモ石油	499,000	209.00	104,291,000
富士興産	6,400	643.00	4,115,200
ニチレキ	22,000	1,039.00	22,858,000
東燃ゼネラル石油	272,000	935.00	254,320,000
ユシロ化学	9,800	1,297.00	12,710,600
ビーピー・カストロール	7,600	641.00	4,871,600
富士石油	46,000	316.00	14,536,000
MORESCO	5,700	1,718.00	9,792,600
出光興産	85,600	2,179.00	186,522,400
JXホールディングス	2,003,600	532.00	1,065,915,200
横浜ゴム	202,000	864.00	174,528,000
東洋ゴム	75,000	1,797.00	134,775,000
ブリヂストン	565,700	3,690.00	2,087,433,000
住友ゴム	140,800	1,459.00	205,427,200
藤倉ゴム	11,300	884.00	9,989,200
オカモト	63,000	354.00	22,302,000
アキレス	143,000	146.00	20,878,000
フコク	7,800	967.00	7,542,600
ニッタ	17,800	2,334.00	41,545,200
クリエートメディック	5,800	980.00	5,684,000
東海ゴム工業	33,400	1,026.00	34,268,400
三ツ星ベルト	46,000	609.00	28,014,000
バンドー化学	66,000	421.00	27,786,000
鬼怒川ゴム	32,000	505.00	16,160,000
旭硝子	889,000	587.00	521,843,000
日本板硝子	870,000	136.00	118,320,000
石塚硝子	24,000	215.00	5,160,000
有沢製作所	30,000	740.00	22,200,000
日本山村硝子	72,000	165.00	11,880,000
日本電気硝子	373,000	584.00	217,832,000
オハラ	7,200	583.00	4,197,600
住友大阪セメント	335,000	375.00	125,625,000
太平洋セメント	1,060,000	391.00	414,460,000
デイ・シイ	18,600	496.00	9,225,600
リゾートソリューション	16,000	233.00	3,728,000
日本ヒューム	17,000	668.00	11,356,000
日本コンクリート	34,000	523.00	17,782,000
三谷セキサン	9,100	1,553.00	14,132,300
ジャパンパイル	21,800	853.00	18,595,400
東海カーボン	169,000	297.00	50,193,000
日本カーボン	95,000	187.00	17,765,000
東洋炭素	11,100	2,392.00	26,551,200
ノリタケ	102,000	276.00	28,152,000
TOTO	265,000	1,326.00	351,390,000

日本碍子	228,000	2,346.00	534,888,000
日本特殊陶業	156,000	2,842.00	443,352,000
ダントーホールディングス	25,000	120.00	3,000,000
M A R U W A	4,600	4,000.00	18,400,000
品川リフラクトリーズ	46,000	228.00	10,488,000
黒崎播磨	39,000	235.00	9,165,000
ヨータイ	11,000	330.00	3,630,000
イソライト	7,400	188.00	1,391,200
東京窯業	22,000	211.00	4,642,000
ニッカトー	6,700	405.00	2,713,500
フジインコーポレーテッド	16,500	1,369.00	22,588,500
エーアンドエーマテリアル	38,000	120.00	4,560,000
ニチアス	87,000	666.00	57,942,000
新日鐵住金	7,629,000	305.00	2,326,845,000
神戸製鋼所	2,879,000	155.00	446,245,000
中山製鋼所	101,000	85.00	8,585,000
合同製鐵	93,000	150.00	13,950,000
J F E ホールディングス	460,400	2,072.00	953,948,800
日新製鋼	76,500	1,298.00	99,297,000
東京製鐵	99,600	500.00	49,800,000
共英製鋼	16,900	1,866.00	31,535,400
大和工業	37,400	3,070.00	114,818,000
東京鐵鋼	38,000	495.00	18,810,000
大阪製鐵	9,100	1,781.00	16,207,100
淀川製鋼所	129,000	444.00	57,276,000
東洋鋼鈑	43,000	579.00	24,897,000
丸一鋼管	60,400	2,790.00	168,516,000
モリ工業	27,000	404.00	10,908,000
大同特殊鋼	302,000	509.00	153,718,000
日本高周波	72,000	102.00	7,344,000
日本冶金工	140,900	306.00	43,115,400
山陽特殊製鋼	99,000	474.00	46,926,000
愛知製鋼	96,000	408.00	39,168,000
日立金属	161,000	1,583.00	254,863,000
日本金属	48,000	142.00	6,816,000
大平洋金属	126,000	524.00	66,024,000
新日本電工	102,000	314.00	32,028,000
栗本鉄工所	93,000	238.00	22,134,000
虹 技	26,000	227.00	5,902,000
日本鑄鉄管	20,000	231.00	4,620,000
日本製鋼所	258,000	438.00	113,004,000
三菱製鋼	109,000	229.00	24,961,000
日亜鋼業	25,000	308.00	7,700,000
日本精線	14,000	489.00	6,846,000
大紀アルミニウム	28,000	298.00	8,344,000
日本軽金属HD	409,500	156.00	63,882,000
三井金属	460,000	307.00	141,220,000
東邦亜鉛	102,000	449.00	45,798,000
三菱マテリアル	1,126,000	370.00	416,620,000
住友鉱山	467,000	1,723.00	804,641,000

DOWAホールディングス	199,000	972.00	193,428,000
古河機金	304,000	203.00	61,712,000
エス・サイエンス	81,600	47.00	3,835,200
大阪チタニウム	19,700	2,639.00	51,988,300
東邦チタニウム	30,700	809.00	24,836,300
UACJ	229,000	388.00	88,852,000
古河電工	567,000	215.00	121,905,000
住友電工	679,900	1,478.00	1,004,892,200
フジクラ	290,000	514.00	149,060,000
昭和電線HLDGS	232,000	114.00	26,448,000
東京特殊電線	25,000	178.00	4,450,000
タツタ電線	26,200	608.00	15,929,600
沖電線	19,000	317.00	6,023,000
カナレ電気	2,700	1,635.00	4,414,500
平河ヒューテック	3,900	865.00	3,373,500
リョービ	110,000	327.00	35,970,000
アーレステイ	15,500	856.00	13,268,000
アサヒHD	27,200	1,765.00	48,008,000
東洋製罐グループHD	128,200	1,560.00	199,992,000
ホッカンホールディングス	43,000	290.00	12,470,000
コロナ	9,500	1,177.00	11,181,500
横河ブリッジHLDGS	34,200	1,439.00	49,213,800
OSJBHD	39,500	144.00	5,688,000
駒井ハルテック	35,000	290.00	10,150,000
高田機工	17,000	198.00	3,366,000
三和ホールディングス	147,000	708.00	104,076,000
文化シャッター	43,000	870.00	37,410,000
三協立山	22,000	1,959.00	43,098,000
東洋シャッター	4,900	836.00	4,096,400
LIXILグループ	251,300	2,631.00	661,170,300
日本ファイルコン	12,100	456.00	5,517,600
ノーリツ	35,400	1,980.00	70,092,000
長府製作所	19,300	2,569.00	49,581,700
リンナイ	28,000	9,480.00	265,440,000
ユニプレス	27,900	2,339.00	65,258,100
ダイニチ工業	9,300	722.00	6,714,600
日東精工	26,000	391.00	10,166,000
三洋工業	24,000	208.00	4,992,000
岡部	35,600	1,202.00	42,791,200
中国工業	3,000	783.00	2,349,000
東プレ	34,700	1,314.00	45,595,800
高周波熱錬	26,300	740.00	19,462,000
東京製綱	122,000	163.00	19,886,000
モリテックスチル	9,700	327.00	3,171,900
パイオラックス	8,400	3,920.00	32,928,000
日本発条	143,600	996.00	143,025,600
中央発條	24,000	323.00	7,752,000
アドバネクス	36,000	178.00	6,408,000
三浦工業	26,800	3,720.00	99,696,000
タクマ	56,000	649.00	36,344,000

リブセンス	8,900	1,103.00	9,816,700
ジャパンマテリアル	2,100	3,295.00	6,919,500
サクセスホールディングス	1,100	1,649.00	1,813,900
アサンテ	3,500	1,309.00	4,581,500
E R Iホールディングス	4,300	1,151.00	4,949,300
ツガミ	56,000	538.00	30,128,000
オークマ	117,000	933.00	109,161,000
東芝機械	98,000	457.00	44,786,000
アマダ	276,000	999.00	275,724,000
アイダエンジニア	39,400	1,001.00	39,439,400
滝澤鉄工所	60,000	226.00	13,560,000
富士機械製造	55,000	867.00	47,685,000
牧野フライス	90,000	842.00	75,780,000
オーエスジー	74,100	1,763.00	130,638,300
ダイジェット	22,000	157.00	3,454,000
旭ダイヤモンド	46,300	1,646.00	76,209,800
D M G森精機	106,700	1,407.00	150,126,900
ディスコ	20,000	6,620.00	132,400,000
日東工器	10,600	2,057.00	21,804,200
パンチ工業	2,800	984.00	2,755,200
豊田自動織機	157,000	5,210.00	817,970,000
豊和工業	10,100	769.00	7,766,900
大阪機工	70,000	154.00	10,780,000
石川製作所	41,000	116.00	4,756,000
東洋機械金属	13,300	547.00	7,275,100
津田駒工業	44,000	145.00	6,380,000
エンシュウ	44,000	130.00	5,720,000
島精機製作所	23,500	1,915.00	45,002,500
日阪製作所	23,000	906.00	20,838,000
やまびこ	7,100	3,940.00	27,974,000
ペガサスミシン製造	16,600	456.00	7,569,600
ナブテスコ	82,300	2,192.00	180,401,600
三井海洋開発	15,900	2,428.00	38,605,200
レオン自動機	17,000	447.00	7,599,000
S M C	51,600	26,900.00	1,388,040,000
新川	15,000	481.00	7,215,000
ホソカワミクロン	30,000	652.00	19,560,000
ユニオンツール	7,800	2,659.00	20,740,200
オイレス工業	17,100	2,299.00	39,312,900
日精エーエスビー	5,700	1,691.00	9,638,700
サトーホールディングス	19,700	2,677.00	52,736,900
日本エアテック	5,500	475.00	2,612,500
日精樹脂工業	13,100	612.00	8,017,200
ワイエイシイ	7,300	637.00	4,650,100
小松製作所	841,800	2,302.00	1,937,823,600
住友重機械	493,000	476.00	234,668,000
日立建機	92,100	1,998.00	184,015,800
日工	27,000	497.00	13,419,000
巴工業	6,200	1,631.00	10,112,200
井関農機	184,000	258.00	47,472,000

T O W A	14,700	617.00	9,069,900
丸山製作所	41,000	246.00	10,086,000
北川鉄工所	83,000	172.00	14,276,000
シンニッタン	17,200	442.00	7,602,400
クボタ	937,000	1,383.00	1,295,871,000
荏原実業	4,900	1,452.00	7,114,800
東洋エンジニア	103,000	445.00	45,835,000
三菱化工機	59,000	443.00	26,137,000
月島機械	29,300	1,111.00	32,552,300
帝国電機製作所	6,400	2,804.00	17,945,600
東京機械	62,000	87.00	5,394,000
新東工業	42,400	701.00	29,722,400
渋谷工業	15,100	2,925.00	44,167,500
アイチ コーポレーション	25,700	469.00	12,053,300
小森コーポレーション	43,800	1,368.00	59,918,400
鶴見製作所	13,000	1,360.00	17,680,000
住友精密	28,000	413.00	11,564,000
酒井重工業	34,000	329.00	11,186,000
荏原製作所	398,000	639.00	254,322,000
石井鉄工所	26,000	232.00	6,032,000
西島製作所	19,100	911.00	17,400,100
北越工業	13,000	568.00	7,384,000
千代田化工建	153,000	1,203.00	184,059,000
ダイキン工業	235,300	6,699.00	1,576,274,700
オルガノ	28,000	515.00	14,420,000
トーヨーカネツ	97,000	258.00	25,026,000
栗田工業	108,400	2,335.00	253,114,000
椿本チエイン	92,000	864.00	79,488,000
大同工業	35,000	257.00	8,995,000
日本コンベヤ	56,000	133.00	7,448,000
日 機 装	55,900	1,173.00	65,570,700
木村化工機	16,600	512.00	8,499,200
新興プランテック	39,700	780.00	30,966,000
アネスト岩田	29,200	695.00	20,294,000
ダイフク	73,000	1,423.00	103,879,000
サムコ	2,300	1,070.00	2,461,000
加藤製作所	41,000	690.00	28,290,000
油研工業	34,000	242.00	8,228,000
タダノ	76,000	1,704.00	129,504,000
フジテック	50,200	1,050.00	52,710,000
C K D	48,300	921.00	44,484,300
キトー	10,100	2,514.00	25,391,400
平和	37,400	2,203.00	82,392,200
理想科学工業	13,300	2,898.00	38,543,400
S A N K Y O	52,200	3,910.00	204,102,000
日本金銭機械	15,900	1,765.00	28,063,500
マースエンジニアリング	9,700	2,003.00	19,429,100
福島工業	9,500	1,606.00	15,257,000
オーイズミ	6,000	948.00	5,688,000
ダイコク電機	7,100	1,648.00	11,700,800

アマノ	49,300	1,157.00	57,040,100
JUKI	111,000	219.00	24,309,000
サンデン	98,000	564.00	55,272,000
蛇の目ミシン	167,000	90.00	15,030,000
ブラザー工業	222,800	1,795.00	399,926,000
マックス	27,000	1,100.00	29,700,000
モリタホールディングス	30,000	964.00	28,920,000
グローリー	51,400	3,310.00	170,134,000
新晃工業	12,100	1,079.00	13,055,900
大和冷機工業	28,000	696.00	19,488,000
セガサミーホールディングス	185,200	1,958.00	362,621,600
日本ピストンリング	68,000	195.00	13,260,000
リケン	69,000	451.00	31,119,000
TPR	19,200	2,447.00	46,982,400
ホシザキ電機	37,700	5,290.00	199,433,000
大豊工業	12,400	1,129.00	13,999,600
日本精工	384,000	1,339.00	514,176,000
NTN	399,000	458.00	182,742,000
ジェイテクト	183,100	1,740.00	318,594,000
不二越	160,000	729.00	116,640,000
ミネベア	235,000	1,183.00	278,005,000
日本トムソン	55,000	504.00	27,720,000
THK	107,400	2,470.00	265,278,000
ユーシン精機	7,600	2,479.00	18,840,400
前澤給装工業	6,700	1,347.00	9,024,900
イーグル工業	21,300	1,845.00	39,298,500
前澤工業	12,800	300.00	3,840,000
日本ピラー工業	18,800	857.00	16,111,600
キッツ	77,200	560.00	43,232,000
日立	4,148,000	753.00	3,123,444,000
東芝	3,402,000	467.00	1,588,734,000
三菱電機	1,724,000	1,269.00	2,187,756,000
富士電機	480,000	505.00	242,400,000
東洋電機製造	37,000	396.00	14,652,000
安川電機	189,000	1,252.00	236,628,000
シンフォニアテクノロジー	104,000	164.00	17,056,000
明電舎	159,000	424.00	67,416,000
オリジン電気	25,000	343.00	8,575,000
山洋電気	35,000	755.00	26,425,000
デンヨー	17,000	1,599.00	27,183,000
日立工機	46,100	849.00	39,138,900
三桜工業	22,200	720.00	15,984,000
マキタ	112,400	6,020.00	676,648,000
東芝テック	108,000	714.00	77,112,000
芝浦メカトロニクス	31,000	315.00	9,765,000
マブチモーター	24,300	8,020.00	194,886,000
日本電産	186,300	6,441.00	1,199,958,300
東光高岳	9,600	1,430.00	13,728,000
宮越ホールディングス	6,000	330.00	1,980,000
ダイヘン	102,000	459.00	46,818,000

ヤーマン	2,200	1,343.00	2,954,600
JVCケンウッド	119,000	226.00	26,894,000
第一精工	7,200	1,785.00	12,852,000
日新電機	35,000	640.00	22,400,000
大崎電気	27,000	569.00	15,363,000
オムロン	194,500	4,215.00	819,817,500
日東工業	25,300	2,163.00	54,723,900
I D E C	22,600	910.00	20,566,000
ジーエス・ユアサ コーポ	332,000	689.00	228,748,000
サクサホールディングス	44,000	162.00	7,128,000
メルコホールディングス	8,300	2,127.00	17,654,100
テクノメディカ	3,900	2,362.00	9,211,800
日本電気	2,369,000	356.00	843,364,000
富士通	1,662,000	762.00	1,266,444,000
沖電気	683,000	215.00	146,845,000
岩崎通信機	81,000	94.00	7,614,000
電気興業	49,000	647.00	31,703,000
サンケン電気	94,000	820.00	77,080,000
ナカヨ通信機	17,000	406.00	6,902,000
アイホン	10,000	2,019.00	20,190,000
ルネサスエレクトロニクス	89,200	754.00	67,256,800
セイコーエプソン	117,600	4,335.00	509,796,000
ワコム	135,600	553.00	74,986,800
アルバック	31,700	2,059.00	65,270,300
アクセル	8,600	1,474.00	12,676,400
ピクセラ	7,200	141.00	1,015,200
E I Z O	15,800	2,740.00	43,292,000
ジャパンディスプレイ	289,600	629.00	182,158,400
日本信号	47,600	971.00	46,219,600
京三製作所	41,000	381.00	15,621,000
能美防災	23,000	1,615.00	37,145,000
ホーチキ	13,000	825.00	10,725,000
エレコム	6,300	2,668.00	16,808,400
日本無線	44,000	444.00	19,536,000
パナソニック	1,969,200	1,214.00	2,390,608,800
シャープ	1,243,000	320.00	397,760,000
アンリツ	100,100	1,109.00	111,010,900
富士通ゼネラル	41,000	1,192.00	48,872,000
日立国際電気	34,000	1,466.00	49,844,000
ソニー	950,500	1,674.00	1,591,137,000
T D K	104,000	4,725.00	491,400,000
帝国通信工業	41,000	178.00	7,298,000
ミツミ電機	65,500	744.00	48,732,000
タムラ製作所	66,000	396.00	26,136,000
アルプス電気	126,300	1,421.00	179,472,300
池上通信機	54,000	119.00	6,426,000
パイオニア	238,900	262.00	62,591,800
日本電波工業	15,700	1,012.00	15,888,400
日本トリム	3,700	3,730.00	13,801,000
ローランド ディー . ジー .	7,600	3,785.00	28,766,000

日本コロムビア	8,500	607.00	5,159,500
フオスター電機	17,600	1,270.00	22,352,000
クラリオン	106,000	319.00	33,814,000
S M K	51,000	413.00	21,063,000
ヨコオ	14,700	525.00	7,717,500
東 光	40,000	290.00	11,600,000
ティアック	92,000	66.00	6,072,000
ホシデン	50,400	634.00	31,953,600
ヒロセ電機	30,000	14,640.00	439,200,000
日本航空電子	44,000	2,411.00	106,084,000
T O A	18,500	1,259.00	23,291,500
日立マクセル	29,900	1,783.00	53,311,700
古野電気	22,200	724.00	16,072,800
ユニデン	54,000	258.00	13,932,000
アルパイン	37,300	1,556.00	58,038,800
スミダコーポレーション	14,200	685.00	9,727,000
アイコム	9,500	2,475.00	23,512,500
リオン	4,900	1,513.00	7,413,700
船井電機	17,400	1,081.00	18,809,400
横河電機	186,900	1,264.00	236,241,600
新電元工業	55,000	569.00	31,295,000
アズビル	52,300	2,510.00	131,273,000
東亜ディーケーケー	6,400	524.00	3,353,600
日本光電工業	36,700	5,120.00	187,904,000
チ ノ ー	31,000	309.00	9,579,000
共和電業	21,000	535.00	11,235,000
日本電子材料	7,400	496.00	3,670,400
堀場製作所	31,800	3,615.00	114,957,000
アドバンテスト	117,500	1,204.00	141,470,000
小野測器	8,500	1,023.00	8,695,500
エスベック	17,900	896.00	16,038,400
パナソニックデバイス	15,300	497.00	7,604,100
キーエンス	39,000	43,145.00	1,682,655,000
日置電機	9,000	1,739.00	15,651,000
シスメックス	144,400	3,640.00	525,616,000
メガチップス	15,400	1,472.00	22,668,800
O B A R A G R O U P	11,200	4,405.00	49,336,000
イマジカ・ロボットHD	8,900	494.00	4,396,600
日本電産コバル電子	17,800	886.00	15,770,800
澤藤電機	11,000	218.00	2,398,000
デンソー	425,800	4,669.00	1,988,060,200
コーセル	25,000	1,315.00	32,875,000
新日本無線	12,000	431.00	5,172,000
オブテックス	10,900	2,193.00	23,903,700
千代田インテグレ	7,500	1,515.00	11,362,500
レーザーテック	17,700	996.00	17,629,200
スタンレー電気	124,100	2,598.00	322,411,800
岩崎電気	63,000	241.00	15,183,000
ウシオ電機	104,600	1,241.00	129,808,600
岡谷電機	9,600	379.00	3,638,400

ヘリオステクノH	14,800	320.00	4,736,000	
日本セラミック	9,900	1,640.00	16,236,000	
遠藤照明	9,500	1,492.00	14,174,000	
日本デジタル研究所	12,700	1,785.00	22,669,500	
古河電池	12,000	695.00	8,340,000	
双信電機	8,500	380.00	3,230,000	
山一電機	18,600	634.00	11,792,400	
図 研	11,200	1,012.00	11,334,400	
日本電子	66,000	448.00	29,568,000	
カ シ オ	179,200	1,575.00	282,240,000	
ファナック	192,300	17,325.00	3,331,597,500	
日本シイエムケイ	40,600	278.00	11,286,800	
エンプラス	5,900	7,720.00	45,548,000	
大真空	32,000	383.00	12,256,000	
ロ ー ム	91,000	5,620.00	511,420,000	
浜松ホトニクス	71,700	4,885.00	350,254,500	
三井ハイテック	22,700	711.00	16,139,700	
新光電気工業	57,800	880.00	50,864,000	
京 セ ラ	303,100	4,806.00	1,456,698,600	
協栄産業	21,000	185.00	3,885,000	
太陽誘電	83,700	1,099.00	91,986,300	
村田製作所	180,800	9,554.00	1,727,363,200	
ユーシン	24,300	588.00	14,288,400	
双葉電子工業	31,900	1,688.00	53,847,200	
日東電工	148,800	4,713.00	701,294,400	
北陸電気工業	70,000	166.00	11,620,000	
東海理化電機	45,400	2,040.00	92,616,000	
ニチコン	54,200	770.00	41,734,000	
日本ケミコン	120,000	273.00	32,760,000	
K O A	21,600	976.00	21,081,600	
三井造船	667,000	204.00	136,068,000	
日立造船	135,400	529.00	71,626,600	
佐世保重工業	121,000	112.00	13,552,000	
三菱重工業	3,069,000	641.00	1,967,229,000	
川崎重工業	1,342,000	394.00	528,748,000	
I H I	1,242,000	471.00	584,982,000	
名村造船所	33,600	905.00	30,408,000	
サノヤスホールディングス	21,100	214.00	4,515,400	
日本車輛	63,000	391.00	24,633,000	
ニチユ三菱フォークリフト	20,000	647.00	12,940,000	
近畿車輛	30,000	302.00	9,060,000	
F P G	13,200	916.00	12,091,200	
島根銀行	3,900	1,315.00	5,128,500	
じもとホールディングス	122,500	212.00	25,970,000	
全国保証	40,600	2,770.00	112,462,000	
足利ホールディングス	89,200	421.00	37,553,200	
日産自動車	2,419,500	971.00	2,349,334,500	
いすゞ自動車	999,000	675.00	674,325,000	
トヨタ自動車	2,398,900	5,981.00	14,347,820,900	*
日野自動車	215,300	1,414.00	304,434,200	

三菱自動車工業	616,800	1,127.00	695,133,600
エフテック	7,400	1,326.00	9,812,400
レシップホールディングス	5,700	895.00	5,101,500
G M B	2,300	1,427.00	3,282,100
武蔵精密工業	18,400	2,588.00	47,619,200
日産車体	84,200	1,667.00	140,361,400
新明和工業	70,000	887.00	62,090,000
極東開発工業	29,800	1,492.00	44,461,600
日信工業	35,100	1,995.00	70,024,500
トピー工業	142,000	207.00	29,394,000
ティラド	67,000	285.00	19,095,000
曙ブレーキ	80,300	496.00	39,828,800
タチエス	25,400	1,687.00	42,849,800
N O K	83,400	2,001.00	166,883,400
フタバ産業	52,800	489.00	25,819,200
カヤバ工業	162,000	465.00	75,330,000
シロキ工業	39,000	215.00	8,385,000
市光工業	42,000	166.00	6,972,000
大同メタル工業	24,000	1,380.00	33,120,000
プレス工業	67,000	386.00	25,862,000
カルソニックカンセイ	117,000	646.00	75,582,000
太平洋工業	35,200	813.00	28,617,600
ケーヒン	39,700	1,592.00	63,202,400
河西工業	23,000	780.00	17,940,000
アイシン精機	157,700	3,930.00	619,761,000
富士機工	20,000	467.00	9,340,000
マ ッ ダ	2,568,000	492.00	1,263,456,000
ダイハツ	182,900	1,750.00	320,075,000
今仙電機製作所	12,800	1,476.00	18,892,800
本田技研	1,551,100	3,515.00	5,452,116,500
スズキ	360,300	3,279.00	1,181,423,700
富士重工業	586,600	2,872.00	1,684,715,200
ヤマハ発動機	262,100	1,779.00	466,275,900
ショーワ	40,700	1,207.00	49,124,900
小糸製作所	94,700	2,693.00	255,027,100
T B K	19,000	533.00	10,127,000
エクセディ	20,800	3,000.00	62,400,000
ミツバ	31,800	1,742.00	55,395,600
豊田合成	55,700	2,070.00	115,299,000
愛三工業	21,100	845.00	17,829,500
ヨ ロ ズ	12,700	2,194.00	27,863,800
エフ・シー・シー	28,300	1,935.00	54,760,500
新家工業	39,000	156.00	6,084,000
シマノ	74,400	11,360.00	845,184,000
タカタ	31,200	2,074.00	64,708,800
テイ・エス テック	36,400	3,025.00	110,110,000
小 野 建	14,900	1,129.00	16,822,100
はるやま商事	7,100	714.00	5,069,400
佐島電機	13,400	711.00	9,527,400
カッパ・クリエイトHD	25,100	1,063.00	26,681,300

エコトレーディング	4,700	701.00	3,294,700
伯東	10,400	1,057.00	10,992,800
コンドーテック	14,200	683.00	9,698,600
中山福	9,900	806.00	7,979,400
ライトオン	12,600	752.00	9,475,200
ナガイレーベン	24,500	2,025.00	49,612,500
ジーンズメイト	5,400	212.00	1,144,800
三菱食品	18,700	2,489.00	46,544,300
良品計画	18,000	12,320.00	221,760,000
三城ホールディングス	21,100	492.00	10,381,200
松田産業	12,500	1,263.00	15,787,500
メディバルHD	170,100	1,349.00	229,464,900
アドヴァン	8,800	1,103.00	9,706,400
S P K	4,200	1,884.00	7,912,800
アズワン	11,100	3,085.00	34,243,500
スズデン	6,200	635.00	3,937,000
尾家産業	6,200	850.00	5,270,000
シモジマ	11,800	1,089.00	12,850,200
ドウシシャ	18,200	1,758.00	31,995,600
コナカ	20,000	760.00	15,200,000
高速	10,300	907.00	9,342,100
ハウス ローゼ	2,100	1,383.00	2,904,300
G - 7ホールディングス	5,000	980.00	4,900,000
イオン北海道	10,400	625.00	6,500,000
コジマ	25,000	312.00	7,800,000
ヒマラヤ	4,000	1,071.00	4,284,000
コーナン商事	22,300	1,027.00	22,902,100
黒田電気	27,200	1,607.00	43,710,400
ネットワンシステムズ	66,500	683.00	45,419,500
エコス	6,200	749.00	4,643,800
ワタミ	20,100	1,400.00	28,140,000
マルシェ	4,400	847.00	3,726,800
ドンキホーテホールディング	58,700	5,230.00	307,001,000
丸文	15,100	623.00	9,407,300
西松屋チェーン	33,500	822.00	27,537,000
ゼンショーホールディングス	78,000	1,024.00	79,872,000
ハビネット	10,300	1,741.00	17,932,300
幸楽苑	10,600	1,380.00	14,628,000
トーマンエレクトロニクス	8,700	1,648.00	14,337,600
ハークスレイ	4,900	844.00	4,135,600
サイゼリヤ	25,200	1,257.00	31,676,400
エクセル	7,800	1,858.00	14,492,400
マルカキカイ	5,500	1,340.00	7,370,000
アルゴグラフィックス	6,400	1,717.00	10,988,800
ガリバーインターナショナル	57,200	805.00	46,046,000
日本エム・ディ・エム	14,200	352.00	4,998,400
ポブラ	4,700	563.00	2,646,100
ユナイテッドアローズ	22,200	3,790.00	84,138,000
進和	10,100	1,318.00	13,311,800
エスケイジャパン	4,400	262.00	1,152,800

ダイトエレクトロン	7,900	412.00	3,254,800
ハイデイ日高	10,800	2,409.00	26,017,200
シークス	10,800	1,761.00	19,018,800
京都きもの友禅	11,300	1,019.00	11,514,700
コロワイド	56,500	1,262.00	71,303,000
田中商事	5,600	646.00	3,617,600
オーハシテクニカ	8,900	1,002.00	8,917,800
壱番屋	6,800	4,375.00	29,750,000
マクニカ	8,700	3,365.00	29,275,500
白銅	5,700	952.00	5,426,400
トップカルチャー	6,500	472.00	3,068,000
P L A N T	4,300	1,054.00	4,532,200
スギホールディングス	30,500	4,580.00	139,690,000
島津製作所	222,000	967.00	214,674,000
J M S	32,000	295.00	9,440,000
クボテック	4,400	271.00	1,192,400
ショットモリテックス	3,900	276.00	1,076,400
長野計器	11,100	692.00	7,681,200
ブイ・テクノロジー	3,600	3,605.00	12,978,000
スター精密	32,700	1,416.00	46,303,200
東京計器	59,000	264.00	15,576,000
愛知時計	24,000	300.00	7,200,000
オーバル	12,600	345.00	4,347,000
東京精密	30,900	1,768.00	54,631,200
マニー	4,800	5,690.00	27,312,000
ニコン	321,800	1,545.00	497,181,000
トプコン	46,300	2,331.00	107,925,300
オリンパス	256,700	3,625.00	930,537,500
理研計器	15,200	1,076.00	16,355,200
大日本スクリーン	163,000	482.00	78,566,000
キヤノン電子	15,800	1,877.00	29,656,600
タムロン	13,200	2,324.00	30,676,800
H O Y A	419,000	3,349.00	1,403,231,000
ノーリツ鋼機	15,500	663.00	10,276,500
エー・アンド・デイ	15,600	531.00	8,283,600
キヤノン	999,300	3,338.00	3,335,663,400
リ コ ー	518,200	1,159.00	600,593,800
シチズンホールディングス	212,200	797.00	169,123,400
リズム時計	78,000	151.00	11,778,000
大研医器	6,000	1,873.00	11,238,000
パラマウントベッドHD	16,500	3,090.00	50,985,000
S H O B I	5,600	424.00	2,374,400
前田工織	16,400	1,247.00	20,450,800
永大産業	23,000	474.00	10,902,000
アートネイチャー	5,500	3,055.00	16,802,500
ダンロップスポーツ	9,400	1,217.00	11,439,800
バンダイナムコH L D G S	190,100	2,338.00	444,453,800
共立印刷	31,800	294.00	9,349,200
フランスベッドH L D G S	109,000	186.00	20,274,000
マーベラス	25,800	1,307.00	33,720,600

パイロットコーポレーション	15,000	4,465.00	66,975,000
萩原工業	2,900	1,534.00	4,448,600
エイベックス・グループHD	31,300	1,732.00	54,211,600
トッパン・フォームズ	30,800	1,023.00	31,508,400
フジシールインターナショナル	20,900	3,000.00	62,700,000
タカラトミー	56,800	563.00	31,978,400
廣済堂	16,100	429.00	6,906,900
アーク	50,800	160.00	8,128,000
レック	5,700	1,096.00	6,247,200
タカノ	7,700	602.00	4,635,400
プロネクサス	17,500	805.00	14,087,500
ホクシン	13,400	137.00	1,835,800
ウッドワン	30,000	299.00	8,970,000
大建工業	70,000	279.00	19,530,000
きもと	26,400	370.00	9,768,000
凸版印刷	487,000	786.00	382,782,000
大日本印刷	525,000	1,065.00	559,125,000
図書印刷	28,000	505.00	14,140,000
共同印刷	53,000	343.00	18,179,000
日本写真印刷	28,900	1,599.00	46,211,100
光村印刷	3,000	261.00	783,000
藤森工業	15,500	3,455.00	53,552,500
宝印刷	9,800	799.00	7,830,200
前澤化成工業	12,800	1,079.00	13,811,200
アシックス	171,200	2,174.00	372,188,800
ツツミ	8,600	2,588.00	22,256,800
ジェイエスピー	11,800	1,796.00	21,192,800
ニチハ	22,000	1,076.00	23,672,000
ローランド	17,400	1,818.00	31,633,200
エフピコ	17,800	3,390.00	60,342,000
小松ウオール工業	5,900	2,787.00	16,443,300
ヤマハ	126,700	1,601.00	202,846,700
河合楽器	60,000	203.00	12,180,000
クリナップ	17,700	915.00	16,195,500
ピジヨン	28,200	5,520.00	155,664,000
天馬	14,400	1,541.00	22,190,400
兼松日産農林	27,000	150.00	4,050,000
キングジム	14,600	750.00	10,950,000
リンテック	41,000	2,071.00	84,911,000
T A S A K I	3,400	1,089.00	3,702,600
信越ポリマー	35,400	484.00	17,133,600
東リ	47,000	226.00	10,622,000
イトーキ	36,300	797.00	28,931,100
任天堂	106,100	12,255.00	1,300,255,500
三菱鉛筆	14,200	2,755.00	39,121,000
松風	8,600	938.00	8,066,800
タカラスタンダード	71,000	925.00	65,675,000
コクヨ	89,600	883.00	79,116,800
ナカバヤシ	37,000	204.00	7,548,000
ニフコ	40,300	3,335.00	134,400,500

グローブライド	90,000	127.00	11,430,000
岡村製作所	66,000	871.00	57,486,000
日本バルカー	75,000	282.00	21,150,000
MUTOHホールディングス	23,000	521.00	11,983,000
伊藤忠	1,357,400	1,295.00	1,757,833,000
丸紅	1,489,000	729.00	1,085,481,000
スクロール	22,100	273.00	6,033,300
高島	32,000	237.00	7,584,000
ヨンドシーホールディングス	12,900	2,194.00	28,302,600
三陽商会	94,000	227.00	21,338,000
長瀬産業	96,400	1,254.00	120,885,600
ナイガイ	65,000	69.00	4,485,000
蝶理	11,100	1,293.00	14,352,300
豊田通商	189,600	2,908.00	551,356,800
オンワードホールディングス	120,000	724.00	86,880,000
三共生興	28,800	420.00	12,096,000
兼松	362,000	176.00	63,712,000
美津濃	85,000	606.00	51,510,000
ツカモトコーポレーション	31,000	138.00	4,278,000
ファミリーマート	57,500	4,520.00	259,900,000
ルック	33,000	274.00	9,042,000
三井物産	1,538,400	1,627.00	2,502,976,800
日本紙パルプ	89,000	335.00	29,815,000
東京エレクトロン	154,600	7,105.00	1,098,433,000
日立ハイテクノロジーズ	51,500	2,433.00	125,299,500
カメイ	22,300	770.00	17,171,000
東都水産	31,000	192.00	5,952,000
OUGホールディングス	27,000	226.00	6,102,000
スターゼン	63,000	289.00	18,207,000
セイコーHD	111,000	401.00	44,511,000
山善	65,600	753.00	49,396,800
椿本興業	19,000	301.00	5,719,000
住友商事	1,004,100	1,347.00	1,352,522,700
日本ユニシス	41,000	846.00	34,686,000
内田洋行	42,000	379.00	15,918,000
三菱商事	1,327,500	2,100.00	2,787,750,000
第一実業	39,000	538.00	20,982,000
キャノンマーケティングJPN	48,500	1,951.00	94,623,500
西華産業	56,000	270.00	15,120,000
佐藤商事	15,600	693.00	10,810,800
菱洋エレクトロ	19,600	1,167.00	22,873,200
東京産業	17,300	404.00	6,989,200
ユアサ商事	175,000	213.00	37,275,000
神鋼商事	44,000	238.00	10,472,000
小林産業	11,600	298.00	3,456,800
阪和興業	170,000	420.00	71,400,000
カナデン	2,000	730.00	1,460,000
菱電商事	25,000	758.00	18,950,000
ニプロ	91,700	884.00	81,062,800
フルサト工業	9,400	1,352.00	12,708,800

岩谷産業	188,000	730.00	137,240,000
すてきナイスグループ	73,000	214.00	15,622,000
昭光通商	57,000	148.00	8,436,000
ニチモウ	28,000	177.00	4,956,000
極東貿易	20,000	213.00	4,260,000
イワキ	27,000	220.00	5,940,000
兼松エレクトロニクス	10,700	1,434.00	15,343,800
三愛石油	40,000	780.00	31,200,000
稲畑産業	42,000	929.00	39,018,000
G S Iクレオス	45,000	142.00	6,390,000
明和産業	15,700	437.00	6,860,900
キムラタン	799,000	10.00	7,990,000
ゴールドウイン	42,000	448.00	18,816,000
ユニ・チャーム	110,700	6,180.00	684,126,000
デサント	41,000	884.00	36,244,000
キング	9,000	429.00	3,861,000
ワキタ	33,500	1,258.00	42,143,000
ヤマトインターナショナル	11,900	457.00	5,438,300
東邦ホールディングス	54,500	1,982.00	108,019,000
サンゲツ	30,100	2,676.00	80,547,600
ミツウロコグループ	27,500	604.00	16,610,000
シナネン	37,000	429.00	15,873,000
伊藤忠エネクス	37,600	743.00	27,936,800
サンリオ	42,900	2,791.00	119,733,900
サンワテクノス	9,200	1,022.00	9,402,400
リョーサン	25,300	2,089.00	52,851,700
新光商事	18,600	896.00	16,665,600
トーヨー	37,000	390.00	14,430,000
三信電気	20,400	823.00	16,789,200
東陽テクニカ	24,900	1,170.00	29,133,000
モスフードサービス	22,300	2,202.00	49,104,600
加賀電子	15,300	1,261.00	19,293,300
三益半導体	15,200	945.00	14,364,000
ソーダニツカ	2,000	451.00	902,000
立花エレテック	10,400	1,414.00	14,705,600
木曽路	20,900	1,993.00	41,653,700
サトレストランシステムズ	16,100	852.00	13,717,200
千趣会	30,600	856.00	26,193,600
タカキユー	13,000	222.00	2,886,000
ケーヨー	28,800	497.00	14,313,600
アデランス	21,500	1,543.00	33,174,500
上新電機	37,000	964.00	35,668,000
日本瓦斯	25,300	2,407.00	60,897,100
ベスト電器	54,100	145.00	7,844,500
マルエツ	35,000	378.00	13,230,000
ロイヤルホールディングス	28,400	1,702.00	48,336,800
東天紅	13,000	180.00	2,340,000
いなげや	19,200	1,038.00	19,929,600
島忠	41,200	2,357.00	97,108,400
チヨダ	20,000	2,272.00	45,440,000

ライフコーポレーション	12,900	1,713.00	22,097,700
カスミ	34,900	771.00	26,907,900
リンガーハット	16,600	1,646.00	27,323,600
さが美	14,000	101.00	1,414,000
MR MAX	17,400	335.00	5,829,000
テンアライド	13,300	325.00	4,322,500
AOKIホールディングス	29,300	1,370.00	40,141,000
オークワ	27,000	974.00	26,298,000
コメリ	26,200	2,546.00	66,705,200
青山商事	42,700	2,650.00	113,155,000
しまむら	19,700	10,270.00	202,319,000
CFSコーポレーション	11,200	529.00	5,924,800
はせがわ	5,900	640.00	3,776,000
高島屋	230,000	940.00	216,200,000
松屋	34,200	1,065.00	36,423,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	140,000	776.00	108,640,000
近鉄百貨店	65,000	385.00	25,025,000
丸栄	28,000	162.00	4,536,000
ニッセンHD	34,100	369.00	12,582,900
パルコ	16,300	888.00	14,474,400
丸井グループ	221,700	942.00	208,841,400
クレディセゾン	138,900	2,084.00	289,467,600
アクシアルリテイリング	9,500	1,727.00	16,406,500
井筒屋	93,000	74.00	6,882,000
ダイエー	104,950	301.00	31,589,950
イオン	679,500	1,159.00	787,540,500
ユニーグループ・HD	162,900	619.00	100,835,100
イズミ	38,000	3,185.00	121,030,000
東武ストア	23,000	278.00	6,394,000
平和堂	34,500	1,605.00	55,372,500
フジ	18,900	2,114.00	39,954,600
ヤオコー	8,600	5,840.00	50,224,000
ゼビオ	20,500	1,932.00	39,606,000
ケーズホールディングス	35,900	2,844.00	102,099,600
Paltac	23,800	1,391.00	33,105,800
OLYMPICグループ	10,000	1,038.00	10,380,000
日産東京販売HD	25,000	306.00	7,650,000
新生銀行	1,472,000	214.00	315,008,000
あおぞら銀行	884,000	335.00	296,140,000
三菱UFJフィナンシャルG	12,886,200	599.00	7,718,833,800
りそなホールディングス	1,616,900	588.00	950,737,200
三井住友トラストHD	3,343,000	447.00	1,494,321,000
三井住友フィナンシャルG	1,286,500	4,118.00	5,297,807,000
第四銀行	215,000	365.00	78,475,000
北越銀行	184,000	209.00	38,456,000
西日本シティ銀行	596,000	250.00	149,000,000
千葉銀行	656,000	725.00	475,600,000
横浜銀行	1,106,000	591.00	653,646,000
常陽銀行	633,000	539.00	341,187,000
群馬銀行	381,000	594.00	226,314,000

武蔵野銀行	27,100	3,445.00	93,359,500
千葉興業銀行	35,300	749.00	26,439,700
筑波銀行	70,800	353.00	24,992,400
東京都民銀行	30,000	1,197.00	35,910,000
七十七銀行	266,000	528.00	140,448,000
青森銀行	125,000	287.00	35,875,000
秋田銀行	117,000	277.00	32,409,000
山形銀行	104,000	470.00	48,880,000
岩手銀行	11,100	4,715.00	52,336,500
東邦銀行	152,000	368.00	55,936,000
東北銀行	88,000	149.00	13,112,000
みちのく銀行	91,000	219.00	19,929,000
ふくおかフィナンシャルG	690,000	496.00	342,240,000
静岡銀行	498,000	1,124.00	559,752,000
十六銀行	213,000	373.00	79,449,000
スルガ銀行	166,000	1,941.00	322,206,000
八十二銀行	314,000	614.00	192,796,000
山梨中央銀行	108,000	454.00	49,032,000
大垣共立銀行	213,000	279.00	59,427,000
福井銀行	146,000	242.00	35,332,000
北國銀行	189,000	338.00	63,882,000
清水銀行	5,800	2,747.00	15,932,600
滋賀銀行	160,000	609.00	97,440,000
南都銀行	164,000	410.00	67,240,000
百五銀行	153,000	404.00	61,812,000
京都銀行	325,000	916.00	297,700,000
紀陽銀行	66,800	1,375.00	91,850,000
三重銀行	71,000	226.00	16,046,000
ほくほくフィナンシャルG	1,156,000	210.00	242,760,000
広島銀行	502,000	492.00	246,984,000
山陰合同銀行	104,000	726.00	75,504,000
中国銀行	122,300	1,537.00	187,975,100
鳥取銀行	55,000	215.00	11,825,000
伊予銀行	181,900	1,021.00	185,719,900
百十四銀行	187,000	353.00	66,011,000
四国銀行	123,000	228.00	28,044,000
阿波銀行	139,000	575.00	79,925,000
鹿児島銀行	118,000	670.00	79,060,000
大分銀行	104,000	358.00	37,232,000
宮崎銀行	113,000	327.00	36,951,000
肥後銀行	139,000	542.00	75,338,000
佐賀銀行	104,000	227.00	23,608,000
十八銀行	106,000	269.00	28,514,000
沖縄銀行	12,700	4,350.00	55,245,000
琉球銀行	33,000	1,464.00	48,312,000
八千代銀行	8,100	3,245.00	26,284,500
セブン銀行	637,400	407.00	259,421,800
みずほフィナンシャルG	22,079,100	201.00	4,437,899,100
高知銀行	67,000	148.00	9,916,000
山口フィナンシャルG	170,000	1,040.00	176,800,000

アクリーティブ	12,100	201.00	2,432,100
芙蓉総合リース	17,800	4,355.00	77,519,000
興銀リース	29,700	2,641.00	78,437,700
東京センチュリーリース	40,000	3,320.00	132,800,000
S B Iホールディングス	204,300	1,217.00	248,633,100
日本証券金融	74,600	595.00	44,387,000
アイフル	309,300	603.00	186,507,900
日本アジア投資	115,000	90.00	10,350,000
ポケットカード	17,000	773.00	13,141,000
長野銀行	57,000	185.00	10,545,000
名古屋銀行	154,000	390.00	60,060,000
北洋銀行	256,200	418.00	107,091,600
愛知銀行	6,100	5,100.00	31,110,000
第三銀行	97,000	179.00	17,363,000
中京銀行	71,000	180.00	12,780,000
東日本銀行	74,000	256.00	18,944,000
大光銀行	61,000	225.00	13,725,000
愛媛銀行	100,000	237.00	23,700,000
トマト銀行	67,000	176.00	11,792,000
みなと銀行	154,000	187.00	28,798,000
京葉銀行	140,000	500.00	70,000,000
関西アーバン銀行	237,000	123.00	29,151,000
栃木銀行	86,000	422.00	36,292,000
北日本銀行	5,300	2,582.00	13,684,600
東和銀行	208,000	99.00	20,592,000
福島銀行	210,000	86.00	18,060,000
大東銀行	109,000	125.00	13,625,000
リコーリース	11,700	2,757.00	32,256,900
イオンフィナンシャルサービス	99,500	2,415.00	240,292,500
アコム	341,500	411.00	140,356,500
ジャックス	103,000	514.00	52,942,000
オリコ	379,600	260.00	98,696,000
日立キャピタル	33,400	2,685.00	89,679,000
アプラスフィナンシャル	81,300	158.00	12,845,400
オリックス	1,061,800	1,609.00	1,708,436,200
三菱UFJリース	431,400	579.00	249,780,600
ジャフコ	23,300	4,335.00	101,005,500
トモニホールディングス	130,800	428.00	55,982,400
大和証券G本社	1,685,000	848.00	1,428,880,000
野村ホールディングス	3,477,700	668.00	2,323,103,600
岡三証券グループ	134,000	746.00	99,964,000
丸三証券	50,500	782.00	39,491,000
東洋証券	69,000	294.00	20,286,000
東海東京HD	180,100	716.00	128,951,600
光世証券	41,000	221.00	9,061,000
水戸証券	49,700	370.00	18,389,000
いちよし証券	33,300	1,327.00	44,189,100
松井証券	86,300	978.00	84,401,400
N K S Jホールディングス	377,900	2,640.00	997,656,000
だいこう証券ビジ	8,300	632.00	5,245,600

日本取引所グループ	249,700	2,383.00	595,035,100
マネックスG	184,900	341.00	63,050,900
カブドットコム証券	65,900	479.00	31,566,100
極東証券	21,100	1,661.00	35,047,100
岩井コスモホールディング	16,000	1,116.00	17,856,000
フィデアホール	98,400	208.00	20,467,200
池田泉州HD	127,800	511.00	65,305,800
MS & AD	508,400	2,332.00	1,185,588,800
マネースクウェア・ジャパン	4,400	1,037.00	4,562,800
SONY FH	163,000	1,663.00	271,069,000
マネーパートナーズGP	17,600	248.00	4,364,800
小林洋行	5,200	254.00	1,320,800
第一生命	856,200	1,398.00	1,196,967,600
東京海上HD	658,800	3,223.00	2,123,312,400
イー・ギャランティ	4,900	1,997.00	9,785,300
アサックス	3,000	1,296.00	3,888,000
NECキャピタルソリューション	5,700	1,971.00	11,234,700
T & Dホールディングス	583,400	1,323.00	771,838,200
三井不動産	893,000	3,364.00	3,004,052,000
三菱地所	1,191,000	2,481.00	2,954,871,000
平和不動産	34,400	1,555.00	53,492,000
東京建物	348,000	911.00	317,028,000
ダイビル	50,200	1,045.00	52,459,000
京阪神ビルディング	28,800	540.00	15,552,000
住友不動産	408,000	4,299.00	1,753,992,000
太平洋興発	71,000	98.00	6,958,000
大京	286,000	226.00	64,636,000
テーオーシー	58,700	726.00	42,616,200
東京楽天地	27,000	507.00	13,689,000
レオパレス21	195,400	484.00	94,573,600
フジ住宅	22,100	619.00	13,679,900
空港施設	20,700	692.00	14,324,400
明和地所	8,500	441.00	3,748,500
住友不動産販売	12,300	3,065.00	37,699,500
ゴールドクレスト	13,400	2,135.00	28,609,000
リロ・ホールディング	6,800	6,640.00	45,152,000
日本エスリード	6,700	1,018.00	6,820,600
日神不動産	22,800	402.00	9,165,600
タカラレーベン	55,700	388.00	21,611,600
サンヨーハウジ 名古屋	9,800	1,115.00	10,927,000
イオンモール	109,800	2,540.00	278,892,000
ファースト住建	6,400	1,311.00	8,390,400
ランド	47,600	15.00	714,000
東祥	3,900	1,979.00	7,718,100
トーセイ	23,200	709.00	16,448,800
穴吹興産	16,000	330.00	5,280,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	105,600	1,123.00	118,588,800
サンフロンティア不動産	16,000	1,175.00	18,800,000
エフ・ジェー・ネクスト	9,200	475.00	4,370,000

ランドビジネス	8,800	404.00	3,555,200
グランディハウス	13,800	342.00	4,719,600
東武鉄道	979,000	526.00	514,954,000
相鉄ホールディングス	296,000	390.00	115,440,000
東京急行	1,014,000	730.00	740,220,000
京浜急行	443,000	910.00	403,130,000
小田急電鉄	552,000	981.00	541,512,000
京王電鉄	482,000	805.00	388,010,000
京成電鉄	258,000	1,025.00	264,450,000
富士急行	47,000	1,174.00	55,178,000
新京成電鉄	23,000	380.00	8,740,000
東日本旅客鉄道	317,100	8,057.00	2,554,874,700
西日本旅客鉄道	155,500	4,585.00	712,967,500
東海旅客鉄道	154,300	14,830.00	2,288,269,000
西武ホールディングス	137,300	2,062.00	283,112,600
鴻池運輸	12,100	1,825.00	22,082,500
西日本鉄道	224,000	412.00	92,288,000
ハマキョウレックス	4,900	3,180.00	15,582,000
サカイ引越センター	2,800	3,475.00	9,730,000
近畿日本鉄道	1,735,000	374.00	648,890,000
阪急阪神HLDGS	1,157,000	580.00	671,060,000
南海電鉄	360,000	462.00	166,320,000
京阪電鉄	364,000	428.00	155,792,000
神戸電鉄	43,000	359.00	15,437,000
名糖運輸	7,400	672.00	4,972,800
名古屋鉄道	607,000	423.00	256,761,000
山陽電鉄	63,000	454.00	28,602,000
トランコム	5,000	4,020.00	20,100,000
日本通運	682,000	492.00	335,544,000
ヤマトホールディングス	316,300	2,077.00	656,955,100
山九	209,000	512.00	107,008,000
日新	65,000	291.00	18,915,000
丸運	11,200	248.00	2,777,600
丸全昭和運輸	58,000	345.00	20,010,000
センコー	69,000	522.00	36,018,000
トナミホールディングス	35,000	233.00	8,155,000
日本梱包運輸	52,600	1,720.00	90,472,000
日石輸送	21,000	230.00	4,830,000
福山通運	104,000	564.00	58,656,000
セイノーホールディングス	122,000	1,154.00	140,788,000
神奈川中央交通	21,000	509.00	10,689,000
日立物流	35,900	1,556.00	55,860,400
日本郵船	1,456,000	287.00	417,872,000
商船三井	968,000	369.00	357,192,000
川崎汽船	754,000	212.00	159,848,000
NSユニテッド海運	74,000	245.00	18,130,000
乾汽船	20,500	319.00	6,539,500
明治海運	15,600	373.00	5,818,800
飯野海運	71,500	588.00	42,042,000
共栄タンカー	15,000	210.00	3,150,000

第一中央汽船	127,000	94.00	11,938,000
日本航空	145,500	5,910.00	859,905,000
A N Aホールディングス	3,388,000	245.00	830,060,000
スカイマーク	48,900	282.00	13,789,800
パスコ	16,000	451.00	7,216,000
三菱倉庫	113,000	1,532.00	173,116,000
三井倉庫	87,000	442.00	38,454,000
住友倉庫	115,000	576.00	66,240,000
渋沢倉庫	41,000	352.00	14,432,000
ヤマタネ	85,000	175.00	14,875,000
東陽倉庫	30,000	257.00	7,710,000
日本トランスシティ	36,000	335.00	12,060,000
ケイヒン	32,000	154.00	4,928,000
中央倉庫	10,000	884.00	8,840,000
安田倉庫	13,500	1,016.00	13,716,000
東洋埠頭	49,000	222.00	10,878,000
宇徳	14,100	371.00	5,231,100
上組	205,000	960.00	196,800,000
サンリツ	1,700	527.00	895,900
キムラユニティ	4,200	957.00	4,019,400
キューソー流通システム	5,600	1,025.00	5,740,000
郵船ロジスティクス	15,900	1,096.00	17,426,400
近鉄エクスプレス	15,400	4,340.00	66,836,000
東海運	9,700	264.00	2,560,800
エーアイティー	6,500	760.00	4,940,000
東京放送HD	91,700	1,188.00	108,939,600
日本テレビH L D S	169,400	1,711.00	289,843,400
テレビ朝日HD	43,100	1,847.00	79,605,700
スカパーJ S A T H D	129,200	592.00	76,486,400
テレビ東京HD	13,900	1,527.00	21,225,300
コネクシオ	15,200	879.00	13,360,800
クロップス	1,400	541.00	757,400
日本電信電話	668,400	6,550.00	4,378,020,000
K D D I	528,000	6,205.00	3,276,240,000
光通信	15,300	7,320.00	111,996,000
N T Tドコモ	1,401,500	1,753.00	2,456,829,500
G M Oインターネット	56,700	1,175.00	66,622,500
学研ホールディングス	57,000	280.00	15,960,000
ゼンリン	22,500	1,139.00	25,627,500
昭文社	10,400	665.00	6,916,000
K A D O K A W A	17,200	2,927.00	50,344,400
インプレスホールディングス	12,500	126.00	1,575,000
東京電力	1,461,900	407.00	594,993,300
中部電力	567,900	1,216.00	690,566,400
関西電力	703,300	964.00	677,981,200
中国電力	238,300	1,341.00	319,560,300
北陸電力	168,800	1,306.00	220,452,800
東北電力	430,600	1,156.00	497,773,600
四国電力	155,200	1,350.00	209,520,000
九州電力	380,600	1,192.00	453,675,200

北海道電力	161,200	856.00	137,987,200
沖縄電力	11,300	3,375.00	38,137,500
電源開発	107,000	3,155.00	337,585,000
東京瓦斯	2,021,000	588.00	1,188,348,000
大阪瓦斯	1,784,000	427.00	761,768,000
東邦瓦斯	438,000	566.00	247,908,000
北海道瓦斯	35,000	283.00	9,905,000
西部瓦斯	195,000	262.00	51,090,000
静岡瓦斯	45,000	690.00	31,050,000
アイネット	7,200	840.00	6,048,000
松竹	112,000	944.00	105,728,000
東宝	121,400	2,385.00	289,539,000
エイチ・アイ・エス	29,300	3,400.00	99,620,000
東映	71,000	541.00	38,411,000
AOI Pro.	7,500	670.00	5,025,000
NTTデータ	120,100	3,765.00	452,176,500
共立メンテナンス	8,900	4,550.00	40,495,000
イチネンホールディングス	19,100	792.00	15,127,200
建設技術研究所	10,700	1,276.00	13,653,200
スペース	8,900	1,034.00	9,202,600
アインファーマシーズ	9,400	4,640.00	43,616,000
燦ホールディングス	3,700	1,394.00	5,157,800
スバル興業	3,000	388.00	1,164,000
東京テアトル	69,000	143.00	9,867,000
よみうりランド	36,000	454.00	16,344,000
東京都競馬	138,000	293.00	40,434,000
常磐興産	62,000	150.00	9,300,000
カナモト	22,900	4,085.00	93,546,500
東京ドーム	133,000	470.00	62,510,000
D T S	16,200	1,866.00	30,229,200
スクウェア・エニックス・HD	61,800	1,950.00	120,510,000
シーイーシー	10,200	711.00	7,252,200
カプコン	43,500	1,717.00	74,689,500
西尾レントオール	14,500	4,095.00	59,377,500
アゴラ・ホスピタリティーG	75,000	44.00	3,300,000
日本空港ビルデング	58,800	2,949.00	173,401,200
トランス・コスモス	23,500	2,214.00	52,029,000
乃村工藝社	35,300	938.00	33,111,400
ジャステック	10,800	810.00	8,748,000
S C S K	40,400	2,817.00	113,806,800
藤田観光	46,000	374.00	17,204,000
K N T - C Tホールディングス	58,000	191.00	11,078,000
日本管財	7,700	2,455.00	18,903,500
トーカイ	8,000	2,933.00	23,464,000
白洋舎	5,000	239.00	1,195,000
セコム	187,300	6,209.00	1,162,945,700
日本システムウエア	6,400	719.00	4,601,600
セントラル警備保障	8,100	1,109.00	8,982,900
アイネス	23,000	778.00	17,894,000
丹青社	22,500	571.00	12,847,500

メイテック	24,400	3,095.00	75,518,000
T K C	14,300	2,140.00	30,602,000
アサツー ディ・ケイ	31,600	2,668.00	84,308,800
富士ソフト	21,600	2,218.00	47,908,800
応用地質	17,200	1,636.00	28,139,200
船井総研ホールディング	18,600	903.00	16,795,800
N S D	36,100	1,365.00	49,276,500
進学会	7,800	377.00	2,940,600
丸紅建材リース	15,000	208.00	3,120,000
コナミ	76,800	2,249.00	172,723,200
ベネッセホールディングス	60,300	4,070.00	245,421,000
イオンディライト	17,400	2,326.00	40,472,400
ナック	9,100	1,475.00	13,422,500
福井コンピュータH L D S	2,400	870.00	2,088,000
ニチイ学館	39,200	905.00	35,476,000
ダイセキ	26,600	1,885.00	50,141,000
ステップ	6,300	805.00	5,071,500
日鉄住金物産	112,000	385.00	43,120,000
元気寿司	5,300	1,961.00	10,393,300
トラスコ中山	19,600	2,467.00	48,353,200
ヤマダ電機	671,900	361.00	242,555,900
オートバックスセブン	57,800	1,677.00	96,930,600
アークランドサカモト	11,100	2,143.00	23,787,300
ニトリホールディングス	67,400	5,650.00	380,810,000
グルメ杵屋	12,000	856.00	10,272,000
愛眼	14,000	277.00	3,878,000
ケーユーホールディングス	7,300	637.00	4,650,100
吉野家ホールディングス	46,100	1,451.00	66,891,100
加藤産業	24,600	2,250.00	55,350,000
イノテック	15,600	476.00	7,425,600
イエローハット	14,700	2,317.00	34,059,900
富士エレクトロニクス	8,800	1,318.00	11,598,400
松屋フーズ	8,200	1,896.00	15,547,200
J B C Cホールディングス	14,200	776.00	11,019,200
J Kホールディングス	15,800	557.00	8,800,600
サガミチェーン	22,000	972.00	21,384,000
日伝	7,700	2,471.00	19,026,700
関西スーパーマーケット	12,900	864.00	11,145,600
ミロク情報サービス	11,300	495.00	5,593,500
北沢産業	11,000	184.00	2,024,000
杉本商事	9,200	995.00	9,154,000
因幡電機産業	23,500	3,395.00	79,782,500
王将フードサービス	11,200	4,580.00	51,296,000
プレナス	19,000	2,313.00	43,947,000
ミニストップ	12,600	1,611.00	20,298,600
アークス	29,100	2,119.00	61,662,900
バロ-	36,600	1,682.00	61,561,200
パイテック	5,800	833.00	4,831,400
ミスミグループ本社	68,200	2,996.00	204,327,200
江守グループH D	7,300	1,848.00	13,490,400

アルテック	8,200	225.00	1,845,000	
ベルク	8,400	2,753.00	23,125,200	
大庄	9,200	1,372.00	12,622,400	
タキヒヨー	29,000	420.00	12,180,000	
ファーストリテイリング	34,100	32,855.00	1,120,355,500	
ソフトバンク	835,300	7,480.00	6,248,044,000	
スズケン	70,400	3,580.00	252,032,000	
サンドラッグ	35,900	4,515.00	162,088,500	
東京デリカ	8,500	2,071.00	17,603,500	
ジェコス	11,800	1,145.00	13,511,000	
ヤマザワ	4,100	1,650.00	6,765,000	
やまや	3,500	1,798.00	6,293,000	
ベルーナ	42,500	496.00	21,080,000	
合計	282,046,550		309,143,700,950	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,326,472,089	1,562,386,247
国債証券		363,862,299,000	351,066,587,400
地方債証券		30,290,111,383	28,835,295,237
特殊債券		31,233,393,096	28,899,480,991
社債券		29,226,433,340	24,825,672,160
未収入金		-	2,597,624,000
未収利息		1,273,563,484	1,167,959,260
前払費用		41,158,715	26,537,829
流動資産合計		457,253,431,107	438,981,543,124
資産合計		457,253,431,107	438,981,543,124
負債の部			
流動負債			
未払解約金		127,301,000	481,101,000
流動負債合計		127,301,000	481,101,000
負債合計		127,301,000	481,101,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	384,301,757,056	364,816,328,000
剰余金			
剰余金又は欠損金()		72,824,373,051	73,684,114,124
元本等合計		457,126,130,107	438,500,442,124
純資産合計		457,126,130,107	438,500,442,124
負債純資産合計		457,253,431,107	438,981,543,124

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	378,118,752,239円	384,301,757,056円
同期中追加設定元本額	13,858,681,881円	17,777,928,783円
同期中一部解約元本額	7,675,677,064円	37,263,357,839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	6,688,627,446円	7,756,287,865円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	9,883,532,093円	10,182,259,605円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	3,738,906,961円	3,914,092,599円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	5,921,633,266円	6,192,757,632円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	2,490,067,683円	2,517,171,139円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,460,154,240円	1,641,113,671円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,597,267,216円	1,758,831,071円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	222,960,116円	244,645,589円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	153,559,854円	161,281,285円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,904,283,775円	2,066,952,819円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,003,057円	2,783,141円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	61,780,972円	76,306,122円

D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	31,092,320円	52,629,594円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	8,500,512円	15,623,275円
投資のソムリエ	223,737,416円	864,950,322円
クルーズコントロール	152,229,038円	936,246,874円
投資のソムリエ<DC年 金>	2,575,074円	8,175,485円
D I A M 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	4,894,743円	76,861,910円
みずほエマージングボン ドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファ ンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債 券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	14,105,425,650円	12,474,154,955円
D I A Mワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	744,486,049円	720,115,552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)	9,022,079,241円	6,935,592,166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)	599,365,688円	479,899,497円
D I A M国際分散 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	450,702,488円	341,568,974円
D I A M国際分散 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	964,855,359円	844,575,756円
D I A M国内重視 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	414,001,445円	368,590,027円
D I A M国内重視 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	366,538,877円	312,565,963円
D I A M世界 balan スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	33,458,041,082円	31,169,757,470円
D I A M世界 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	11,123,880,558円	10,254,053,433円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	14,089,795,868円	13,350,867,008円

D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	5,401,245,203円	5,036,303,536円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	8,698,267,858円	8,138,535,860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)	1,538,935,431円	1,260,636,240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)	6,433,940,797円	5,578,068,754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)	7,054,769,081円	6,392,961,406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)	12,209,720,687円	10,794,357,014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)	507,069,889円	508,585,424円
D I A M世界バランス ファンド55VA(適格 機関投資家限定)	13,646,929,146円	12,282,364,696円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	8,472,967,585円	8,330,542,690円
D I A Mグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	1,418,178,474円	1,267,326,367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)	111,231,367,099円	105,975,107,147円
D I A M世界アセットバ ランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,176,780,242円	1,875,098,981円
D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	9,797,400,827円	9,280,699,535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)	34,326,382,186円	32,944,458,192円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	483,433円	487,284円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	420,386,914円	377,180,600円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	124,094,157円	83,354,529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)	38,015,228,752円	36,582,413,492円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	933,930,861円	700,952,715円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	199,033,079円	173,684,857円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	1,748,356,268円	1,092,651,739円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	26,145,578円	389,671,541円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	304,583円	313,763円
計	384,301,757,056円	364,816,328,000円
2 . 受益権の総数	384,301,757,056口	364,816,328,000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25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,779,705,100	559,019,100
地方債証券	147,909,892	29,237,277
特殊債証券	181,654,816	23,720,140
社債証券	90,495,920	14,304,600
合計	4,359,644,472	578,840,837

(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25年2月15日から平成26年1月14日まで及び平成26年2月15日から平成26年7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,189円	1,202円
（1万口当たり純資産額）	（11,895円）	（12,020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26年7月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 3 1 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,960,000	
	3 3 2 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,520,000	
	3 3 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,001,120,000	
	3 3 4 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,001,800,000	
	3 3 5 回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,501,575,000	
	3 3 6 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,501,005,000	
	3 3 7 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,001,420,000	
	3 4 0 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,001,640,000	
	9 1 回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,409,792,000	
	9 2 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,011,560,000	
	9 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,522,295,000	
	9 5 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,009,050,000	
	9 6 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,216,236,000	
	9 7 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,026,200,000	
	9 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,021,900,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,016,260,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,519,950,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,528,260,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,517,100,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,019,800,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,316,899,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,000,540,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,020,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,517,325,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,526,705,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,534,650,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,518,150,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	6,000,000,000	6,018,120,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	666,906,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,111,040,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,443,585,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	1,400,000,000	1,477,784,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	923,679,000	
	2 7 2 回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	914,310,000	
	2 7 4 回 利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,449,632,000	
	2 7 7 回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,564,575,000	
	2 8 0 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,553,235,000	
	2 8 2 回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,521,584,000	
	2 8 4 回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,351,623,000	
	2 8 5 回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,817,693,000	

286回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,256,395,000	
288回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,577,655,000	
289回	利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	4,090,281,000	
290回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,048,040,000	
293回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,413,024,000	
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,230,640,000	
297回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,224,800,000	
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,267,927,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,626,440,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,447,867,000	
305回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,245,600,000	
306回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,207,540,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,918,314,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,107,980,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,727,868,000	
312回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,401,056,000	
313回	利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,923,748,000	
315回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,873,772,000	
317回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,116,220,000	
318回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,311,540,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,115,560,000	
320回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,101,020,000	
321回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,676,995,000	
324回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,104,160,000	
325回	利付国庫債券(10年)	4,700,000,000	4,858,578,000	
326回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,073,410,000	
328回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,058,560,000	
329回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,400,617,000	
330回	利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,868,150,000	
332回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,554,505,000	
333回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,041,500,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	125,548,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	119,784,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	236,372,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,936,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	232,424,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,054,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	351,084,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	543,085,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	424,952,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	337,887,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	331,806,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	586,185,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,614,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	474,844,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,630,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	942,122,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	229,508,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	354,783,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	572,300,000	

2 2 回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	555,060,600	
2 3 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	708,366,000	
2 4 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	708,120,000	
2 5 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	685,746,000	
2 6 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,162,130,000	
2 7 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,063,962,000	
2 8 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	945,560,000	
2 9 回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,511,653,000	
3 0 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,714,590,000	
3 1 回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,347,384,000	
3 2 回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,828,816,000	
3 3 回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,943,604,000	
3 4 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,682,430,000	
3 5 回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,830,543,000	
3 6 回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,828,690,000	
3 7 回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,683,424,000	
3 8 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,028,200,000	
3 9 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	839,984,000	
4 0 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,025,500,000	
4 1 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,101,078,000	
4 2 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,498,515,000	
3 7 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	657,642,000	
3 9 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	436,816,000	
4 0 回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	785,664,000	
4 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	892,112,000	
4 3 回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	981,638,400	
4 5 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,013,175,000	
4 6 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	559,325,000	
4 7 回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,066,755,000	
4 8 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	572,885,000	
5 0 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	866,041,800	
5 1 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	671,796,000	
5 2 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	620,950,000	
5 4 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	796,985,000	
5 5 回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	912,367,800	
5 7 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,267,114,200	
5 8 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	673,452,000	
6 0 回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,071,635,400	
6 1 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	838,856,000	
6 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,339,065,000	
6 4 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	677,022,000	
6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,243,198,000	
6 7 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,148,558,000	
7 0 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,476,100,000	
7 2 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,441,700,000	
7 3 回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,361,586,100	
7 5 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,618,064,000	
7 8 回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,647,591,500	
8 1 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,607,088,000	
8 3 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,855,776,000	

85回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,972,935,000		
88回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,776,015,000		
90回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,877,856,000		
92回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,976,726,000		
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	805,035,000		
94回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,278,596,000		
95回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,017,747,000		
97回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,880,592,000		
99回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,859,056,000		
100回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,997,143,000		
102回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,282,470,000		
105回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,090,070,000		
107回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,319,900,000		
109回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,149,147,000		
111回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,343,760,000		
113回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,544,146,000		
114回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,542,232,000		
116回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,571,756,000		
118回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,365,840,000		
119回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,440,933,000		
121回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,355,045,000		
123回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,529,054,000		
125回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,326,440,000		
128回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,115,770,000		
129回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,099,910,000		
130回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,415,556,000		
132回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,267,706,000		
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	983,061,000		
135回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,291,272,000		
137回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,362,316,000		
140回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,357,146,000		
141回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,350,062,000		
143回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,515,776,000		
145回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,655,950,000		
146回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,647,425,000		
147回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,596,200,000		
148回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,544,450,000		
国債証券 合計		330,220,000,000	351,066,587,400		
地方債証券	628回	東京都公募公債	100,000,000	102,162,000	
	629回	東京都公募公債	494,000,000	503,682,400	
	632回	東京都公募公債	115,300,000	119,014,966	
	633回	東京都公募公債	100,000,000	103,171,000	
	634回	東京都公募公債	200,000,000	206,882,000	
	638回	東京都公募公債	200,000,000	207,950,000	
	640回	東京都公募公債	150,000,000	156,198,000	
	641回	東京都公募公債	100,000,000	104,205,000	
	659回	東京都公募公債	203,500,000	215,435,275	
	664回	東京都公募公債	300,000,000	316,551,000	
	667回	東京都公募公債	300,000,000	319,767,000	
	680回	東京都公募公債	200,000,000	213,384,000	

685回	東京都公募公債	500,000,000	526,985,000	
688回	東京都公募公債	200,000,000	208,664,000	
697回	東京都公募公債	500,000,000	527,875,000	
701回	東京都公募公債	700,000,000	733,187,000	
708回	東京都公募公債	500,000,000	519,055,000	
720回	東京都公募公債	300,000,000	309,900,000	
18年度4回	北海道公募公債	190,500,000	197,438,010	
18年度6回	北海道公募公債	100,000,000	104,170,000	
19年度4回	北海道公募公債	300,000,000	316,170,000	
21年度6回	北海道公募公債	200,000,000	213,788,000	
22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	212,524,000	
135回	神奈川県公募公債	200,000,000	203,930,000	
136回	神奈川県公募公債	100,000,000	102,064,000	
166回	神奈川県公募公債	300,000,000	318,135,000	
194回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,448,000	
285回	大阪府公募公債	100,000,000	101,978,000	
286回	大阪府公募公債	200,000,000	204,200,000	
289回	大阪府公募公債	200,000,000	205,960,000	
293回	大阪府公募公債	200,000,000	208,372,000	
301回	大阪府公募公債	100,000,000	104,670,000	
307回	大阪府公募公債	100,000,000	105,556,000	
310回	大阪府公募公債	240,000,000	252,391,200	
319回	大阪府公募公債	200,000,000	212,852,000	
336回	大阪府公募公債	200,000,000	213,582,000	
345回	大阪府公募公債	300,000,000	318,261,000	
356回	大阪府公募公債	200,000,000	209,646,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	307,713,000	
374回	大阪府公募公債	300,000,000	310,434,000	
83回	大阪府公募公債 5年	300,000,000	301,332,000	
18年度1回	京都府公募公債	100,000,000	103,909,000	
17年度9回	兵庫県公募公債	306,000,000	312,257,700	
17年度13回	兵庫県公募公債	105,000,000	107,793,000	
18年度1回	兵庫県公募公債	120,000,000	123,597,600	
19年度2回	兵庫県公募公債	200,000,000	209,484,000	
18年度5回	静岡県公募公債	129,800,000	135,011,470	
21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	208,926,380	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	210,010,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	210,148,000	
18年度2回	愛知県公募公債	160,300,000	166,293,617	
20年度4回	愛知県公募公債	100,000,000	106,130,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	211,316,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	526,500,000	
25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	309,480,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	213,282,000	
18年度1回	埼玉県公募公債	200,000,000	206,126,000	
21年度4回	埼玉県公募公債	440,000,000	468,177,600	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	212,126,000	
17年度5回	福岡県公募公債	100,000,000	102,179,000	
18年度1回	福岡県公募公債	104,000,000	108,457,440	
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	213,870,000	

19年度5回	千葉県公募公債	300,000,000	317,166,000	
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	212,638,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	307,083,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	205,844,000	
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	176,099,690	
31回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,618,000	
32回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,148,000	
33回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,594,000	
35回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,906,000	
36回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,569,000	
37回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,579,500	
38回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	176,063,900	
39回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	151,150,880	
40回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,133,500	
47回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	168,768,576	
54回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	420,396,000	
55回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,444,000	
57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,608,000	
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,122,000	
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,085,000	
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	535,990,000	
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	750,078,000	
94回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,309,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	741,755,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,440,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	525,335,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	726,432,000	
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,890,000	
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,585,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	814,493,766	
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,870,000	
17年度7回	大阪市公募公債	200,000,000	203,104,000	
17年度8回	大阪市公募公債	200,000,000	203,816,000	
17年度11回	大阪市公募公債	100,000,000	102,379,000	
18年度2回	大阪市公募公債	100,000,000	103,622,000	
18年度3回	大阪市公募公債	150,000,000	156,006,000	
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	142,472,250	
18年度3回	京都市公募公債	101,700,000	106,450,407	
17年度13回	神戸市公募公債	103,000,000	105,458,610	
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	211,318,000	
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	212,762,000	
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	472,720,500	
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	413,380,000	
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	314,934,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	205,136,000	
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	108,278,000	
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	212,346,000	
18年度4回	福岡市公募公債	100,000,000	103,870,000	
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	214,290,000	
地方債証券 合計		27,635,600,000	28,835,295,237	

特殊債券	1 3 回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	125,910,180	
	2 7 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	208,096,000	
	4 6 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	211,150,000	
	1 5 回 高速道路機構債	400,000,000	416,620,000	
	2 5 回 高速道路機構債	300,000,000	315,675,000	
	3 5 回 高速道路機構債	400,000,000	421,404,000	
	4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	747,726,000	
	9 6 回 高速道路機構債	700,000,000	715,750,000	
	3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	306,609,000	
	5 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	214,170,660	
	8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	110,788,560	
	9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,776,000	
	1 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	312,772,110	
	1 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	126,989,800	
	1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	339,792,000	
	1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,787,000	
	2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	390,285,000	
	2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	311,844,000	
	3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,026,000	
	3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	310,216,500	
	3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	362,166,640	
	4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	349,645,230	
	4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,626,000	
	5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	523,665,000	
	5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,622,000	
	6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	753,746,840	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,269,640		
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	426,062,500		
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	633,204,000		

7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	741,363,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,573,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,382,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,024,000,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,790,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	342,045,000	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	203,634,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	211,527,090	
8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	246,241,700	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,154,000	
8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,498,000	
8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	104,927,890	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	106,114,680	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	504,012,940	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	524,580,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	692,969,970	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,761,950	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,350,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,219,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,990,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,378,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,321,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,505,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,805,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	518,385,000	
1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,739,000	
2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	207,438,000	
2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	313,149,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	213,562,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,310,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	317,853,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	80,811,000	87,466,593	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	56,546,000	60,978,640	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	83,802,000	90,516,216	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	91,362,000	99,019,049	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	42,941,000	45,559,112	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	220,825,000	232,137,864	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,640,000	56,237,248	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,386,000	40,672,603	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	140,824,000	153,382,684	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	112,095,000	121,500,891	

1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,980,000	207,719,812	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	301,430,000	322,246,755	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	578,144,000	614,173,934	
7 3 2 号 利付商工債	400,000,000	403,400,000	
7 3 6 号 利付商工債	300,000,000	302,016,000	
7 4 0 号 利付商工債	300,000,000	302,283,000	
7 3 7 号 利附農林債	300,000,000	302,229,000	
7 4 3 号 利附農林債	300,000,000	302,208,000	
7 5 3 号 利附農林債	300,000,000	300,435,000	
7 6 0 号 利附農林債	300,000,000	302,064,000	
2 5 3 回 利附信金中金債	300,000,000	302,028,000	
2 6 1 回 利附信金中金債	300,000,000	301,968,000	
2 7 5 回 利附信金中金債	400,000,000	401,900,000	
2 8 2 回 利附信金中金債	300,000,000	301,440,000	
1 5 6 号 利附商工債(3年)	500,000,000	500,460,000	
1 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,108,880	
2 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,071,510	
8 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	176,783,000	
4 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	174,389,400	
1 0 回 政保中日本高速道路債券	215,000,000	223,643,000	
2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	318,213,000	
5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	213,676,000	
1 回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	205,196,880	
5 回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	270,199,160	
6 回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	122,222,880	
5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	512,960,000	
特殊債券 合計	27,717,786,000	28,899,480,991	
社債券			
1 4 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	102,203,000	
2 回 J P モルガン・チェース劣後債	100,000,000	102,082,000	
1 2 回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	105,806,000	
1 6 回 シティグループ円貨社債	100,000,000	101,516,000	
2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	312,750,000	
7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	107,147,000	
3 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	106,709,000	
4 1 回 住友化学社債	100,000,000	106,616,000	
3 7 回 三菱化学社債	100,000,000	107,180,000	
3 4 回 三井化学社債	100,000,000	102,603,000	
1 1 回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,325,000	
1 2 回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,650,000	
2 9 回 新日本製鐵社債	100,000,000	108,210,000	
6 4 回 新日本製鐵社債	100,000,000	106,545,000	
1 回 日本電産社債	100,000,000	100,512,000	
1 0 回 パナソニック社債	200,000,000	201,828,000	
1 1 回 パナソニック社債	100,000,000	103,025,000	
1 9 回 三菱重工業社債	100,000,000	103,977,000	
5 6 回 日産自動車社債	100,000,000	101,218,000	
1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	207,452,000	

49回	伊藤忠商事社債	100,000,000	107,932,000	
58回	伊藤忠商事社債	100,000,000	100,760,000	
66回	伊藤忠商事社債	200,000,000	200,800,000	
91回	丸紅社債	100,000,000	100,783,000	
30回	住友商事社債	100,000,000	102,487,000	
69回	三菱商事社債	300,000,000	320,112,000	
7回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	317,064,000	
24回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,242,000	
25回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	303,012,000	
27回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	302,199,000	
29回	みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	503,585,000	
31回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,230,000	
32回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,428,000	
7回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	110,288,000	
126回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,430,000	
134回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,154,000	
140回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,792,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	219,096,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,600,000	
12回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	211,806,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	211,232,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	214,634,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	111,541,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,172,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	214,036,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	108,176,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,615,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	104,820,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,713,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	102,187,000	
51回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,540,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,404,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	301,179,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	209,858,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,226,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	218,774,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	212,740,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	215,170,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	104,653,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,233,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	218,040,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,764,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,805,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,702,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,199,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	217,680,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	103,193,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	312,009,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	104,240,000	

148回	オリックス社債	200,000,000	205,236,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,731,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,550,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,886,000	
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,712,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	101,157,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	305,367,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,497,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	102,112,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	213,494,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	208,618,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	105,415,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	213,598,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,411,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,648,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	106,613,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	104,312,000	
3回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	212,406,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,775,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	342,594,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,419,000	
41回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,709,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	316,140,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	319,680,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	216,096,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	339,111,000	
2回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	213,598,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,773,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,591,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	197,577,200	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	218,342,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,377,000	
3回	東京地下鉄社債	100,000,000	103,850,000	
5回	KDDI社債	100,000,000	108,328,000	
50回	日本電信電話社債	100,000,000	101,709,000	
51回	日本電信電話社債	200,000,000	207,436,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	212,026,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	318,951,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	213,742,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	202,954,000	
519回	東京電力社債	372,000,000	372,717,960	
542回	東京電力社債	500,000,000	499,145,000	
409回	中部電力社債	300,000,000	321,531,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	107,220,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	103,672,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	207,964,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	523,905,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	318,960,000	
446回	関西電力社債	200,000,000	204,858,000	

310回	中国電力社債	200,000,000	217,942,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	111,231,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	212,674,000	
380回	東北電力社債	300,000,000	323,376,000	
427回	東北電力社債	200,000,000	202,854,000	
432回	東北電力社債	500,000,000	517,130,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	107,474,000	
387回	九州電力社債	200,000,000	204,886,000	
257回	北海道電力社債	200,000,000	212,538,000	
284回	北海道電力社債	500,000,000	509,305,000	
14回	電源開発社債	100,000,000	101,567,000	
17回	電源開発社債	100,000,000	103,544,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	109,490,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	109,650,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	102,808,000	
社債券 合計		23,762,000,000	24,825,672,160	
合計		409,335,386,000	433,627,035,788	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,481,571,982	560,089,264
投資証券		17,369,800,780	30,790,917,250
未収入金		-	40,042,340
未収配当金		142,457,948	220,750,335
流動資産合計		18,993,830,710	31,611,799,189
資産合計		18,993,830,710	31,611,799,189
負債の部			
流動負債			
未払金		1,414,710,940	494,250,610
未払解約金		248,000	1,091,000
流動負債合計		1,414,958,940	495,341,610
負債合計		1,414,958,940	495,341,610
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,323,636,866	21,574,800,459
剰余金			
剰余金又は欠損金()		4,255,234,904	9,541,657,120
元本等合計		17,578,871,770	31,116,457,579
純資産合計		17,578,871,770	31,116,457,579
負債純資産合計		18,993,830,710	31,611,799,189

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,539,027,253円	13,323,636,866円
同期中追加設定元本額	7,946,924,419円	34,618,843,798円
同期中一部解約元本額	4,162,314,806円	26,367,680,205円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	41,017,905円	41,484,123円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	506,890,177円	531,488,485円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,678,558円	3,274,109円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	2,914,314円	3,325,877円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	5,414,120円	8,400,189円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	13,767,469円	23,379,905円
投資のソムリエ	26,829,709円	86,261,425円
投資のソムリエ<DC年金>	301,687円	815,168円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	235,000円	3,341,854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）	2,158,973,286円	2,120,719,175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）	1,167,041,128円	1,145,882,682円

DIAM J-REIT インデックス私募ファン ド201401(適格機 関投資家限定)	- 円	3,107,027,079円
DIAM J-REIT インデックスファンド (適格機関投資家向け)	6,334,891,129円	10,294,411,927円
DIAMグローバル 私 募ファンド(適格機関投 資家向け)	140,888,123円	138,473,210円
DIAMグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	249,108,638円	210,074,712円
DIAMグローバル・リ スクファクター・パリ ティ戦略ファンド(適格 機関投資家限定)	50,509,031円	218,038,011円
DIAMグローバル・リ スクファクター・パリ ティ戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	- 円	82,356,264円
DIAM リスクコント ロールJ-REITファ ンド(適格機関投資家限 定)	2,623,176,592円	3,556,046,264円
計	13,323,636,866円	21,574,800,459円
2. 受益権の総数	13,323,636,866口	21,574,800,459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25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	1,095,382,568	524,815,072
合計	1,095,382,568	524,815,072

(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25年6月7日から平成26年1月14日まで及び平成26年6月7日から平成26年7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3194円	1.4423円
(1万口当たり純資産額)	(13,194円)	(14,423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26年7月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	7,719	864,528,000	
	MIDリート投資法人	676	161,226,000	
	SIA不動産投資法人	276	117,714,000	
	いちご不動産投資法人	3,777	264,012,300	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	924	822,360,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,784	1,175,428,800	
	イオンリート投資法人	3,496	471,960,000	
	インヴィンシブル投資法人	5,789	156,592,450	
	オリックス不動産投資法人	7,235	1,015,794,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	713	216,752,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,306	724,830,000	
	ケネディクスレジデンシャル投資法人	889	213,093,300	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	370	279,720,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,646	529,565,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	4,463	606,968,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,605	2,657,085,000	
	スタートアップリート投資法人	533	93,754,700	
	トップリート投資法人	648	289,656,000	
	ヒューリックリート投資法人	2,399	388,638,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,825	1,009,225,000	
	プレミアム投資法人	805	327,232,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,200	1,495,920,000	
	阪急リート投資法人	440	248,160,000	
	産業ファンド投資法人	609	545,055,000	
	森トラスト総合リート投資法人	4,857	824,232,900	
	森ヒルズリート投資法人	5,096	762,361,600	
	星野リゾート・リート投資法人	158	136,512,000	
	積水ハウス・S Iレジデ投資法人	3,368	346,567,200	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,376	650,160,000	
	大和ハウスリート投資法人	1,080	484,380,000	
	大和証券オフィス投資法人	1,608	766,212,000	
	東急リアル・エステート投資法人	3,597	510,774,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,698	647,787,000	
	日本ビルファンド投資法人	5,196	2,987,700,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	3,036	1,079,298,000	
日本プロロジスリート投資法人	5,754	1,361,396,400		
日本リート投資法人	559	143,942,500		
日本リテールファンド投資法人	8,494	1,881,421,000		
日本ロジスティクスファンド投資法人	3,054	718,606,200		
日本賃貸住宅投資法人	5,428	383,216,800		
福岡リート投資法人	2,539	442,293,800		

	平和不動産リート投資法人	3,244	274,118,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,371	645,741,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	6,128	743,326,400	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	592	325,600,000	
投資証券	合計	141,360	30,790,917,250	
合計		141,360	30,790,917,250	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,172,666,831	5,833,337,961
コール・ローン		143,379,026	220,039,182
株式		298,535,209,958	292,121,965,503
投資信託受益証券		858,691,616	887,593,981
投資証券		5,115,634,900	5,699,560,140
派生商品評価勘定		38,917,107	40,168,128
未収入金		12,541,185	26,050,626
未収配当金		366,142,712	425,315,276
差入委託証拠金		883,876,270	1,199,093,671
流動資産合計		310,127,059,605	306,453,124,468
資産合計		310,127,059,605	306,453,124,468
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		14,954,691	58,686,748
未払解約金		65,294,000	252,450,000
流動負債合計		80,248,691	311,136,748
負債合計		80,248,691	311,136,748
純資産の部			
元本等			
元本	1	135,913,743,805	127,193,032,969
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		174,133,067,109	178,948,954,751
元本等合計		310,046,810,914	306,141,987,720
純資産合計		310,046,810,914	306,141,987,720
負債純資産合計		310,127,059,605	306,453,124,468

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	151,632,920,551円	135,913,743,805円
同期中追加設定元本額	1,623,839,145円	6,364,362,756円
同期中一部解約元本額	17,343,015,891円	15,085,073,592円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,159,121,996円	887,020,842円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	33,296,459,708円	33,841,068,565円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	150,534,125円	149,610,480円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	890,329,376円	856,618,886円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,112,032,575円	1,078,718,512円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	148,892,745円	156,524,275円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	423,004,157円	434,961,342円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	337,783,336円	344,717,137円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	76,219,172円	65,941,071円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	947,808,800円	845,784,211円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	163,376,187円	177,605,873円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	5,540,548円	6,583,756円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	7,687,612円	12,614,143円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	17,375,983円	31,047,635円
投資のソムリエ	41,909,527円	119,082,512円
クルーズコントロール	35,598,562円	195,372,699円
投資のソムリエ< D C年金>	483,907円	1,126,108円

D I A M 8資産バランス ファンドN<DC年金 >	452,734円	6,695,719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)	446,333,455円	422,931,683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)	4,223,297,292円	3,901,253,297円
D I A Mワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	48,987,699円	46,620,553円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,797,958,766円	2,872,315,713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)	757,583,234円	596,806,716円
D I A M国際分散 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	97,541,633円	72,748,351円
D I A M国際分散 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	487,450,822円	419,742,948円
D I A M国内重視 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	41,788,110円	36,609,441円
D I A M国内重視 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	92,550,138円	77,651,441円
D I A M世界 balan スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	11,265,455,225円	10,327,702,881円
D I A M世界 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	5,618,861,756円	5,096,353,739円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	1,777,730,776円	1,657,611,459円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	1,590,948,161円	1,459,782,085円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	4,393,683,480円	4,044,870,931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)	2,616,588,063円	2,097,912,960円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	3,936,646,960円	3,327,945,690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)	2,375,066,041円	2,117,765,913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)	2,049,442,154円	1,780,746,848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)	29,321,084円	27,678,338円
D I A M世界バランス ファンド55VA(適格 機関投資家限定)	10,441,316,927円	9,157,206,481円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	2,275,077,315円	2,106,792,977円
D I A Mグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	73,011,333円	61,756,573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)	14,039,586,099円	13,161,968,876円
D I A M世界アセットバ ランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,099,526,644円	932,195,945円
D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,473,239,583円	2,305,317,728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)	8,666,421,148円	8,184,393,863円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	155,731円	151,532円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	347,414,773円	299,835,388円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	238,514,023円	151,789,349円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	11,517,045,938円	10,906,396,585円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	268,844,682円	162,988,126円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	11,460,038円	165,814,913円

D I A Mバランス60V A（適格機関投資家限 定）	283,672円	279,880円
計	135,913,743,805円	127,193,032,969円
2. 受益権の総数	135,913,743,805口	127,193,032,969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25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	42,184,166,839	12,487,548,269
投資信託受益証券	28,406,461	69,258,120
投資証券	226,080,969	411,746,900
合計	41,929,679,409	12,968,553,289

（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25年2月16日から平成26年1月14日まで及び平成26年2月18日から平成26年7月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年1月14日 現在				平成26年7月11日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	（円）		（円）	（円）	（円）		（円）	（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	37,729,980	-	37,728,000	1,980	351,633,505	-	351,514,100	119,405
アメリカ・ドル	-	-	-	-	233,244,560	-	233,128,000	116,560
イギリス・ポンド	-	-	-	-	27,771,280	-	27,769,600	1,680
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	27,570,445	-	27,570,300	145
カナダ・ドル	9,488,400	-	9,488,000	400	16,181,960	-	16,180,600	1,360
ユーロ	28,241,580	-	28,240,000	1,580	46,865,260	-	46,865,600	340
買 建	53,340,050	-	52,691,000	649,050	-	-	-	-
アメリカ・ドル	10,494,800	-	10,331,000	163,800	-	-	-	-
ユーロ	42,845,250	-	42,360,000	485,250	-	-	-	-
合計	91,070,030	-	90,419,000	647,070	351,633,505	-	351,514,100	119,405

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

株式関連

種類	平成26年1月14日 現在				平成26年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,361,842,494	-	5,386,451,980	24,609,486	7,017,878,673	-	6,999,240,648	18,638,025
合計	5,361,842,494	-	5,386,451,980	24,609,486	7,017,878,673	-	6,999,240,648	18,638,025

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.2812円	2.4069円
(1万口当たり純資産額)	(22,812円)	(24,069円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	37,094	327.920	12,163,864.480	
	ABBOTT LABORATORIES	147,822	41.240	6,096,179.280	
	AES CORP	65,017	15.530	1,009,714.010	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	94,874	187.700	17,807,849.800	
	ADOBE SYSTEMS INC	45,391	71.700	3,254,534.700	
	ACE LTD	33,751	104.260	3,518,879.260	
	AGCO CORP	9,937	53.290	529,542.730	
	AIRGAS INC	6,292	109.500	688,974.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,385	128.690	2,365,965.650	
	ENERGEN CORP	7,454	86.450	644,398.300	
	ALLEGHANY CORP	1,956	436.970	854,713.320	
	ALLERGAN INC	29,445	165.600	4,876,092.000	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	87,709	64.940	5,695,822.460	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	159.970	846,241.300	
	ALLSTATE CORP	43,188	58.070	2,507,927.160	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	70,977	94.280	6,691,711.560	
	ALTERA CORPORATION	23,108	35.110	811,321.880	
	ALCOA INC	102,779	15.620	1,605,407.980	
	AMGEN INC	72,230	118.950	8,591,758.500	
	HESS CORP	27,886	98.500	2,746,771.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	92,749	94.460	8,761,070.540	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	48,454	54.800	2,655,279.200	
	AFLAC INC	41,406	62.420	2,584,562.520	
	AMERICAN INTL GROUP	133,440	54.480	7,269,811.200	
	ANALOG DEVICES	32,150	54.400	1,748,960.000	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	48,203	106.140	5,116,266.420	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,075	162.890	3,107,126.750	
	NABORS INDUSTRIES LTD	19,674	28.990	570,349.260	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	40,908	44.820	1,833,496.560	
	TIME WARNER	85,446	72.220	6,170,910.120	
	VALERO ENERGY CORP	53,282	49.210	2,622,007.220	
	APACHE CORP	37,504	99.220	3,721,146.880	
	ANSYS INC	9,305	74.740	695,455.700	
APPLE INC	598,883	95.035	56,914,845.900		

APPLIED MATERIALS INC	118,836	22.870	2,717,779.320	
ALBEMARLE CORP	7,690	71.600	550,604.000	
ARCHER-DANIELS- MIDLAND CO	65,752	47.350	3,113,357.200	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	13,584	56.940	773,472.960	
AMEREN CORP	25,297	40.200	1,016,939.400	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	60.780	472,078.260	
ASHLAND INC	6,333	107.590	681,367.470	
AUTOLIV INC	9,293	106.400	988,775.200	
AUTODESK INC	20,701	55.435	1,147,559.930	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	45,799	80.145	3,670,560.850	
AUTOZONE INC	3,337	534.020	1,782,024.740	
AVERY DENNISON CORP	8,865	50.850	450,785.250	
AVNET INC	15,099	43.870	662,393.130	
AVON PRODUCTS INC	41,317	14.430	596,204.310	
BAKER HUGHES INC	41,613	73.400	3,054,394.200	
BALL CORP	12,188	63.340	771,987.920	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	107,527	128.450	13,811,843.150	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	109,395	37.720	4,126,379.400	
CR BARD INC	6,949	145.740	1,012,747.260	
BAXTER INTERNATIONAL INC	54,225	76.750	4,161,768.750	
BED BATH & BEYOND INC	16,743	58.330	976,619.190	
BECTON DICKINSON & CO	19,000	118.870	2,258,530.000	
AMETEK INC	25,338	52.170	1,321,883.460	
BE AEROSPACE INC	10,265	93.450	959,264.250	
VERIZON COMM INC	397,874	49.640	19,750,465.360	
WR BERKLEY CORP	11,053	46.170	510,317.010	
BEST BUY CO INC	26,686	30.490	813,656.140	
YUM! BRANDS INC	44,276	82.470	3,651,441.720	
FIRSTENERGY CORP	44,278	33.180	1,469,144.040	
H&R BLOCK INC	26,590	32.600	866,834.000	
ENSCO PLC-CL A	22,819	53.550	1,221,957.450	
BOEING CO	67,627	126.790	8,574,427.330	
ROBERT HALF INTL INC	14,807	47.860	708,663.020	
BORGWARNER INC	20,836	66.150	1,378,301.400	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131,498	13.100	1,722,623.800	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,679	63.460	868,069.340	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,922	250.540	732,077.880	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	160,632	48.510	7,792,258.320	

AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,422	202.820	1,099,690.040	
ONEOK INC	20,139	66.680	1,342,868.520	
UNITED RENTALS INC	7,795	107.690	839,443.550	
SEMPRA ENERGY	22,909	102.450	2,347,027.050	
FEDEX CORP	28,393	150.260	4,266,332.180	
VERISIGN INC	12,278	49.400	606,533.200	
AMPHENOL CORP	15,769	96.660	1,524,231.540	
BROWN-FORMAN CORP	12,081	93.790	1,133,076.990	
QUANTA SERVICES INC	20,095	34.670	696,693.650	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	15,657	44.710	700,024.470	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	324,052	3.380	1,095,295.760	
CSX CORP	96,355	30.840	2,971,588.200	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	20,538	18.120	372,148.560	
CABOT OIL & GAS CORP	43,570	34.730	1,513,186.100	
CAMPBELL SOUP CO	22,764	45.270	1,030,526.280	
SEAGATE TECHNOLOGY	32,204	58.830	1,894,561.320	
WHITING PETROLEUM CORP	13,133	79.960	1,050,114.680	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,362	89.920	1,471,271.040	
CARDINAL HEALTH INC	33,720	70.510	2,377,597.200	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	37,957	36.430	1,382,773.510	
CATERPILLAR INC	61,002	109.360	6,671,178.720	
CELGENE CORP	77,746	87.830	6,828,431.180	
CORE LABORATORIES N.V.	4,891	162.090	792,782.190	
CITRIX SYSTEMS INC	18,649	62.750	1,170,224.750	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	29.020	1,294,466.120	
CENTURYLINK INC	58,784	36.780	2,162,075.520	
CERNER CORP	32,135	51.240	1,646,597.400	
JPMORGAN CHASE & CO	364,200	55.560	20,234,952.000	
CHUBB CORP	25,276	93.180	2,355,217.680	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,581	68.040	856,011.240	
CIGNA CORP	27,804	92.300	2,566,309.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,516	47.740	788,473.840	
CINTAS CORP	8,876	63.155	560,563.780	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	103,027	5.730	590,344.710	
CISCO SYSTEMS INC	493,369	25.440	12,551,307.360	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	9,607	66.840	642,131.880	

CLOROX COMPANY	9,288	93.030	864,062.640	
EQUINIX INC	4,475	211.510	946,507.250	
COCA-COLA CO/THE	380,237	42.260	16,068,815.620	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	24,325	48.460	1,178,789.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	88,193	69.420	6,122,358.060	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	21,321	65.570	1,398,017.970	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	40,254	54.040	2,175,326.160	
COMERICA INC	18,671	50.200	937,284.200	
NRG ENERGY, INC.	23,703	35.360	838,138.080	
COMCAST CORP-CL A	206,890	54.355	11,245,505.950	
CA INC	30,767	28.170	866,706.390	
COMPUTER SCIENCES CORP	15,686	62.710	983,669.060	
CONAGRA FOODS INC	45,240	30.510	1,380,272.400	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,579	56.610	1,617,857.190	
CMS ENERGY CORP	20,017	30.390	608,316.630	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	22,218	68.200	1,515,267.600	
MOLSON COORS BREWING CO	14,777	73.320	1,083,449.640	
CORNING INC	138,428	21.630	2,994,197.640	
DIRECTV	46,620	86.410	4,028,434.200	
CREE INC	12,621	48.920	617,419.320	
SEALED AIR CORP	20,323	33.210	674,926.830	
BROADCOM CORP-CL A	50,788	37.850	1,922,325.800	
CUMMINS INC	15,720	152.000	2,389,440.000	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	8,350	119.030	993,900.500	
DR HORTON INC	30,691	24.420	749,474.220	
DANAHER CORP	59,746	78.000	4,660,188.000	
MOODY'S CORP	19,691	88.500	1,742,653.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	58,110	50.010	2,906,081.100	
TARGET CORP	57,397	59.930	3,439,802.210	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	47.640	317,663.520	
DEERE & CO	34,560	88.120	3,045,427.200	
MORGAN STANLEY	137,640	31.680	4,360,435.200	
REPUBLIC SERVICES INC	29,354	37.080	1,088,446.320	
THE WALT DISNEY CO	160,092	86.860	13,905,591.120	
DOLLAR TREE INC	21,769	55.480	1,207,744.120	
DOVER CORP	16,297	88.450	1,441,469.650	
DOW CHEMICAL	119,577	51.120	6,112,776.240	
OMNICOM GROUP	24,978	71.360	1,782,430.080	
DTE ENERGY CO	19,035	76.360	1,453,512.600	

XL GROUP PLC	26,332	33.320	877,382.240	
DUKE ENERGY CORP	68,256	72.390	4,941,051.840	
FLOWERVE CORP	12,469	73.110	911,608.590	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,714	44.760	300,518.640	
EBAY INC	116,508	50.335	5,864,430.180	
EMC CORP/MASS	193,849	26.720	5,179,645.280	
BANK OF AMERICA CORP	1,016,192	15.440	15,690,004.480	
CITIGROUP INC	291,694	46.900	13,680,448.600	
EASTMAN CHEMICAL CO	15,223	86.760	1,320,747.480	
EATON CORP PLC	47,290	77.660	3,672,541.400	
EATON VANCE CORP	12,917	37.350	482,449.950	
DISH NETWORK CORP	16,800	65.150	1,094,520.000	
ECOLAB INC	27,290	110.010	3,002,172.900	
ELECTRONIC ARTS INC	30,888	35.850	1,107,334.800	
SALESFORCE.COM INC	57,371	54.300	3,115,245.300	
EMERSON ELECTRIC CO	65,481	67.200	4,400,323.200	
WEATHERFORD INTL PLC	73,546	22.100	1,625,366.600	
ENTERGY CORP	16,359	78.700	1,287,453.300	
EOG RESOURCES INC	52,325	114.960	6,015,282.000	
EQUIFAX INC	11,487	73.390	843,030.930	
EQT CORP	14,624	102.710	1,502,031.040	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	23,912	74.690	1,785,987.280	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,066	44.350	889,927.100	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	74,245	67.705	5,026,757.720	
EXXON MOBIL CORP	414,839	102.570	42,550,036.230	
FMC CORP	12,155	69.140	840,396.700	
NEXTERA ENERGY INC	42,705	99.390	4,244,449.950	
FAMILY DOLLAR STORES	10,460	64.120	670,695.200	
ASSURANT INC	6,227	65.760	409,487.520	
FASTENAL CO	28,589	48.155	1,376,703.290	
FIFTH THIRD BANCORP	87,505	21.220	1,856,856.100	
M&T BANK CORP	11,528	121.690	1,402,842.320	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	11,007	98.910	1,088,702.370	
FISERV INC	26,258	60.910	1,599,374.780	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	33.900	488,905.800	
MACY'S INC	35,128	58.800	2,065,526.400	
FORD MOTOR CO	352,221	17.300	6,093,423.300	
FOSSIL GROUP INC	5,086	103.030	524,010.580	
FRANKLIN RESOURCES INC	39,798	56.800	2,260,526.400	
FREPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	99,387	38.860	3,862,178.820	
FLEXTRONICS INTL LTD	65,835	10.920	718,918.200	
GAP INC/THE	16,693	40.970	683,912.210	

DENTSPLY INTERNATIONAL INC	15,658	47.500	743,755.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,931	115.530	3,111,338.430	
GENERAL MILLS INC	60,165	53.020	3,189,948.300	
GENUINE PARTS CO	14,679	86.880	1,275,311.520	
GILEAD SCIENCES INC	148,770	88.945	13,232,347.650	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	17,970	84.340	1,515,589.800	
MCKESSON CORP	22,122	188.990	4,180,836.780	
NVIDIA CORP	51,123	19.005	971,592.610	
GENERAL ELECTRIC CO	962,324	26.200	25,212,888.800	
WW GRAINGER INC	4,603	247.650	1,139,932.950	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	12,399	121.380	1,504,990.620	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	18.210	404,917.560	
HALLIBURTON CO	81,085	69.350	5,623,244.750	
MONSTER BEVERAGE CORP	14,671	70.860	1,039,587.060	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41,294	163.420	6,748,265.480	
HARLEY-DAVIDSON INC	21,132	67.760	1,431,904.320	
HARRIS CORP	10,776	73.230	789,126.480	
CONSOL ENERGY INC	22,051	43.490	958,997.990	
HASBRO INC	11,176	53.730	600,486.480	
HENRY SCHEIN INC	7,142	118.570	846,826.940	
DENBURY RESOURCES INC	28,517	17.770	506,747.090	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	114.610	1,137,962.690	
HERSHEY FOODS CORP	16,263	96.280	1,565,801.640	
HEWLETT-PACKARD CO	180,697	33.850	6,116,593.450	
F5 NETWORKS INC	7,198	111.290	801,065.420	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	51.050	659,514.950	
REYNOLDS AMERICAN INC	32,398	62.260	2,017,099.480	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	12,502	104.140	1,301,958.280	
JUNIPER NETWORKS INC	48,236	24.390	1,176,476.040	
HOLLYFRONTIER CORP	19,247	43.100	829,545.700	
HOLOGIC INC	12,273	25.480	312,716.040	
UNUM GROUP	24,833	34.700	861,705.100	
HOME DEPOT INC	135,232	79.400	10,737,420.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,878	59.060	819,634.680	
HORMEL FOODS CORP	14,878	48.710	724,707.380	
HUDSON CITY BANCORP INC	61,279	9.660	591,955.140	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,422	25.060	1,088,155.320	
HUMANA INC	15,524	127.080	1,972,789.920	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,635	73.470	707,883.450	
RED HAT INC	14,283	54.780	782,422.740	
BIOGEN IDEC INC	22,651	319.120	7,228,387.120	
ILLINOIS TOOL WORKS	38,341	85.650	3,283,906.650	
INTUIT INC	25,555	80.420	2,055,133.100	
INGERSOLL-RAND PLC	28,100	60.990	1,713,819.000	
INTEL CORP	475,279	31.260	14,857,221.540	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,046	103.930	836,220.780	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,978	49.780	1,741,204.840	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	19.130	705,361.360	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,497	53.150	770,515.550	
JOHNSON & JOHNSON	271,522	105.800	28,727,027.600	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	41,564	36.200	1,504,616.800	
JOHNSON CONTROLS INC	62,334	50.410	3,142,256.940	
KLA-TENCOR CORP	16,662	74.720	1,244,984.640	
DEVON ENERGY CORP	38,601	78.100	3,014,738.100	
KELLOGG CO	25,929	65.880	1,708,202.520	
KEYCORP	66,833	14.150	945,686.950	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,855	112.810	4,270,422.550	
BLACKROCK INC/NEW YORK	13,096	315.900	4,137,026.400	
KOHL'S CORP	23,092	52.070	1,202,400.440	
KROGER CO	48,049	48.970	2,352,959.530	
LAM RESEARCH CORP	14,133	71.090	1,004,714.970	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,064	60.070	1,025,034.480	
LEGG MASON INC	13,165	50.050	658,908.250	
LEGGETT & PLATT INC	8,522	33.470	285,231.340	
LENNAR CORP	18,341	40.650	745,561.650	
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,186	25.530	770,648.580	
ELI LILLY & CO	97,045	62.530	6,068,223.850	
L BRANDS INC	23,896	60.210	1,438,778.160	
LINCOLN NATIONAL CORP	25,472	51.810	1,319,704.320	
LINEAR TECH CORP	23,086	47.570	1,098,201.020	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	68,012	102.090	6,943,345.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34,061	56.490	1,924,105.890	
LOCKHEED MARTIN CORP	26,723	158.180	4,227,044.140	
LOEWS CORP	33,738	43.720	1,475,025.360	
RANGE RESOURCES CORP	17,434	82.100	1,431,331.400	
LOWE'S COS INC	98,937	47.200	4,669,826.400	

DOMINION RESOURCES INC/VA	56,433	69.980	3,949,181.340	
IRON MOUNTAIN INC	12,968	35.280	457,511.040	
SCANA CORP	9,574	53.460	511,826.040	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,355	34.190	285,657.450	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,258	25.720	1,061,155.760	
MCCORMICK & CO INC	12,364	70.430	870,796.520	
MCDONALD'S CORPORATION	96,238	100.580	9,679,618.040	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	24,858	81.660	2,029,904.280	
EVEREST RE GROUP LTD	2,661	163.680	435,552.480	
MANPOWERGROUP INC	7,953	82.300	654,531.900	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	11,191	88.150	986,486.650	
MARSH & MCLENNAN COS	53,011	51.750	2,743,319.250	
ENERGIZER HOLDINGS INC	6,938	122.500	849,905.000	
MASCO CORP	37,719	21.240	801,151.560	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	129.300	659,688.600	
MATTEL INC	35,228	39.250	1,382,699.000	
METLIFE INC	93,799	55.450	5,201,154.550	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	30,330	33.930	1,029,096.900	
MEDTRONIC INC	95,432	63.470	6,057,069.040	
ACTIVISION BLIZZARD INC	51,983	22.440	1,166,498.520	
CVS CAREMARK CORP	114,498	76.610	8,771,691.780	
MERCK & CO. INC.	282,267	58.580	16,535,200.860	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,194	103.970	955,900.180	
MICROSOFT CORP	757,300	41.685	31,568,050.500	
MICRON TECH INC	103,537	32.770	3,392,907.490	
RACKSPACE HOSTING INC	13,630	33.690	459,194.700	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,985	49.270	935,390.950	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	40,080	14.260	571,540.800	
3M CO	60,180	143.890	8,659,300.200	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,856	130.370	763,446.720	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	23,746	66.450	1,577,921.700	
KANSAS CITY SOUTHERN	10,506	111.780	1,174,360.680	
MURPHY OIL CORPORATION	17,184	65.450	1,124,692.800	
ENDO INTERNATIONAL PLC	12,378	66.300	820,661.400	

MYLAN LABORATORIES	37,298	50.705	1,891,195.090	
ILLUMINA INC	13,037	173.990	2,268,307.630	
XCEL ENERGY INC	48,810	31.800	1,552,158.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	42,180	83.360	3,516,124.800	
NETAPP INC	33,354	36.640	1,222,090.560	
SEARS HOLDINGS CORP	4,095	38.350	157,043.250	
NEWELL RUBBERMAID INC	29,362	31.860	935,473.320	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	110.150	405,021.550	
NEWMONT MINING CORP	49,529	25.440	1,260,017.760	
NIKE INC-CL B	67,607	77.500	5,239,542.500	
NOBLE ENERGY INC	35,626	74.910	2,668,743.660	
NORDSTROM INC	13,411	69.180	927,772.980	
NORFOLK SOUTHERN CORP	30,111	102.410	3,083,667.510	
NORTHEAST UTILITIES	34,447	46.040	1,585,939.880	
NISOURCE INC	33,928	38.930	1,320,817.040	
COACH INC	21,436	34.100	730,967.600	
TOWERS WATSON & COMPANY	6,639	103.580	687,667.620	
NORTHERN TRUST CORP	22,009	63.830	1,404,834.470	
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,613	119.920	2,232,070.960	
WELLS FARGO & CO	481,097	51.810	24,925,635.570	
NUCOR CORP	31,445	49.680	1,562,187.600	
MONSANTO CO	50,244	122.560	6,157,904.640	
CHENIERE ENERGY INC	19,714	70.620	1,392,202.680	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	56,581	83.690	4,735,263.890	
OCWEN FINANCIAL CORP	12,196	35.940	438,324.240	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	75,942	100.410	7,625,336.220	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	73.640	668,724.840	
OGE ENERGY CORP	22,050	37.670	830,623.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	11,245	153.590	1,727,119.550	
OMNICARE INC	12,226	65.680	803,003.680	
ORACLE CORP	345,398	40.320	13,926,447.360	
OWENS-ILLINOIS INC	19,173	34.030	652,457.190	
PACCAR INC	34,453	64.965	2,238,239.140	
PALL CORP	10,048	82.270	826,648.960	
EXELON CORP	85,567	34.360	2,940,082.120	
PARKER HANNIFIN CORP	15,329	122.780	1,882,094.620	
PARTNERRE LTD	3,890	110.760	430,856.400	
PATTERSON COS INC	4,032	39.110	157,691.520	
PAYCHEX INC	32,595	41.915	1,366,219.420	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,943	44.470	620,045.210	
PPL CORPORATION	64,994	34.240	2,225,394.560	
PEPSICO INC	146,082	90.100	13,161,988.200	

PENTAIR PLC	15,841	70.480	1,116,473.680	
PFIZER INC	611,961	30.000	18,358,830.000	
CONOCOPHILLIPS	115,025	85.670	9,854,191.750	
PVH CORP	7,894	114.900	907,020.600	
PETSMART INC	8,567	70.350	602,688.450	
PG&E CORP	44,930	47.200	2,120,696.000	
PHARMACYCLICS INC	5,559	97.160	540,112.440	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,786	224.140	3,089,994.040	
ALTRIA GROUP INC	191,515	42.950	8,225,569.250	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51,309	87.450	4,486,972.050	
POLARIS INDUSTRIES INC	6,387	130.230	831,779.010	
GARMIN LTD	13,083	57.390	750,833.370	
AETNA INC	36,794	81.250	2,989,512.500	
FLUOR CORP (NEW)	16,823	77.580	1,305,128.340	
PPG INDUSTRIES INC	13,290	207.390	2,756,213.100	
PRAXAIR INC	28,203	131.870	3,719,129.610	
PRECISION CASTPARTS CORP	13,870	253.950	3,522,286.500	
COSTCO WHOLESALE CORP	41,967	118.080	4,955,463.360	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,241	81.590	1,896,233.190	
QUEST DIAGNOSTICS	14,594	59.040	861,629.760	
PROCTER & GAMBLE CO	260,260	81.610	21,239,818.600	
PROGRESSIVE CORP	54,081	24.520	1,326,066.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,038	38.980	1,638,641.240	
PULTE GROUP INC	36,651	19.850	727,522.350	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	37,710	16.040	604,868.400	
QUALCOMM INC	161,889	80.430	13,020,732.270	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	49.310	511,541.940	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,570	107.120	596,658.400	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,865	314.490	2,473,463.850	
AUTONATION INC	3,445	60.680	209,042.600	
RESMED INC	15,512	49.590	769,240.080	
US BANCORP	176,262	43.100	7,596,892.200	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,613	56.970	832,502.610	
ROSS STORES INC	21,400	66.600	1,425,240.000	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	6,832	99.610	680,535.520	
ROPER INDUSTRIES INC	9,399	143.980	1,353,268.020	
PEABODY ENERGY CORP	28,578	15.930	455,247.540	

ROCKWELL AUTOMATION INC	13,242	122.930	1,627,839.060	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,326	54.660	892,379.160	
RAYTHEON COMPANY	28,622	92.100	2,636,086.200	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,463	77.560	889,070.280	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	273.990	1,254,874.200	
FMC TECHNOLOGIES INC	22,653	59.470	1,347,173.910	
ACCENTURE PLC-CL A	59,410	79.770	4,739,135.700	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	163,015	37.990	6,192,939.850	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	13,685	42.820	585,991.700	
SANDISK CORP	22,281	103.770	2,312,099.370	
SAFEWAY INC	23,620	34.500	814,890.000	
ROCKWELL COLLINS INC	11,510	78.550	904,110.500	
ST JUDE MEDICAL INC	27,283	69.010	1,882,799.830	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	33,653	94.300	3,173,477.900	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,320	55.100	1,615,532.000	
PRICELINE GROUP INC	5,032	1,216.130	6,119,566.160	
SCHLUMBERGER LTD	124,752	115.400	14,396,380.800	
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,670	26.900	3,165,323.000	
JOY GLOBAL INC	10,888	60.210	655,566.480	
ZIMMER HOLDINGS INC	16,197	103.670	1,679,142.990	
SPX CORP	3,361	107.450	361,139.450	
BUNGE LTD	13,535	74.440	1,007,545.400	
SEI INVESTMENTS CO	4,761	32.450	154,494.450	
WELLPOINT INC	28,358	110.760	3,140,932.080	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,772	72.920	1,660,534.240	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	28,696	51.220	1,469,809.120	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8,538	202.280	1,727,066.640	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	36.180	601,203.060	
SIGMA-ALDRICH	11,301	101.740	1,149,763.740	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	44,302	88.790	3,933,574.580	
ADVANCE AUTO PARTS	7,525	133.160	1,002,029.000	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	34,348	43.760	1,503,068.480	
EDISON INTERNATIONAL	30,264	56.990	1,724,745.360	
SOUTHERN CO	87,757	44.640	3,917,472.480	
BB&T CORP	70,509	39.600	2,792,156.400	

SOUTHWEST AIRLINES	17,528	27.270	477,988.560	
AT&T INC	500,342	35.700	17,862,209.400	
CHEVRON CORP	182,973	130.250	23,832,233.250	
MEADWESTVACO CORP	16,496	43.530	718,070.880	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,726	86.090	1,267,761.340	
STAPLES INC	69,553	10.930	760,214.290	
STATE STREET CORP	42,900	67.700	2,904,330.000	
STARBUCKS CORP	72,313	78.850	5,701,880.050	
STRYKER CORP	29,747	83.680	2,489,228.960	
NETFLIX INC	5,395	438.550	2,365,977.250	
STERICYCLE INC	7,859	118.700	932,863.300	
SUNTRUST BANKS INC	54,576	39.650	2,163,938.400	
SYMANTEC CORP	69,832	22.830	1,594,264.560	
SYNOPSYS INC	14,312	38.780	555,019.360	
SYSCO CORP	59,058	36.950	2,182,193.100	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,314	382.920	1,268,996.880	
TESORO CORP	13,140	58.930	774,340.200	
TEXAS INSTRUMENTS INC	102,944	48.995	5,043,741.280	
TEXTRON INC	25,116	37.340	937,831.440	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,264	117.150	4,365,477.600	
TIFFANY & CO	12,040	101.500	1,222,060.000	
TOLL BROTHERS INC	17,142	36.030	617,626.260	
TORCHMARK CORP	13,665	54.780	748,568.700	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	31.690	432,156.530	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	17,040	73.040	1,244,601.600	
TRACTOR SUPPLY CO	11,181	59.920	669,965.520	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	32.590	762,214.920	
TYSON FOODS INC	19,830	39.130	775,947.900	
MARATHON OIL CORP	65,945	39.390	2,597,573.550	
UNION PACIFIC CORP	88,682	99.610	8,833,614.020	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	83,248	113.510	9,449,480.480	
UNITEDHEALTH GROUP INC	94,969	82.080	7,795,055.520	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,035	92.450	835,285.750	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,927	85.260	931,636.020	
VF CORP	33,991	62.830	2,135,654.530	
CBS CORP	55,261	61.800	3,415,129.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,598	97.820	2,112,716.360	
VULCAN MATERIALS CO	13,619	64.500	878,425.500	

URBAN OUTFITTERS INC	13,462	33.780	454,746.360	
WALGREEN CO	87,967	71.530	6,292,279.510	
WAL-MART STORES INC	157,453	77.060	12,133,328.180	
WASTE MANAGEMENT INC	42,453	44.180	1,875,573.540	
WATERS CORP	8,002	102.190	817,724.380	
ACTAVIS PLC	24,245	216.520	5,249,527.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,083	106.210	1,070,915.430	
WESTERN DIGITAL CORP	22,023	95.410	2,101,214.430	
WHIRLPOOL CORP	7,676	139.210	1,068,575.960	
WYNN RESORTS LTD	7,511	203.190	1,526,160.090	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	37.640	1,093,630.200	
NASDAQ OMX GROUP	10,282	38.600	396,885.200	
CME GROUP INC	32,609	70.130	2,286,869.170	
WILLIAMS COS INC	68,666	57.820	3,970,268.120	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	45.900	400,064.400	
LKQ CORP	28,289	26.570	751,638.730	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	27.700	504,001.500	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	59.550	631,765.950	
WISCONSIN ENERGY CORP	20,446	45.610	932,542.060	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	69.740	545,645.760	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	30.990	770,101.500	
CARMAX INC	21,581	52.430	1,131,491.830	
XEROX CORP	117,305	12.400	1,454,582.000	
XILINX INC	22,098	48.320	1,067,775.360	
YAHOO! INC	90,464	34.920	3,159,002.880	
CIMAREX ENERGY CO	8,341	142.610	1,189,510.010	
TJX COMPANIES INC	66,121	53.780	3,555,987.380	
HOSPIRA INC	15,624	51.060	797,761.440	
GENWORTH FINANCIAL INC	36,757	17.060	627,074.420	
CBRE GROUP INC	28,979	32.630	945,584.770	
LIBERTY GLOBAL PLC	16,870	43.690	737,050.300	
REGIONS FINANCIAL CORP	138,567	10.550	1,461,881.850	
GOOGLE INC-CL A	26,937	580.040	15,624,537.480	
T-MOBILE US INC	19,411	32.880	638,233.680	
LAS VEGAS SANDS CORP	41,129	74.930	3,081,795.970	
MOSAIC CO/THE	29,078	47.340	1,376,552.520	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	42,294	34.620	1,464,218.280	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	139,589	35.710	4,984,723.190	
HERBALIFE LTD	7,528	64.990	489,244.720	
CELANESE CORP	14,767	64.120	946,860.040	

WINDSTREAM HOLDINGS INC	69,587	10.050	699,349.350	
IHS INC-CLASS A	5,758	133.860	770,765.880	
DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	13,414	77.940	1,045,487.160	
EXPEDIA INC	10,399	79.325	824,900.670	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,592	240.460	1,344,652.320	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,034	120.270	2,289,219.180	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	55,275	42.200	2,332,605.000	
GAMESTOP CORP. - CL. A	11,417	41.780	477,002.260	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,889	183.450	2,181,037.050	
UNDER ARMOUR INC- CLASS A	15,436	58.190	898,220.840	
VIACOM INC-CLASS B	37,334	86.295	3,221,737.530	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,976	600.610	1,787,415.360	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	10,239	45.170	462,495.630	
TRANSDIGM GROUP INC	4,774	165.610	790,622.140	
MASTERCARD INC	99,765	75.470	7,529,264.550	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	46,990	28.590	1,343,444.100	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	12,025	76.700	922,317.500	
WESTERN UNION CO	57,195	17.300	989,473.500	
KBR INC	15,988	23.050	368,523.400	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	45,731	28.540	1,305,162.740	
SPECTRA ENERGY CORP	67,253	42.660	2,869,012.980	
TIME WARNER CABLE INC	26,871	148.550	3,991,687.050	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	35,585	15.060	535,910.100	
DELTA AIR LINES INC	22,701	37.450	850,152.450	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,582	154.910	399,977.620	
DISCOVER FINANCIAL	46,251	62.660	2,898,087.660	
COVIDIEN PLC	43,256	91.000	3,936,296.000	
TE CONNECTIVITY LTD	40,997	63.330	2,596,340.010	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	147.760	1,488,977.520	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	39.980	307,046.400	
VMWARE INC	8,753	95.450	835,473.850	
TERADATA CORP	16,676	40.810	680,547.560	

ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	6,664	92.690	617,686.160	
INVESCO LTD	43,479	37.740	1,640,897.460	
NETSUITE INC	3,281	80.640	264,579.840	
CALPINE CORP NPR	35,908	23.600	847,428.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	152,088	84.900	12,912,271.200	
VISA INC	48,300	215.540	10,410,582.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	19,252	58.930	1,134,520.360	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	48.600	791,645.400	
LORILLARD INC	34,911	63.090	2,202,534.990	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	80.760	586,236.840	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,733	77.080	750,219.640	
MARATHON PETROLEUM CORP	29,479	77.410	2,281,969.390	
CAREFUSION CORP	20,958	44.640	935,565.120	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	67,126	35.680	2,395,055.680	
XYLEM INC	11,028	37.240	410,682.720	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	46,102	98.490	4,540,585.980	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	23,766	73.150	1,738,482.900	
LINKEDIN CORP	10,629	156.310	1,661,418.990	
HCA HOLDINGS INC	26,194	55.700	1,459,005.800	
NIelsen NV	26,310	48.460	1,274,982.600	
VERISK ANALYTICS INC	16,556	61.020	1,010,247.120	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	128.840	922,752.080	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	20,925	93.120	1,948,536.000	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	54.230	427,983.160	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	30,557	17.110	522,830.270	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,012	162.880	979,234.560	
CIT GROUP INC	20,577	44.500	915,676.500	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	713,000	0.735	524,055.000	
DOLLAR GENERAL CORP	30,790	57.360	1,766,114.400	
AON PLC	27,630	89.960	2,485,594.800	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	38.530	441,707.920	
QEP RESOURCES INC	18,552	33.540	622,234.080	
TESLA MOTORS INC	8,566	219.460	1,879,894.360	

	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	47.920	737,632.560	
	GENERAL MOTORS CO	121,065	37.750	4,570,203.750	
	VANTIV INC	12,141	34.070	413,643.870	
	TRIPADVISOR INC	12,128	103.350	1,253,428.800	
	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	19,210	89.170	1,712,955.700	
	VOYA FINANCIAL INC	3,535	36.280	128,249.800	
	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	27,392	69.470	1,902,922.240	
	PHILLIPS 66	56,440	79.730	4,499,961.200	
	LIBERTY MEDIA CORP	9,165	138.040	1,265,136.600	
	FACEBOOK INC	180,348	64.880	11,700,978.240	
	QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	726	55.550	40,329.300	
	ADT CORP	19,783	33.340	659,565.220	
	SERVICENOW INC	10,829	57.500	622,667.500	
	WORKDAY INC	7,948	80.570	640,370.360	
	KRAFT FOODS GROUP INC	53,710	59.450	3,193,059.500	
	ABBVIE INC	153,820	55.790	8,581,617.800	
	ZOETIS INC	51,278	32.520	1,667,560.560	
	NEWS CORP/NEW-CL A	43,948	17.990	790,624.520	
	SPRINT CORP	84,196	8.250	694,617.000	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,766	42.820	632,280.120	
	FIREEYE INC	5,217	33.270	173,569.590	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,568	62.210	97,545.280	
	NOBLE CORP PLC	24,088	32.000	770,816.000	
	TWITTER INC	10,850	37.840	410,564.000	
	PERRIGO CO PLC	12,793	147.270	1,884,025.110	
	GOOGLE INC-CL C	27,558	571.100	15,738,373.800	
	NAVIENT CORP	42,295	17.780	752,005.100	
	SEVENTY SEVEN ENERGY INC	3,186	25.050	79,809.300	
	VERITIV CORP	668	37.830	25,270.440	
	FNF GROUP	21,690	27.590	598,427.100	
アメリカ・ドル	小計	30,500,023		1,728,091,469.490 (175,176,632,261)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	4.470	414,355.590	
	AMEC PLC	28,599	11.770	336,610.230	
	ANTOFAGASTA PLC	44,020	8.120	357,442.400	
	SEVERN TRENT PLC	23,162	19.150	443,552.300	
	BHP BILLITON PLC	201,404	19.515	3,930,399.060	
	BARCLAYS PLC	1,505,739	2.080	3,131,937.120	
	BT GROUP PLC	762,004	3.815	2,907,045.260	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	104,248	8.695	906,436.360	
	AGGREKO PLC	26,303	16.800	441,890.400	

TULLOW OIL PLC	92,627	7.900	731,753.300	
BUNZL PLC	34,501	16.120	556,156.120	
EASYJET PLC	13,628	12.720	173,348.160	
CAPITA PLC	64,410	11.150	718,171.500	
AVIVA PLC	295,997	4.832	1,430,257.500	
CRODA INTERNATIONAL	12,849	21.560	277,024.440	
DIAGEO PLC	238,252	18.515	4,411,235.780	
SCHRODERS PLC	12,609	24.890	313,838.010	
NATIONAL GRID PLC	359,503	8.470	3,044,990.410	
GKN PLC	178,098	3.503	623,877.290	
KINGFISHER PLC	234,699	3.390	795,629.610	
BAE SYSTEMS PLC	316,568	4.191	1,326,736.480	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	182,850	35.210	6,438,148.500	
COBHAM PLC	88,449	3.072	271,715.320	
NEXT PLC	15,179	64.550	979,804.450	
REXAM PLC	54,770	5.245	287,268.650	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	95,579	26.590	2,541,445.610	
IMI PLC	31,163	14.260	444,384.380	
JOHNSON MATTHEY PLC	21,473	30.090	646,122.570	
SABMILLER PLC	90,949	32.360	2,943,109.640	
ANGLO AMERICAN PLC	132,119	14.895	1,967,912.500	
COMPASS GROUP PLC	148,870	10.080	1,500,609.600	
HSBC HOLDINGS PLC	1,807,266	5.890	10,644,796.740	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	574,217	2.246	1,289,691.380	
ARM HOLDINGS PLC	141,802	8.510	1,206,735.020	
CENTRICA PLC	486,813	3.061	1,490,134.590	
UNILEVER PLC	122,727	25.980	3,188,447.460	
MEGGITT PLC	71,707	4.958	355,523.300	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	128,338	1.738	223,051.440	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	68,091	8.710	593,072.610	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	106,729	4.626	493,728.350	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,638	29.580	1,024,592.040	
PEARSON PLC	81,603	10.920	891,104.760	
PERSIMMON PLC	29,923	12.540	375,234.420	
PRUDENTIAL PLC	245,713	13.590	3,339,239.670	
RIO TINTO PLC	122,400	32.140	3,933,936.000	
VODAFONE GROUP PLC	2,552,130	1.889	4,820,973.570	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	62,012	49.640	3,078,275.680	
REED ELSEVIER PLC	111,858	9.170	1,025,737.860	
OLD MUTUAL PLC	484,073	1.956	946,846.780	

ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	186,284	10.390	1,935,490.760	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	234,054	3.149	737,036.040	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	15.740	313,147.300	
SSE PLC	83,923	15.470	1,298,288.810	
BP PLC	1,768,685	5.037	8,908,866.340	
SHIRE PLC	56,316	46.000	2,590,536.000	
SAGE GROUP PLC(THE)	98,062	3.730	365,771.260	
SMITHS GROUP PLC	36,935	12.400	457,994.000	
STANDARD CHARTERED PLC	238,329	11.975	2,853,989.770	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,288,943	0.731	3,866,217.330	
TATE & LYLE PLC	20,845	6.575	137,055.870	
BG GROUP PLC	326,496	11.990	3,914,687.040	
TESCO PLC	793,678	2.807	2,227,854.140	
3I GROUP PLC	119,685	3.853	461,146.300	
SMITH & NEPHEW PLC	93,652	10.170	952,440.840	
GLAXOSMITHKLINE PLC	465,656	15.720	7,320,112.320	
WEIR GROUP	18,336	26.500	485,904.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	17,421	18.960	330,302.160	
BABCOCK INT'L GROUP	47,919	11.000	527,109.000	
WPP PLC	130,749	12.200	1,595,137.800	
WOLSELEY PLC	24,909	31.770	791,358.930	
ASTRAZENECA PLC	122,359	43.450	5,316,498.550	
WHITBREAD PLC	19,002	41.950	797,133.900	
ASOS PLC	5,525	28.610	158,070.250	
CARNIVAL PLC	17,669	21.170	374,052.730	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	158,973	4.230	672,455.790	
INTERTEK GROUP PLC	18,332	26.990	494,780.680	
WILLIAM HILL PLC	99,059	3.314	328,281.520	
BURBERRY GROUP PLC	41,539	14.640	608,130.960	
INVESTEC PLC	50,655	5.240	265,432.200	
INTERCONTINENTAL HOTELS	23,341	24.200	564,852.200	
ICAP PLC	52,823	3.578	189,000.690	
ITV PLC	345,353	1.737	599,878.160	
SAINSBURY (J) PLC	132,439	3.149	417,050.410	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	52.350	454,031.550	
G4S PLC	171,953	2.539	436,588.660	
ADMIRAL GROUP PLC	22,361	15.200	339,887.200	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	376,859	23.675	8,922,136.820	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	231,591	25.075	5,807,144.320	

	INMARSAT PLC	46,334	7.425	344,029.950	
	PETROFAC LTD	28,374	11.660	330,840.840	
	STANDARD LIFE PLC	223,263	3.767	841,031.720	
	EXPERIAN PLC	98,499	10.030	987,944.970	
	SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	17,067	7.020	119,810.340	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	11.280	292,456.560	
	TUI TRAVEL PLC	48,609	3.730	181,311.570	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	90,508	2.595	234,868.260	
	FRESNILLO PLC NPR	10,457	9.450	98,818.650	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	122,660	3.202	392,757.320	
	GLENCORE PLC	1,015,708	3.427	3,480,831.310	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	107,350	2.748	294,997.800	
	COCA-COLA HBC AG	18,432	13.120	241,827.840	
	ROYAL MAIL PLC	64,647	4.743	306,620.720	
イギリス・ポンド 小計		26,622,471		161,178,330.660 (27,977,334,637)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	133,450	19.850	2,648,982.500	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	13.370	1,661,489.900	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	6.420	1,208,436.600	
	DELEK GROUP LTD	227	1,357.000	308,039.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	59,178	28.400	1,680,655.200	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	86,778	183.500	15,923,763.000	
イスラエル・シュケル 小計		592,133		23,431,366.200 (692,865,499)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	45.000	575,775.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	265,033	33.160	8,788,494.280	
	AMCOR LTD	123,722	10.060	1,244,643.320	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	300,428	33.750	10,139,445.000	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	12.170	410,153.340	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	4.350	649,046.100	
	TELSTRA CORP LTD	409,021	5.290	2,163,721.090	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	12.320	392,687.680	
	AMP LTD	285,088	5.330	1,519,519.040	
	ASX LTD	18,724	35.870	671,629.880	

BHP BILLITON LTD	304,860	37.410	11,404,812.600	
CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	22.100	312,692.900	
ALS LTD	34,895	8.990	313,706.050	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	47,699	3.100	147,866.900	
COMPUTERSHARE LT	50,472	12.480	629,890.560	
CSL LIMITED	44,222	67.460	2,983,216.120	
REA GROUP LTD	5,318	44.870	238,618.660	
TRANSURBAN GROUP	159,479	7.580	1,208,850.820	
COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	9.410	569,305.000	
COCHLEAR LTD	5,226	62.100	324,534.600	
ORIGIN ENERGY LTD	107,742	14.240	1,534,246.080	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	155,792	80.850	12,595,783.200	
BORAL LIMITED	84,744	5.380	455,922.720	
RIO TINTO LIMITED	42,941	62.410	2,679,947.810	
APA GROUP	86,227	7.080	610,487.160	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,859	5.850	1,309,575.150	
TPG TELECOM LTD	12,142	5.460	66,295.320	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,423	45.510	201,290.730	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	14.060	503,207.400	
ORICA LTD	34,301	20.420	700,426.420	
LEIGHTON HLDGS LTD	11,538	20.740	239,298.120	
SYDNEY AIRPORT	115,539	4.320	499,128.480	
MACQUARIE GROUP LTD	30,054	59.020	1,773,787.080	
WORLEYPARSONS LTD	23,411	18.540	434,039.940	
SUNCORP GROUP LTD	134,025	13.570	1,818,719.250	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	224,769	33.390	7,505,036.910	
NEWCREST MINING LTD	74,849	11.240	841,302.760	
INCITEC PIVOT LTD	165,148	2.950	487,186.600	
TOLL HOLDINGS LTD	72,011	5.260	378,777.860	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	127,737	1.205	153,923.080	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	121,525	11.270	1,369,586.750	
SANTOS LTD	100,411	14.070	1,412,782.770	
SONIC HEALTHCARE	45,868	17.620	808,194.160	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	3.360	237,807.360	
WESFARMERS LTD	107,640	42.620	4,587,616.800	
ALUMINA LIMITED	291,417	1.380	402,155.460	
ILUKA RESOURCES LIMI	45,912	8.440	387,497.280	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	64,556	41.380	2,671,327.280	
WOOLWORTHS LTD	118,091	35.830	4,231,200.530	
METCASH LTD	79,084	2.660	210,363.440	

	SEEK LTD	29,830	16.290	485,930.700	
	TATTS GROUP LTD	141,350	3.450	487,657.500	
	SP AUSNET	234,780	1.350	316,953.000	
	AGL ENERGY LTD	57,550	15.790	908,714.500	
	BRAMBLES LTD	152,289	9.100	1,385,829.900	
	ASCIANO LTD	108,957	5.740	625,413.180	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	15.430	507,045.230	
	AURIZON HOLDINGS LTD	210,167	5.020	1,055,038.340	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	5.090	287,086.180	
	オーストラリア・ドル 小計	6,192,921		101,855,191.370 (9,686,428,700)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,334	42.200	731,494.800	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	45,815	29.150	1,335,507.250	
	BARRICK GOLD CORP	111,117	19.760	2,195,671.920	
	ATCO LTD	7,193	51.280	368,857.040	
	TALISMAN ENERGY INC	100,146	10.760	1,077,570.960	
	BANK OF MONTREAL	62,421	79.780	4,979,947.380	
	BANK OF NOVA SCOTIA	117,052	72.030	8,431,255.560	
	NATIONAL BANK OF CANADA	34,258	46.300	1,586,145.400	
	BCE INC	26,643	48.390	1,289,254.770	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	55,291	46.970	2,597,018.270	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	29,239	128.350	3,752,825.650	
	BOMBARDIER INC 'B'	155,097	3.760	583,164.720	
	SAPUTO INC	12,795	65.040	832,186.800	
	BLACKBERRY LTD	50,923	12.150	618,714.450	
	CGI GROUP INC	22,652	37.720	854,433.440	
	CAE INC	31,436	13.920	437,589.120	
	CAMECO CORP	39,575	20.450	809,308.750	
	ROGERS COMM-CL B	35,628	42.060	1,498,513.680	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,520	97.810	3,767,641.200	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	107,303	48.560	5,210,633.680	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,877	102.400	704,204.800	
	CANADIAN UTILITIES LTD	15,036	39.430	592,869.480	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	79,382	69.630	5,527,368.660	
	AGRIUM INC	13,950	94.400	1,316,880.000	
	YAMANA GOLD INC	67,520	8.750	590,800.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	62.530	718,532.230	
	OPEN TEXT CORP	12,014	51.170	614,756.380	

ELDORADO GOLD CORP	78,309	8.060	631,170.540	
EMPIRE CO LTD	5,031	70.920	356,798.520	
KINROSS GOLD CORP	125,461	4.540	569,592.940	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	31.010	532,131.600	
FORTIS INC	20,884	32.610	681,027.240	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	60,600	26.080	1,580,448.000	
TELUS CORP	24,270	38.960	945,559.200	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	30.650	761,254.050	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	57.030	1,305,017.490	
ENBRIDGE INC	73,421	50.720	3,723,913.120	
IGM FINANCIAL INC	3,211	50.760	162,990.360	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	78,272	3.680	288,040.960	
MANULIFE FINANCIAL CORP	181,070	21.470	3,887,572.900	
LOBLAW CO LTD	17,936	47.650	854,650.400	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	33,447	21.000	702,387.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	47.270	455,210.100	
MAGNA INTERNATIONAL INC	21,548	116.920	2,519,392.160	
SUN LIFE FINANCIAL INC	61,535	39.960	2,458,938.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,940	507.900	985,326.000	
METRO INC	10,154	66.020	670,367.080	
HUSKY ENERGY INC	35,673	33.990	1,212,525.270	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	44.670	1,649,216.400	
METHANEX CORP	9,418	66.540	626,673.720	
ONEX CORP	10,676	65.410	698,317.160	
GOLDCORP INC	75,826	29.740	2,255,065.240	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	84,743	38.210	3,238,030.030	
POWER CORP OF CANADA	39,841	30.420	1,211,963.220	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	33.880	796,891.480	
ROYAL BANK OF CANADA	138,906	78.340	10,881,896.040	
SNC-LAVALIN GROUP INC	16,326	55.630	908,215.380	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	15,337	193.500	2,967,709.500	
SHAW COMM INC-B	30,249	27.950	845,459.550	
NEW GOLD INC	51,627	6.890	355,710.030	
SUNCOR ENERGY INC	141,423	44.980	6,361,206.540	
ENCANA CORP	71,646	23.800	1,705,174.800	

	TECK RESOURCES LTD-CL B	58,533	25.960	1,519,516.680	
	THOMSON REUTERS CORP	36,670	39.350	1,442,964.500	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	177,548	55.170	9,795,323.160	
	TRANSCANADA CORP	67,626	52.550	3,553,746.300	
	TRANSALTA CORP	34,014	12.790	435,039.060	
	WESTON (GEORGE) LTD	4,743	78.340	371,566.620	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,288	71.960	884,244.480	
	SILVER WHEATON CORP	41,308	28.220	1,165,711.760	
	CATAMARAN CORP	16,398	46.050	755,127.900	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,024	62.160	996,051.840	
	CI FINANCIAL CORP	16,122	34.690	559,272.180	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	54.760	864,058.040	
	KEYERA CORP	8,738	77.810	679,903.780	
	ALTAGAS LTD	12,358	48.740	602,328.920	
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,565	45.280	1,293,423.200	
	TIM HORTONS INC	14,007	59.400	832,015.800	
	DOLLARAMA INC	6,908	91.120	629,456.960	
	BAYTEX ENERGY CORP	11,962	47.600	569,391.200	
	MEG ENERGY CORP	14,673	38.110	559,188.030	
	ATHABASCA OIL CORP	42,987	7.010	301,338.870	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	72,925	33.790	2,464,135.750	
	ENERPLUS CORP	20,814	25.550	531,797.700	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	70.040	580,701.640	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	9.740	510,931.180	
	ARC RESOURCES LTD	30,599	30.710	939,695.290	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	23.280	1,099,444.560	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	38.500	429,968.000	
	PENGROWTH ENERGY CORP	36,505	7.270	265,391.350	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	32.410	963,127.970	
	カナダ・ドル 小計	3,907,393		148,403,851.730 (14,128,046,685)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.770	471,250.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES	139,000	5.420	753,380.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.190	708,110.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	473,640	0.545	258,133.800	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	147,000	16.970	2,494,590.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	10.200	377,400.000	
	SEMBICORP MARINE	108,000	4.030	435,240.000	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	46.010	598,130.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	6.920	602,040.000	
	CAPITALAND LTD	276,000	3.210	885,960.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	1.320	771,408.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	10.760	1,145,940.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	202,000	2.500	505,000.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	1.370	564,115.310	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	252,200	9.400	2,370,680.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	819,867	3.840	3,148,289.280	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	10.390	679,506.000	
	KEPPEL LAND LTD	95,000	3.460	328,700.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	125,000	23.200	2,900,000.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.190	638,000.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.070	247,170.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.680	763,800.000	
	シンガポール・ドル 小計	4,952,770		21,646,842.390 (1,766,598,808)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	149,787	25.120	3,762,649.440	
	SYNGENTA AG	9,019	327.900	2,957,330.100	
	NESTLE SA-REGISTERED	309,542	68.450	21,188,149.900	
	CIE FINANC RICHEMONT	50,896	90.300	4,595,908.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	67,415	262.200	17,676,213.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,842	134.000	648,828.000	
	SIKA INHABER	188	3,516.000	661,008.000	
	SGS SA-REG	576	2,115.000	1,218,240.000	
	SULZER AG-REG	3,187	120.100	382,758.700	
	NOVARTIS AG-REG SHS	220,606	79.650	17,571,267.900	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,702	109.800	626,079.600	
	SWISSCOM AG-REG	2,309	509.500	1,176,435.500	
	ABB LTD	209,315	20.300	4,249,094.500	
	ADECCO SA-REG	12,185	67.200	818,832.000	
	GEBERIT AG	3,708	304.900	1,130,569.200	
	LONZA GROUP AG-REG	5,846	94.600	553,031.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	4,511.000	410,501.000	

	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	54,955.000	714,415.000	
	UBS AG-REGISTERED	351,193	16.250	5,706,886.250	
	GIVAUDAN-REG	909	1,440.000	1,308,960.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,823	269.600	3,726,680.800	
	HOLCIM LTD-REG	22,704	78.500	1,782,264.000	
	ACTELION	9,776	109.800	1,073,404.800	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	135.000	610,065.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,445	115.200	742,464.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,690	524.500	1,410,905.000	
	THE SWATCH GROUP AG- REG	5,552	94.400	524,108.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,824	134.300	244,963.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	213.000	756,789.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,280	354.500	453,760.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,477	74.150	406,119.550	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	243.400	489,234.000	
	ARYZTA AG	8,596	84.500	726,362.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,855	36.050	859,972.750	
	SWISS RE LTD	31,693	76.850	2,435,607.050	
	TRANSOCEAN LTD	36,667	38.410	1,408,379.470	
スイス・フラン	小計	1,587,793		105,008,237.910 (11,918,435,002)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	62,055	195.000	12,100,725.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,459	177.800	7,549,210.200	
	ELEKTA AB	18,233	85.300	1,555,274.900	
	ERICSSON LM-B SHS	288,977	78.500	22,684,694.500	
	GETINGE AB-B SHS	14,684	173.600	2,549,142.400	
	SKF AB-B SHS	40,686	168.600	6,859,659.600	
	SANDVIK AB	106,160	89.700	9,522,552.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	148,106	88.100	13,048,138.600	
	SKANSKA AB-B SHS	39,626	147.100	5,828,984.600	
	SWEDBANK AB	88,783	171.200	15,199,649.600	
	SVENSKA CELLULOZA AB- B SHS	52,925	172.000	9,103,100.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	48,233	315.900	15,236,804.700	
	VOLVO AB-B SHS	144,477	92.050	13,299,107.850	
	SWEDISH MATCH AB	21,596	229.900	4,964,920.400	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	80.100	1,946,830.500	
	NORDEA AB	292,476	92.950	27,185,644.200	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	127.500	2,340,007.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	25,721	164.700	4,236,248.700	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	81.200	2,213,593.200	

	INVESTOR AB-B SHS	44,529	247.000	10,998,663.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	90,383	281.300	25,424,737.900	
	ASSA ABLOY AB-B	32,006	345.300	11,051,671.800	
	TELIASONERA AB	194,938	50.100	9,766,393.800	
	LUNDIN PETROLEUM AB	28,131	129.000	3,628,899.000	
	BOLIDEN AB	17,761	105.000	1,864,905.000	
	ALFA LAVAL AB	31,389	167.600	5,260,796.400	
	KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	276.800	6,426,742.400	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,723	610.000	4,711,030.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	54,633	51.950	2,838,184.350	
	HEXAGON AB	21,871	213.600	4,671,645.600	
スウェーデン・クローナ 小計		2,051,698		264,067,957.700 (3,947,815,967)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,483	576.000	6,038,208.000	
	A P MOLLER A/S	620	13,360.000	8,283,200.000	
	AP MOLLER MAERSK A	310	12,690.000	3,933,900.000	
	DANSKE BANK A/S	65,562	150.700	9,880,193.400	
	NOVOZYMES-B SHS	24,240	270.700	6,561,768.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	191,031	247.800	47,337,481.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	22,090	248.500	5,489,365.000	
	TDC A/S	84,208	54.600	4,597,756.800	
	COLOPLAST-B	12,458	475.300	5,921,287.400	
	DSV A/S	15,918	172.900	2,752,222.200	
	WILLIAM DEMANT	2,595	487.700	1,265,581.500	
PANDORA A/S	11,367	413.800	4,703,664.600		
デンマーク・クローネ 小計		440,882		106,764,628.700 (1,974,077,985)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	106,690	3.845	410,223.050	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	8.900	658,528.800	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	209,231	2.690	562,831.390	
	XERO LTD	4,888	25.650	125,377.200	
ニュージーランド・ドル 小計		394,801		1,756,960.440 (156,966,845)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	98,819	109.500	10,820,680.500	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	34.350	3,677,579.700	
	TELENOR ASA	65,096	139.100	9,054,853.600	
	SUBSEA 7 SA	22,609	109.000	2,464,381.000	
	ORKLA ASA	43,472	53.800	2,338,793.600	
	STATOIL ASA	112,577	184.800	20,804,229.600	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,198	295.000	5,368,410.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	95.000	1,798,920.000	

	SEADRILL LTD	38,772	235.600	9,134,683.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21,678	113.700	2,464,788.600	
	ノルウェー・クローネ 小計	547,219		67,927,319.800 (1,115,366,591)	
ユーロ	CRH PLC	73,961	18.785	1,389,357.380	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	55.340	786,658.100	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.244	591,173.440	
	UMICORE	13,643	34.100	465,226.300	
	AIR LIQUIDE	31,622	98.450	3,113,185.900	
	AIRBUS GROUP NV	58,013	46.815	2,715,878.590	
	AXA	177,702	17.505	3,110,673.510	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,954	12.865	501,143.210	
	ADIDAS AG	20,732	71.810	1,488,764.920	
	ASSICURAZIONI GENERALI	112,448	15.280	1,718,205.440	
	BANCO ESPIRITO SANTO- REG	219,975	0.509	111,967.270	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	42,816	16.115	689,979.840	
	DANONE	54,689	53.900	2,947,737.100	
	SAFRAN SA	28,086	46.000	1,291,956.000	
	INTESA SANPAOLO	1,112,314	2.178	2,422,619.890	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,318	91.420	2,954,511.560	
	ACCOR SA	17,313	36.615	633,915.490	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	9,683	39.395	381,461.780	
	BOUYGUES	18,587	28.480	529,357.760	
	BNP PARIBAS	99,978	47.690	4,767,950.820	
	REED ELSEVIER NV	68,686	16.270	1,117,521.220	
	THALES SA	8,128	44.055	358,079.040	
	CAP GEMINI SA	15,406	51.810	798,184.860	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	93.090	611,322.030	
	CHRISTIAN DIOR	5,133	143.000	734,019.000	
	ALCATEL-LUCENT	298,978	2.618	782,724.400	
	UNICREDIT SPA	419,292	5.800	2,431,893.600	
	NATIXIS	102,266	4.700	480,650.200	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,919	50.540	804,546.260	
	DELHAIZE GROUP	10,182	48.905	497,950.710	
	COMMERZBANK AG	96,311	10.825	1,042,566.570	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,555	110.900	1,503,249.500	
	UNITED INTERNET	12,924	29.960	387,203.040	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	8,822	31.250	275,687.500	
	PUBLICIS GROUPE	17,067	59.300	1,012,073.100	
	MAN SE	3,396	89.390	303,568.440	

IBERDROLA SA	474,406	5.314	2,520,993.480	
ENI SPA	243,757	19.310	4,706,947.670	
JERONIMO MARTINS	33,291	11.255	374,690.200	
KBC GROUPE	24,972	38.925	972,035.100	
LAFARGE SA	19,853	63.510	1,260,864.030	
HANNOVER RUECK SE	2,391	64.740	154,793.340	
WARTSILA OYJ	13,904	35.100	488,030.400	
L'OREAL	22,593	125.300	2,830,902.900	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	25,369	139.350	3,535,170.150	
LAGARDERE S.C.A.	13,927	23.150	322,410.050	
GEA GROUP AG	20,171	33.925	684,301.170	
BOLLORE	197	446.000	87,862.000	
MEDIOBANCA SPA	55,752	6.975	388,870.200	
MICHELIN(CGDE)-B	18,608	85.000	1,581,680.000	
CONTINENTAL AG	11,210	164.400	1,842,924.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	90,507	25.805	2,335,533.130	
TELEKOM AUSTRIA AG	21,149	7.149	151,194.200	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	28.080	263,923.920	
AXEL SPRINGER SE	6,021	43.380	261,190.980	
OMV AG	15,010	31.640	474,916.400	
PERNOD-RICARD	20,007	85.810	1,716,800.670	
PEUGEOT SA	38,593	10.750	414,874.750	
PIRELLI & C	30,073	11.600	348,846.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	14,295	74.880	1,070,409.600	
RENAULT SA	18,577	68.230	1,267,508.710	
REPSOL SA	89,426	18.505	1,654,828.130	
REMY COINTREAU	3,877	63.070	244,522.390	
MERCK KGAA	11,228	63.670	714,886.760	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	79,049	83.350	6,588,734.150	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	44,154	38.305	1,691,318.970	
SAIPEM	28,190	18.730	527,998.700	
RWE AG	48,073	30.785	1,479,927.300	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	16,499	41.000	676,459.000	
SOCIETE GENERALE-A	69,557	36.695	2,552,394.110	
VINCI S.A.	47,191	51.530	2,431,752.230	
SODEXO	9,625	76.730	738,526.250	
SOLVAY SA	5,034	123.500	621,699.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	50,023	65.610	3,282,009.030	
VIVENDI SA	116,945	17.395	2,034,258.270	
SAP AG	88,612	56.970	5,048,225.640	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	75.710	726,286.030	
TELEFONICA S.A	395,663	12.190	4,823,131.970	
TOTAL SA	205,591	50.590	10,400,848.690	

VALLOUREC	11,847	32.885	389,588.590	
VALEO	8,400	94.770	796,068.000	
E.ON SE	185,310	14.430	2,674,023.300	
VOEST-ALPINE AG	9,875	33.870	334,466.250	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	23.545	359,814.690	
HENKEL AG & CO KGAA	12,518	74.000	926,332.000	
METRO AG	11,655	31.050	361,887.750	
SIEMENS AG-REG	76,287	92.650	7,067,990.550	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	12.210	565,420.680	
ING GROEP NV-CVA	359,466	10.050	3,612,633.300	
BAYER AG	80,199	100.800	8,084,059.200	
STORA ENSO OYJ-R SHS	67,549	6.885	465,074.860	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,679	85.510	1,426,221.290	
DAIMLER AG	92,809	67.050	6,222,843.450	
BASF SE	88,454	83.420	7,378,832.680	
BEIERSDORF AG	10,562	69.050	729,306.100	
HOCHTIEF AG	1,935	60.520	117,106.200	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,234	61.490	813,758.660	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	21,622	49.715	1,074,937.730	
ORANGE	183,592	11.245	2,064,492.040	
SAMPO OYJ-A SHS	43,001	37.110	1,595,767.110	
RANDSTAD HOLDINGS	13,985	36.885	515,836.720	
ALLIANZ SE	44,122	127.450	5,623,348.900	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.228	616,851.430	
KONINKLIJKE AHOLD NV	80,187	13.405	1,074,906.730	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	21,897	31.095	680,887.210	
DEUTSCHE LUFTHANSA- REG	27,299	14.645	399,793.850	
ERSTE GROUP BANK AG	30,671	17.990	551,771.290	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17,587	159.750	2,809,523.250	
ARCELOR MITTAL (NL)	102,748	10.685	1,097,862.380	
SOCIETE BIC SA	3,322	100.300	333,196.600	
DASSAULT SYSTEMES SA	5,537	94.550	523,523.350	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,369	30.990	631,235.310	
HEINEKEN NV	21,379	53.210	1,137,576.590	
AKZO NOBEL	24,058	52.440	1,261,601.520	
ASML HOLDING NV	35,450	68.140	2,415,563.000	
AEGON NV	167,051	6.377	1,065,284.220	
VOLKSWAGEN AG	1,653	183.550	303,408.150	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,869	184.400	2,926,243.600	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	572,134	9.075	5,192,116.050	
KERING	7,231	156.300	1,130,205.300	

CNP ASSURANCES	22,463	15.150	340,314.450	
FORTUM OYJ	43,978	19.150	842,178.700	
AGEAS	19,877	29.115	578,718.850	
UCB SA	10,367	63.500	658,304.500	
THYSSENKRUPP AG	44,483	21.725	966,393.170	
UNILEVER NV-CVA	154,785	31.155	4,822,326.670	
CARREFOUR SA	61,756	26.780	1,653,825.680	
GAS NATURAL SDG SA	34,711	21.900	760,170.900	
ATOS	6,025	58.810	354,330.250	
NOKIA OYJ	370,975	5.515	2,045,927.120	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	93,569	23.145	2,165,654.500	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,008	20.945	712,297.560	
SANOFI	114,429	75.700	8,662,275.300	
IMMOFINANZ AG	131,110	2.590	339,574.900	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	6.424	379,080.240	
ELISA OYJ	13,898	22.520	312,982.960	
BANCO SANTANDER SA	1,141,463	7.430	8,481,070.090	
METSO OYJ	10,879	26.280	285,900.120	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	6,801	61.400	417,581.400	
QIAGEN N.V.	27,019	17.840	482,018.960	
LINDE AG	16,910	151.050	2,554,255.500	
FIAT SPA	92,315	7.380	681,284.700	
DEUTSCHE BANK AG-REG	132,865	25.505	3,388,721.820	
BMW VORZUG	4,116	70.440	289,931.040	
K & S	18,588	23.175	430,776.900	
ENEL SPA	640,791	4.136	2,650,311.570	
COLRUYT NV	7,116	37.470	266,636.520	
VOPAK (KON.)	8,976	33.250	298,452.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG- REG	281,902	12.070	3,402,557.140	
BANCO POPULAR ESPANOL	154,985	4.614	715,100.790	
FINMECCANICA SPA	55,583	7.065	392,693.890	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	103,908	8.870	921,663.960	
KONINKLIJKE KPN NV	316,177	2.380	752,501.260	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.280	209,741.760	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,044	53.610	1,074,558.840	
EURAZEO	2,565	56.950	146,076.750	
BANCO SABADELL	347,311	2.316	804,372.270	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,333	75.250	401,308.250	
GROUPE BRUX LAMBERT- STR VVPR	516	0.001	0.510	
FRAPORT AG	3,149	49.320	155,308.680	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	48.095	385,433.330	
INDITEX	21,769	111.050	2,417,447.450	

BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	269,372	1.338	360,419.730	
ANDRITZ AG	4,704	41.205	193,828.320	
MAPFRE SA	80,219	2.780	223,008.820	
ESSILOR INTL	18,032	74.580	1,344,826.560	
SNAM SPA	225,511	4.350	980,972.850	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	10.000	855,850.000	
ENAGAS	8,433	23.675	199,651.270	
WENDEL	4,087	99.110	405,062.570	
TENARIS SA	46,257	17.070	789,606.990	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	6.075	455,345.550	
TELECOM ITALIA SPA	1,035,863	0.876	907,415.980	
TELECOM ITALIA-RNC	615,367	0.690	424,603.230	
ATLANTIA SPA	33,870	19.550	662,158.500	
ILIAD SA	2,821	209.800	591,845.800	
BELGACOM SA	13,498	23.730	320,307.540	
SES FDR	28,786	27.485	791,183.210	
TERNA SPA	179,290	3.844	689,190.760	
GRIFOLS SA	17,550	38.370	673,393.500	
FERROVIAL SA	45,760	15.240	697,382.400	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	48.215	330,562.040	
SKY DEUTSCHLAND AG	45,911	6.289	288,734.270	
EXOR SPA	9,585	28.900	277,006.500	
NESTE OIL OYJ	10,692	13.500	144,342.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	22.405	203,863.090	
FUGRO CERT	7,283	32.825	239,064.470	
KONE OYJ	31,230	30.510	952,827.300	
GDF SUEZ	131,451	19.500	2,563,294.500	
ALSTOM	22,916	25.715	589,284.940	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	39.105	196,502.620	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	24.890	434,330.500	
ELECTRICITE DE FRANCE	23,911	22.585	540,029.930	
DEUTSCHE WOHNEN AG	27,130	15.935	432,316.550	
ARKEMA SA	5,658	70.050	396,342.900	
LEGRAND SA	27,260	43.170	1,176,814.200	
ADP	2,540	96.500	245,110.000	
ORION OYJ	8,051	26.440	212,868.440	
RTL GROUP SA	1,270	77.780	98,780.600	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	12.735	433,219.230	
SCOR SE	14,425	24.390	351,825.750	
REXEL SA	20,799	15.900	330,704.100	
PRYSMIAN SPA	14,445	15.650	226,064.250	
BANCO POPOLARE SC	34,687	11.170	387,453.790	

	CAIXABANK	160,150	4.245	679,836.750	
	BUREAU VERITAS SA	23,255	19.990	464,867.450	
	GROUPE EUROTUNNEL SA	46,533	9.746	453,510.610	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	13.290	301,324.170	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	AMADEUS IT HOLDING SA	37,149	29.880	1,110,012.120	
	TNT EXPRESS NV W/I	26,687	6.439	171,837.590	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,019	103.600	209,168.400	
	ENEL GREEN POWER SPA	160,695	2.020	324,603.900	
	BRENTAG AG	5,161	129.600	668,865.600	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	119,317	4.180	498,745.060	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.590	386,220.130	
	DELTA LLOYD NV	19,898	18.165	361,447.170	
	EDENRED	18,682	22.100	412,872.200	
	BANKIA SA	431,169	1.417	610,966.470	
	ZIGGO NV	16,833	33.560	564,915.480	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	31,777	6.035	191,774.190	
	HUGO BOSS AG -ORD	2,985	106.050	316,559.250	
	OSRAM LICHT AG	9,503	35.300	335,455.900	
	GEMALTO	8,626	74.710	644,448.460	
	OCI NV	10,578	26.930	284,865.540	
	CNH INDUSTRIAL NV	103,669	6.885	713,761.060	
	ALTICE SA	5,487	46.490	255,090.630	
	REPSOL SA-RTS	89,388	0.500	44,694.000	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV-RTS	20,369	0.643	13,097.260	
	IBERDROLA SA-RTS	474,406	0.114	54,082.280	
	BANCO POPULAR ESPANOL SA-RTS	154,985	0.010	1,549.850	
	FERROVIAL SA-RTS	45,760	0.276	12,629.760	
ユーロ 小計		21,212,381		289,704,504.910 (39,932,868,957)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	30,900	84.350	2,606,415.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	23.800	5,188,400.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	32.100	3,584,286.000	
	CLP HOLDINGS LTD	204,000	63.000	12,852,000.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	10.060	5,355,944.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	137,000	142.000	19,454,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	53.000	2,597,000.000	

HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	108,200	152.800	16,532,960.000	
MTR CORP	133,500	29.400	3,924,900.000	
HANG SENG BANK LTD	85,500	127.100	10,867,050.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	122,870	45.350	5,572,154.500	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	130,500	67.550	8,815,275.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	142,750	56.000	7,994,000.000	
HONG KONG & CHINA GAS	621,214	16.800	10,436,395.200	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	208,000	105.300	21,902,400.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	224,000	62.200	13,932,800.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	381,500	23.350	8,908,025.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	86,000	26.400	2,270,400.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	574,266	9.040	5,191,364.640	
SINO LAND CO	355,400	12.520	4,449,608.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	164,000	106.300	17,433,200.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	73,500	96.300	7,078,050.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	24.350	2,203,675.000	
WHEELLOCK & CO LTD	107,000	33.100	3,541,700.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	19.400	3,802,400.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	29.650	5,028,640.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	27.550	1,157,100.000	
AIA GROUP LTD	1,191,800	39.150	46,658,970.000	
SANDS CHINA LTD	258,400	57.100	14,754,640.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	23.950	3,908,640.000	
GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING LTD	532,400	1.760	937,024.000	
香港・ドル 小計	7,445,060		278,939,416.340 (3,648,527,566)	
合計	106,447,545		292,121,965,503 (292,121,965,503)	

(2) 株式以外の有価証券

平成26年7月11日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	235,579.000	480,581.160	
		DEXUS PROPERTY GROUP	527,575.000	606,711.250	
		FEDERATION CENTRES	146,114.000	362,362.720	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	797,522.400	
		GPT GROUP	73,257.000	287,167.440	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	621,363.600	

		MIRVAC GROUP	399,690.000	713,446.650	
		SCENTRE GROUP	544,404.000	1,807,421.280	
		STOCKLAND	210,736.000	826,085.120	
		WESTFIELD CORP	196,302.000	1,450,671.780	
	オーストラリア・ドル	小計	2,535,677.000	7,953,333.400 (756,362,006)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.000	686,501.920	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	348,150.000	
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	573,386.000	
	シンガポール・ドル	小計	801,706.000	1,608,037.920 (131,231,975)	
投資信託受益証券 合計			3,337,383	887,593,981 (887,593,981)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	36,231.000	833,675.310	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	65,404.000	822,782.320	
		AMERICAN TOWER CORP	38,061.000	3,479,156.010	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	88,038.000	985,145.220	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,610.000	1,669,518.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,821.000	1,773,925.490	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	450,320.250	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,561.000	2,425,468.890	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,632.000	815,193.600	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	518,147.080	
		EQUITY RESIDENTIAL	35,320.000	2,253,416.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,238.000	1,169,375.480	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,764.000	955,049.640	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	1,122,681.600	
		HCP INC	44,698.000	1,856,754.920	
		HEALTH CARE REIT INC	27,413.000	1,724,003.570	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	69,904.000	1,579,830.400	
		KIMCO REALTY	32,980.000	764,146.600	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.000	609,862.500	
		PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	590,692.480	
		PROLOGIS INC	47,963.000	1,977,514.490	
		PUBLIC STORAGE	14,278.000	2,445,250.280	
		RAYONIER INC	10,834.000	380,165.060	
		REALTY INCOME CORP	16,761.000	756,591.540	
		REGENCY CENTERS CORP	10,144.000	564,310.720	

	SIMON PROPERTY GROUP INC	30,155.000	5,072,674.100	
	SL GREEN	10,737.000	1,178,385.750	
	THE MACERICH COMPANY	15,776.000	1,057,780.800	
	UDR INC	28,307.000	805,051.080	
	VENTAS INC	30,398.000	1,963,710.800	
	VORNADO REALTY TRUST	16,326.000	1,731,535.560	
	WEYERHAEUSER CO	53,522.000	1,743,211.540	
アメリカ・ドル 小計		921,237.000	46,075,327.080 (4,670,655,906)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	567,241.380	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	393,986.340	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	275,349.900	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,883.000	767,550.750	
	SEGRO PLC	87,111.000	302,797.830	
イギリス・ポンド 小計		401,538.000	2,306,926.200 (400,436,249)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	224,883.410	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	424,051.600	
カナダ・ドル 小計		25,495.000	648,935.010 (61,778,613)	
ユーロ	CORIO NV	7,710.000	280,451.250	
	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	205,286.400	
	GECINA SA	2,977.000	313,626.950	
	ICADE	3,001.000	228,676.200	
	KLEPIERRE	9,740.000	363,204.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,582.000	1,761,455.500	
ユーロ 小計		34,602.000	3,152,700.900 (434,568,292)	
香港・ドル	LINK REIT/THE	240,500.000	10,101,000.000	
香港・ドル 小計		240,500.000	10,101,000.000 (132,121,080)	
投資証券 合計		1,623,372	5,699,560,140 (5,699,560,140)	
合計			6,587,154,121 (6,587,154,121)	

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、内数で表示してあります。

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 586銘柄	57.22%	-%	-%	60.21%
	投資証券 32銘柄	-%	-%	1.53%	
イギリス・ポンド	株式 102銘柄	9.14%	-%	-%	9.50%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.23%	-%	-%	0.23%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	3.16%	-%	-%	3.50%
	投資信託 受益証券 10銘柄	-%	0.25%	-%	
カナダ・ドル	株式 91銘柄	4.61%	-%	-%	4.75%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 22銘柄	0.58%	-%	-%	0.64%
	投資信託 受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 36銘柄	3.89%	-%	-%	3.99%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.29%	-%	-%	1.32%
デンマーク・クローネ	株式 12銘柄	0.64%	-%	-%	0.66%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.05%	-%	-%	0.05%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.36%	-%	-%	0.37%
ユーロ	株式 233銘柄	13.04%	-%	-%	13.51%
	投資証券 6銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 31銘柄	1.19%	-%	-%	1.27%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.04%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		97,742,205	27,140,085
コール・ローン		39,224,638	61,440,840
投資信託受益証券		3,637,199,986	3,595,593,671
投資証券		23,258,633,556	24,159,330,317
派生商品評価勘定		36,897	62,575
未収配当金		139,256,249	141,956,888
流動資産合計		27,172,093,531	27,985,524,376
資産合計		27,172,093,531	27,985,524,376
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		20	-
未払金		12,861,521	-
未払解約金		28,596,000	63,293,000
流動負債合計		41,457,541	63,293,000
負債合計		41,457,541	63,293,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	33,767,135,662	30,616,773,967
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	6,636,499,672	2,694,542,591
元本等合計		27,130,635,990	27,922,231,376
純資産合計		27,130,635,990	27,922,231,376
負債純資産合計		27,172,093,531	27,985,524,376

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	34,966,105,154円	33,767,135,662円
	同期中追加設定元本額	892,519,020円	3,477,307,558円
	同期中一部解約元本額	2,091,488,512円	6,627,669,253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）	4,761,816円	5,279,693円
	D I A M D C 8資産 バランスファンド（新興 国20）	8,818,658円	13,415,911円
	D I A M D C 8資産 バランスファンド（新興 国30）	22,426,848円	37,205,215円
	投資のソムリエ	54,642,091円	274,351,753円
	投資のソムリエ< D C年 金>	628,414円	2,593,099円
	D I A M 8資産バラ ンスファンドN< D C年 金>	386,582円	5,349,089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）	601,140,054円	1,155,468,823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）	11,911,759,183円	9,493,830,800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）	20,347,077,372円	17,460,413,302円
	D I A Mグローバル・リ スクファクター・パリ ティ戦略ファンド（適格 機関投資家限定）	132,635,704円	1,163,737,871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）	- 円	439,563,468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）	682,858,940円	565,564,943円
	計	33,767,135,662円	30,616,773,967円
2 .	受益権の総数	33,767,135,662口	30,616,773,967口

3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,636,499,672円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,694,542,591円であります。
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	47,609,246	32,954,254
投資証券	240,727,022	95,302,829
合計	193,117,776	128,257,083

(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25年6月25日から平成26年1月14日まで及び平成26年6月24日から平成26年7月11日まで)に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年1月14日 現在				平成26年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	13,157,267	-	13,120,370	36,897	24,711,535	-	24,648,960	62,575
アメリカ・ドル	13,157,267	-	13,120,370	36,897	13,696,572	-	13,683,600	12,972
イギリス・ポンド	-	-	-	-	3,660,510	-	3,644,970	15,540
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	7,354,453	-	7,320,390	34,063
買 建	474,420	-	474,400	20	-	-	-	-
カナダ・ドル	474,420	-	474,400	20	-	-	-	-
合計	13,631,687	-	13,594,770	36,877	24,711,535	-	24,648,960	62,575

（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26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.8035円	0.9120円
（1万口当たり純資産額）	(8,035円)	(9,120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26年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	360 CAPITAL OFFICE FUND	17,000.000	33,745.000	
		ABACUS PROPERTY GROUP	98,506.000	247,250.060	
		ALE PROPERTY GROUP	54,896.000	164,139.040	
		ASPEN GROUP	45,418.000	61,314.300	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	23,734.000	98,733.440	
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	142,841.000	638,499.270	
		AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	26,000.000	52,520.000	
		BWP TRUST	145,065.000	365,563.800	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	750,386.000	1,530,787.440	
		CHARTER HALL GROUP	86,050.000	362,270.500	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	96,946.000	378,089.400	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	382,605.000	382,605.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	1,648,944.000	1,896,285.600	
		FEDERATION CENTRES	432,368.000	1,072,272.640	
		GDI PROPERTY GROUP	150,000.000	142,500.000	
		GOODMAN GROUP	471,520.000	2,423,612.800	
		GPT GROUP	514,517.000	2,016,906.640	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	54,400.000	134,368.000	
		INDUSTRIA REIT	30,000.000	60,600.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	213,500.000	109,952.500	
		INVESTA OFFICE FUND	185,373.000	645,098.040	
		MIRVAC GROUP	1,108,600.000	1,978,851.000	
		NATIONAL STORAGE REIT	67,000.000	96,145.000	
		SCENTRE GROUP	1,561,335.000	5,183,632.200	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	190,259.000	331,050.660	
	STOCKLAND	706,731.000	2,770,385.520		
WESTFIELD CORP	581,517.000	4,297,410.630			
	オーストラリア・ドル 小計		9,785,511.000	27,474,588.480 (2,612,833,364)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	152,195.000	223,726.650	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	222,000.000	167,610.000	

		ASCENDAS REAL ESTATE INVT	614,361.000	1,425,317.520	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	268,800.000	338,688.000	
		CACHE LOGISTICS TRUST	223,000.000	272,060.000	
		CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	356,405.000	272,649.820	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	691,806.000	1,141,479.900	
		CAPITAMALL TRUST	782,064.000	1,521,114.480	
		CAPITARETAIL CHINA TRUST	203,080.000	307,666.200	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	196,000.000	343,000.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	246,000.000	216,480.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	167,000.000	202,905.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	146,000.000	270,830.000	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	145,280.000	201,212.800	
		KEPPEL REIT	217,900.000	276,733.000	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	556,000.000	227,960.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	414,000.000	567,180.000	
		MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	553,000.000	492,170.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	371,120.000	528,846.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	441,920.000	512,627.200	
		QUE COMMERCIAL REIT	134,000.000	107,200.000	
		PARKWAY LIFE REIT	102,000.000	247,860.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	176,000.000	184,800.000	
		SAIZEN REIT	104,400.000	98,658.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	196,000.000	157,780.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	438,000.000	365,730.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	765,291.000	1,369,870.890	
		シンガポール・ドル 小計	8,883,622.000	12,042,155.460 (982,760,307)	
		投資信託受益証券 合計	18,669,133	3,595,593,671 (3,595,593,671)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	17,640.000	499,564.800	
		AGREE REALTY CORP	4,501.000	136,020.220	
		ALEXANDER'S INC.	674.000	253,464.440	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,743.000	1,693,127.410	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	11,040.000	386,068.800	

AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	31,801.000	1,243,737.110	
AMERICAN HOMES 4 RENT	14,979.000	272,767.590	
AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	276,075.000	3,473,023.500	
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	5,010.000	93,236.100	
AMREIT INC	5,200.000	116,740.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	44,314.000	1,464,577.700	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	7,000.000	66,290.000	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	6,714.000	118,099.260	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	24,137.000	288,919.890	
ASSOCIATED ESTATES RLTY CORP	17,268.000	317,040.480	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	37,255.000	5,357,269.000	
AVIV REIT INC	7,500.000	209,625.000	
BIOMED REALTY TRUST INC	58,365.000	1,275,858.900	
BOSTON PROPERTIES INC	46,796.000	5,601,013.240	
BRANDYWINE REALTY TRUST	47,479.000	737,348.870	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,865.000	505,956.100	
CAMDEN PROPERTY TRUST	25,972.000	1,860,893.800	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	21,271.000	184,419.570	
CARETRUST REIT INC	6,000.000	111,180.000	
CBL & ASSOCIATES	51,561.000	1,006,470.720	
CEDAR REALTY TRUST INC	21,069.000	136,316.430	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	71,525.000	576,491.500	
CHATHAM LODGING TRUST	8,321.000	182,396.320	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	15,065.000	459,331.850	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	38,591.000	982,140.950	
COMMONWEALTH REIT	36,713.000	985,376.920	
CORESITE REALTY CORP	6,882.000	231,028.740	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	26,487.000	747,992.880	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	35,271.000	1,179,462.240	
COUSINS PROPERTIES INC	55,763.000	700,383.280	
CUBESMART	40,661.000	752,228.500	
CYRUSONE INC	10,168.000	251,963.040	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	100,586.000	817,764.180	
DDR CORP	88,306.000	1,583,326.580	

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	59,176.000	763,962.160	
DIGITAL REALTY TRUST INC	41,109.000	2,458,318.200	
DOUGLAS EMMETT INC	40,198.000	1,157,702.400	
DUKE REALTY TRUST	100,010.000	1,802,180.200	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	19,663.000	526,968.400	
EAST GROUP	9,765.000	631,697.850	
EDUCATION REALTY TRUST INC	41,867.000	452,582.270	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	23,373.000	385,888.230	
EPR PROPERTIES	16,178.000	909,203.600	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,982.000	1,068,158.280	
EQUITY ONE INC	19,062.000	456,153.660	
EQUITY RESIDENTIAL	102,664.000	6,549,963.200	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,139.000	3,587,796.940	
EXCEL TRUST INC	17,615.000	230,756.500	
EXTRA SPACE STORAGE INC	33,431.000	1,772,511.620	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	20,433.000	2,513,463.330	
FELCOR LODGING TR INC	33,173.000	344,999.200	
FIRST INDUSTRIAL RT	30,323.000	580,685.450	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	18,956.000	250,408.760	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,966.000	322,757.380	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	159,581.000	3,834,731.430	
GEO GROUP INC	21,987.000	783,396.810	
GETTY REALTY CORP	9,123.000	172,789.620	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,808.000	85,101.600	
GLIMCHER REALTY TRUST	43,702.000	478,536.900	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	16,419.000	406,534.440	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	29,200.000	179,288.000	
HCP INC	140,065.000	5,818,300.100	
HEALTH CARE REIT INC	93,388.000	5,873,171.320	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	29,035.000	737,489.000	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	53,756.000	661,736.360	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	57,276.000	389,476.800	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	27,758.000	1,164,170.520	
HOME PROPERTIES INC	17,311.000	1,111,366.200	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	45,411.000	1,387,760.160	

HOST HOTELS & RESORTS INC	231,504.000	5,231,990.400	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	16,530.000	424,986.300	
INLAND REAL ESTATE CORP	26,906.000	286,279.840	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	32,009.000	281,999.290	
KILROY REALTY CORP	24,944.000	1,553,013.440	
KIMCO REALTY	124,750.000	2,890,457.500	
KITE REALTY GROUP TRUST	39,731.000	255,470.330	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	31,533.000	1,135,188.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	61,943.000	687,567.300	
LIBERTY PROPERTY TRUST	44,821.000	1,682,132.130	
LTC PROPERTIES INC	10,441.000	409,391.610	
MACK CALI	26,757.000	561,361.860	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	52,110.000	679,514.400	
MID AMERICA	22,762.000	1,662,764.100	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	16,885.000	172,902.400	
NATIONAL HEALTH INVS INC	8,811.000	546,898.770	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	37,862.000	1,417,931.900	
NEW YORK REIT INC	49,800.000	534,354.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	38,562.000	1,444,532.520	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,912.000	84,851.280	
PARKWAY PROPERTIES INC	22,820.000	478,307.200	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,314.000	723,888.720	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	21,663.000	422,428.500	
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,991.000	144,270.040	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	46,695.000	884,870.250	
POST PROPERTIES, INC	16,521.000	897,090.300	
PROLOGIS INC	152,751.000	6,297,923.730	
PS BUSINESS PARKS	6,163.000	521,451.430	
PUBLIC STORAGE	44,292.000	7,585,447.920	
QTS REALTY TRUST INC	4,440.000	129,870.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	20,559.000	345,391.200	
REALTY INCOME CORP	67,284.000	3,037,199.760	
REGENCY CENTERS CORP	28,015.000	1,558,474.450	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	26,662.000	420,059.810	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	56,555.000	888,479.050	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,800.000	82,070.000	

	RLJ LODGING TRUST	40,196.000	1,169,301.640	
	ROUSE PROPERTIES INC	11,144.000	195,577.200	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,359.000	756,737.930	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	14,828.000	426,898.120	
	SAUL CENTERS INC	3,906.000	192,487.680	
	SELECT INCOME REIT	10,969.000	315,029.680	
	SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	61,800.000	1,476,402.000	
	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	12,248.000	196,947.840	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	94,851.000	15,955,835.220	
	SL GREEN	29,222.000	3,207,114.500	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	10,026.000	768,893.940	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	113,862.000	1,291,195.080	
	STAG INDUSTRIAL INC	16,542.000	395,353.800	
	STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST	11,772.000	312,311.160	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	74,683.000	887,980.870	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	26,510.000	282,066.400	
	SUN COMMUNITIES INC	11,479.000	579,689.500	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	60,909.000	904,498.650	
	TANGER FACTORY OUTLET	29,505.000	1,038,280.950	
	TAUBMAN CENTERS INC	19,189.000	1,466,807.160	
	TERRENO REALTY CORP	9,815.000	186,583.150	
	THE MACERICH COMPANY	42,746.000	2,866,119.300	
	UDR INC	76,352.000	2,171,450.880	
	UMH PROPERTIES INC	6,837.000	68,575.110	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,885.000	168,375.900	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,258.000	172,179.300	
	VENTAS INC	89,985.000	5,813,031.000	
	VORNADO REALTY TRUST	53,290.000	5,651,937.400	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	47,498.000	917,186.380	
	WASHINGTON REIT	20,089.000	518,697.980	
	WEINGARTEN REALTY INVST	34,055.000	1,138,118.100	
	WHITESTONE REIT	7,606.000	115,611.200	
	WINTHROP REALTY TRUST	9,586.000	146,569.940	
	WP CAREY INC	17,763.000	1,148,733.210	
	アメリカ・ドル 小計	5,361,334.000	185,972,310.700 (18,852,013,135)	
	イギリス・ポンド			
	BIG YELLOW GROUP PLC	40,226.000	199,118.700	
	BRITISH LAND CO PLC	312,810.000	2,153,696.850	

	DERWENT LONDON PLC	25,958.000	693,338.180	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	104,228.000	660,805.520	
	HAMMERSON PLC	216,440.000	1,253,187.600	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	216,959.000	223,684.720	
	INTU PROPERTIES PLC	273,188.000	844,150.920	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	238,458.000	2,444,194.500	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	183,038.000	256,070.160	
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	18,776.000	81,994.790	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	30,249.000	104,359.050	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	239,500.000	126,456.000	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	65,000.000	142,025.000	
	SEGRO PLC	224,988.000	782,058.280	
	SHAFTESBURY PLC	84,121.000	543,001.050	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	57,000.000	60,420.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	31,543.000	183,580.260	
イギリス・ポンド	小計	2,362,482.000	10,752,141.580 (1,866,356,736)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	36,003.000	327,519.290	
イスラエル・シュケル	小計	36,003.000	327,519.290 (9,684,746)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	10,183.000	353,961.080	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,093.000	312,647.080	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,839.000	509,691.780	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	4,919.000	136,256.300	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	19,607.000	514,683.750	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	15,912.000	364,862.160	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	10,212.000	464,237.520	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE	24,756.000	263,403.840	
	CHOICE PROPERTIES REIT	14,471.000	153,247.890	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	19,565.000	366,843.750	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	11,190.000	149,610.300	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,671.000	109,572.430	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,069.000	152,494.810	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	8,455.000	81,506.200	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	15,322.000	446,942.740	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,199.000	286,232.240	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	40,725.000	941,154.750	
	HEALTHLEASE PROPERTIES REIT	4,662.000	49,650.300	
	INNVEST REAL ESTATE INV TR	14,628.000	78,113.520	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,926.000	46,604.880	
	MILESTONE APARTMENTS REIT	6,642.000	70,737.300	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,277.000	55,144.650	
	MORGUARD REAL ESTATE INV TR	9,688.000	171,477.600	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	4,560.000	130,826.400	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,385.000	63,403.050	
	PLAZA RETAIL REIT	12,000.000	47,640.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	29,461.000	136,109.820	
	RETROCOM REIT	9,828.000	44,324.280	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	45,804.000	1,232,127.600	
カナダ・ドル 小計		413,049.000	7,733,508.020 (736,229,964)	
ニュージーランド・ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	89,415.000	146,640.600	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	295,432.000	320,543.720	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	283,348.000	332,933.900	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	128,764.000	172,543.760	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	88,438.000	123,813.200	
ニュージーランド・ドル 小計		885,397.000	1,096,475.180 (97,959,093)	
ユーロ	AEDIFICA	2,979.000	153,269.550	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	23,020.000	222,879.640	
	ALTAREA	1,170.000	163,800.000	
	ANF IMMOBILIER	3,251.000	82,835.480	
	BEFIMMO	5,508.000	315,222.840	
	BENI STABILI SPA	244,156.000	159,189.710	
	COFINIMMO SA	4,874.000	443,826.440	
	CORIO NV	30,575.000	1,112,165.620	

	EUROBANK PROPERTIES REAL ESTAT	7,639.000	69,056.560	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,353.000	410,638.010	
	FONCIERE DES REGIONS	13,375.000	1,059,300.000	
	GECINA SA	7,966.000	839,218.100	
	GREEN REIT PLC	200,077.000	258,099.330	
	HAMBORNER REIT AG	11,944.000	94,954.800	
	HIBERNIA REIT PLC	120,000.000	133,800.000	
	ICADE	10,639.000	810,691.800	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	48,247.000	57,413.930	
	KLEPIERRE	29,649.000	1,105,611.210	
	MERCIALYS	16,581.000	280,965.040	
	NIEUWE STEEN INVS	32,513.000	155,412.140	
	SOCIETE TOUR EIFFEL	1,729.000	100,282.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	29,678.000	6,091,409.500	
	VASTNED RETAIL	6,030.000	228,537.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	3,617.000	204,360.500	
	WERELDHAVE NV	6,646.000	450,598.800	
	ユーロ 小計	873,216.000	15,003,538.000 (2,068,087,677)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	799,000.000	2,940,320.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	386,000.000	2,759,900.000	
	LINK REIT/THE	706,023.000	29,652,966.000	
	PROSPERITY REIT	365,000.000	912,500.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	273,000.000	573,300.000	
	SPRING REIT	130,000.000	455,000.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	294,000.000	964,320.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	572,000.000	2,185,040.000	
	香港・ドル 小計	3,525,023.000	40,443,346.000 (528,998,966)	
投資証券 合計		13,456,504	24,159,330,317 (24,159,330,317)	
合計			27,754,923,988 (27,754,923,988)	

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 144銘柄	-%	67.52%	67.92%
イギリス・ポンド	投資証券 17銘柄	-%	6.68%	6.72%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.03%	0.03%
オーストラリア・ドル	投資信託 受益証券 27銘柄	9.36%	-%	9.41%
カナダ・ドル	投資証券 29銘柄	-%	2.64%	2.65%
シンガポール・ドル	投資信託 受益証券 27銘柄	3.52%	-%	3.54%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	0.35%	0.35%
ユーロ	投資証券 25銘柄	-%	7.41%	7.45%
香港・ドル	投資証券 8銘柄	-%	1.89%	1.91%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		318,885,865	280,345,191
コール・ローン		2,557,257,884	1,556,917,230
国債証券		169,967,119,076	169,978,201,254
派生商品評価勘定		3,865,119,885	514,618,126
未収利息		1,954,887,215	1,763,945,349
前払費用		66,718,971	94,447,056
流動資産合計		178,729,988,896	174,188,474,206
資産合計		178,729,988,896	174,188,474,206
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		651	95,817,440
未払解約金		30,510,000	118,834,000
流動負債合計		30,510,651	214,651,440
負債合計		30,510,651	214,651,440
純資産の部			
元本等			
元本	1	148,344,483,263	139,254,883,317
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		30,354,994,982	34,718,939,449
元本等合計		178,699,478,245	173,973,822,766
純資産合計		178,699,478,245	173,973,822,766
負債純資産合計		178,729,988,896	174,188,474,206

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	145,220,343,241円 4,690,606,307円 1,566,466,285円	148,344,483,263円 3,858,247,838円 12,947,847,784円
元本の内訳		
ファンド名		
投資のソムリエ	95,937,477円	832,989,647円
投資のソムリエ<DC年金>	1,102,236円	7,873,826円
D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定）	280,655,548円	244,508,411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）	27,556,382,270円	25,465,967,407円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,157,895,232円	1,803,039,853円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	9,712,459,659円	8,924,360,981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）	42,537,990,522円	39,601,656,245円
D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	181,667円	175,645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)	37,685,620,097円	35,176,498,269円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	522,752,256円	314,774,137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)	4,048,995,692円	3,879,137,532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)	10,205,726,638円	9,794,715,234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)	13,010,148,282円	12,689,398,577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)	528,635,687円	519,787,553円
計	148,344,483,263円	139,254,883,317円
2 . 受益権の総数	148,344,483,263口	139,254,883,317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25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	145,139,774	802,257,601
合計	145,139,774	802,257,601

(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25年6月25日から平成26年1月14日まで及び平成26年6月24日から平成26年7月11日まで)に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年1月14日 現在				平成26年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	174,944,374,180	-	171,079,254,946	3,865,119,234	172,598,142,283	-	172,179,341,597	418,800,686
アメリカ・ドル	68,536,580,768	-	67,367,208,630	1,169,372,138	65,006,743,988	-	65,054,163,005	47,419,017
イギリス・ポンド	13,875,002,364	-	13,503,038,928	371,963,436	14,038,705,992	-	14,070,307,622	31,601,630
オーストラリア・ドル	2,656,671,072	-	2,639,215,352	17,455,720	2,924,112,725	-	2,910,355,240	13,757,485
カナダ・ドル	4,160,321,321	-	3,991,169,165	169,152,156	4,005,262,499	-	4,010,477,976	5,215,477
シンガポール・ドル	655,482,815	-	642,545,727	12,937,088	615,905,139	-	618,498,770	2,593,631
スウェーデン・クローナ	1,026,255,931	-	996,477,940	29,777,991	979,490,447	-	966,473,082	13,017,365
デンマーク・クローネ	1,447,048,658	-	1,410,096,248	36,952,410	1,456,502,937	-	1,447,707,832	8,795,105
ノルウェー・クローネ	574,373,327	-	559,713,222	14,660,105	488,792,813	-	486,386,280	2,406,533
ポーランド・ズロチ	1,495,240,842	-	1,457,944,488	37,296,354	1,198,469,515	-	1,198,312,206	157,309
マレーシア・リンギット	896,019,080	-	887,960,000	8,059,080	886,119,450	-	894,423,000	8,303,550
メキシコ・ペソ	1,689,770,469	-	1,663,945,528	25,824,941	1,895,632,271	-	1,896,265,170	632,899
ユーロ	77,123,821,618	-	75,190,689,132	1,933,132,486	78,239,427,796	-	77,765,923,352	473,504,444
南アフリカ・ランド	807,785,915	-	769,250,586	38,535,329	862,976,711	-	860,048,062	2,928,649
合計	174,944,374,180	-	171,079,254,946	3,865,119,234	172,598,142,283	-	172,179,341,597	418,800,686

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2046円	1.2493円
（1万口当たり純資産額）	（12,046円）	（12,493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26年7月11日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 12/15/15	4,000,000.000	4,000,760.000	
		US T N/B 0.375 01/15/16	15,500,000.000	15,523,560.000	
		US T N/B 0.375 04/30/16	18,500,000.000	18,493,340.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	17,300,000.000	17,173,537.000	
		US T N/B 0.625 08/31/17	9,300,000.000	9,189,144.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	5,000,000.000	4,914,600.000	
		US T N/B 0.75 03/31/18	4,600,000.000	4,514,072.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	4,200,000.000	4,153,380.000	
		US T N/B 0.875 04/30/17	8,000,000.000	8,007,760.000	
		US T N/B 0.875 11/30/16	10,000,000.000	10,055,800.000	
		US T N/B 1.0 06/30/19	5,000,000.000	4,840,600.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	8,800,000.000	8,886,944.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	5,500,000.000	5,281,705.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	3,500,000.000	3,361,470.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	3,900,000.000	3,764,397.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	2,600,000.000	2,566,070.000	
		US T N/B 1.25 08/31/15	11,000,000.000	11,137,060.000	
		US T N/B 1.25 09/30/15	9,000,000.000	9,118,440.000	
		US T N/B 1.25 10/31/15	11,000,000.000	11,151,250.000	
		US T N/B 1.25 10/31/18	5,000,000.000	4,952,700.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	11,900,000.000	11,864,657.000	
		US T N/B 1.375 11/30/15	10,500,000.000	10,668,525.000	
		US T N/B 1.375 11/30/18	2,000,000.000	1,990,300.000	
		US T N/B 1.5 02/28/19	5,000,000.000	4,983,200.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	6,300,000.000	6,275,871.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	6,900,000.000	6,923,667.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	5,600,000.000	5,593,840.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	5,000,000.000	4,746,050.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	2,500,000.000	2,361,125.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	3,300,000.000	3,174,930.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,700,000.000	7,286,125.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	11,000,000.000	11,274,120.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	1,800,000.000	1,796,976.000	
		US T N/B 1.875 09/30/17	6,000,000.000	6,157,680.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	3,300,000.000	3,247,134.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	5,900,000.000	5,723,413.000			
US T N/B 2.0 02/28/21	6,500,000.000	6,467,500.000			
US T N/B 2.0 04/30/16	9,500,000.000	9,774,170.000			
US T N/B 2.0 07/31/20	2,500,000.000	2,511,500.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	8,500,000.000	8,509,945.000			

US T N/B 2.0 11/15/21	5,000,000.000	4,935,500.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	4,500,000.000	4,495,050.000	
US T N/B 2.25 07/31/18	4,000,000.000	4,137,640.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	5,500,000.000	5,706,030.000	
US T N/B 2.375 03/31/16	6,000,000.000	6,211,620.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	4,300,000.000	4,471,828.000	
US T N/B 2.375 07/31/17	10,500,000.000	10,947,825.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	6,900,000.000	7,043,382.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	6,500,000.000	6,802,380.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	5,500,000.000	5,527,500.000	
US T N/B 2.625 04/30/18	4,300,000.000	4,515,301.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	5,500,000.000	5,718,680.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	9,100,000.000	9,444,071.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	3,700,000.000	3,897,136.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,900,000.000	3,471,585.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	12,900,000.000	13,205,343.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,000,000.000	3,554,360.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,500,000.000	1,364,760.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	7,000,000.000	7,412,020.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,600,000.000	1,501,872.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	6,000,000.000	6,319,440.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,100,000.000	2,022,384.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,800,000.000	4,599,744.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	8,000,000.000	8,508,080.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,817,610.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	3,800,000.000	4,054,106.000	
US T N/B 3.125 10/31/16	10,500,000.000	11,102,490.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,300,000.000	2,219,500.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,000,000.000	7,465,080.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	7,000,000.000	7,385,210.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	7,800,000.000	8,291,400.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,500,000.000	4,884,255.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	2,500,000.000	2,701,650.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,800,000.000	1,871,712.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	5,000,000.000	5,460,350.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	6,500,000.000	7,139,535.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	4,500,000.000	4,948,200.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,800,000.000	5,043,360.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	7,000,000.000	7,674,800.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,600,000.000	4,837,544.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,700,000.000	1,838,788.000	
US T N/B 3.75 11/15/18	6,000,000.000	6,583,080.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	6,500,000.000	6,987,955.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	5,800,000.000	6,366,138.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,500,000.000	2,764,250.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	800,000.000	935,744.000	
US T N/B 4.25 08/15/15	12,000,000.000	12,537,600.000	
US T N/B 4.25 11/15/17	3,000,000.000	3,311,940.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,900,000.000	2,229,821.000	

US T N/B 4.375 02/15/38	1,200,000.000	1,428,084.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,100,000.000	2,508,177.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,200,000.000	1,436,904.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,400,000.000	1,669,934.000	
US T N/B 4.5 02/15/16	11,000,000.000	11,733,370.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,700,000.000	2,059,125.000	
US T N/B 4.5 05/15/17	4,000,000.000	4,409,200.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	700,000.000	848,365.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,500,000.000	1,821,555.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	6,000,000.000	6,600,180.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,500,000.000	3,096,875.000	
US T N/B 4.625 11/15/16	7,000,000.000	7,651,560.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,000,000.000	2,531,240.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	3,700,000.000	4,128,645.000	
US T N/B 4.875 08/15/16	8,000,000.000	8,725,280.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	700,000.000	905,786.000	
US T N/B 5.125 05/15/16	5,000,000.000	5,431,400.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	900,000.000	1,151,640.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,200,000.000	1,534,680.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,966,275.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	500,000.000	652,965.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,600,000.000	2,134,992.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,919,414.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,000,000.000	1,418,820.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,000,000.000	2,635,460.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,000,000.000	2,797,260.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	1,000,000.000	1,317,810.000	
アメリカ・ドル 小計	613,600,000.000 (62,200,632,000)	636,197,962.000 (64,491,387,408)	
イギリス・債券			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	3,000,000.000	2,954,100.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	3,700,000.000	3,623,780.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/17	2,100,000.000	2,126,880.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,800,000.000	2,644,600.000	
UK TREASURY 2.0 01/22/16	3,000,000.000	3,051,900.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,650,000.000	2,570,844.500	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,800,000.000	2,731,400.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,400,000.000	1,457,960.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,550,000.000	1,681,285.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	3,200,000.000	3,473,280.000	

UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,300,000.000	2,507,920.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,400,000.000	2,626,968.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	1,508,910.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,300,000.000	1,446,640.000	
UK TREASURY 4.0 09/07/16	2,900,000.000	3,082,990.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,300,000.000	2,640,630.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,300,000.000	2,635,570.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,350,000.000	1,560,600.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,300,000.000	1,484,730.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,800,000.000	2,086,200.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,650,000.000	1,939,245.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,600,000.000	1,900,160.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,650,000.000	1,996,005.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,000,000.000	2,232,400.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,250,000.000	2,663,775.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,100,000.000	2,543,730.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	2,700,000.000	3,082,590.000	
UK TREASURY 4.75 09/07/15	1,300,000.000	1,360,580.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,800,000.000	2,177,280.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,800,000.000	2,234,700.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/18	2,250,000.000	2,519,100.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,500,000.000	3,020,250.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,200,000.000	1,621,560.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,500,000.000	2,048,100.000	
UK TREASURY 8.0 12/07/15	500,000.000	551,200.000	

	UK TREASURY 8.75 08/25/17	600,000.000	733,380.000	
イギリス・ボンド 小計		72,850,000.000 (12,645,303,000)	80,521,242.500 (13,976,877,273)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,000,000.000	2,155,180.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,550,000.000	2,813,925.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	2,150,000.000	2,490,259.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,300,000.000	1,223,404.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,300,000.000	1,267,370.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	750,000.000	701,422.500	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	400,000.000	406,912.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	800,000.000	849,776.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,500,000.000	1,571,085.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,050,000.000	1,123,006.500	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,300,000.000	1,442,207.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	2,000,000.000	2,084,860.000	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/15	1,500,000.000	1,542,930.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	2,700,000.000	2,953,125.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,300,000.000	2,668,759.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,000,000.000	2,342,540.000	
AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	2,500,000.000	2,716,200.000		
オーストラリア・ドル 小計		28,100,000.000 (2,672,310,000)	30,352,961.000 (2,886,566,591)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	500,000.000	810,620.000	
	CANADA 1.0 08/01/16	1,000,000.000	997,650.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,100,000.000	1,095,820.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	1,500,000.000	1,513,065.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,650,000.000	1,568,787.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	800,000.000	805,080.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,900,000.000	1,917,860.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,500,000.000	1,536,375.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,500,000.000	1,583,475.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	2,100,000.000	2,171,883.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	6,200,000.000	6,365,726.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,300,000.000	1,419,223.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,500,000.000	1,651,155.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,800,000.000	2,065,500.000	

	CANADA 3.75 06/01/19	2,700,000.000	2,977,263.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	2,300,000.000	2,423,395.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	1,500,000.000	1,619,385.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,203,866.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,200,000.000	1,328,748.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,500,000.000	2,067,495.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,300,000.000	1,817,920.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,380,000.000	2,004,353.400	
カナダ・ドル	小計	38,030,000.000 (3,620,456,000)	41,944,644.400 (3,993,130,147)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	700,000.000	693,679.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	350,000.000	328,692.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	400,000.000	409,848.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	500,000.000	496,625.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	200,000.000	209,716.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	900,000.000	966,321.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,000,000.000	1,091,480.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	60,000.000	63,468.600	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	550,000.000	594,500.500	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	1,000,000.000	1,072,520.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,400,000.000	1,581,832.000	
シンガポール・ドル	小計	7,060,000.000 (576,166,600)	7,508,682.100 (612,783,546)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,500,000.000	12,373,875.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	6,200,000.000	6,530,522.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,600,000.000	5,550,820.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	8,000,000.000	9,250,880.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	6,000,000.000	6,594,660.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,000,000.000	9,248,400.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	8,000,000.000	8,372,480.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	4,600,000.000	5,685,186.000	
スウェーデン・クローナ	小計	57,900,000.000 (865,605,000)	63,606,823.000 (950,922,004)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	7,100,000.000	7,266,140.000	
	DENMARK 2.5 11/15/16	3,300,000.000	3,486,978.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	11,100,000.000	12,772,770.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	10,000,000.000	10,531,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	6,000,000.000	6,766,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	10,000,000.000	11,868,500.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	13,550,000.000	19,651,565.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	3,000,000.000	4,678,260.000	
デンマーク・クローネ	小計	64,050,000.000 (1,184,284,500)	77,022,013.000 (1,424,137,020)	

ノルウェー・クローネ	NORWAY 2.0 05/24/23	7,900,000.000	7,744,765.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	1,000,000.000	1,052,600.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	6,300,000.000	7,001,190.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	7,000,000.000	7,553,000.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	5,500,000.000	6,221,325.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,700,000.000 (454,834,000)	29,572,880.000 (485,586,690)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.75 04/25/18	4,900,000.000	5,071,010.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,900,000.000	3,038,040.000	
	POLAND 4.75 04/25/17	1,800,000.000	1,904,130.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	3,000,000.000	3,150,300.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	1,300,000.000	1,357,330.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	3,400,000.000	3,674,550.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	1,900,000.000	2,130,280.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,100,000.000	2,355,570.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	950,000.000	1,169,944.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	2,400,000.000	2,811,528.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	1,800,000.000	2,090,700.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	6,000,000.000	6,291,000.000	
ポーランド・ズロチ 小計		32,450,000.000 (1,081,558,500)	35,044,382.000 (1,168,029,252)	
マレーシア・リングット	MALAYSIA 3.172 07/15/16	3,000,000.000	2,989,920.000	
	MALAYSIA 3.197 10/15/15	2,700,000.000	2,696,841.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	600,000.000	578,442.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,600,000.000	1,487,008.000	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	2,300,000.000	2,296,366.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	2,700,000.000	2,721,762.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,200,000.000	1,160,352.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,064,520.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	3,000,000.000	3,060,330.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	4,000,000.000	4,123,440.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,500,000.000	1,537,440.000	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,500,000.000	1,652,715.000		
マレーシア・リングット 小計		28,100,000.000 (894,423,000)	28,369,136.000 (902,989,599)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	6,800,000.000	9,501,232.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	21,000,000.000	28,036,680.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 06/15/17	13,000,000.000	13,495,170.000	
	MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	12,500,000.000	13,220,750.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	14,000,000.000	14,912,100.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	12,000,000.000	12,904,080.000	

	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	9,500,000.000	10,754,190.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	14,000,000.000	15,962,520.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	8,900,000.000	10,090,197.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	6,000,000.000	6,840,480.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	30,000,000.000	33,569,100.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	15,000,000.000	17,309,250.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/17/15	25,500,000.000	27,204,930.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	10,000,000.000	12,182,500.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,800,000.000	14,438,952.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	1,000,000.000	1,157,710.000	
	メキシコ・ペソ 小計	211,000,000.000 (1,647,910,000)	241,579,841.000 (1,886,738,558)	
ユーロ	AUSTRIA 1.15 10/19/18	650,000.000	673,952.500	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	800,000.000	825,600.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	800,000.000	860,000.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	320,000.000	334,259.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	570,000.000	675,866.100	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,200,000.000	1,296,720.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,200,000.000	1,416,720.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	500,000.000	517,250.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,200,000.000	1,417,800.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,100,000.000	1,315,600.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	400,000.000	567,472.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,400,000.000	1,668,100.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	2,000,000.000	2,170,000.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,330,000.000	1,790,180.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	800,000.000	904,400.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,150,000.000	1,362,002.500	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,400,000.000	1,617,700.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	850,000.000	1,139,722.500	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	800,000.000	1,218,880.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,600,000.000	1,714,464.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	600,000.000	652,614.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	1,100,000.000	1,150,534.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	400,000.000	431,680.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,000,000.000	1,126,400.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	1,300,000.000	1,392,508.000	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	1,500,000.000	1,647,570.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	450,000.000	542,740.500	

BELGIUM 3.75 09/28/15	600,000.000	626,892.000	
BELGIUM 3.75 09/28/20	1,800,000.000	2,126,898.000	
BELGIUM 4.0 03/28/17	1,600,000.000	1,767,088.000	
BELGIUM 4.0 03/28/18	2,200,000.000	2,504,062.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,500,000.000	1,748,955.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,700,000.000	2,062,797.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	900,000.000	1,110,492.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,550,000.000	2,025,710.500	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,800,000.000	2,207,988.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,600,000.000	1,977,584.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	900,000.000	1,148,976.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,300,000.000	3,220,207.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,800,000.000	2,532,780.000	
BELGIUM 5.5 09/28/17	1,000,000.000	1,169,150.000	
BUNDESOBL 0.25 04/13/18	1,400,000.000	1,404,900.000	
BUNDESOBL 0.5 02/23/18	2,000,000.000	2,026,840.000	
BUNDESOBL 0.5 04/07/17	900,000.000	911,205.000	
BUNDESOBL 0.5 10/13/17	1,700,000.000	1,724,242.000	
BUNDESOBL 1.0 02/22/19	1,300,000.000	1,343,394.000	
BUNDESOBL 1.0 10/12/18	1,200,000.000	1,239,336.000	
BUNDESOBL 1.75 10/09/15	4,100,000.000	4,188,109.000	
BUNDESOBL 2.0 02/26/16	2,000,000.000	2,064,300.000	
BUNDESOBL 2.75 04/08/16	2,500,000.000	2,618,150.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,000,000.000	2,084,780.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	900,000.000	935,685.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,200,000.000	2,307,932.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	3,500,000.000	3,690,050.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,200,000.000	3,427,808.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,000,000.000	2,180,400.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	800,000.000	864,736.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	1,900,000.000	2,101,115.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,000,000.000	2,218,200.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,000,000.000	2,246,800.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,700,000.000	1,837,190.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	600,000.000	647,832.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	2,500,000.000	2,873,875.000	

DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,500,000.000	2,889,750.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,000,000.000	2,355,200.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,700,000.000	2,106,300.000	
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	4,500,000.000	4,731,570.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	3,200,000.000	3,708,000.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	3,100,000.000	3,386,750.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	3,300,000.000	3,821,730.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,000,000.000	3,408,600.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,500,000.000	3,352,200.000	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	4,700,000.000	5,068,292.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	4,000,000.000	4,500,000.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	3,100,000.000	3,605,610.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,500,000.000	2,122,950.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,200,000.000	1,659,360.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,200,000.000	3,184,060.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,750,000.000	2,671,550.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,850,000.000	2,795,905.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,400,000.000	2,076,620.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,600,000.000	2,345,600.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,000,000.000	1,599,900.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,500,000.000	2,374,500.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	540,000.000	559,056.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	550,000.000	562,595.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	550,000.000	571,862.500	
FINLAND 1.75 04/15/16	700,000.000	721,000.000	
FINLAND 1.875 04/15/17	570,000.000	597,417.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	380,000.000	414,200.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	430,000.000	479,471.500	
FINLAND 3.375 04/15/20	550,000.000	636,185.000	

FINLAND 3.5 04/15/21	450,000.000	529,087.500	
FINLAND 3.875 09/15/17	600,000.000	670,200.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,050,000.000	1,312,447.500	
FINLAND 4.25 07/04/15	500,000.000	520,410.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	550,000.000	656,232.500	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,000,000.000	1,603,220.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	2,400,000.000	2,466,600.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	700,000.000	718,235.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	2,300,000.000	2,364,377.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,100,000.000	3,211,507.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,550,000.000	2,718,223.500	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,800,000.000	3,029,124.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	600,000.000	618,360.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	3,550,000.000	3,933,577.500	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,800,000.000	3,044,048.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	3,500,000.000	3,995,565.000	
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	7,600,000.000	7,888,572.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	9,400,000.000	9,938,338.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,100,000.000	1,231,582.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,000,000.000	4,639,600.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,900,000.000	4,534,959.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,300,000.000	3,874,200.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	5,400,000.000	5,944,050.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,250,000.000	5,061,282.500	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	4,400,000.000	5,141,400.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	2,900,000.000	3,311,858.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,800,000.000	2,338,560.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,100,000.000	1,445,422.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,600,000.000	3,285,672.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	3,400,000.000	4,017,270.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	6,100,000.000	6,915,997.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	3,300,000.000	3,850,440.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	4,200,000.000	5,244,876.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,600,000.000	3,556,280.000	

FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,300,000.000	3,171,470.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	5,500,000.000	6,119,135.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,450,000.000	4,928,014.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,100,000.000	4,689,742.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,000,000.000	2,873,480.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,000,000.000	1,417,500.000	
IRISH 3.9 03/20/23	600,000.000	685,410.000	
IRISH 4.4 06/18/19	700,000.000	818,580.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,100,000.000	1,302,378.000	
IRISH 4.5 10/18/18	1,000,000.000	1,160,150.000	
IRISH 4.6 04/18/16	700,000.000	755,013.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,000,000.000	1,221,650.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,700,000.000	2,158,150.000	
IRISH 5.5 10/18/17	1,000,000.000	1,165,190.000	
IRISH 5.9 10/18/19	800,000.000	1,003,040.000	
ITALY BTPS 2.5 05/01/19	1,500,000.000	1,573,950.000	
ITALY BTPS 3.5 11/01/17	2,000,000.000	2,160,320.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,800,000.000	3,096,520.000	
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	4,500,000.000	4,751,100.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	1,100,000.000	1,213,630.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	5,300,000.000	5,482,108.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	6,500,000.000	6,912,750.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,000,000.000	3,311,100.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,400,000.000	1,502,592.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	5,900,000.000	6,380,260.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,900,000.000	3,017,740.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,000,000.000	3,374,100.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	4,200,000.000	4,738,020.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,600,000.000	2,957,240.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	3,000,000.000	3,404,400.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	5,000,000.000	5,590,500.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,700,000.000	3,106,620.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	2,700,000.000	3,080,970.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,200,000.000	3,656,992.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,200,000.000	2,497,440.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,970,084.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	4,700,000.000	5,310,530.000	

ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,213,310.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,100,000.000	3,627,000.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.000	2,295,060.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.000	1,564,318.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,000,000.000	2,368,400.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,500,000.000	2,952,675.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,300,000.000	2,703,650.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,200,000.000	2,566,300.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,400,000.000	2,782,800.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	3,800,000.000	4,290,200.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,800,000.000	4,564,940.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,200,000.000	2,682,790.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,300,000.000	2,803,861.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.000	2,171,750.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,200,000.000	4,165,440.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,900,000.000	3,892,960.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,100,000.000	1,548,800.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,400,000.000	2,127,440.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	2,000,000.000	2,074,100.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	600,000.000	624,030.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,700,000.000	1,771,655.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	400,000.000	421,760.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,800,000.000	1,964,016.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	2,000,000.000	2,121,260.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,150,000.000	1,228,970.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,800,000.000	2,093,040.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,600,000.000	1,869,120.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,750,000.000	2,121,350.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,100,000.000	2,790,459.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,400,000.000	1,858,080.000	

	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,500,000.000	5,931,750.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	1,800,000.000	2,067,480.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,500,000.000	1,763,325.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	1,700,000.000	1,921,850.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,700,000.000	2,465,000.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	2,500,000.000	2,604,550.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	2,800,000.000	2,940,028.000	
	SPAIN 3.75 10/31/15	1,800,000.000	1,880,010.000	
	SPAIN 3.75 10/31/18	3,400,000.000	3,753,498.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	4,400,000.000	4,747,600.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,000,000.000	1,083,570.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,200,000.000	2,477,860.000	
	SPAIN 4.0 07/30/15	1,900,000.000	1,974,157.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	2,800,000.000	3,129,560.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,900,000.000	2,006,533.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	2,500,000.000	2,706,575.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	2,000,000.000	2,281,000.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,900,000.000	2,163,340.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	2,300,000.000	2,578,070.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	2,200,000.000	2,534,400.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,600,000.000	1,838,560.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,400,000.000	1,564,920.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,950,000.000	4,615,180.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,000,000.000	2,360,400.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,500,000.000	1,740,000.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,100,000.000	1,309,990.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	500,000.000	587,695.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,700,000.000	2,070,974.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,700,000.000	3,294,675.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	2,500,000.000	2,847,125.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,700,000.000	2,175,983.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,100,000.000	2,623,005.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,500,000.000	1,897,425.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,150,000.000	2,759,804.500	
	ユーロ 小計	479,190,000.000 (66,051,549,600)	554,028,296.900 (76,367,260,445)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	18,000,000.000	21,017,520.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	8,800,000.000	6,553,360.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,700,000.000	5,758,291.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	14,000,000.000	13,153,420.000	

	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	8,600,000.000	7,238,620.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	2,500,000.000	2,338,375.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	18,000,000.000	18,315,540.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	6,000,000.000	6,165,660.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	2,400,000.000	2,269,056.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	5,100,000.000	4,932,006.000	
	南アフリカ・ランド 小計	91,100,000.000 (863,628,000)	87,741,848.000 (831,792,719)	
国債証券 合計		154,758,660,200 (154,758,660,200)	169,978,201,254 (169,978,201,254)	
合計		154,758,660,200 (154,758,660,200)	169,978,201,254 (169,978,201,254)	

- (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せん。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 116銘柄	37.07%	37.94%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	8.03%	8.22%
オーストラリア・ドル	国債証券 17銘柄	1.66%	1.70%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	2.30%	2.35%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.55%	0.56%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.82%	0.84%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.28%	0.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.67%	0.69%
マレーシア・リンギット	国債証券 12銘柄	0.52%	0.53%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	1.08%	1.11%
ユーロ	国債証券 227銘柄	43.90%	44.93%
南アフリカ・ランド	国債証券 10銘柄	0.48%	0.49%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		898,020,599	1,083,098,878
コール・ローン		36,843,254	56,894,491
株式		36,394,271,057	37,495,144,475
投資信託受益証券		330,187,525	595,605,690
投資証券		73,394,633	88,222,026
派生商品評価勘定		11,310	29,252,203
未収入金		-	1,843,031
未収配当金		20,722,573	201,788,648
差入委託証拠金		259,191,756	477,571,203
流動資産合計		38,012,642,707	40,029,420,645
資産合計		38,012,642,707	40,029,420,645
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		28,813,882	130,767
未払金		3,752	1,746
未払解約金		8,519,000	34,147,000
流動負債合計		37,336,634	34,279,513
負債合計		37,336,634	34,279,513
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,097,535,766	40,840,815,210
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	4,122,229,693	845,674,078
元本等合計		37,975,306,073	39,995,141,132
純資産合計		37,975,306,073	39,995,141,132
負債純資産合計		38,012,642,707	40,029,420,645

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,129,921,867円	42,097,535,766円
	同期中追加設定元本額	605,950,199円	3,848,230,800円
	同期中一部解約元本額	1,638,336,300円	5,104,951,356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>	213,583,763円	295,499,458円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	241,045,504円	311,445,375円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	7,051,114円	8,267,924円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	13,044,378円	20,869,332円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	33,166,784円	57,345,068円
	投資のソムリエ	58,142,043円	190,670,032円
	クルーズコントロール	80,753,967円	493,622,712円
	投資のソムリエ< D C年金>	660,890円	1,794,298円
	D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	550,917円	8,385,551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）	7,930,699,430円	7,458,945,137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）	3,090,291,212円	3,081,962,508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）	2,166,543,481円	2,174,923,438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）	17,474,957,918円	16,479,892,484円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	10,787,044,365円	10,257,191,893円
	計	42,097,535,766円	40,840,815,210円
2 .	受益権の総数	42,097,535,766口	40,840,815,210口

3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,122,229,693円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は845,674,078円であります。
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	1,205,838,994	1,721,868,000
投資信託受益証券	14,444,172	16,227,819
投資証券	5,032,148	3,610,721
合計	1,186,362,674	1,709,250,902

（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25年4月19日から平成26年1月14日まで及び平成26年4月19日から平成26年7月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年1月14日 現在				平成26年7月11日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	10,268,310	-	10,257,000	11,310	162,187,520	-	162,176,000	11,520
アメリカ・ドル	-	-	-	-	162,187,520	-	162,176,000	11,520
メキシコ・ペソ	10,268,310	-	10,257,000	11,310	-	-	-	-
合計	10,268,310	-	10,257,000	11,310	162,187,520	-	162,176,000	11,520

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成26年1月14日 現在			平成26年7月11日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,167,675,113	-	1,138,861,231	28,813,882	1,553,268,181	-	1,582,378,097	29,109,916
合計	1,167,675,113	-	1,138,861,231	28,813,882	1,553,268,181	-	1,582,378,097	29,109,916

(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26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.9021円	0.9793円
(1万口当たり純資産額)	(9,021円)	(9,793円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BANCOLOMBIA SA SPONS ADR	30,480	58.890	1,794,967.200	
	LATAM AIRLINES GROUP SP ADR	44,550	13.460	599,643.000	
	BANCO SANTANDER CHILE ADR	23,792	26.750	636,436.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,973	11.490	229,489.770	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS ADR	15,568	22.900	356,507.200	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PEF	66,300	8.470	561,561.000	
	CREDICORP LTD	6,349	150.820	957,556.180	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA ADR	11,700	22.740	266,058.000	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHILE SP ADR	14,616	46.790	683,882.640	
	ENERSIS SA SPONS ADR	49,308	17.440	859,931.520	
	CORPBANCA SA ADR	19,365	18.540	359,027.100	
	MOBILE TELESYSTEMS OJSC ADR	51,125	19.100	976,487.500	
	QUIMICA Y MINERA DE CHIL-SP ADR	15,246	28.290	431,309.340	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,380	33.170	543,324.600	
	BANCO DE CHILE-ADR	6,157	78.860	485,541.020	
	VINA CONCHA Y TORO SA SP ADR	7,200	39.810	286,632.000	
	LUKOIL SPON ADR	47,288	61.350	2,901,118.800	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	56,215	3.534	198,663.810	
	OAD GAZPROM ADR	540,539	8.685	4,694,581.210	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	91,980	4.882	449,046.360	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	84,200	1.384	116,532.800	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	72,932	7.770	566,681.640	
	SISTEMA JSFC GDR	15,837	31.010	491,105.370	
NOVATEK OAO GDR	8,820	119.500	1,053,990.000		
TELECOM EGYPT -GDR REG S	13,015	9.000	117,135.000		
MMC NORILSK NICKEL ADR	53,604	21.200	1,136,404.800		

	ROSTELECOM SPON ADR	13,980	15.390	215,152.200	
	ROSNEFT OIL CO GDR	116,050	7.190	834,399.500	
	URALKALI -SPON GDR	26,381	22.750	600,167.750	
	SEVERSTAL GDR	21,786	8.380	182,566.680	
	TATNEFT GDR	22,116	39.650	876,899.400	
	VTB BANK OJSC GDR	252,902	2.446	618,598.290	
	MAGNIT OJSC GDR	24,149	64.700	1,562,440.300	
	ECOPETROL SA SP ADR	50,348	34.310	1,727,439.880	
	FEDERAL HYDROGENERATING ADR	135,146	1.943	262,588.670	
	SBERBANK ADR	254,831	10.125	2,580,163.870	
	CENCOSUD SA ADR	59,520	10.110	601,747.200	
	MEGAFON OAO GDR	9,723	30.220	293,829.060	
アメリカ・ドル 小計		2,369,471		32,109,606.660 (3,254,950,826)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	116,674	997.200	116,347,312.800	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,876	580.750	9,800,737.000	
	ASIAN PAINTS LTD	27,790	587.000	16,312,730.000	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,318	764.950	5,597,904.100	
	HDFC BANK LTD	33,984	823.350	27,980,726.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	28,008	1,165.550	32,644,724.400	
	ICICI BANK LTD	20,321	1,389.000	28,225,869.000	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	4,900	1,370.150	6,713,735.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	13,553	2,545.700	34,501,872.100	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	29,705	325.300	9,663,036.500	
	RELIANCE CAPITAL LTD	8,069	605.550	4,886,182.950	
	TATA STEEL LTD	25,639	521.400	13,368,174.600	
	TATA MOTORS LTD	68,641	453.150	31,104,669.150	
	JSW STEEL LTD	9,507	1,204.650	11,452,607.550	
	TATA POWER CO LTD	97,018	105.900	10,274,206.200	
	NESTLE INDIA LTD	1,596	4,954.350	7,907,142.600	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	51,907	243.750	12,652,331.250	
	GAIL INDIA LTD	31,444	463.050	14,560,144.200	
	SESA STERLITE LTD	104,288	294.400	30,702,387.200	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	68,260	404.000	27,577,040.000	
	GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	1,065	4,722.400	5,029,356.000	
ACC LTD	3,257	1,458.500	4,750,334.500		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	134,103	1,022.850	137,167,253.550		

INFOSYS LTD	41,576	3,292.700	136,897,295.200	
WIPRO LTD	61,260	544.750	33,371,385.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	64,597	631.850	40,815,614.450	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,687	1,033.000	8,973,671.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	23,511	1,472.400	34,617,596.400	
DABUR INDIA LTD	20,857	194.000	4,046,258.000	
HERO MOTOCORP LTD	7,766	2,439.100	18,942,050.600	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,141	2,650.650	26,880,241.650	
BHARTI AIRTEL LTD	58,442	334.050	19,522,550.100	
UNITED SPIRITS LTD	4,650	2,347.500	10,915,875.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	65,207	726.250	47,356,583.750	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,562	1,476.750	3,783,433.500	
AUROBINDO PHARMA LTD	11,358	663.950	7,541,144.100	
JINDAL STEEL & POWER LTD	32,302	300.550	9,708,366.100	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,445	906.650	12,189,909.250	
CIPLA LTD/INDIA	36,885	436.050	16,083,704.250	
LARSEN & TOUBRO LTD	28,362	1,654.750	46,932,019.500	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	87,706	64.950	5,696,504.700	
ULTRATECH CEMENT LTD	4,282	2,511.400	10,753,814.800	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	44,055	2,351.800	103,608,549.000	
ADANI ENTERPRISES LTD	8,706	444.550	3,870,252.300	
NTPC LTD	143,909	151.150	21,751,845.350	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,088	697.350	4,245,466.800	
YES BANK LTD	9,775	528.850	5,169,508.750	
AMBUJA CEMENTS LTD	77,639	219.850	17,068,934.150	
RANBAXY LABORATORIES LTD	12,995	543.200	7,058,884.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	112,300	176.250	19,792,875.000	
ITC LTD	198,630	342.150	67,961,254.500	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	84,596	126.350	10,688,704.600	
SIEMENS INDIA LTD	5,734	884.800	5,073,443.200	
UNITED BREWERIES LTD	5,209	700.550	3,649,164.950	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,583	804.450	10,122,394.350	
TECH MAHINDRA LTD	4,815	2,021.450	9,733,281.750	
CAIRN INDIA LTD	42,833	353.350	15,135,040.550	
IDEA CELLULAR LTD	81,695	133.750	10,926,706.250	
POWER FINANCE CORP LTD	25,765	302.550	7,795,200.750	

	DLF LTD	45,392	222.400	10,095,180.800	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	65,166	137.550	8,963,583.300	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	34,730	270.300	9,387,519.000	
	RELIANCE POWER LTD	63,381	96.950	6,144,787.950	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	25,236	367.450	9,272,968.200	
	BAJAJ AUTO LTD	8,032	2,152.200	17,286,470.400	
	OIL INDIA LTD	12,465	582.150	7,256,499.750	
	COAL INDIA LTD	43,852	369.900	16,220,854.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	20,882	256.400	5,354,144.800	
インド・ルビー	小計	2,683,982		1,507,882,009.650 (2,563,399,416)	
インドネシア・ルビア	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	27,150.000	950,250,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	151,501	24,600.000	3,726,924,600.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	372,500	7,075.000	2,635,437,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	152,500	31,400.000	4,788,500,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,787,500	7,825.000	13,987,187,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,497,100	2,590.000	11,647,489,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	687,000	3,875.000	2,662,125,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	49,500	53,800.000	2,663,100,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	141,000	25,500.000	3,595,500,000.000	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	93,500	11,225.000	1,049,537,500.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	4,310.000	1,251,692,960.000	
	BANK MANDIRI	817,700	10,475.000	8,565,407,500.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	143,000	14,800.000	2,116,400,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	1,024,800	11,675.000	11,964,540,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,019,500	5,700.000	5,811,150,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	602,600	5,175.000	3,118,455,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,111,000	1,745.000	3,683,695,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	290,700	16,725.000	4,861,957,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,149,000	11,475.000	13,184,775,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	188,000	5,400.000	1,015,200,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,601,200	1,165.000	1,865,398,000.000	

	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	674,500	2,065.000	1,392,842,500.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,560.000	1,199,360,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	6,325.000	1,185,937,500.000	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	44,000	26,400.000	1,161,600,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	808,500	1,620.000	1,309,770,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	1,180.000	1,286,790,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	123,000	10,350.000	1,273,050,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	151,500	7,900.000	1,196,850,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	393,500	3,720.000	1,463,820,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	21,146,517		116,614,742,060.000 (1,026,209,730)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	44,500	202.000	8,989,000.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	51.750	4,460,850.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	225,600	22.600	5,098,560.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	133,800	182.000	24,351,600.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	462,600	10.200	4,718,520.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	42,900	213.000	9,137,700.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	904,300	2.500	2,260,750.000	
	IRPC PCL NVDR	1,080,200	3.340	3,607,868.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	115,000	28.500	3,277,500.000	
	BANGKOK BANK PCL NVDR	50,100	203.000	10,170,300.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	268,400	27.500	7,381,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	99,700	225.000	22,432,500.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	301,600	9.900	2,985,840.000	
	PTT PCL	77,400	326.000	25,232,400.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	7,700	464.000	3,572,800.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	38,900	200.000	7,780,000.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	31,300	474.000	14,836,200.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	115,100	215.000	24,746,500.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	154,000	49.250	7,584,500.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	358,000	16.200	5,799,600.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	114.000	3,454,200.000	

	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,700	32.750	5,819,675.000	
	THAI OIL PCL NVDR	87,000	51.500	4,480,500.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	86.250	3,588,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	424,000	47.000	19,928,000.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	8.700	4,483,110.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	125,945	163.000	20,529,035.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	21,422	28.000	599,816.000	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	28.000	1,538,124.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	141,208	67.000	9,460,936.000	
タイ・パーツ	小計	6,216,708		272,305,384.000 (855,038,906)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,339	4,540.000	6,079,060.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	10,953	267.500	2,929,927.500	
	CEZ	13,616	578.900	7,882,302.400	
チェコ・コルナ	小計	25,908		16,891,289.900 (84,794,275)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	170,308	7.790	1,326,699.320	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,760	27.000	587,520.000	
	ARCELIK	27,213	13.000	353,769.000	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	43,887	5.690	249,717.030	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,611	4.250	533,846.750	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	26.500	147,976.000	
	KOC HOLDING AS	54,466	10.400	566,446.400	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	47,162	2.870	135,354.940	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	12,826	12.600	161,607.600	
	TURK HAVA YOLLARI	44,435	6.600	293,271.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	82,738	12.550	1,038,361.900	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	206,754	8.240	1,703,652.960	
	TURKIYE IS BANKASI	135,648	5.620	762,341.760	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,970	50.750	556,727.500	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	11,216	18.350	205,813.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	76,848	4.520	347,352.960	

	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	80,353	9.680	777,817.040	
	COCA-COLA ICECEK AS	5,353	54.100	289,597.300	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,998	50.000	999,900.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	57,549	4.830	277,961.670	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	16,685	17.150	286,147.750	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	57,669	15.450	890,986.050	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	52,652	5.890	310,120.280	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	4,261	24.850	105,885.850	
トルコ・リラ	小計	1,371,946		12,908,874.660 (617,044,209)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	15,067	4,224.000	63,643,008.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,754	11,375.000	42,701,750.000	
	OTP BANK NYRT	19,837	4,146.000	82,244,202.000	
ハンガリー・フォロント	小計	38,658		188,588,960.000 (83,884,370)	
フィリピン・ペン	AYALA LAND INC	492,500	31.350	15,439,875.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	163,780	55.050	9,016,089.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	75,426	96.400	7,271,066.400	
	AYALA CORP	17,403	664.000	11,555,592.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	212,800	29.800	6,341,440.000	
	DMCI HOLDINGS INC	70,370	75.300	5,298,861.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,520	1,726.000	6,075,520.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	111.400	4,531,752.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	219,380	50.900	11,166,442.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	48,790	180.000	8,782,200.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	4,451	90.100	401,035.100	
	BDO UNIBANK INC	124,238	92.000	11,429,896.000	
	MEGAWORLD CORP	887,000	4.680	4,151,160.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	3,615	3,008.000	10,873,920.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	522,075	16.300	8,509,822.500	
UNIVERSAL ROBINA CORP	87,930	159.600	14,033,628.000		
SM INVESTMENTS CORP	12,462	811.500	10,112,913.000		

	ENERGY DEVELOPMENT CORP	949,200	6.230	5,913,516.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,289,200	5.030	6,484,676.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	36.400	4,473,560.000	
フィリピン・ペソ 小計		5,347,720		161,862,964.000 (378,759,336)	
ブラジル・レ アル	BRF SA	57,692	54.900	3,167,290.800	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA	26,730	13.960	373,150.800	
	VALE SA	122,727	30.800	3,779,991.600	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	34.000	272,612.000	
	VALE SA-PREF A	165,096	27.720	4,576,461.120	
	RAIA DROGASIL SA	21,900	18.650	408,435.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	73,200	11.940	874,008.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	10.690	248,542.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,749	6.350	131,756.150	
	BANCO DO BRASIL SA	78,200	26.260	2,053,532.000	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	37,962	8.310	315,464.220	
	AES TIETE SA	12,300	19.450	239,235.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	291,197	8.940	2,603,301.180	
	LOJAS AMERICANAS SA	47,795	14.510	693,505.450	
	LOJAS AMERICANAS SA	20,125	12.480	251,160.000	
	GERDAU SA	79,230	13.710	1,086,243.300	
	METALURGICA GERDAU SA	24,400	16.710	407,724.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	12,906	106.450	1,373,843.700	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	271,410	16.980	4,608,541.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	376,512	18.110	6,818,632.320	
	SOUZA CRUZ SA	33,700	22.340	752,858.000	
	KROTON EDUCACIONAL SA	28,542	60.190	1,717,942.980	
	CCR SA	81,920	18.480	1,513,881.600	
	WEG SA	29,770	27.000	803,790.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	187,149	33.000	6,175,917.000	
	BANCO BRADESCO SA	58,460	34.180	1,998,162.800	
	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	45,400	7.920	359,568.000	
NATURA COSMETICOS SA	14,400	38.350	552,240.000		
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	66,706	10.550	703,748.300		
BRADESPAR SA	22,300	21.160	471,868.000		
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	36,300	8.730	316,899.000		

CPFL ENERGIA SA	22,140	20.170	446,563.800	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	247,808	33.200	8,227,225.600	
PORTO SEGURO SA	9,400	33.270	312,738.000	
FIBRIA CELULOSE SA	26,090	22.490	586,764.100	
B2W CIA DIGITAL	10,300	30.700	316,210.000	
BRASKEM SA	14,130	14.680	207,428.400	
TRACTEBEL ENERGIA SA	15,770	33.230	524,037.100	
LOCALIZA RENT A CAR	14,805	36.620	542,159.100	
TELEFONICA BRASIL S.A.	28,028	43.500	1,219,218.000	
LOJAS RENNEN SA	11,700	72.000	842,400.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	10.770	194,937.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,552	52.120	1,644,490.240	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,900	39.700	472,430.000	
CIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA	6,000	39.950	239,700.000	
TOTVS SA	13,000	38.250	497,250.000	
EMBRAER SA	59,460	21.290	1,265,903.400	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,900	30.650	548,635.000	
BR PROPERTIES SA	12,500	13.280	166,000.000	
M DIAS BRANCO SA	3,600	95.370	343,332.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	11,700	20.150	235,755.000	
ODONTOPREV SA	22,600	9.950	224,870.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	37,600	18.480	694,848.000	
JBS SA	62,600	7.820	489,532.000	
OI SA-PREFERENCE	251,924	1.420	357,732.080	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	68,449	18.050	1,235,504.450	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,198	23.670	785,796.660	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,900	50.950	402,505.000	
BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL	18,300	11.350	207,705.000	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	29.650	717,530.000	
DURATEX SA	34,037	8.760	298,164.120	
SUL AMERICA SA	15,448	15.600	240,988.800	
HYPERMARCAS SA	31,100	19.180	596,498.000	
BM&FBOVESPA SA	164,900	11.590	1,911,191.000	
QUALICORP SA	17,800	26.800	477,040.000	

	BANCO SANTANDER BRASIL SA	88,600	14.950	1,324,570.000	
	CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,152	30.940	623,502.880	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	17,300	15.210	263,133.000	
	CIELO SA	66,614	46.240	3,080,231.360	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	62,800	33.370	2,095,636.000	
	AMBEV SA	423,250	15.670	6,632,327.500	
	VIA VAREJO SA	15,000	25.310	379,650.000	
	KLABIN SA	56,000	11.660	652,960.000	
	AMBEV SA-RCT	645	15.600	10,062.000	
	ブラジル・リアル 小計	4,502,346		92,185,461.210 (4,206,422,595)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	43,979	7.720	339,517.880	
	MBANK	1,540	487.000	749,980.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	3,518	103.200	363,057.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,689	122.000	1,548,058.000	
	BANK PEKAO SA	11,972	170.450	2,040,627.400	
	ORANGE POLSKA SA	69,255	9.450	654,459.750	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	28,514	40.590	1,157,383.260	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,841	349.550	993,071.550	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	79,567	37.680	2,998,084.560	
	SYNTHOS SA	60,398	4.550	274,810.900	
	EUROCASH SA	7,580	39.000	295,620.000	
	GRUPA LOTOS SA	5,604	36.490	204,489.960	
	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	147,281	5.100	751,133.100	
	CYFROWY POLSAT SA	14,022	21.950	307,782.900	
	GRUPA AZOTY SA	4,565	71.290	325,438.850	
	ENEA SA	18,176	15.390	279,728.640	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	64,784	20.500	1,328,072.000	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	5.140	424,173.360	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	5,301	431.000	2,284,731.000	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,528	42.500	192,440.000	
GETIN NOBLE BANK SA	89,202	2.970	264,929.940		
ALIOR BANK SA	4,463	78.810	351,729.030		
ENERGA SA	11,023	20.680	227,955.640		
	ポーランド・ズロチ 小計	773,326		18,357,275.320	

(611,847,986)

マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	142,800	7.180	1,025,304.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	10,100	11.440	115,544.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	445,400	7.240	3,224,696.000	
	DIGI.COM BHD	285,000	5.690	1,621,650.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	57,600	8.390	483,264.000	
	RHB CAPITAL BHD	26,700	8.720	232,824.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	81,735	3.910	319,583.850	
	GAMUDA BHD	165,800	4.790	794,182.000	
	GENTING BHD	187,400	9.790	1,834,646.000	
	YTL CORP BHD	303,210	1.610	488,168.100	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,400	16.800	309,120.000	
	HONG LEONG BANK BHD	63,200	14.120	892,384.000	
	IJM CORP BHD	102,980	6.710	690,995.800	
	IOI CORP BHD	245,913	5.220	1,283,665.860	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	39,900	24.300	969,570.000	
	MALAYAN BANKING BHD	392,275	9.980	3,914,904.500	
	LAFARGE MALAYSIA BHD	60,500	10.640	643,720.000	
	MMC CORP BHD	51,000	2.500	127,500.000	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	85,100	5.060	430,606.000	
	MISC BHD	109,680	6.700	734,856.000	
	PPB GROUP BHD	38,000	14.960	568,480.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	24,900	22.600	562,740.000	
	PETRONAS GAS BHD	68,400	24.300	1,662,120.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	280,200	4.170	1,168,434.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	66.980	763,572.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	105,000	6.360	667,800.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	264,150	12.460	3,291,309.000	
	UMW HOLDINGS BHD	57,900	11.400	660,060.000	
	DIALOG GROUP BHD	190,300	3.840	730,752.000	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	221,300	20.060	4,439,278.000	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	169,063	1.500	253,594.500	
	AIRASIA BHD	83,400	2.300	191,820.000	
SIME DARBY BERHAD	272,400	9.650	2,628,660.000		
AXIATA GROUP BERHAD	241,400	6.900	1,665,660.000		
UEM SUNRISE BHD	145,600	2.060	299,936.000		
BUMI ARMADA BHD	120,700	3.170	382,619.000		
MAXIS BHD	175,900	6.700	1,178,530.000		

	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	257,900	6.760	1,743,404.000	
	SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	324,300	4.400	1,426,920.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	142,900	3.400	485,860.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	233,800	4.700	1,098,860.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	4.210	501,832.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	137,605	2.520	346,764.600	
	PUBLIC BANK BHD-RTS	22,130	5.950	131,673.500	
	マレーシア・リンギット 小計	6,582,541		46,987,862.710 (1,495,623,670)	
メキシコ・ペ ン	ALFA SAB DE CV	254,700	36.700	9,347,490.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,400	149.920	5,906,848.000	
	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV	34,700	48.900	1,696,830.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	18,300	149.990	2,744,817.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	167,100	34.980	5,845,158.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	233,000	89.060	20,750,980.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,800	39.860	5,971,028.000	
	GRUMA SAB DE CV	13,800	154.000	2,125,200.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	24,700	177.910	4,394,377.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	53,300	71.890	3,831,737.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	225,000	91.360	20,556,000.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	80,088	53.230	4,263,084.240	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,610	353.900	4,816,579.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	139,700	34.710	4,848,987.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	21,800	161.370	3,517,866.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	350,452	45.520	15,952,575.040	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,101,878	14.600	45,287,418.800	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	219,100	38.540	8,444,114.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	27,100	88.770	2,405,667.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	480,500	33.340	16,019,870.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,200	85.440	2,238,528.000	

	GENOMMA LAB INTERNACIONAL SAB DE CV	69,800	36.020	2,514,196.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	71,500	40.820	2,918,630.000	
	MINERA FRISCO SAB DE CV	74,900	26.340	1,972,866.000	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	130,900	27.880	3,649,492.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	44,300	42.980	1,904,014.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	43,400	33.890	1,470,826.000	
メキシコ・ペソ 小計		6,109,028		205,395,178.080 (1,604,136,340)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	206,279	1.500	309,418.500	
	ALPHA BANK A.E.	368,087	0.621	228,582.020	
	NATIONAL BANK OF GREECE	139,891	2.430	339,935.130	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,332	22.000	117,304.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	19,004	10.400	197,641.600	
	FOLLI FOLLIE SA	3,130	31.960	100,034.800	
	EUROBANK ERGASIAS	715,082	0.350	250,278.700	
	OPAP SA	19,320	12.000	231,840.000	
	JUMBO SA	10,590	10.900	115,431.000	
	PUBLIC POWER CORP	10,857	10.400	112,912.800	
ユーロ 小計		1,497,572		2,003,378.550 (276,145,698)	
韓国・ウォン	CHEIL COMMUNICATIONS INC	7,090	21,450.000	152,080,500.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	3,555	158,000.000	561,690,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,064	266,500.000	816,556,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	3,798	51,900.000	197,116,200.000	
	COWAY CO LTD	4,858	92,100.000	447,421,800.000	
	KT&G CORP	9,996	92,800.000	927,628,800.000	
	S-1 CORPORATION	1,432	77,400.000	110,836,800.000	
	KOREA GAS CORP	2,355	59,800.000	140,829,000.000	
	CJ CORP	1,359	149,000.000	202,491,000.000	
	CHEIL INDUSTRIES INC	4,098	70,200.000	287,679,600.000	
	DOOSAN INFRACORE CO.,LTD	10,180	13,000.000	132,340,000.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	9,480	25,100.000	237,948,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	864	239,000.000	206,496,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,426	87,500.000	212,275,000.000	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	20,370	9,250.000	188,422,500.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,442	163,000.000	235,046,000.000	
LG UPLUS CORP	19,290	9,040.000	174,381,600.000		

DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	33,300.000	134,865,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,500	9,380.000	117,250,000.000	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	38,700.000	168,383,700.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	883	435,000.000	384,105,000.000	
LG CHEM LTD	4,386	287,500.000	1,260,975,000.000	
LG CHEM LTD	480	199,000.000	95,520,000.000	
LS CORP	1,350	73,000.000	98,550,000.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,800	66,800.000	120,240,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	38,061	46,550.000	1,771,739,550.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	5,023	33,250.000	167,014,750.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	5,812	9,070.000	52,714,840.000	
S-OIL CORP	3,908	54,700.000	213,767,600.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,261	17,950.000	148,284,950.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,278	46,100.000	289,415,800.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,258	166,000.000	208,828,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,976	101,500.000	302,064,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,877	167,500.000	649,397,500.000	
HYUNDAI MOBIS	6,136	279,500.000	1,715,012,000.000	
SK HYNIX INC	51,200	49,300.000	2,524,160,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,782	61,500.000	417,093,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,167	149,500.000	323,966,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,863	228,500.000	3,167,695,500.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	987	135,500.000	133,738,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,364	70,600.000	449,298,400.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	17,110	12,950.000	221,574,500.000	
KCC CORP	490	632,000.000	309,680,000.000	
KIA MOTORS CORP	23,534	54,200.000	1,275,542,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	824	427,000.000	351,848,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,027	38,550.000	926,240,850.000	
HANWHA CORP	4,116	24,950.000	102,694,200.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,851	34,200.000	97,504,200.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	159,000.000	238,500,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,472	87,400.000	128,652,800.000	
KT CORP	5,458	30,350.000	165,650,300.000	

LG ELECTRONICS INC	9,874	73,500.000	725,739,000.000	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	28,810	12,000.000	345,720,000.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	71	1,962,000.000	139,302,000.000	
LG CORP	9,046	62,700.000	567,184,200.000	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,973	8,930.000	142,638,890.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	37,100.000	146,359,500.000	
NAVER CORP	2,540	807,000.000	2,049,780,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	39,700.000	129,858,700.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,551	135,500.000	210,160,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,730	43,900.000	163,747,000.000	
DOOSAN CORP	404	117,500.000	47,470,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	314	817,000.000	256,538,000.000	
KANGWON LAND INC	9,140	32,850.000	300,249,000.000	
POSCO	5,884	300,500.000	1,768,142,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,891	75,000.000	216,825,000.000	
SAMSUNG C&T CORP	11,085	71,800.000	795,903,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,024	166,500.000	503,496,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	5,014	58,300.000	292,316,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,040	1,306,000.000	13,112,240,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	14,050	26,100.000	366,705,000.000	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	4,103	50,800.000	208,432,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS- PFD	1,854	1,053,000.000	1,952,262,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	882	209,000.000	184,338,000.000	
HYOSUNG CORP	2,374	67,300.000	159,770,200.000	
ORION CORP	365	890,000.000	324,850,000.000	
YUHAN CORP	699	174,000.000	121,626,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,331	170,500.000	397,435,500.000	
HALLA CLIMATE CONTROL	4,350	49,800.000	216,630,000.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	28,450.000	162,449,500.000	
GS HOLDINGS CORP	4,288	43,800.000	187,814,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	21,408	32,350.000	692,548,800.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	11,250.000	115,650,000.000	
HITE JINRO CO LTD	220	20,850.000	4,587,000.000	
CELLTRION INC	5,987	44,850.000	268,516,950.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,146	36,600.000	920,343,600.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,245	272,000.000	338,640,000.000	

MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	2,981	48,350.000	144,131,350.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,217	294,500.000	358,406,500.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,638	99,400.000	560,417,200.000	
AMOREPACIFIC CORP	322	1,660,000.000	534,520,000.000	
SAMSUNG CARD CO	3,858	42,250.000	163,000,500.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,448	100,500.000	547,524,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	703	350,500.000	246,401,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	945	142,000.000	134,190,000.000	
SK C&C CO LTD	1,712	176,000.000	301,312,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	33,684	35,700.000	1,202,518,800.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,471	187,500.000	275,812,500.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	2,980	32,450.000	96,701,000.000	
BS FINANCIAL GROUP INC	16,320	15,500.000	252,960,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	18,670	6,380.000	119,114,600.000	
E-MART CO LTD	1,845	236,500.000	436,342,500.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	11,200	14,950.000	167,440,000.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,765	57,800.000	391,017,000.000	
BS FINANCIAL GROUP INC-RTS	2,768	2,150.000	5,951,200.000	
韓国・ウォン 小計	730,218		58,437,235,030.000 (5,849,567,227)	
香港・ドル				
JIANGXI COPPER CO LTD	133,000	13.240	1,760,920.000	
JIANGSU EXPRESS	110,000	9.670	1,063,700.000	
CHINA MOBILE LIMITED	550,000	76.250	41,937,500.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	122,000	28.400	3,464,800.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	280,000	3.940	1,103,200.000	
BEIJING ENTERPRISES	51,000	69.050	3,521,550.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	292,000	8.740	2,552,080.000	
CITIC 21CN CO LTD	230,000	5.910	1,359,300.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	180,000	5.860	1,054,800.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,500	83.000	5,436,500.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	80,800	16.070	1,298,456.000	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	286,000	4.720	1,349,920.000	
CNOOC LTD	1,596,000	13.440	21,450,240.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	282,000	15.460	4,359,720.000	

CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	154,000	6.290	968,660.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	375,120	20.150	7,558,668.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	192,000	15.180	2,914,560.000	
CITIC PACIFIC	133,000	13.880	1,846,040.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	5.380	699,400.000	
LENOVO GROUP LTD	582,000	10.580	6,157,560.000	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	95,000	3.280	311,600.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,890,000	9.800	18,522,000.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	416,742	12.360	5,150,931.120	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	79,000	14.760	1,166,040.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,289,200	7.240	16,573,808.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	72,000	55.350	3,985,200.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	280,000	12.120	3,393,600.000	
COSCO PACIFIC LTD	176,000	10.740	1,890,240.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	564,000	1.540	868,560.000	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	106,000	25.200	2,671,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	252,000	2.850	718,200.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	10.460	815,880.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	188,000	15.940	2,996,720.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	54,900	16.340	897,066.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	470,000	2.950	1,386,500.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	88,000	24.000	2,112,000.000	
BYD CO LTD	48,000	46.550	2,234,400.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,214,000	3.930	4,771,020.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	154,000	19.940	3,070,760.000	
CHINAVISION MEDIA GROUP LTD	470,000	1.670	784,900.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	251,000	11.420	2,866,420.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	197,000	4.060	799,820.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	278,158	11.640	3,237,759.120	

AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	176,000	4.400	774,400.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	189,200	22.900	4,332,680.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	96,500	29.750	2,870,875.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	668,000	20.850	13,927,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	661,000	1.780	1,176,580.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	8.310	1,329,600.000	
WEICHAI POWER CO LTD	42,360	30.450	1,289,862.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	363,000	2.270	824,010.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	38,000	24.400	927,200.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	21.600	3,888,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	32,000	59.950	1,918,400.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	248,000	8.920	2,212,160.000	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	118,000	21.400	2,525,200.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	164,000	8.490	1,392,360.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	260,000	6.390	1,661,400.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.990	563,170.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	126,000	35.750	4,504,500.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	465,500	122.200	56,884,100.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	175,000	59.100	10,342,500.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	382,000	5.300	2,024,600.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	953,240	1.260	1,201,082.400	
AIR CHINA / HONG KONG	168,000	4.610	774,480.000	
ZTE CORP	50,240	15.220	764,652.800	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	340,000	3.220	1,094,800.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	314,000	21.600	6,782,400.000	
COSCO HOLDINGS	174,500	3.080	537,460.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	754,205	5.190	3,914,323.950	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	162,000	13.460	2,180,520.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	70,500	50.000	3,525,000.000	

CHINA CONSTRUCTION BANK	6,471,530	5.570	36,046,422.100	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	60,000	28.000	1,680,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	248,000	14.020	3,476,960.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	124,000	5.630	698,120.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	190,000	5.310	1,008,900.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	298,000	7.130	2,124,740.000	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD	69,000	9.210	635,490.000	
BANK OF CHINA LTD	7,072,200	3.460	24,469,812.000	
SHUI ON LAND LTD	345,600	1.930	667,008.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	123,000	15.880	1,953,240.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	68,400	10.260	701,784.000	
CHINA BLUECHEMICAL LTD	184,000	4.160	765,440.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	418,970	14.740	6,175,617.800	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,587,235	4.990	32,870,302.650	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	3.650	765,040.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	417,000	5.510	2,297,670.000	
CHINA COAL ENERGY CO	308,000	4.180	1,287,440.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	17.100	1,179,900.000	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	46,000	26.250	1,207,500.000	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	120,000	7.280	873,600.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	82,000	21.400	1,754,800.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	215,800	3.080	664,664.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	459,509	3.350	1,539,355.150	
CHINA CITIC BANK-H	740,800	4.760	3,526,208.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	436,000	8.790	3,832,440.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	78,000	12.460	971,880.000	
FOSUN INTERNATIONAL	164,000	10.200	1,672,800.000	
FRANSHION PROPERTIES CHINA LTD	402,000	2.140	860,280.000	

SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	4.140	1,188,180.000	
SOHO CHINA LTD	208,500	6.140	1,280,190.000	
KINGSOFT CORP LTD	56,000	23.200	1,299,200.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	937,000	2.710	2,539,270.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	396,000	4.050	1,603,800.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	126,000	5.890	742,140.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	202,000	7.450	1,504,900.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	522,000	10.660	5,564,520.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	246,000	28.000	6,888,000.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	559,000	3.290	1,839,110.000	
CSR CORP LTD - H	227,000	6.700	1,520,900.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	230,500	8.670	1,998,435.000	
BBMG CORP	131,000	5.250	687,750.000	
SINOPHARM GROUP CO	90,400	22.200	2,006,880.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	258,000	5.230	1,349,340.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	229,805	9.560	2,196,935.800	
YINGDE GASES	83,000	8.350	693,050.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	139,000	3.540	492,060.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	280,000	7.840	2,195,200.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	74,500	16.060	1,196,470.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	396,000	5.010	1,983,960.000	
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	15,500	40.800	632,400.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	120,480	4.610	555,412.800	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	135,500	10.060	1,363,130.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	69,200	27.100	1,875,320.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	581,880	7.100	4,131,348.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	172,000	3.420	588,240.000	

	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,921,000	3.530	6,781,130.000	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	86,000	9.990	859,140.000	
	FAR EAST HORIZON LTD	146,000	5.870	857,020.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	109,000	17.680	1,927,120.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD	126,000	12.400	1,562,400.000	
	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	49,400	15.900	785,460.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	405,000	3.090	1,251,450.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	27.000	904,500.000	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	82,500	8.620	711,150.000	
	HANERGY SOLAR GROUP LTD	1,056,000	1.220	1,288,320.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	404,000	1.770	715,080.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	449,000	4.010	1,800,490.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	112,261	15.500	1,740,045.500	
	香港・ドル 小計	61,110,235		536,033,175.190 (7,011,313,931)	
台湾・ドル	ACER INC	203,069	22.100	4,487,824.900	
	ASUSTEK COMPUTER INC	61,554	327.500	20,158,935.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	48,616	95.100	4,623,381.600	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	566,729	39.950	22,640,823.550	
	ASIA CEMENT CORP	251,891	41.550	10,466,071.050	
	TAIWAN BUSINESS BANK	261,498	9.500	2,484,231.000	
	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS CORP	1,914	374.500	716,793.000	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	55,000	59.500	3,272,500.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	48.500	3,783,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	138,210	28.700	3,966,627.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	51,853	83.500	4,329,725.500	
	QUANTA COMPUTER INC	230,858	87.400	20,176,989.200	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	16,600	67.800	1,125,480.000	
	EVA AIRWAYS CORP	58,227	14.550	847,202.850	

CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	282.500	15,752,200.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	446,357	19.000	8,480,783.000	
CHINA AIRLINES	232,156	10.200	2,367,991.200	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	148,169	77.800	11,527,548.200	
CHINA STEEL CORP	1,074,155	25.100	26,961,290.500	
CHINA MOTORS CO	57,000	30.000	1,710,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	238,344	29.050	6,923,893.200	
ADVANTECH CO LTD	32,251	247.000	7,965,997.000	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO LTD	23,460	40.850	958,341.000	
CLEVO CO	48,424	52.700	2,551,944.800	
COMPAL ELECTRONICS INC	349,304	25.950	9,064,438.800	
CTCI CORP	39,000	51.200	1,996,800.000	
DELTA ELECTRONICS INC	164,448	208.000	34,205,184.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	365,327	96.000	35,071,392.000	
AU OPTRONICS CORP	707,194	13.200	9,334,960.800	
TAIWAN MOBILE CO LTD	160,800	90.800	14,600,640.000	
EVERGREEN MARINE CORP	206,399	16.900	3,488,143.100	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORES CO LTD	179,781	28.650	5,150,725.650	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	262,807	32.800	8,620,069.600	
ECLAT TEXTILE CO LTD	16,000	338.000	5,408,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,285	154.500	9,005,032.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	369,633	77.500	28,646,557.500	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	89,000	33.000	2,937,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	279,594	71.500	19,990,971.000	
TRANSCEND INFORMATION INC	22,897	107.500	2,461,427.500	
EPISTAR CORP	90,149	77.300	6,968,517.700	
GIANT MANUFACTURING	32,151	238.500	7,668,013.500	
MEDIATEK INC	127,507	515.000	65,666,105.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	660,936	45.700	30,204,775.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	483,782	18.850	9,119,290.700	
HOTAI MOTOR CO LTD	23,000	387.000	8,901,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	151,000	68.000	10,268,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	29,088	182.500	5,308,560.000	

YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	893,600	16.600	14,833,760.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	717,067	48.300	34,634,336.100	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,166,403	9.720	11,337,437.160	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	460,469	19.300	8,887,051.700	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,004,769	108.500	109,017,436.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	833,075	25.400	21,160,105.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	2,480.000	22,865,600.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	568,300	15.950	9,064,385.000	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	591,213	9.460	5,592,874.980	
INVENTEC CO LTD	211,005	30.100	6,351,250.500	
HTC CORPORATION	66,832	134.500	8,988,904.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	192,014	54.300	10,426,360.200	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	43,496	141.500	6,154,684.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	518,967	14.000	7,265,538.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,184,943	20.600	24,409,825.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	625,975	19.450	12,175,213.750	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	19,000	215.000	4,085,000.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,560	54.000	2,568,240.000	
NAN YA PLASTICS CORP	420,828	71.000	29,878,788.000	
WISTRON CORP	177,481	30.100	5,342,178.100	
KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	31,020	132.500	4,110,150.000	
POU CHEN CORP	201,990	33.400	6,746,466.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	388,841	57.000	22,163,937.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	54,392	240.000	13,054,080.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	97,480	75.900	7,398,732.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	14,658	235.500	3,451,959.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	34,569	56.900	1,966,976.100	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	52,715	78.600	4,143,399.000	

	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	84,886	75.000	6,366,450.000	
	SILICONWARE PRECISION INDS	268,743	50.300	13,517,772.900	
	STANDARD FOODS CORP	32,628	82.100	2,678,758.800	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	127,666	48.100	6,140,734.600	
	TAIWAN CEMENT CORP	330,874	45.700	15,120,941.800	
	TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP	61,301	25.000	1,532,525.000	
	TSRC CORP	67,790	42.800	2,901,412.000	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	181,000	34.500	6,244,500.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,236,083	134.500	300,753,163.500	
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	51,000	50.300	2,565,300.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,109,525	15.700	17,419,542.500	
	WALSIN LIHWA CORP	215,000	11.400	2,451,000.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	86,668	12.250	1,061,683.000	
	YULON MOTOR CO	93,149	49.150	4,578,273.350	
	INOTERA MEMORIES INC	200,000	60.500	12,100,000.000	
	INNOLUX CORPORATION	571,410	14.800	8,456,868.000	
	WPG HOLDINGS CO LTD	111,526	42.100	4,695,244.600	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,936	341.000	6,457,176.000	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	1,300.000	3,900,000.000	
	PEGATRON CORP	149,554	59.600	8,913,418.400	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	86,500	75.500	6,530,750.000	
	SCINOPHARM TAIWAN LTD	27,520	72.300	1,989,696.000	
	TPK HOLDING CO LTD	24,494	269.500	6,601,133.000	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	141,000	17.900	2,523,900.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	14,385	100.000	1,438,500.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	486,666	17.350	8,443,655.100	
	台湾・ドル 小計	26,657,363		1,395,822,244.540 (4,731,837,410)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	7.450	838,393.200	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	8,785	187.570	1,647,802.450	
	BARLOWORLD LTD	18,561	99.860	1,853,501.460	
	BIDVEST GROUP LTD	27,094	281.720	7,632,921.680	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	42,285	74.350	3,143,889.750	

STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	149,847	55.350	8,294,031.450	
ASSORE LTD	3,722	362.000	1,347,364.000	
DISCOVERY LTD	27,542	95.830	2,639,349.860	
REDEFINE PROPERTIES LTD	299,835	9.350	2,803,457.250	
MASSMART HOLDINGS LTD	10,432	140.000	1,460,480.000	
GOLD FIELDS LTD	63,646	43.570	2,773,056.220	
REMGRO LTD	47,779	227.040	10,847,744.160	
THE FOSCHINI GROUP LTD	19,461	113.200	2,202,985.200	
NORTHAM PLATINUM LTD	35,773	44.970	1,608,711.810	
MMI HOLDINGS LTD	91,004	25.710	2,339,712.840	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	203,661	24.280	4,944,889.080	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,073	35.100	1,406,562.300	
EXXARO RESOURCES LTD	12,410	137.860	1,710,842.600	
LIBERTY HOLDINGS LTD	11,685	127.180	1,486,098.300	
MTN GROUP LTD	151,991	220.000	33,438,020.000	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,495	196.360	7,166,158.200	
FIRSTRAND LTD	300,784	40.750	12,256,948.000	
NASPERS LTD	35,696	1,288.950	46,010,359.200	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	22,337	95.500	2,133,183.500	
NEDBANK GROUP LTD	17,567	232.500	4,084,327.500	
NETCARE LTD	76,295	30.250	2,307,923.750	
PICK'N PAY STORES LTD	27,363	56.990	1,559,417.370	
RMB HOLDINGS LTD	78,470	52.800	4,143,216.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,114	478.130	2,923,286.820	
SAPPI LTD	47,232	41.530	1,961,544.960	
SASOL LTD	49,378	619.010	30,565,475.780	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,558	157.320	6,380,584.560	
MR PRICE GROUP LTD	23,912	187.250	4,477,522.000	
STANDARD BANK GROUP LTD	105,864	144.500	15,297,348.000	
SPAR GROUP LTD/THE	13,119	124.110	1,628,199.090	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,570	78.250	6,069,852.500	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	19,114	187.260	3,579,287.640	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,113	283.920	7,981,842.960	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	29,034	160.750	4,667,215.500	
TIGER BRANDS LTD	13,044	297.030	3,874,459.320	
NAMPAK LTD	60,915	37.750	2,299,541.250	
SANLAM LTD	164,935	61.800	10,192,983.000	

MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	33,048	84.550	2,794,208.400	
INVESTEC LTD	21,693	95.400	2,069,512.200	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	49,265	109.010	5,370,377.650	
KUMBA IRON ORE LTD	4,785	344.350	1,647,714.750	
PPC LTD	69,881	30.800	2,152,334.800	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	85,791	42.270	3,626,385.570	
RMI HOLDINGS	60,982	32.000	1,951,424.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	34,684	127.590	4,425,331.560	
南アフリカ・ランド 小計	3,012,160		300,017,779.440 (2,844,168,550)	
合計	150,175,699		37,495,144,475 (37,495,144,475)	

(2) 株式以外の有価証券

平成26年7月11日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI QATAR CAPPED ETF	58,100.000	1,442,042.000	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	60,000.000	1,372,800.000	
	アメリカ・ドル	小計	118,100.000	2,814,842.000 (285,340,534)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,082,066.000	18,763,024.440	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	172,200.000	20,963,628.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,254,266.000	39,726,652.440 (310,265,156)	
投資信託受益証券	合計		1,372,366	595,605,690 (595,605,690)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	173,951.000	462,709.660	
		トルコ・リラ	小計	173,951.000	462,709.660 (22,117,522)
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	188,300.000	8,464,085.000	
	メキシコ・ペソ	小計	188,300.000	8,464,085.000 (66,104,504)	
投資証券	合計		362,251	88,222,026 (88,222,026)	
合計				683,827,716 (683,827,716)	

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、内数で表示してあります。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式	38銘柄	8.14%	-%	-%
	投資信託 受益証券	2銘柄	-%	0.71%	-%
インド・ルピー	株式	68銘柄	6.41%	-%	-%
インドネシア・ルピア	株式	30銘柄	2.57%	-%	-%
タイ・バーツ	株式	30銘柄	2.14%	-%	-%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.21%	-%	-%
トルコ・リラ	株式	24銘柄	1.54%	-%	-%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.06%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.21%	-%	-%
フィリピン・ペソ	株式	20銘柄	0.95%	-%	-%
ブラジル・レアル	株式	74銘柄	10.52%	-%	-%
ポーランド・ズロチ	株式	23銘柄	1.53%	-%	-%
マレーシア・リングギット	株式	44銘柄	3.74%	-%	-%
メキシコ・ペソ	株式	27銘柄	4.01%	-%	-%
	投資信託 受益証券	2銘柄	-%	0.78%	-%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.17%
ユーロ	株式	10銘柄	0.69%	-%	-%
韓国・ウォン	株式	105銘柄	14.63%	-%	-%
香港・ドル	株式	140銘柄	17.53%	-%	-%
台湾・ドル	株式	101銘柄	11.83%	-%	-%
南アフリカ・ランド	株式	50銘柄	7.11%	-%	-%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		935,551,132	695,144,472
コール・ローン		155,668,597	32,310,039
国債証券		33,982,851,042	38,125,585,732
派生商品評価勘定		-	14,400
未収入金		-	263,792,617
未収利息		654,823,508	664,145,508
前払費用		14,320,492	57,080,161
流動資産合計		35,743,214,771	39,838,072,929
資産合計		35,743,214,771	39,838,072,929
負債の部			
流動負債			
未払解約金		4,583,000	19,209,000
流動負債合計		4,583,000	19,209,000
負債合計		4,583,000	19,209,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	25,243,130,380	26,672,684,439
剰余金			
剰余金又は欠損金()		10,495,501,391	13,146,179,490
元本等合計		35,738,631,771	39,818,863,929
純資産合計		35,738,631,771	39,818,863,929
負債純資産合計		35,743,214,771	39,838,072,929

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	25,941,870,874円	25,243,130,380円
同期中追加設定元本額	399,969,306円	4,740,786,516円
同期中一部解約元本額	1,098,709,800円	3,311,232,457円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,290,175円	49,967,584円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	4,487,571円	5,374,082円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	8,312,309円	13,607,019円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	21,137,131円	37,700,639円
投資のソムリエ	111,323,605円	555,755,277円
クルーズコントロール	53,525,426円	314,530,561円
投資のソムリエ<DC年金>	1,280,751円	5,253,529円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	358,267円	5,416,583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	321,885,428円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	- 円	1,018,806,995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)	835,800,885円	861,528,632円
エマージング債券パッシブファンドV A(適格機関投資家専用)	5,153,890,667円	4,776,036,590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)	11,458,441,241円	10,633,051,837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)	7,073,097,903円	6,611,007,867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)	166,299,021円	1,061,729,208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)	- 円	401,032,608円
計	25,243,130,380円	26,672,684,439円
2 . 受益権の総数	25,243,130,380口	26,672,684,439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25年10月31日 至 平成26年1月14日	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(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。
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。	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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,187,953,904	828,917,082
合計	4,187,953,904	828,917,082

(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25年4月19日から平成26年1月14日まで及び平成26年4月19日から平成26年7月11日まで)に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年1月14日 現在				平成26年7月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	202,734,400	-	202,720,000	14,400
アメリカ・ドル	-	-	-	-	202,734,400	-	202,720,000	14,400
合計	-	-	-	-	202,734,400	-	202,720,000	14,400

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年1月14日現在	平成26年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.4158円	1.4929円
（1万口当たり純資産額）	（14,158円）	（14,929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26年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 10.125 05/15/27	1,800,000.000	2,842,920.000	
		BRAZIL 11.0 08/17/40	2,200,000.000	2,460,040.000	
		BRAZIL 2.625 01/05/23	2,000,000.000	1,837,000.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	2,800,000.000	2,820,300.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	4,200,000.000	4,578,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	3,600,000.000	3,852,000.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	2,100,000.000	2,402,400.000	
		BRAZIL 6.0 01/17/17	3,400,000.000	3,779,780.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	4,000,000.000	5,020,000.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	2,600,000.000	3,546,400.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,500,000.000	3,478,750.000	
		BRAZIL 8.875 04/15/24	2,500,000.000	3,477,250.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	2,200,000.000	2,838,000.000	
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,289,700.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,900,000.000	1,769,850.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	2,100,000.000	2,153,550.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	2,900,000.000	3,104,450.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	2,500,000.000	2,793,750.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	4,200,000.000	5,019,000.000	
		COLOMBIA 7.375 01/27/17	2,650,000.000	3,046,175.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	4,100,000.000	4,971,250.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	2,600,000.000	3,523,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	1,800,000.000	2,396,700.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	1,700,000.000	1,761,625.000	
		CROATIA 6.25 04/27/17	1,900,000.000	2,059,125.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	1,700,000.000	1,862,350.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	2,000,000.000	2,226,000.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	1,600,000.000	1,788,240.000	
		HUNGARY 4.125 02/19/18	1,500,000.000	1,560,000.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	2,500,000.000	2,673,450.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	2,000,000.000	2,177,500.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	2,700,000.000	3,054,375.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	3,900,000.000	4,450,875.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	1,600,000.000	2,034,000.000	
INDONESIA 11.625 03/04/19		1,800,000.000	2,447,280.000		
INDONESIA 3.375 04/15/23		2,100,000.000	1,976,625.000		
INDONESIA 3.75 04/25/22		2,300,000.000	2,256,875.000		

INDONESIA 4.625 04/15/43	1,500,000.000	1,342,500.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	2,300,000.000	2,432,250.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	2,600,000.000	2,535,000.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,000,000.000	1,081,250.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,800,000.000	3,117,660.000	
INDONESIA 6.625 02/17/37	1,700,000.000	1,925,590.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	3,000,000.000	3,429,150.000	
INDONESIA 6.875 03/09/17	1,250,000.000	1,408,625.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,700,000.000	3,418,740.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	1,600,000.000	2,152,720.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	3,500,000.000	3,906,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	4,000,000.000	4,925,600.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,900,000.000	2,419,650.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	2,200,000.000	3,134,802.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,900,000.000	2,832,900.000	
PERU 5.625 11/18/50	2,800,000.000	3,137,820.000	
PERU 6.55 03/14/37	2,100,000.000	2,609,460.000	
PERU 7.125 03/30/19	2,000,000.000	2,440,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	4,100,000.000	5,411,180.000	
PERU 8.375 05/03/16	1,200,000.000	1,350,276.000	
PERU 8.75 11/21/33	4,000,000.000	6,100,000.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	1,800,000.000	2,830,500.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	1,900,000.000	2,010,789.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	1,500,000.000	1,659,375.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	1,900,000.000	2,196,875.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	1,600,000.000	1,976,000.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,200,000.000	4,036,000.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	1,700,000.000	2,031,500.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	2,700,000.000	3,729,375.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	900,000.000	1,147,500.000	
PHILIPPINES 9.375 01/18/17	500,000.000	598,830.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	2,100,000.000	3,294,375.000	

PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,500,000.000	1,987,500.000	
REPUBLIC OF LITHUANIA 7.375 02/11/20	3,000,000.000	3,675,000.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	1,500,000.000	1,543,560.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	1,200,000.000	1,279,500.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	1,200,000.000	1,368,000.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	3,000,000.000	3,581,250.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	4,000,000.000	4,295,400.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	16,371,500.000	19,050,695.890	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	5,600,000.000	7,352,520.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	3,500,000.000	6,093,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17	4,000,000.000	4,154,200.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	1,000,000.000	1,018,760.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	3,000,000.000	3,093,750.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	4,600,000.000	4,795,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	3,600,000.000	3,792,960.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	1,600,000.000	1,720,000.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	1,900,000.000	1,933,250.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	3,100,000.000	3,386,750.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,000,000.000	1,112,500.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	800,000.000	917,000.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,300,000.000	2,659,375.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	1,700,000.000	2,901,220.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	2,000,000.000	1,855,500.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	1,900,000.000	1,797,875.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,584,870.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	2,700,000.000	2,966,625.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	3,000,000.000	3,300,000.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	3,400,000.000	3,659,250.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	3,000,000.000	3,397,500.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	2,000,000.000	2,259,600.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	2,100,000.000	2,469,075.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	2,900,000.000	3,422,000.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	3,100,000.000	3,579,725.000	

	TURKEY 7.0 06/05/20	2,100,000.000	2,451,750.000	
	TURKEY 7.0 09/26/16	3,000,000.000	3,318,900.000	
	TURKEY 7.25 03/05/38	1,300,000.000	1,613,300.000	
	TURKEY 7.375 02/05/25	3,900,000.000	4,744,350.000	
	TURKEY 7.5 07/14/17	2,800,000.000	3,189,900.000	
	TURKEY 7.5 11/07/19	1,800,000.000	2,138,400.000	
	TURKEY 8.0 02/14/34	1,900,000.000	2,510,375.000	
	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16	3,000,000.000	3,640,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	500,000.000	517,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	3,400,000.000	3,507,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	4,600,000.000	4,810,450.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	6,300,000.000	6,353,550.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	2,800,000.000	3,158,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	3,000,000.000	3,391,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17	3,300,000.000	3,664,650.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	4,200,000.000	4,462,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	4,000,000.000	4,634,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,200,000.000	6,253,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	3,300,000.000	4,203,870.000	
	UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	800,000.000	1,098,160.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	1,700,000.000	2,486,250.000	
	アメリカ・ドル 小計	320,771,500.000 (32,516,606,955)	376,103,242.890 (38,125,585,732)	
国債証券 合計		32,516,606,955 (32,516,606,955)	38,125,585,732 (38,125,585,732)	
合計		32,516,606,955 (32,516,606,955)	38,125,585,732 (38,125,585,732)	

(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、内数で表示してあります。

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 123銘柄	95.75%	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26年7月31日現在

資産総額	92,553,885円
負債総額	141,742円
純資産総額（ - ）	92,412,143円
発行済数量	88,966,759口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0387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26年7月31日現在

資産総額	325,902,663,835円
負債総額	2,460,438,300円
純資産総額（ - ）	323,442,225,535円
発行済数量	178,144,806,614口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8156円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	444,139,062,562円
負債総額	6,389,758,000円
純資産総額（ - ）	437,749,304,562円
発行済数量	363,947,069,364口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2028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26年7月31日現在

資産総額	33,423,981,537円
負債総額	165,282,700円
純資産総額（ - ）	33,258,698,837円
発行済数量	22,539,887,240口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4755円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	310,229,829,915円
負債総額	262,974,776円
純資産総額（ - ）	309,966,855,139円
発行済数量	126,493,028,580口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4505円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	28,248,347,472円
負債総額	20,972,000円
純資産総額（ - ）	28,227,375,472円
発行済数量	30,275,680,851口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9323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26年7月31日現在

資産総額	175,418,220,201円
負債総額	1,217,855,248円
純資産総額（ - ）	174,200,364,953円
発行済数量	138,725,910,553口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2557円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	40,588,206,809円
負債総額	292,836,624円
純資産総額（ - ）	40,295,370,185円
発行済数量	39,843,990,628口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0113円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	40,524,957,548円
負債総額	45,157,290円
純資産総額（ - ）	40,479,800,258円
発行済数量	26,609,551,554口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5213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。

第二部【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。

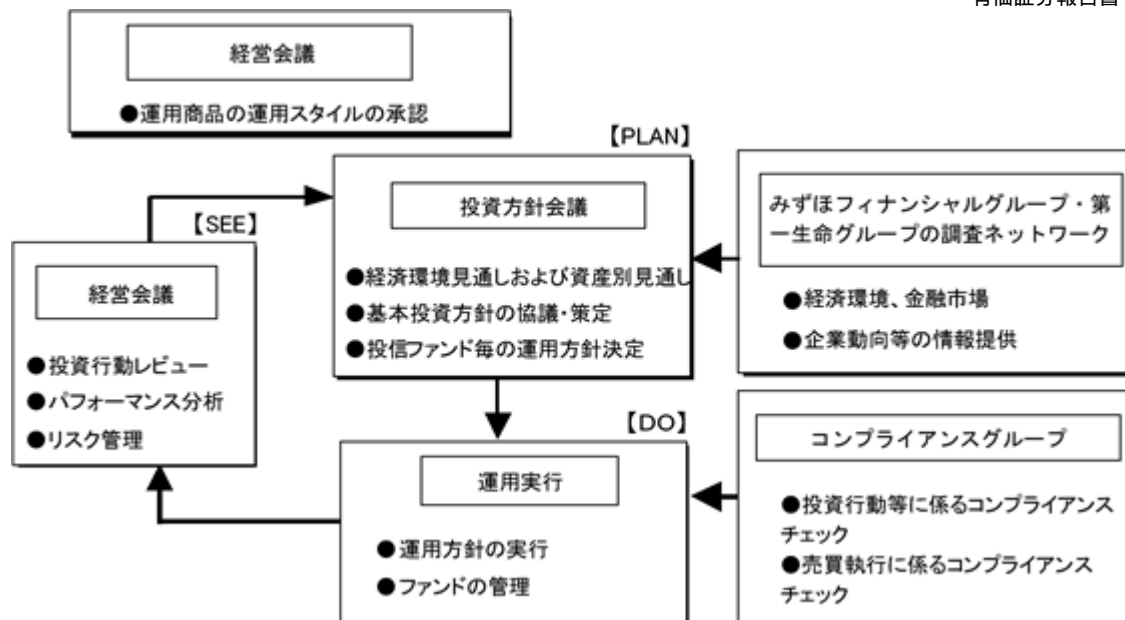
投資運用の意思決定機構

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26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26年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は331本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	7	20,000,365,251
追加型株式投資信託	310	5,099,223,501,944
単位型公社債投資信託	14	142,300,010,495
追加型公社債投資信託	0	0
合計	331	5,261,523,877,690

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。以下「財務諸表等規則」という。）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。
なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。
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29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

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

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

（単位：千円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

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

（3）当該会計基準等の適用による影響

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第28期(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第28期（平成25年3月31日現在）

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第28期(平成25年3月31日現在)

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

第29期(平成26年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

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

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

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第28期（平成25年3月31日現在）

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

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

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

1.5%

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

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

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成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26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。
第一生命保険株式会社	210,200	日本において保険業務を営んでおります。

*平成26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【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書類名	提出年月日
有価証券報告書	平成26年4月14日
有価証券届出書の訂正届出書	平成26年4月14日

独立監査人の監査報告書

平成26年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26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

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ＜DC年金＞の平成26年1月15日から平成26年7月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ＜DC年金＞の平成26年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。