

【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28年4月12日
【計算期間】	第5計算期間 (自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12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 恵正
【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、委託会社と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を約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

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

運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

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

■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

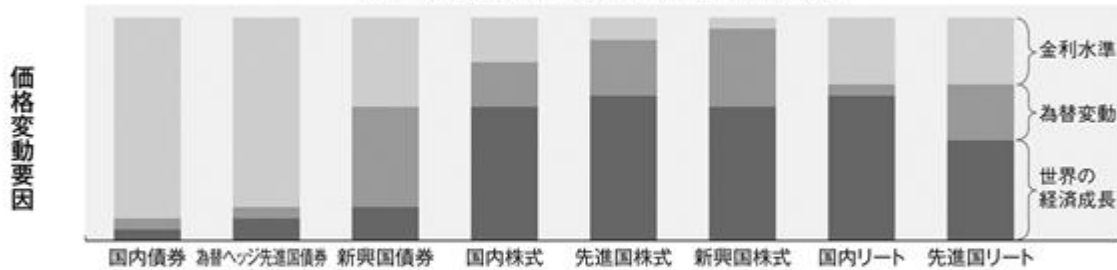
基本配分戦略

(月次戦略)

資産価格は様々な要因により変動し、またその要因も刻々と変化していきます。
当ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、これを分散させることで、
各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率を決定します。

基本配分比率決定のイメージ

各資産における価格変動要因と要因の比率(例)

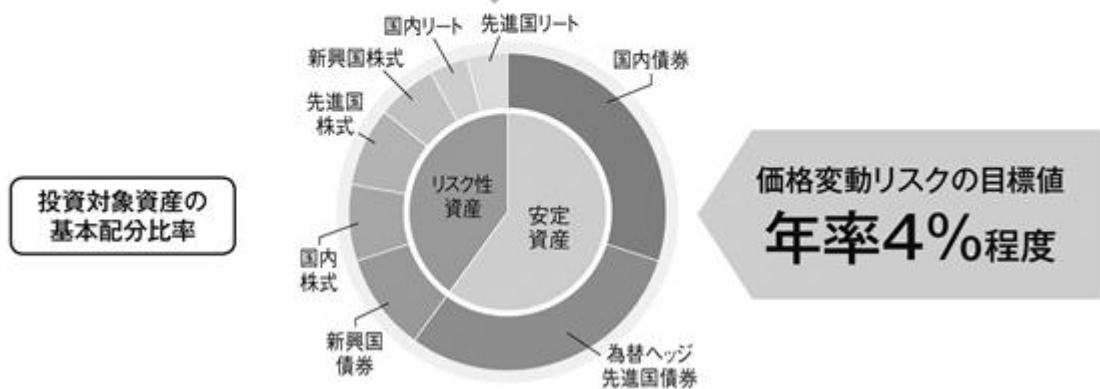


価格変動要因の比率を均等に配分



着目する価格変動要因は
各時点において適宜変更します。

価格変動要因の分散から最適な資産配分の比率を決定



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

機動的配分戦略

（日次戦略）

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

*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等です。

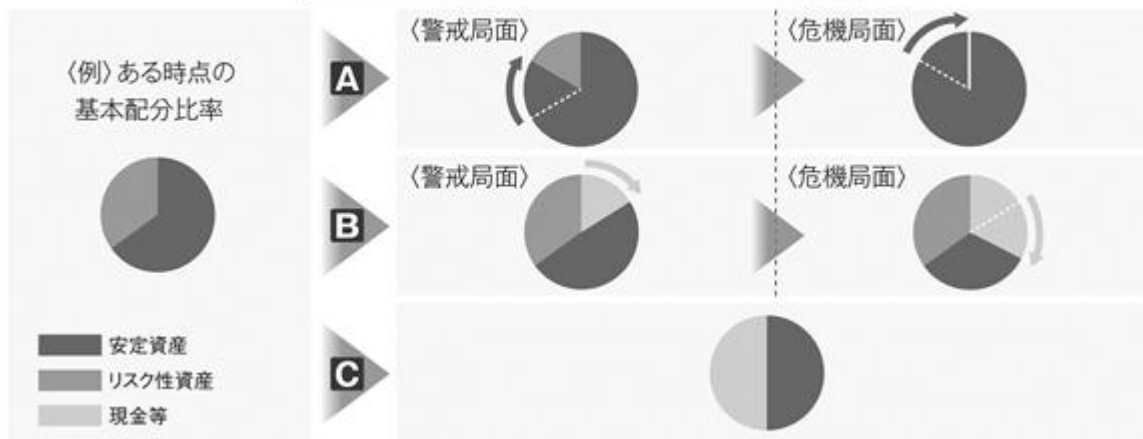
投資行動

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

※2016年1月末時点

※各投資行動は基本配分比率に対するものです。

（ご参考）配分比率変更のイメージ



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

投資対象資産

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

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

リスク性資産

分配方針

年2回の決算時(毎年1月11日および7月11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

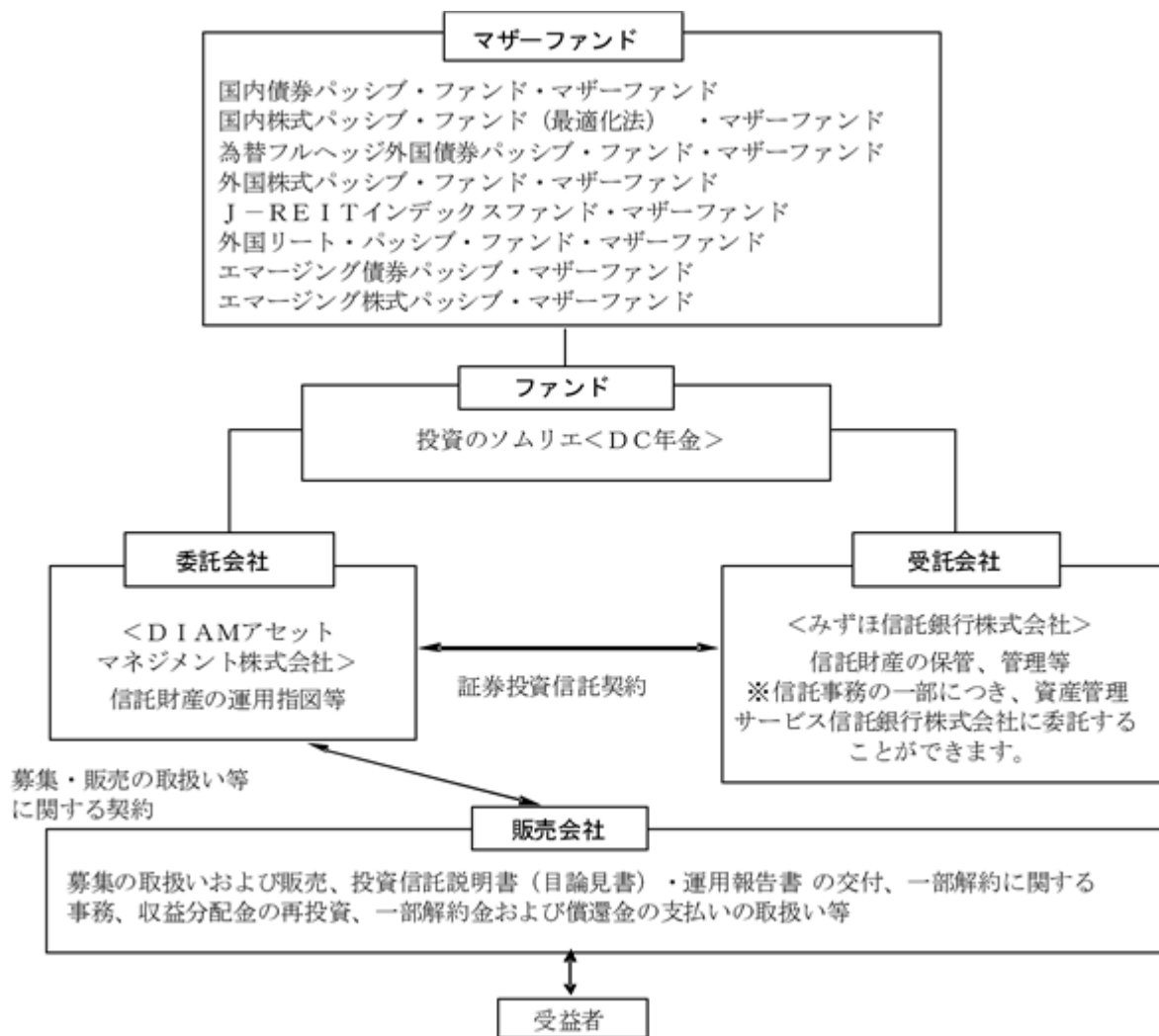
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

（２）【ファンドの沿革】

平成25年10月31日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

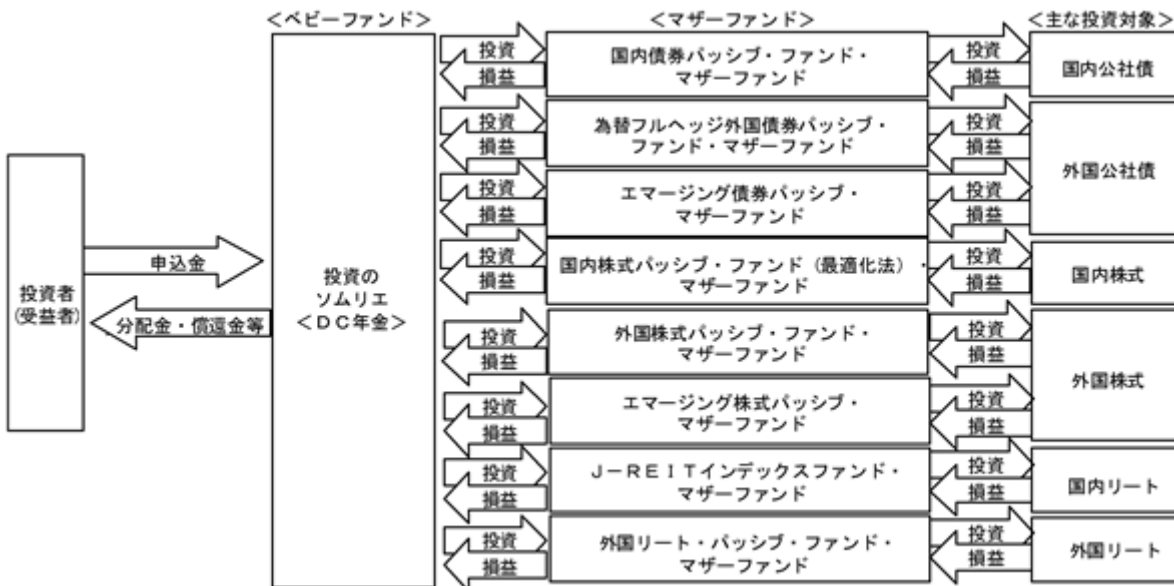
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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

委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成28年1月29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28年1月29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、委託会社はその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

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

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

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

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

基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

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

・基本配分戦略は月次で行います。

機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

・機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

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

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

23.外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

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

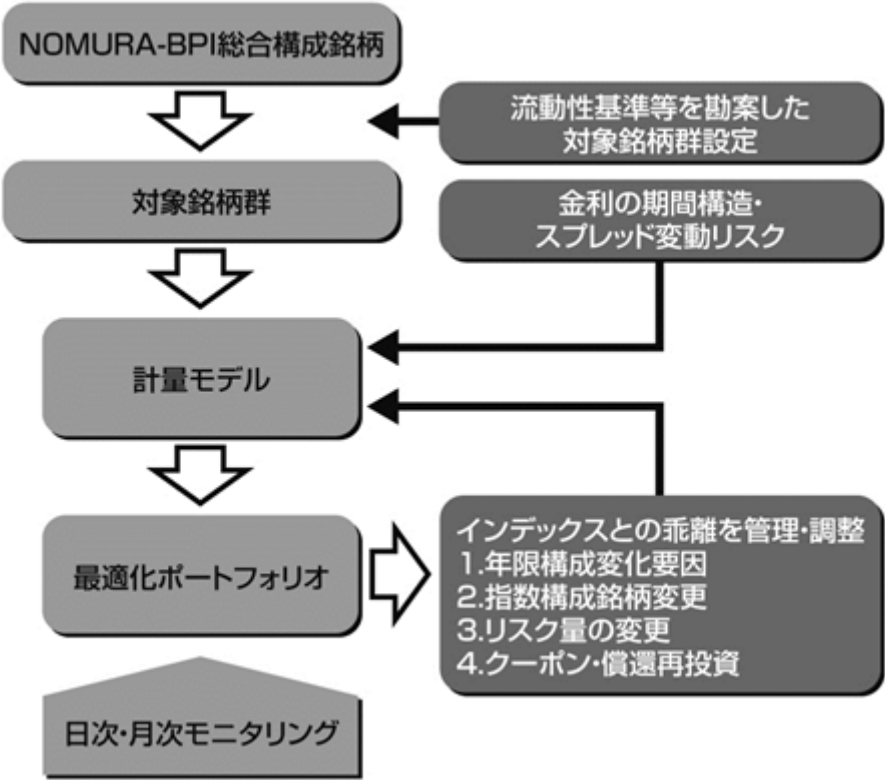
運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

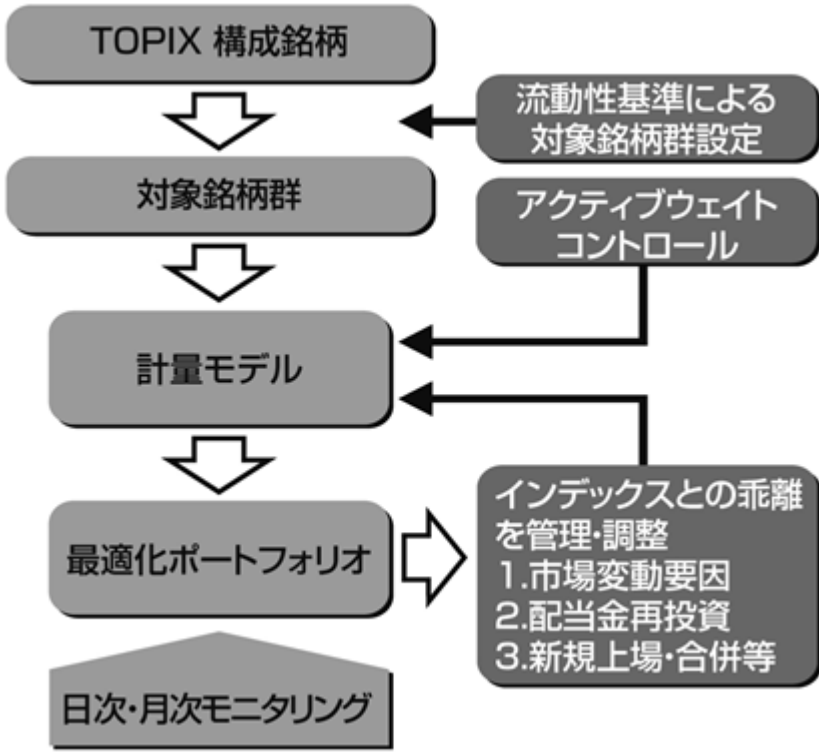
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があ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

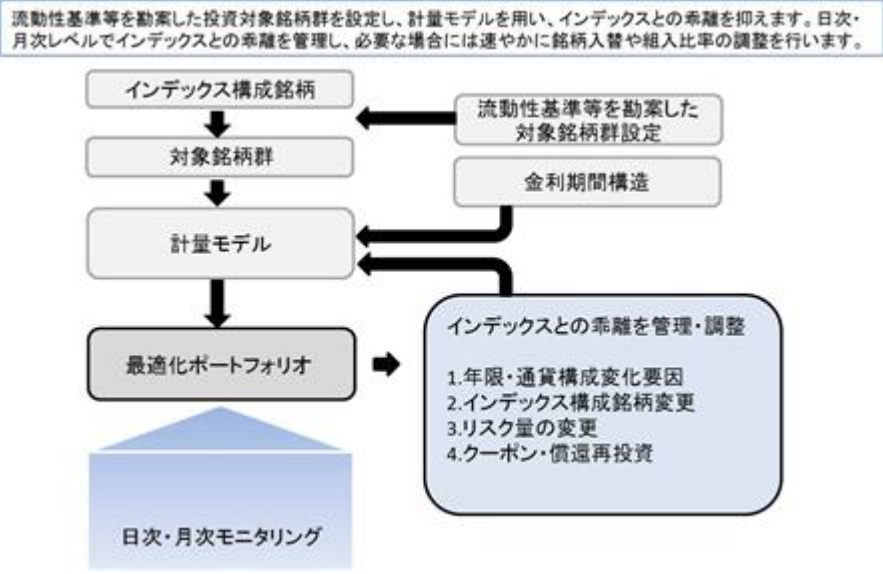
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p>  <pre> graph TD A[NOMURA-BPI総合構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[金利の期間構造・スプレッド変動リスク] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限構成変化要因 2.指数構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
--------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

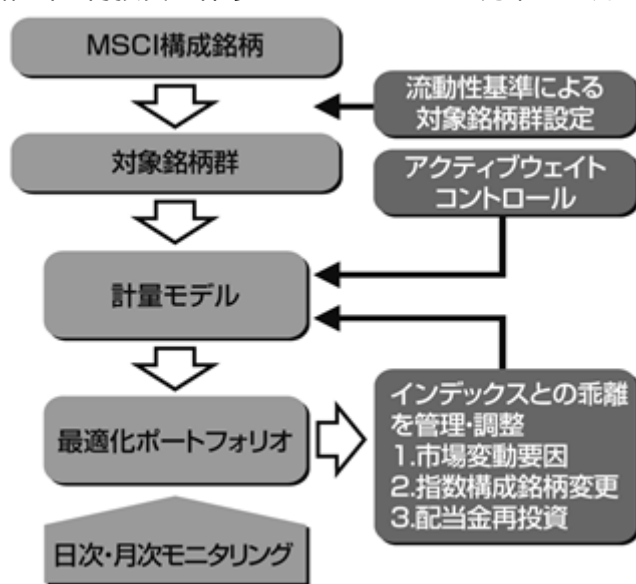
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 <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;"> シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。 </div>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] subgraph H [] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>
主な投資制限	<p>1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3.同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4.同一銘柄の転換社債等への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5.外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

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

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

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

投資態度

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

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

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

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

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

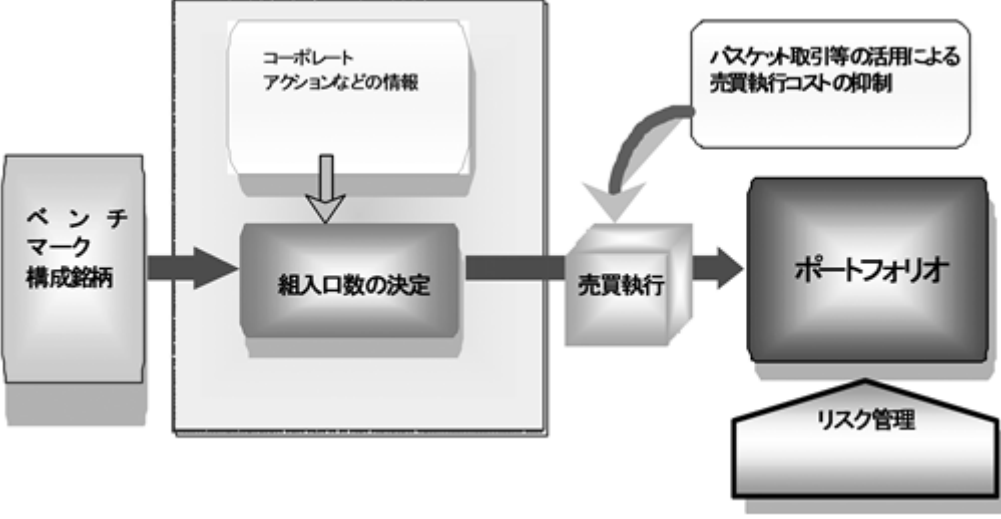
当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

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

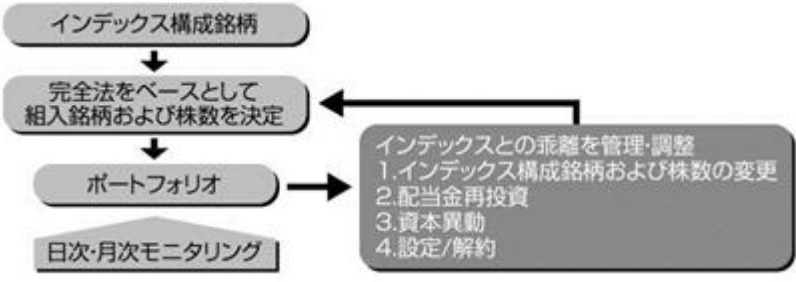
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。

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

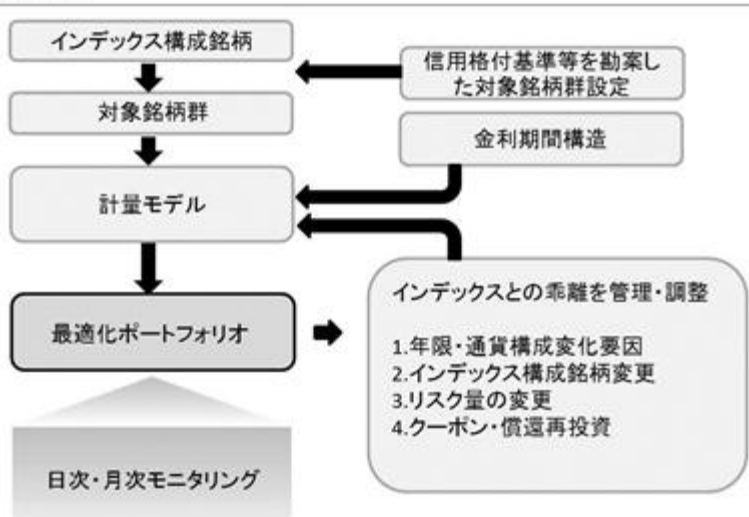
Standard & Poor's®並びに S&P®は、スタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、委託会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P 先進国 REIT インデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、委託会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・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

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

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくは委託会社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、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・

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

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

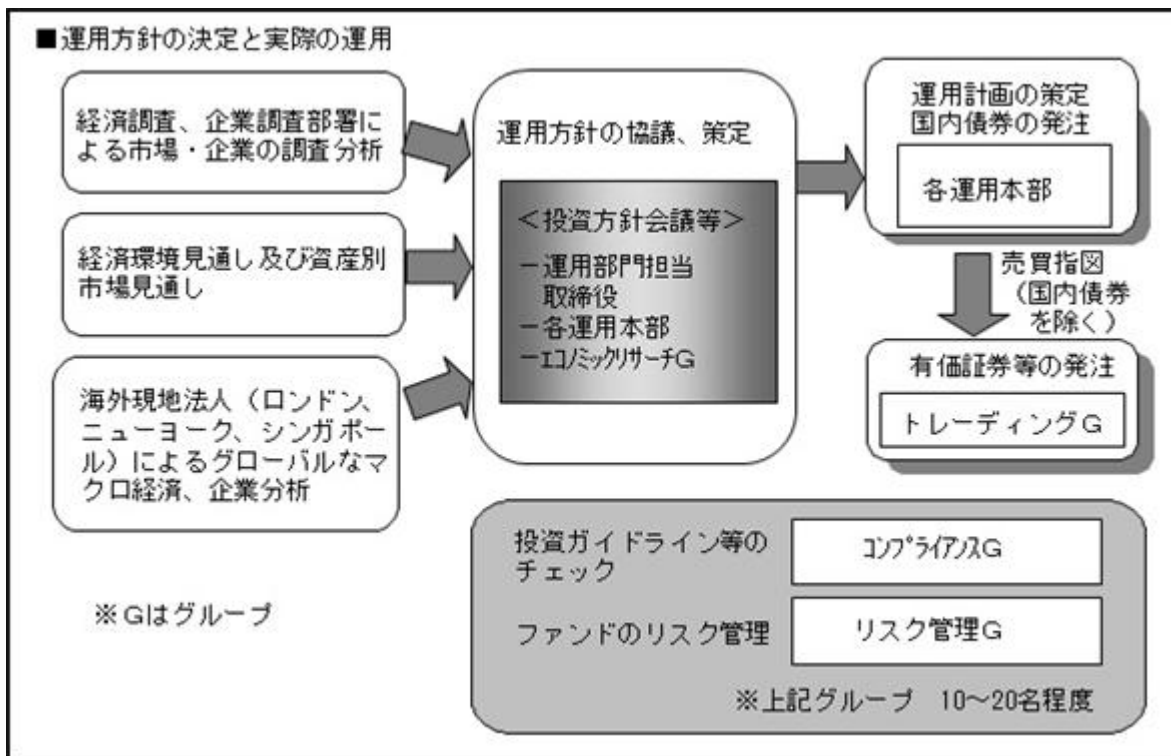
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはM o o d y ' sの外貨建て長期格付がB B - 格もしくはB a 3 格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <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> </div>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> C subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>

主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマーキング・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マーキング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D D --> F[インデックスとの乖離を管理・調整
1.市場変動要因
2.指数構成銘柄変更
3.配当金再投資] F --> D G[日次・月次モニタリング] --> D </pre>
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】



経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部の運用担当者、エコ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。

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

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

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成28年1月29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ます。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲(約款第21条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

らびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図（約款第23条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

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

外国為替予約取引の指図（約款第27条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第33条）

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

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

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

株価変動リスク

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

金利リスク

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

リートの価格変動リスク

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

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

為替リスク

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

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

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

< その他の留意点 >

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

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

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

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

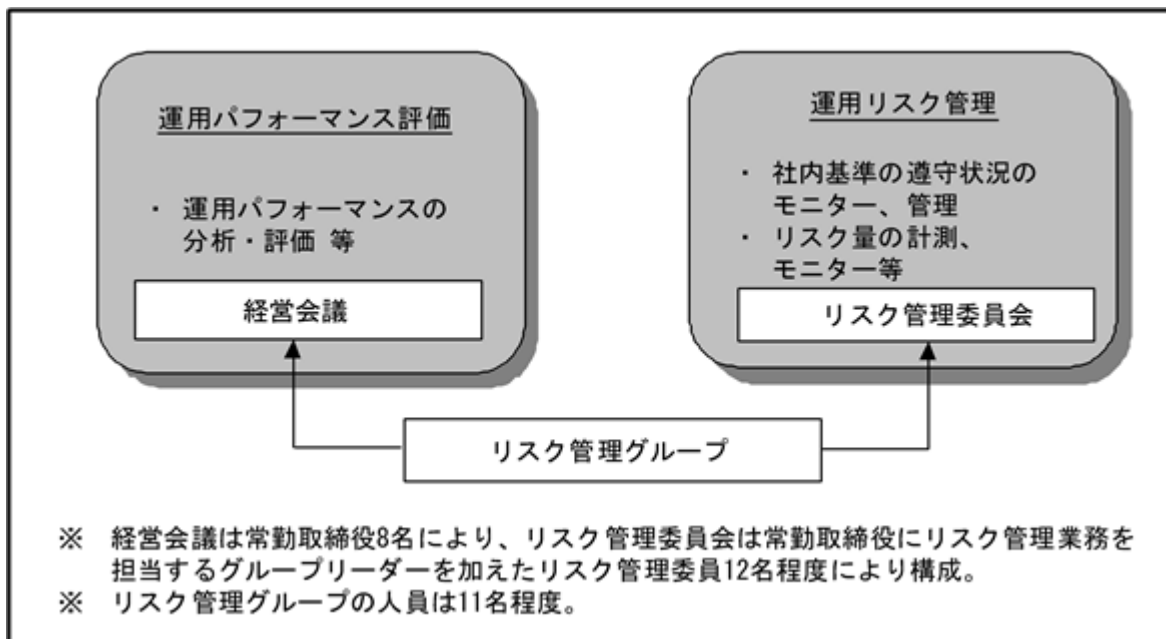
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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

注意事項

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

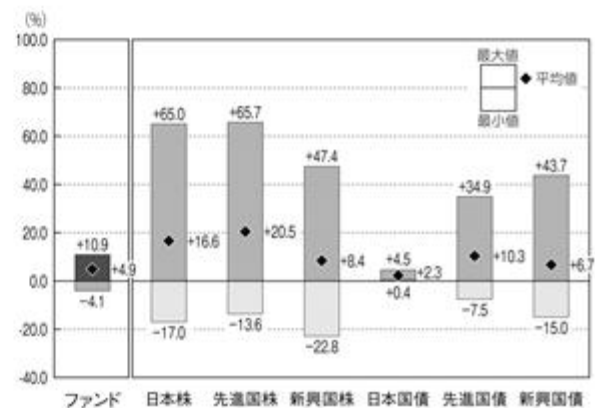
< 運用評価・運用リスク管理体制 >



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28年1月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)**ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移****ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較**

ファンド:2014年10月~2016年1月

代表的な資産クラス:2011年2月~2016年1月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

***各資産クラスの指数**

日本株…… 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
 新興国株… MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
 日本国債… NOMURA-BPI国債
 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 新興国債… JPMオルガンGBI-EMグローバル・レディバース・シファイド(円ベース)
 (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

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

●「MSCIコクサイ・インデックス」「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、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.188%（税抜1.10%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.525%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.525%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.050%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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。

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28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年1月29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	548,121,112	96.71
内 日本	548,121,112	96.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	18,661,422	3.29
純資産総額	566,782,534	100.00

その他資産の投資状況

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	31,649,310	5.58
-	31,649,310	5.58

（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28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	282,559,280,140	96.49
内 日本	282,559,280,140	96.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,273,486,434	3.51
純資産総額	292,832,766,574	100.00

その他資産の投資状況

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,461,530,000	3.57
内 日本	10,461,530,000	3.57

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		336,798,414,900	82.00
	内 日本	336,798,414,900	82.00
地方債証券		27,672,819,568	6.74
	内 日本	27,672,819,568	6.74
特殊債券		23,822,892,772	5.80
	内 日本	23,822,892,772	5.80
社債券		20,792,159,480	5.06
	内 日本	20,491,172,480	4.99
	内 オランダ	201,234,000	0.05
	内 イギリス	99,753,000	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,649,190,837	0.40
純資産総額		410,735,477,557	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28年1月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券		23,911,891,500	98.82
	内 日本	23,911,891,500	98.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		285,039,554	1.18
純資産総額		24,196,931,054	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		246,379,108,449	94.81
	内 アメリカ	149,816,187,312	57.65
	内 イギリス	19,730,807,312	7.59
	内 スイス	10,703,057,315	4.12
	内 フランス	9,630,746,230	3.71
	内 ドイツ	9,441,482,411	3.63
	内 カナダ	8,722,266,274	3.36
	内 オーストラリア	6,389,924,858	2.46
	内 アイルランド	4,505,401,886	1.73
	内 オランダ	4,400,261,467	1.69
	内 スペイン	3,306,636,566	1.27
	内 スウェーデン	2,971,244,638	1.14
	内 香港	2,239,403,417	0.86
	内 イタリア	2,110,823,051	0.81
	内 デンマーク	2,063,579,626	0.79
	内 ベルギー	1,604,471,079	0.62
	内 シンガポール	1,441,799,969	0.55

内	ジャージー	1,280,185,891	0.49
内	フィンランド	1,122,636,664	0.43
内	パミューダ	906,381,566	0.35
内	オランダ領キュラソー	812,752,708	0.31
内	イスラエル	769,436,389	0.30
内	ケイマン諸島	608,967,137	0.23
内	ノルウェー	592,994,848	0.23
内	ルクセンブルグ	210,977,617	0.08
内	パナマ	183,920,375	0.07
内	オーストリア	178,128,951	0.07
内	ポルトガル	177,213,840	0.07
内	ニュージーランド	144,682,388	0.06
内	リベリア	126,205,068	0.05
内	イギリス領バージン諸島	77,569,059	0.03
内	パプアニューギニア	54,035,981	0.02
内	マン島	34,405,644	0.01
内	モーリシャス	20,520,912	0.01
投資信託受益証券		822,279,122	0.32
内	オーストラリア	688,055,658	0.26
内	シンガポール	134,223,464	0.05
投資証券		5,962,031,036	2.29
内	アメリカ	5,002,615,240	1.93
内	イギリス	399,629,816	0.15
内	フランス	393,310,244	0.15
内	香港	115,981,841	0.04
内	カナダ	50,493,895	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,690,461,312	2.57
純資産総額		259,853,879,919	100.00

その他資産の投資状況

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	380,601,600	0.15
-	380,601,600	0.15
株価指数先物取引（買建）	6,899,665,869	2.66
内 アメリカ	4,546,404,180	1.75
内 ドイツ	1,308,935,021	0.50
内 イギリス	581,588,809	0.22
内 カナダ	241,253,222	0.09
内 オーストラリア	221,484,637	0.09

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（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28年1月29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	2,799,406,888	10.94
内 オーストラリア	2,062,786,442	8.06
内 シンガポール	730,405,399	2.85
内 カナダ	6,215,047	0.02
投資証券	22,526,617,571	88.02
内 アメリカ	18,094,746,445	70.70
内 イギリス	1,599,271,510	6.25
内 フランス	1,181,095,078	4.62
内 カナダ	440,399,976	1.72
内 香港	416,427,730	1.63
内 ベルギー	164,516,158	0.64
内 オランダ	148,905,225	0.58
内 スペイン	130,108,120	0.51
内 ニュージーランド	124,371,127	0.49
内 アイルランド	65,188,780	0.25
内 ドイツ	49,621,553	0.19
内 シンガポール	36,526,050	0.14
内 イタリア	25,227,605	0.10
内 ガーンジィ	21,437,373	0.08
内 マン島	17,850,641	0.07
内 イスラエル	10,924,200	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	266,383,249	1.04
純資産総額	25,592,407,708	100.00

その他資産の投資状況

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	62,034,450	0.24
-	62,034,450	0.24

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	180,273,530,119	99.29
内 アメリカ	78,565,146,927	43.27
内 イタリア	17,737,706,542	9.77
内 フランス	17,626,704,173	9.71
内 イギリス	14,741,209,809	8.12
内 ドイツ	13,785,825,116	7.59
内 スペイン	9,836,673,277	5.42
内 ベルギー	4,605,345,394	2.54
内 オランダ	4,540,915,025	2.50
内 カナダ	3,566,203,176	1.96
内 オーストラリア	3,153,487,625	1.74
内 オーストリア	2,782,555,150	1.53
内 メキシコ	1,645,531,834	0.91
内 アイルランド	1,345,087,925	0.74
内 デンマーク	1,126,584,208	0.62
内 フィンランド	1,019,824,268	0.56
内 ポーランド	905,361,989	0.50
内 スウェーデン	807,823,331	0.44
内 マレーシア	747,356,172	0.41
内 南アフリカ	673,349,574	0.37
内 シンガポール	604,975,614	0.33
内 ノルウェー	455,862,990	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,295,864,384	0.71
純資産総額	181,569,394,503	100.00

その他資産の投資状況

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	179,354,711,450	98.78
-	179,354,711,450	98.78

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	33,307,358,918	97.00
内 韓国	5,404,287,158	15.74
内 台湾	4,092,624,293	11.92
内 中国	3,774,280,815	10.99
内 インド	2,941,528,127	8.57
内 ケイマン諸島	2,770,201,897	8.07
内 南アフリカ	2,092,468,118	6.09
内 ブラジル	1,763,378,937	5.14
内 香港	1,605,156,203	4.67
内 メキシコ	1,226,574,543	3.57
内 ロシア	1,225,641,822	3.57
内 マレーシア	1,210,891,213	3.53
内 インドネシア	947,174,528	2.76
内 タイ	761,389,485	2.22
内 フィリピン	485,134,923	1.41
内 トルコ	483,723,627	1.41
内 ポーランド	437,190,206	1.27
内 チリ	433,594,798	1.26
内 バミューダ	396,677,909	1.16
内 カタール	324,076,179	0.94
内 アラブ首長国連邦	287,598,237	0.84
内 コロンビア	150,863,791	0.44
内 オランダ	121,887,046	0.35
内 ハンガリー	96,726,809	0.28
内 チェコ	71,611,612	0.21
内 エジプト	53,550,048	0.16
内 アメリカ	41,002,536	0.12
内 ギリシャ	38,976,296	0.11
内 マルタ	33,119,162	0.10
内 マン島	23,455,135	0.07
内 ベルー	12,573,465	0.04
投資信託受益証券	248,331,222	0.72
内 メキシコ	248,331,222	0.72
投資証券	102,003,018	0.30
内 メキシコ	48,127,336	0.14
内 南アフリカ	36,990,484	0.11
内 トルコ	16,885,198	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	680,903,381	1.98
純資産総額	34,338,596,539	100.00

その他資産の投資状況

平成28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	1,099,591,590	3.20
-	1,099,591,590	3.20
為替予約取引（売建）	100,959,058	0.29
-	100,959,058	0.29
株価指数先物取引（買建）	1,307,549,903	3.81
内 アメリカ	1,307,549,903	3.81

（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28年1月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	46,941,583,072	96.68
内 トルコ	6,974,711,480	14.36
内 ロシア	6,302,821,590	12.98
内 メキシコ	6,028,672,270	12.42
内 インドネシア	4,923,743,391	10.14
内 ブラジル	4,251,669,330	8.76
内 フィリピン	4,051,645,312	8.34
内 コロンビア	3,485,796,520	7.18
内 ハンガリー	2,718,903,079	5.60
内 ベルギー	1,898,422,897	3.91
内 パナマ	1,737,293,518	3.58
内 クロアチア	1,706,591,208	3.51
内 南アフリカ	1,610,211,041	3.32
内 ルーマニア	1,251,101,436	2.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,612,665,454	3.32
純資産総額	48,554,248,526	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	189,163,808	1.3195 249,618,954	1.3334 252,231,021	- -	44.50%
2	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	168,362,027	1.2510 210,623,788	1.2615 212,388,697	- -	37.47%
3	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	12,996,341	2.0290 26,370,875	2.0733 26,945,313	- -	4.75%
4	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	12,836,838	1.7315 22,226,985	1.7959 23,053,677	- -	4.07%
5	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	5,089,197	1.5735 8,008,360	1.7060 8,682,170	- -	1.53%
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	7,538,869	1.0929 8,239,983	1.0989 8,284,463	- -	1.46%
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	10,084,831	0.8000 8,068,873	0.8206 8,275,612	- -	1.46%
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,167,482	2.5725 8,148,664	2.6078 8,260,159	- -	1.46%

(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28年1月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.71%
合計	96.71%

(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

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,659,100	7,683.24 12,747,275,180	7,200.00 11,945,520,000	- -	4.08%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	10,563,700	681.78 7,202,186,276	609.40 6,437,518,780	- -	2.20%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,017,700	3,636.47 3,700,843,886	5,028.00 5,116,995,600	- -	1.75%
4	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,054,200	4,225.53 4,454,563,916	3,980.00 4,195,716,000	- -	1.43%
5	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	883,600	3,542.09 3,129,795,167	4,661.00 4,118,459,600	- -	1.41%
6	K D D I 日本	株式 情報・通信業	1,337,500	2,606.43 3,486,109,200	3,008.00 4,023,200,000	- -	1.37%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,200,500	3,815.91 4,581,005,072	3,341.00 4,010,870,500	- -	1.37%
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	746,000	7,094.43 5,292,450,758	5,265.00 3,927,690,000	- -	1.34%
9	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	18,542,400	201.45 3,735,445,063	205.80 3,816,025,920	- -	1.30%
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	556,400	5,906.70 3,286,491,210	5,773.00 3,212,097,200	- -	1.10%
11	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	550,700	4,399.43 2,422,769,761	5,312.00 2,925,318,400	- -	1.00%
12	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	243,900	9,172.46 2,237,164,452	10,990.00 2,680,461,000	- -	0.92%
13	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	119,500	19,445.41 2,323,727,285	22,105.00 2,641,547,500	- -	0.90%
14	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,564,500	1,823.52 2,852,909,688	1,650.00 2,581,425,000	- -	0.88%
15	N T T ドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,015,400	2,010.55 2,041,513,485	2,527.00 2,565,915,800	- -	0.88%
16	花王 日本	株式 化学	375,800	5,014.85 1,884,581,035	6,395.00 2,403,241,000	- -	0.82%
17	キヤノン 日本	株式 電気機器	718,200	3,730.46 2,679,221,330	3,342.00 2,400,224,400	- -	0.82%
18	ソニー 日本	株式 電気機器	941,100	3,097.45 2,915,017,255	2,523.00 2,374,395,300	- -	0.81%
19	三菱地所 日本	株式 不動産業	979,000	2,510.19 2,457,479,530	2,367.50 2,317,782,500	- -	0.79%
20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	533,400	4,089.24 2,181,202,670	4,248.00 2,265,883,200	- -	0.77%

21	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,872,500	1,064.94 1,994,113,876	1,180.00 2,209,550,000	- -	0.75%
22	ファナック 日本	株式 電気機器	136,500	20,012.42 2,731,695,536	15,810.00 2,158,065,000	- -	0.74%
23	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	421,500	3,984.61 1,679,516,276	4,856.00 2,046,804,000	- -	0.70%
24	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	471,500	4,546.43 2,143,645,704	4,336.00 2,044,424,000	- -	0.70%
25	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,403,000	788.28 2,682,525,640	586.40 1,995,519,200	- -	0.68%
26	三井不動産 日本	株式 不動産業	698,000	3,125.44 2,181,557,130	2,803.00 1,956,494,000	- -	0.67%
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	140,000	12,862.44 1,800,742,408	13,695.00 1,917,300,000	- -	0.65%
28	三菱商事 日本	株式 卸売業	987,900	2,221.37 2,194,500,109	1,905.50 1,882,443,450	- -	0.64%
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	329,500	5,446.58 1,794,650,548	5,160.00 1,700,220,000	- -	0.58%
30	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,524,100	1,316.30 2,006,187,242	1,114.00 1,697,847,400	- -	0.58%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年1月29日現在

種類	投資比率
株式	96.49%
合計	96.49%

(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

平成28年1月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	10.54%
輸送用機器		10.41%
銀行業		8.05%
情報・通信業		7.47%
化学		5.85%
医薬品		5.27%
食料品		4.78%
小売業		4.74%
陸運業		4.53%
機械		4.30%
卸売業		3.95%
サービス業		3.57%
建設業		2.92%
不動産業		2.69%
保険業		2.38%
電気・ガス業		2.07%
精密機器		1.54%
その他製品		1.47%
その他金融業		1.32%
証券、商品先物取引業		1.16%
鉄鋼		1.14%
ゴム製品		0.94%
ガラス・土石製品		0.92%
非鉄金属		0.84%
繊維製品		0.72%
空運業		0.69%
金属製品		0.64%
石油・石炭製品		0.46%
鉱業		0.33%
パルプ・紙		0.24%
海運業	0.22%	
倉庫・運輸関連業	0.21%	
水産・農林業	0.10%	
合計		96.49%

(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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 2 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.21 5,010,945,000	100.74 5,037,300,000	0.100000 2020/6/20	1.23%
2	1 2 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.13 5,006,675,000	100.70 5,035,150,000	0.100000 2020/3/20	1.23%
3	1 1 8 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.34 4,515,420,000	100.91 4,541,130,000	0.200000 2019/6/20	1.11%
4	1 1 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.38 4,517,310,000	100.86 4,538,745,000	0.200000 2019/3/20	1.11%
5	1 2 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	99.98 4,499,535,000	100.66 4,529,745,000	0.100000 2019/12/20	1.10%
6	1 0 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.37 4,516,830,000	100.44 4,520,160,000	0.200000 2017/9/20	1.10%
7	1 0 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,523,850,000	100.42 4,518,990,000	0.300000 2017/3/20	1.10%
8	1 0 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.33 4,515,210,000	100.37 4,517,055,000	0.200000 2017/6/20	1.10%
9	1 1 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	100.44 4,218,634,000	100.77 4,232,718,000	0.200000 2018/12/20	1.03%
10	3 3 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.65 4,026,250,000	103.12 4,124,880,000	0.400000 2025/6/20	1.00%
11	1 2 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.28 4,011,250,000	100.78 4,031,560,000	0.100000 2020/9/20	0.98%
12	3 3 8 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.23 3,508,050,000	103.17 3,611,265,000	0.400000 2025/3/20	0.88%
13	3 4 0 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.09 3,538,225,000	103.05 3,607,030,000	0.400000 2025/9/20	0.88%
14	1 1 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.81 3,528,510,000	100.98 3,534,580,000	0.300000 2018/9/20	0.86%
15	1 0 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.39 3,313,068,000	100.50 3,316,764,000	0.200000 2017/12/20	0.81%

16	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	104.09 3,330,912,000	102.95 3,294,528,000	1.500000 2017/12/20	0.80%
17	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	106.94 3,208,350,000	107.04 3,211,410,000	1.300000 2021/3/20	0.78%
18	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	105.40 3,162,060,000	106.58 3,197,490,000	1.000000 2022/3/20	0.78%
19	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	104.26 3,128,070,000	105.72 3,171,720,000	0.800000 2022/9/20	0.77%
20	296回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	105.05 3,151,770,000	104.15 3,124,500,000	1.500000 2018/9/20	0.76%
21	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	105.97 3,073,208,000	105.31 3,054,164,000	1.500000 2019/6/20	0.74%
22	113回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.76 3,023,040,000	100.89 3,026,790,000	0.300000 2018/6/20	0.74%
23	355回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.17 3,005,100,000	100.26 3,008,040,000	0.100000 2017/8/15	0.73%
24	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	104.76 2,933,448,000	104.94 2,938,460,000	1.000000 2020/9/20	0.72%
25	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	101.75 2,849,060,000	104.89 2,937,060,000	0.600000 2024/6/20	0.72%
26	116回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	2,200,000,000	118.44 2,605,746,000	125.15 2,753,388,000	2.200000 2030/3/20	0.67%
27	286回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,600,000,000	104.09 2,706,392,000	102.58 2,667,236,000	1.800000 2017/6/20	0.65%
28	306回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	106.38 2,659,600,000	106.06 2,651,500,000	1.400000 2020/3/20	0.65%
29	324回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	103.96 2,599,025,000	105.54 2,638,500,000	0.800000 2022/6/20	0.64%
30	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,272,000	105.30 2,632,700,000	1.300000 2019/12/20	0.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年1月29日現在

種類	投資比率
国債証券	82.00%
地方債証券	6.74%
特殊債券	5.80%
社債券	5.06%
合計	99.60%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,132	565,301.89 1,770,525,546	622,000.00 1,948,104,000	- -	8.05%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,904	558,820.21 1,622,813,897	638,000.00 1,852,752,000	- -	7.66%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	5,661	236,961.73 1,341,440,358	254,700.00 1,441,856,700	- -	5.96%
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	8,256	152,078.69 1,255,561,742	148,000.00 1,221,888,000	- -	5.05%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,103	172,933.15 1,055,411,040	164,500.00 1,003,943,500	- -	4.15%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,148	166,066.91 854,912,467	167,800.00 863,834,400	- -	3.57%
7	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,937	399,517.04 773,864,509	432,500.00 837,752,500	- -	3.46%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	3,839	226,615.49 869,976,867	213,800.00 820,778,200	- -	3.39%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,884	277,342.73 799,856,459	260,500.00 751,282,000	- -	3.10%
10	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,074	600,185.02 644,598,712	688,000.00 738,912,000	- -	3.05%
11	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,330	509,852.90 678,104,361	540,000.00 718,200,000	- -	2.97%
12	G L P投資法人 日本	投資証券	5,754	117,936.69 678,607,722	117,100.00 673,793,400	- -	2.78%

13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	7,352	81,880.69 601,986,858	91,100.00 669,767,200	- -	2.77%
14	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,928	219,115.60 641,570,486	200,100.00 585,892,800	- -	2.42%
15	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	898	593,344.60 532,823,459	609,000.00 546,882,000	- -	2.26%
16	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,100	534,779.39 588,257,333	489,000.00 537,900,000	- -	2.22%
17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,483	154,501.94 538,130,263	152,100.00 529,764,300	- -	2.19%
18	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	7,084	64,835.66 459,295,844	73,400.00 519,965,600	- -	2.15%
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,952	237,622.44 463,839,009	239,600.00 467,699,200	- -	1.93%
20	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,075	440,123.49 473,132,759	431,000.00 463,325,000	- -	1.91%
21	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	782	550,343.94 430,368,967	562,000.00 439,484,000	- -	1.82%
22	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,659	254,612.95 422,402,891	247,000.00 409,773,000	- -	1.69%
23	プレミア投資法人 日本	投資証券	2,921	124,861.42 364,720,222	134,500.00 392,874,500	- -	1.62%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,805	142,937.70 400,940,261	133,900.00 375,589,500	- -	1.55%
25	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	778	496,776.72 386,492,293	464,000.00 360,992,000	- -	1.49%
26	福岡リート投資法人 日本	投資証券	1,657	204,724.25 339,228,093	196,700.00 325,931,900	- -	1.35%
27	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,169	150,384.86 326,184,768	141,300.00 306,479,700	- -	1.27%
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	1,732	168,294.97 291,486,894	175,100.00 303,273,200	- -	1.25%
29	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,418	151,311.63 365,871,545	125,400.00 303,217,200	- -	1.25%
30	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	3,638	81,508.45 296,527,756	81,500.00 296,497,000	- -	1.23%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年1月29日現在

種類	投資比率
投資証券	98.82%
合計	98.82%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	441,370	15,233.60 6,723,655,559	11,372.65 5,019,550,193	- -	1.93%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	588,372	5,327.96 3,134,827,067	6,291.88 3,701,970,638	- -	1.42%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	323,143	11,178.01 3,612,095,791	9,305.78 3,007,098,086	- -	1.16%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	214,965	12,027.65 2,585,525,088	12,361.37 2,657,262,955	- -	1.02%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	731,083	3,054.09 2,232,796,258	3,409.74 2,492,804,922	- -	0.96%
6	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	30,833	47,545.25 1,465,962,993	76,794.75 2,367,812,665	- -	0.91%
7	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	378,015	6,660.45 2,517,753,234	5,912.96 2,235,187,725	- -	0.86%
8	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	166,791	9,394.65 1,566,943,803	13,188.12 2,199,660,673	- -	0.85%
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	246,731	8,401.87 2,073,002,835	8,726.90 2,153,197,750	- -	0.83%
10	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	23,927	66,847.53 1,599,460,949	88,351.13 2,113,977,611	- -	0.81%
11	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	477,189	4,125.52 1,968,653,524	4,294.51 2,049,293,457	- -	0.79%
12	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	22,486	68,006.10 1,529,185,271	90,447.02 2,033,791,714	- -	0.78%

13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	210,614	10,303.99 2,170,165,913	9,647.84 2,031,970,889	- -	0.78%
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	287,219	7,213.46 2,071,842,778	6,923.43 1,988,541,675	- -	0.77%
15	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	315,793	5,940.87 1,876,086,833	5,923.83 1,870,706,794	- -	0.72%
16	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	479,191	4,164.17 1,995,435,708	3,650.27 1,749,178,448	- -	0.67%
17	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	54,507	29,159.86 1,589,416,589	30,770.68 1,677,217,563	- -	0.65%
18	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	321,236	5,063.70 1,626,644,304	5,145.43 1,652,899,246	- -	0.64%
19	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	176,682	11,239.57 1,985,830,859	9,233.58 1,631,408,971	- -	0.63%
20	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	146,250	13,421.49 1,962,893,082	10,385.15 1,518,828,246	- -	0.58%
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	100,707	13,610.57 1,370,679,732	14,779.98 1,488,447,808	- -	0.57%
22	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	124,706	12,561.61 1,566,508,232	11,304.97 1,409,797,725	- -	0.54%
23	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	90,521	17,830.15 1,614,003,199	15,230.82 1,378,709,844	- -	0.53%
24	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	114,409	11,961.31 1,368,482,517	11,778.78 1,347,598,612	- -	0.52%
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	370,427	4,120.57 1,526,371,764	3,622.47 1,341,862,139	- -	0.52%
26	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	811,211	1,994.34 1,617,838,649	1,635.37 1,326,631,025	- -	0.51%
27	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	219,189	7,046.48 1,544,513,023	5,946.80 1,303,474,021	- -	0.50%
28	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	152,160	8,190.01 1,246,193,340	8,379.91 1,275,088,185	- -	0.49%
29	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	118,365	10,016.94 1,185,656,217	10,764.68 1,274,161,608	- -	0.49%
30	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	193,518	7,155.31 1,384,681,862	6,540.27 1,265,661,072	- -	0.49%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年1月29日現在

種類	投資比率
株式	94.81%
投資信託受益証券	0.32%
投資証券	2.29%
合計	97.43%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年1月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.38%
医薬品		7.05%
石油・ガス・消耗燃料		5.94%
保険		4.23%
ソフトウェア		3.25%
メディア		3.00%
各種電気通信サービス		2.87%
インターネットソフトウェア・サービス		2.83%
飲料		2.57%
情報技術サービス		2.49%
バイオテクノロジー		2.45%
化学		2.44%
コンピュータ・周辺機器		2.40%
食品		2.38%
食品・生活必需品小売り		2.19%
航空宇宙・防衛		2.09%
コングロマリット		2.06%
専門小売り		1.99%
資本市場		1.88%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.86%
ホテル・レストラン・レジャー		1.82%
電力		1.78%
半導体・半導体製造装置		1.74%
タバコ		1.63%
ヘルスケア機器・用品		1.61%
家庭用品		1.60%
各種金融サービス		1.36%
インターネット販売・カタログ販売		1.36%
総合公益事業		1.30%
繊維・アパレル・贅沢品		1.29%
機械		1.24%
通信機器		1.08%
自動車		1.00%
金属・鉱業		0.89%
陸運・鉄道		0.74%
エネルギー設備・サービス		0.72%
パーソナル用品		0.71%
電気設備		0.69%

不動産管理・開発	0.58%
自動車部品	0.55%
航空貨物・物流サービス	0.54%
複合小売り	0.52%
消費者金融	0.50%
専門サービス	0.48%
無線通信サービス	0.46%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.44%
家庭用耐久財	0.42%
商業サービス・用品	0.41%
電子装置・機器・部品	0.37%
建設・土木	0.32%
建設資材	0.29%
商社・流通業	0.29%
容器・包装	0.28%
建設関連製品	0.25%
運送インフラ	0.25%
ガス	0.18%
旅客航空輸送業	0.17%
水道	0.10%
販売	0.10%
レジャー用品	0.08%
海運業	0.08%
紙製品・林産品	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.03%
各種消費者サービス	0.03%
合計	94.81%

(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28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	68,670	22,493.03 1,544,596,754	22,577.30 1,550,383,692	- -	6.06%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	32,670	25,785.66 842,417,649	30,103.88 983,493,831	- -	3.84%
3	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	80,870	9,191.00 743,276,250	9,160.73 740,828,825	- -	2.89%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	21,770	31,027.28 675,464,060	29,923.28 651,429,979	- -	2.55%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	30,400	20,803.56 632,428,308	20,637.34 627,375,251	- -	2.45%
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	78,600	8,051.51 632,848,877	7,304.17 574,108,084	- -	2.24%
7	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	116,470	4,891.49 569,712,643	4,699.42 547,342,099	- -	2.14%
8	VENTAS INC アメリカ	投資証券	73,790	6,702.89 494,606,576	6,501.59 479,752,864	- -	1.87%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	34,040	15,069.16 512,954,266	13,953.23 474,968,044	- -	1.86%
10	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,180,000	342.06 403,638,567	371.76 438,681,992	- -	1.71%
11	HCP INC アメリカ	投資証券	103,060	4,508.94 464,692,334	4,230.45 435,990,177	- -	1.70%
12	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	129,050	3,235.26 417,510,521	3,331.17 429,888,417	- -	1.68%
13	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	39,280	11,809.74 463,886,945	10,508.43 412,771,436	- -	1.61%
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	14,640	27,103.34 396,793,013	25,476.97 372,982,966	- -	1.46%
15	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	55,400	5,784.66 320,470,413	6,632.13 367,420,384	- -	1.44%
16	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	424,000	819.70 347,556,242	844.60 358,113,622	- -	1.40%
17	LINK REIT 香港	投資証券	500,023	722.79 361,415,896	672.35 336,194,714	- -	1.31%
18	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	177,600	2,168.80 385,180,187	1,851.99 328,913,761	- -	1.29%
19	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	32,450	8,417.22 273,139,109	9,605.53 311,699,737	- -	1.22%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	27,400	9,209.30 252,335,041	10,798.52 295,879,606	- -	1.16%
21	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	91,700	3,001.96 275,280,641	3,195.80 293,055,116	- -	1.15%
22	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	227,000	1,430.53 324,731,182	1,252.30 284,273,813	- -	1.11%

23	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	15,400	16,752.73 257,992,123	17,868.21 275,170,466	- -	1.08%
24	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	29,890	9,484.72 283,498,289	9,189.74 274,681,510	- -	1.07%
25	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	166,800	2,215.99 369,627,866	1,594.27 265,925,120	- -	1.04%
26	SL GREEN アメリカ	投資証券	22,180	13,768.20 305,378,735	11,291.67 250,449,360	- -	0.98%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	58,300	4,153.36 242,141,452	4,235.28 246,917,103	- -	0.96%
28	KLEPIERRE フランス	投資証券	42,000	5,281.38 221,818,276	5,091.84 213,857,668	- -	0.84%
29	MID AMERICA アメリカ	投資証券	16,800	9,827.11 165,095,492	11,111.57 186,674,528	- -	0.73%
30	STOCKLAND オーストラリア	投資信託受益 証券	528,000	354.84 187,357,608	350.34 184,984,483	- -	0.72%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年1月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.94%
投資証券	88.02%
合計	98.96%

(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28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ	国債証券	3,565,665,000	102.10 3,640,713,227	102.77 3,664,540,890	2.000000 2020/7/31	2.02%
2	US T N/B 1.25 10/31/18 アメリカ	国債証券	2,417,400,000	100.24 2,423,322,630	100.67 2,433,620,754	1.250000 2018/10/31	1.34%
3	US T N/B 0.625 08/31/17 アメリカ	国債証券	2,296,530,000	99.77 2,291,316,876	99.73 2,290,513,091	0.625000 2017/8/31	1.26%
4	US T N/B 3.625 08/15/19 アメリカ	国債証券	2,054,790,000	109.04 2,240,666,303	108.51 2,229,755,368	3.625000 2019/8/15	1.23%
5	US T N/B 0.875 04/30/17 アメリカ	国債証券	1,740,528,000	100.51 1,749,422,098	100.21 1,744,252,729	0.875000 2017/4/30	0.96%
6	US T N/B 0.875 01/31/18 アメリカ	国債証券	1,680,093,000	100.03 1,680,690,141	100.03 1,680,748,236	0.875000 2018/1/31	0.93%
7	US T N/B 8.125 08/15/19 アメリカ	国債証券	1,329,570,000	127.32 1,692,808,524	124.24 1,651,884,359	8.125000 2019/8/15	0.91%
8	US T N/B 0.75 03/31/18 アメリカ	国債証券	1,643,832,000	99.54 1,636,308,630	99.72 1,639,393,653	0.750000 2018/3/31	0.90%
9	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,437,144,300	109.43 1,572,767,607	109.20 1,569,505,290	3.625000 2020/2/15	0.86%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,543,509,900	98.60 1,521,988,416	100.59 1,552,662,913	1.750000 2022/5/15	0.86%
11	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	1,486,701,000	100.01 1,486,864,537	99.83 1,484,307,411	0.625000 2017/5/31	0.82%
12	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,462,527,000	97.75 1,429,730,738	100.35 1,467,777,471	2.000000 2025/2/15	0.81%
13	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,270,343,700	101.61 1,290,906,781	103.63 1,316,584,210	2.375000 2024/8/15	0.73%
14	US T N/B 2.375 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,269,135,000	103.53 1,313,948,156	102.38 1,299,467,326	2.375000 2017/7/31	0.72%
15	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,219,578,300	102.51 1,250,231,560	104.69 1,276,837,501	2.500000 2024/5/15	0.70%
16	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	1,196,613,000	99.65 1,192,456,401	101.31 1,212,408,291	2.125000 2025/5/15	0.67%
17	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,208,700,000	99.57 1,203,516,949	99.59 1,203,780,591	0.500000 2017/7/31	0.66%
18	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,160,352,000	98.89 1,147,514,880	100.28 1,163,705,417	1.750000 2022/9/30	0.64%
19	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,148,265,000	98.64 1,132,651,617	99.70 1,144,900,583	1.625000 2022/8/15	0.63%
20	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,087,830,000	99.79 1,085,567,313	99.83 1,086,002,445	0.750000 2017/12/31	0.60%
21	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	956,081,700	108.83 1,040,514,580	109.00 1,042,195,978	3.500000 2020/5/15	0.57%
22	US T N/B 1.5 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,015,308,000	100.83 1,023,785,821	101.25 1,028,070,421	1.500000 2019/3/31	0.57%
23	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,027,395,000	97.88 1,005,690,978	99.85 1,025,946,373	1.750000 2023/5/15	0.57%

24	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	931,907,700	100.33 935,029,590	102.40 954,329,399	2.000000 2022/2/15	0.53%
25	US T N/B 2.0 08/31/21 アメリカ	国債証券	930,699,000	100.66 936,878,841	102.46 953,631,423	2.000000 2021/8/31	0.53%
26	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	925,864,200	98.91 915,828,218	100.17 927,521,496	1.375000 2020/5/31	0.51%
27	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	843,508,940	110.01 927,997,898	108.95 919,087,341	4.500000 2018/2/1	0.51%
28	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	858,177,000	104.59 897,593,069	106.85 916,970,706	2.750000 2023/11/15	0.51%
29	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	894,438,000	97.96 876,227,242	99.10 886,397,002	1.000000 2019/11/30	0.49%
30	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	841,922,900	107.19 902,524,510	105.13 885,138,802	3.750000 2017/4/25	0.49%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年1月29日現在

種類	投資比率
国債証券	99.29%
合計	99.29%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	9,849	138,221.13 1,361,339,952	114,958.00 1,132,221,342	- -	3.30%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,191,083	506.37 1,109,508,305	504.00 1,104,305,832	- -	3.22%
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	461,800	2,395.68 1,106,328,660	2,196.21 1,014,212,548	- -	2.95%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	547,500	1,594.40 872,934,204	1,313.69 719,249,107	- -	2.09%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,559,530	108.60 821,026,965	71.65 541,687,193	- -	1.58%
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	35,690	13,862.55 494,754,729	14,442.55 515,454,966	- -	1.50%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,647,235	95.64 635,792,962	60.79 404,146,570	- -	1.18%
8	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	45,200	10,027.02 453,221,404	8,088.62 365,605,642	- -	1.06%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,277,120	312.74 399,410,050	270.35 345,282,163	- -	1.01%
10	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	163,617	1,939.77 317,380,933	2,010.68 328,982,738	- -	0.96%
11	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	7,177,200	75.00 538,361,384	45.75 328,389,197	- -	0.96%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	134,524	2,278.18 306,469,965	2,042.99 274,831,859	- -	0.80%
13	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	473,000	778.76 368,355,185	529.66 250,532,254	- -	0.73%
14	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	12,400	25,642.65 317,968,962	18,969.33 235,219,788	- -	0.69%
15	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,844,078	101.07 287,453,707	81.97 233,156,376	- -	0.68%

16	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	429,495	559.87 240,464,268	531.33 228,204,866	- -	0.66%
17	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	538,911	637.42 343,515,501	422.31 227,592,774	- -	0.66%
18	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	118,026	1,669.82 197,082,543	1,810.08 213,636,738	- -	0.62%
19	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	277,208	925.26 256,491,464	708.04 196,276,569	- -	0.57%
20	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	679,000	534.98 363,257,232	281.66 191,248,226	- -	0.56%
21	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	14,077	16,258.50 228,870,993	13,554.00 190,799,658	- -	0.56%
22	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	46,802	5,525.35 258,597,726	3,917.39 183,342,000	- -	0.53%
23	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,636,000	181.85 297,522,708	111.51 182,441,648	- -	0.53%
24	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV メキシコ	投資信託受益 証券 -	163,500	970.35 158,653,082	1,111.00 181,649,824	- -	0.53%
25	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,837	110,368.66 202,747,244	97,588.79 179,270,625	- -	0.52%
26	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	42,181	4,417.06 186,316,364	4,149.53 175,031,578	- -	0.51%
27	HYUNDAI MOBIS 韓国	株式 自動車部品	6,126	23,812.46 145,875,165	27,208.39 166,678,658	- -	0.49%
28	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	50,924	3,375.49 171,893,734	3,170.50 161,454,542	- -	0.47%
29	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	248,938	674.89 168,007,609	646.65 160,976,877	- -	0.47%
30	NAVER CORP 韓国	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	2,508	64,762.56 162,424,510	63,352.39 158,887,819	- -	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28年1月29日現在

種類	投資比率
株式	97.00%
投資信託受益証券	0.72%
投資証券	0.30%
合計	98.02%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年1月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	15.61%
石油・ガス・消耗燃料		7.04%
インターネットソフトウェア・サービス		5.69%
コンピュータ・周辺機器		5.06%
半導体・半導体製造装置		5.01%
無線通信サービス		4.99%
保険		3.83%
自動車		2.66%
コングロマリット		2.54%
不動産管理・開発		2.39%
情報技術サービス		2.39%
食品		2.34%
メディア		2.31%
電子装置・機器・部品		2.29%
金属・鉱業		2.23%
化学		2.17%
医薬品		2.11%
各種電気通信サービス		1.98%
食品・生活必需品小売り		1.89%
各種金融サービス		1.55%
電力		1.37%
飲料		1.15%
資本市場		1.12%
運送インフラ		1.06%
建設・土木		1.04%
パーソナル用品		0.96%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.96%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.90%
自動車部品		0.89%
家庭用耐久財		0.84%
タバコ		0.83%
建設資材		0.83%
複合小売り		0.77%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.76%
家庭用品		0.74%
機械		0.70%
繊維・アパレル・贅沢品		0.58%
ホテル・レストラン・レジャー		0.50%

ガス	0.48%
インターネット販売・カタログ販売	0.43%
専門小売り	0.42%
紙製品・林産品	0.39%
航空宇宙・防衛	0.28%
水道	0.26%
旅客航空輸送業	0.25%
不動産投資信託	0.23%
電気設備	0.21%
各種消費者サービス	0.21%
消費者金融	0.19%
ソフトウェア	0.19%
商業サービス・用品	0.19%
陸運・鉄道	0.14%
航空貨物・物流サービス	0.13%
海運業	0.12%
総合公益事業	0.11%
商社・流通業	0.10%
レジャー用品	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.09%
容器・包装	0.09%
建設関連製品	0.07%
ヘルスケア機器・用品	0.07%
通信機器	0.05%
バイオテクノロジー	0.05%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.04%
販売	0.04%
合計	97.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	2,020,885,965	118.43 2,393,394,939	119.53 2,415,706,455	7.500000 2030/3/31	4.98%
2	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	688,959,000	103.25 711,407,580	101.24 697,570,987	4.000000 2023/10/2	1.44%
3	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	809,829,000	89.78 727,069,311	84.12 681,268,646	4.250000 2025/1/7	1.40%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	749,394,000	95.87 718,481,497	90.75 680,075,055	4.750000 2044/3/8	1.40%
5	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	568,089,000	114.35 649,652,076	107.62 611,405,786	6.050000 2040/1/11	1.26%
6	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	580,176,000	103.91 602,887,473	103.99 603,354,031	5.000000 2020/4/29	1.24%
7	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	374,697,000	159.52 597,722,697	158.65 594,494,260	12.750000 2028/6/24	1.22%
8	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	423,045,000	149.40 632,053,404	138.80 587,228,764	8.750000 2033/11/21	1.21%
9	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	435,132,000	133.26 579,859,320	134.37 584,712,976	6.375000 2034/10/23	1.20%
10	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	471,393,000	119.52 563,439,735	118.30 557,667,346	6.750000 2022/2/7	1.15%
11	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	580,176,000	101.20 587,144,155	95.85 556,098,696	4.875000 2021/1/22	1.15%
12	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	471,393,000	118.77 559,874,674	117.10 552,001,203	7.375000 2025/2/5	1.14%
13	INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア	国債証券	435,132,000	127.35 554,163,567	125.71 547,026,193	11.625000 2019/3/4	1.13%
14	PHILIPPINES 10.625 03/16/25 フィリピン	国債証券	338,436,000	159.99 541,472,217	159.80 540,851,187	10.625000 2025/3/16	1.11%
15	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	531,828,000	106.55 566,662,734	101.50 539,805,420	5.550000 2045/1/21	1.11%
16	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	580,176,000	98.47 571,316,229	92.25 535,212,360	5.750000 2110/10/12	1.10%
17	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	471,393,000	114.19 538,288,501	111.50 525,603,195	7.375000 2019/3/18	1.08%
18	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	459,306,000	115.26 529,414,226	113.31 520,462,593	6.375000 2021/3/29	1.07%

19	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	507,654,000	100.79 511,678,971	102.02 517,954,299	4.875000 2023/9/16	1.07%
20	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	314,262,000	165.82 521,118,918	162.00 509,110,725	9.500000 2030/2/2	1.05%
21	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20 メキシコ	国債証券	459,306,000	110.44 507,267,216	108.80 499,724,928	5.125000 2020/1/15	1.03%
22	HUNGARY 6.25 01/29/20 ハンガリー	国債証券	447,219,000	113.01 505,445,705	111.28 497,696,608	6.250000 2020/1/29	1.03%
23	TURKEY 6.875 03/17/36 トルコ	国債証券	435,132,000	114.48 498,177,792	112.86 491,133,488	6.875000 2036/3/17	1.01%
24	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	471,393,000	103.88 489,701,178	103.49 487,858,757	6.000000 2041/1/14	1.00%
25	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	471,393,000	102.16 481,606,515	100.80 475,164,144	3.625000 2022/3/15	0.98%
26	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	459,306,000	108.72 499,386,492	103.22 474,118,618	5.625000 2050/11/18	0.98%
27	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	326,349,000	143.07 466,911,744	144.94 473,039,612	7.750000 2031/1/14	0.97%
28	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	410,958,000	112.62 462,848,699	112.02 460,367,480	5.750000 2023/11/22	0.95%
29	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	652,698,000	77.92 508,608,873	69.75 455,256,855	5.000000 2045/1/27	0.94%
30	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	386,784,000	123.22 476,626,671	117.35 453,929,702	6.700000 2036/1/26	0.93%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年1月29日現在

種類	投資比率
国債証券	96.68%
合計	96.68%

（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28年1月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	イギリス・ポンド売/ 円買 2016年04月	売建	49,000	8,382,920	8,491,210	1.50%
		オーストラリア・ドル 売/円買 2016年0 4月	売建	85,000	6,964,050	7,243,700	1.28%
		カナダ・ドル売/円買 2016年04月	売建	84,000	6,949,320	7,214,760	1.27%
		アメリカ・ドル売/円 買 2016年04月	売建	48,000	5,641,920	5,791,680	1.02%
		ユーロ売/円買 201 6年04月	売建	22,000	2,813,140	2,907,960	0.51%

(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28年1月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2803月	買建	727	10,249,415,548	10,461,530,000	3.57%

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

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

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28年1月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年02月	買建	1,940,000	230,597,712	234,468,400	0.09%
		ユーロ買/円売201 6年02月	買建	720,000	93,589,704	95,162,400	0.04%
		イギリス・ポンド買/ 円売2016年02月	買建	180,000	30,724,848	31,239,000	0.01%
		オーストラリア・ドル 買/円売2016年0 2月	買建	140,000	11,791,080	11,988,200	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2016年02月	買建	90,000	7,615,512	7,743,600	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 M a r 1 6	買建	80	4,812,014,494	4,546,404,180	1.75%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 M a r 1 6	買建	333	1,387,117,541	1,308,935,021	0.50%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E M a r 1 6	買建	57	595,200,169	581,588,809	0.22%
	モントリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T M a r 1 6	買建	19	242,137,816	241,253,222	0.09%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S M a r 1 6	買建	21	223,238,526	221,484,637	0.09%

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年02月	買建	475,000	56,460,780	57,408,500	0.22%
		ユーロ買/円売201 6年02月	買建	35,000	4,549,447	4,625,950	0.02%

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

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

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28年1月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2016年02月	売建	644,149,200	77,418,644,583	77,845,430,820	42.87%
		ユーロ売/円買201 6年02月	売建	554,899,300	72,500,399,534	73,341,040,481	40.39%
		イギリス・ポンド売/ 円買2016年02月	売建	83,391,100	14,769,690,749	14,472,525,405	7.97%
		カナダ・ドル売/円買 2016年02月	売建	41,326,800	3,576,176,629	3,555,344,604	1.96%
		オーストラリア・ドル 売/円買2016年0 2月	売建	36,970,000	3,228,257,404	3,165,371,400	1.74%
		メキシコ・ペソ売/円 買2016年02月	売建	250,712,200	1,740,865,289	1,649,686,276	0.91%
		デンマーク・クローネ 売/円買2016年0 2月	売建	62,547,000	1,095,429,760	1,107,707,370	0.61%
		ポーランド・ズロチ 売/円買2016年0 2月	売建	31,072,300	945,190,963	920,361,526	0.51%
		スウェーデン・クロー ナ売/円買2016年 02月	売建	56,651,500	808,510,027	805,017,815	0.44%
		マレーシア・リングギ ット売/円買2016年 02月	売建	25,370,000	694,021,720	736,237,400	0.41%
		南アフリカ・ランド 売/円買2016年0 2月	売建	92,233,200	711,783,896	687,137,340	0.38%
		シンガポール・ドル 売/円買2016年0 2月	売建	7,140,800	604,541,770	604,754,352	0.33%
ノルウェー・クローネ 売/円買2016年0 2月	売建	33,126,100	449,906,094	464,096,661	0.26%		

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年02月	買建	5,500,000	653,756,400	664,730,000	1.94%
		南アフリカ・ランド 買/円売2016年0 2月	買建	14,600,000	105,299,580	108,770,000	0.32%
		ブラジル・リアル買/ 円売2016年02月	買建	2,892,004	83,903,478	85,892,523	0.25%
		メキシコ・ペソ買/円 売2016年02月	買建	9,200,000	59,073,200	60,536,000	0.18%
		マレーシア・リングイ ット買/円売2016年 02月	買建	2,050,000	57,189,670	59,491,000	0.17%
		インドネシア・ルピア 買/円売2016年0 2月	買建	5,810,000,000	49,733,600	50,547,000	0.15%
		タイ・バーツ買/円売 2016年02月	買建	10,700,000	35,486,550	36,059,000	0.11%
		フィリピン・ペソ買/ 円売2016年02月	買建	7,130,000	17,699,512	18,038,900	0.05%
		コロンビア・ペソ買/ 円売2016年02月	買建	421,933,956	15,217,837	15,527,167	0.05%
		アメリカ・ドル売/円 買2016年02月	売建	835,338	99,121,315	100,959,058	0.29%
株価指数先物 取引	ICE - US	MINI MSCI EMG MKT Ma r16	買建	299	1,306,142,976	1,307,549,903	3.81%

(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

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成26年1月14日)	10	10	1.0126	1.0126
第2計算期間末 (平成26年7月11日)	39	39	1.0284	1.0284
第3計算期間末 (平成27年1月13日)	167	167	1.1049	1.1049
第4計算期間末 (平成27年7月13日)	395	395	1.0878	1.0878
第5計算期間末 (平成28年1月12日)	559	559	1.0575	1.0575
平成27年1月末日	188	-	1.1134	-
2月末日	219	-	1.1088	-
3月末日	286	-	1.1153	-
4月末日	319	-	1.1098	-
5月末日	327	-	1.1091	-
6月末日	387	-	1.0882	-
7月末日	470	-	1.0915	-
8月末日	486	-	1.0598	-
9月末日	512	-	1.0624	-
10月末日	553	-	1.0780	-
11月末日	549	-	1.0776	-
12月末日	557	-	1.0689	-
平成28年1月末日	566	-	1.0681	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.3
第2計算期間	1.6
第3計算期間	7.4
第4計算期間	1.5
第5計算期間	2.8

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,000,000	0
第2計算期間	29,620,308	1,469,785
第3計算期間	157,808,160	44,749,582
第4計算期間	295,136,653	82,702,800
第5計算期間	236,709,209	71,385,857

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年1月29日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2013年10月31日)~2016年1月29日)



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

分配の推移(税引前)

第1期	(2014.01.14)	0円
第2期	(2014.07.11)	0円
第3期	(2015.01.13)	0円
第4期	(2015.07.13)	0円
第5期	(2016.01.12)	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	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	44.50%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	37.47%
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	4.75%
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4.07%
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1.53%
6	外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド	1.46%
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1.46%
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.46%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△5.58

■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	82.00
内 日本	82.00
地方債証券	6.74
内 日本	6.74
特殊債券	5.80
内 日本	5.80
社債券	5.06
内 日本	4.99
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.40
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.23%
2	123回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/3/20	1.23%
3	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.11%
4	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.11%
5	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.10%

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	96.49
内 日本	96.49
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.51
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	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.08%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.20%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.75%
4	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.43%
5	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.41%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	10.54%
2	輸送用機器	10.41%
3	銀行業	8.05%
4	情報・通信業	7.47%
5	化学	5.85%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.57

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2016年1月29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	99.29
内 アメリカ	43.27
内 イタリア	9.77
内 フランス	9.71
内 イギリス	8.12
内 ドイツ	7.59
内 その他	20.83
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.71
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 2.0 07/31/20	国債証券	アメリカ	2.000000	2020/7/31	2.02%
2	US T N/B 1.25 10/31/18	国債証券	アメリカ	1.250000	2018/10/31	1.34%
3	US T N/B 0.625 08/31/17	国債証券	アメリカ	0.625000	2017/8/31	1.26%
4	US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	アメリカ	3.625000	2019/8/15	1.23%
5	US T N/B 0.875 04/30/17	国債証券	アメリカ	0.875000	2017/4/30	0.96%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△98.78

■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	94.81
内 アメリカ	57.65
内 イギリス	7.59
内 スイス	4.12
内 フランス	3.71
内 ドイツ	3.63
内 その他	18.11
投資信託受益証券	0.32
内 オーストラリア	0.26
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.29
内 アメリカ	1.93
内 イギリス	0.15
内 フランス	0.15
内 香港	0.04
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.57
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	1.93%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.42%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.16%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.02%
5	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.96%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	8.38%
2	医薬品	7.05%
3	石油・ガス・消耗燃料	5.94%
4	保険	4.23%
5	ソフトウェア	3.25%

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)	0.15
株価指数先物取引(買建)	2.66

■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	98.82
内 日本	98.82
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.18
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	8.05%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	7.66%
3	日本リートファンド投資法人	日本	5.96%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	5.05%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	4.15%

■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	10.94
内 オーストラリア	8.06
内 シンガポール	2.85
内 カナダ	0.02
投資証券	88.02
内 アメリカ	70.70
内 イギリス	6.25
内 フランス	4.62
内 カナダ	1.72
内 香港	1.63
内 その他	3.10
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.04
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	6.06%
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.84%
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.89%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.55%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.45%

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)	0.24

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2016年1月29日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	96.68
内 トルコ	14.36
内 ロシア	12.98
内 メキシコ	12.42
内 インドネシア	10.14
内 ブラジル	8.76
内 その他	38.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.32
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	4.98%
2	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	メキシコ	4.000000	2023/10/2	1.44%
3	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.40%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.40%
5	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.050000	2040/1/11	1.26%

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.00
内 韓国	15.74
内 台湾	11.92
内 中国	10.99
内 インド	8.57
内 ケイマン諸島	8.07
内 その他	41.71
投資信託受益証券	0.72
内 メキシコ	0.72
投資証券	0.30
内 メキシコ	0.14
内 南アフリカ	0.11
内 トルコ	0.05
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.98
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.30%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.22%
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	2.95%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	2.09%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	商業銀行	1.58%

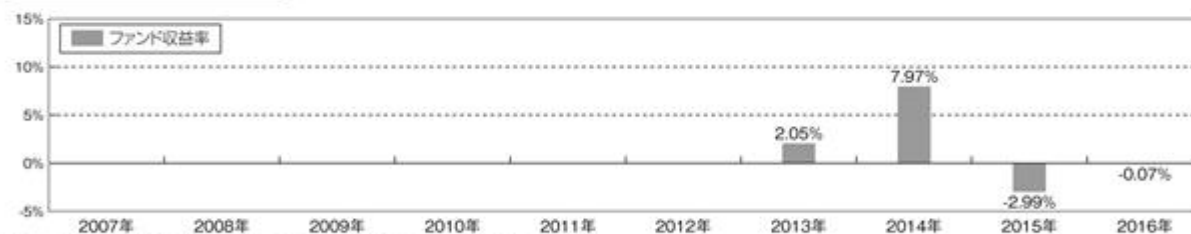
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	15.61%
2	石油・ガス・消耗燃料	7.04%
3	インターネットソフトウェアサービス	5.69%
4	コンピュータ・周辺機器	5.06%
5	半導体・半導体製造装置	5.01%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	3.20
為替予約取引(売建)	△0.29
株価指数先物取引(買建)	3.81

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2013年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・お申込単位

1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

・お申込手数料

ありません。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、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、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・解約単位

1口単位とします。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

信託期間は、平成25年10月31日（設定日）から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

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

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

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

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

託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

二. 公告

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

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

ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年1月11日、7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金受領権

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

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

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3) 一部解約請求権

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

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

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成27年7月14日から平成28年1月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

投資のソムリエ＜DC年金＞

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成27年7月13日現在	第5期 平成28年1月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	70,275,707	16,746,982
親投資信託受益証券	339,648,929	544,806,485
派生商品評価勘定	20,768	-
未収入金	2,421,842	10,933,279
流動資産合計	412,367,246	572,486,746
資産合計	412,367,246	572,486,746
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	312,062	2,362
未払金	5,754,634	7,982,706
未払解約金	9,035,104	2,065,398
未払受託者報酬	76,247	138,966
未払委託者報酬	1,602,089	2,919,161
その他未払費用	7,166	13,114
流動負債合計	16,787,302	13,121,707
負債合計	16,787,302	13,121,707
純資産の部		
元本等		
元本	1,363,642,954	1,528,966,306
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,936,990	30,398,733
（分配準備積立金）	7,300,831	8,536,053
元本等合計	395,579,944	559,365,039
純資産合計	395,579,944	559,365,039
負債純資産合計	412,367,246	572,486,746

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第4期		第5期	
	自	平成27年1月14日 平成27年7月13日	自	平成27年7月14日 平成28年1月12日
営業収益				
受取利息		8,338		7,830
有価証券売買等損益		1,374,504		16,692,444
為替差損益		2,721,765		4,817,699
営業収益合計		4,087,931		11,866,915
営業費用				
受託者報酬		76,247		138,966
委託者報酬		1,602,089		2,919,161
その他費用		7,166		23,914
営業費用合計		1,685,502		3,082,041
営業利益又は営業損失()		5,773,433		14,948,956
経常利益又は経常損失()		5,773,433		14,948,956
当期純利益又は当期純損失()		5,773,433		14,948,956
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()		460,350		1,006,415
期首剰余金又は期首欠損金()		15,866,651		31,936,990
剰余金増加額又は欠損金減少額		30,111,631		18,523,745
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		30,111,631		18,523,745
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,728,209		6,119,461
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,728,209		6,119,461
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		31,936,990		30,398,733

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成27年7月13日、当計算期間末日を平成28年1月12日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期 平成27年7月13日現在	第5期 平成28年1月12日現在
1 . 1 期首元本額	151,209,101円	363,642,954円
期中追加設定元本額	295,136,653円	236,709,209円
期中一部解約元本額	82,702,800円	71,385,857円
2 . 受益権の総数	363,642,954口	528,966,306口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期 自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日	第5期 自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,582,975円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(24,636,159円)及び分配準備積立金(5,717,856円)より分配対象収益は31,936,990円(1万口当たり878.25円)ですが、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(2,242,935円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(37,854,699円)及び分配準備積立金(6,293,118円)より分配対象収益は46,390,752円(1万口当たり877.01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4期	第5期
	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日	自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12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4期 平成27年7月13日現在	第5期 平成28年1月12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4期 平成27年7月13日現在	第5期 平成28年1月12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	2,232,220	6,894,465
合計	2,232,220	6,894,465

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第4期 平成27年7月13日 現在				第5期 平成28年1月12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	46,177,266	-	46,468,560	291,294	30,748,988	-	30,751,350	2,362
アメリカ・ドル	9,979,990	-	10,031,060	51,070	5,641,248	-	5,641,920	672
イギリス・ポンド	16,110,810	-	16,304,740	193,930	8,381,891	-	8,382,920	1,029
オーストラリア・ドル	7,977,728	-	7,956,960	20,768	6,963,795	-	6,964,050	255
カナダ・ドル	8,050,518	-	8,085,000	34,482	6,949,068	-	6,949,320	252
ユーロ	4,058,220	-	4,090,800	32,580	2,812,986	-	2,813,140	154
合計	46,177,266	-	46,468,560	291,294	30,748,988	-	30,751,350	2,362

（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4期 平成27年7月13日現在	第5期 平成28年1月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0878円 (10,878円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年1月12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	25,711,338	52,170,875	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	140,353,064	175,623,788	
	J - R E I Tインデックスファンド・マ ザーファンド	10,300,179	16,208,361	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	6,043,950	15,548,665	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザー ファンド	14,675,192	16,039,984	
	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	158,922,634	209,618,954	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	19,208,691	15,368,873	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	25,542,585	44,226,985	
親投資信託受益証券 合計		400,757,633	544,806,485	
合計		400,757,633	544,806,485	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,929,438,458	3,393,222,349
株式	2	315,699,614,616	276,342,361,426
派生商品評価勘定		2,617,084	-
未収配当金		298,154,084	375,847,721
前払金		143,547,000	167,729,000
流動資産合計		323,073,371,242	280,279,160,496
資産合計		323,073,371,242	280,279,160,496
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		72,741,556	260,639,956
未払金		-	37,223,144
未払解約金		2,328,014,000	173,697,000
流動負債合計		2,400,755,556	471,560,100
負債合計		2,400,755,556	471,560,100
純資産の部			
元本等			
元本	1	138,587,667,315	137,895,802,136
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		182,084,948,371	141,911,798,260
元本等合計		320,672,615,686	279,807,600,396
純資産合計		320,672,615,686	279,807,600,396
負債純資産合計		323,073,371,242	280,279,160,496

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	163,582,012,277円	138,587,667,315円
同期中追加設定元本額	9,763,833,161円	21,290,618,106円
同期中一部解約元本額	34,758,178,123円	21,982,483,285円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	4,362,404,421円	5,243,119,200円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,529,860,430円	1,434,903,894円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	6,372,306円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	13,241,995円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	33,085,052円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	15,617,096円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	10,949,401円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	11,175,343円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	35,429,218,983円	37,229,466,103円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	684,915,524円	753,957,603円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,641,508,603円	2,677,160,685円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,776,171,231円	2,838,691,583円

D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	345,968,388円	360,300,606円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,219,714,464円	1,205,856,079円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,060,913,826円	1,077,747,976円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	63,921,903円	59,990,854円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,181,223,508円	1,225,789,571円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	26,322,530円	26,328,141円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	17,299,081円	23,879,309円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	36,031,952円	46,943,703円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	89,203,441円	101,897,155円
投資のソムリエ	756,128,700円	1,437,588,833円
クルーズコントロール	140,012,301円	411,063,743円
投資のソムリエ<DC年金>	10,399,168円	25,711,338円
D I A M 8資産バランスマ ンドN<DC年金>	46,400,295円	68,146,669円
D I A M D C バランス・F (成長型)	16,893,023円	50,706,467円
クルーズコントロール<DC年 金>	41,111円	65,644円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	- 円	5,635,268円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	- 円	7,643,548円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	- 円	378,598円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	423,890,044円	290,705,619円
D I A Mワールドバランス 2 5 VA(適格機関投資家限定)	110,619,477円	106,160,395円
D I A Mグローバル・バラン スファンド 2 5 VA(適格機関 投資家限定)	1,202,685,119円	576,396,892円
D I A Mグローバル・バラン スファンド 5 0 VA(適格機関 投資家限定)	502,571,390円	464,365,370円
D I A M国際分散バランスマ ンド 3 0 VA(適格機関投資家 限定)	44,077,447円	40,121,091円
D I A M国際分散バランスマ ンド 5 0 VA(適格機関投資家 限定)	203,591,769円	164,133,734円
D I A M国内重視バランスマ ンド 3 0 VA(適格機関投資家 限定)	46,860,062円	39,392,533円

D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	74,467,407円	59,164,711円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	6,938,509,908円	5,310,699,991円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	2,641,592,306円	2,014,996,367円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	2,284,966,402円	1,925,294,426円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,607,489,058円	1,534,659,208円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	4,197,637,341円	4,028,185,938円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	330,395,030円	313,152,279円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	867,775,378円	814,928,278円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	996,950,326円	953,342,133円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	4,137,523,941円	3,906,961,067円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	41,335,811円	41,880,337円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,372,939,277円	1,304,865,632円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	5,328,123,989円	5,298,661,400円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	42,257,264円	- 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)	20,173,972,938円	19,928,952,130円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	815,084,480円	764,217,632円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	2,348,889,165円	2,257,945,180円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	12,747,730,166円	12,639,527,962円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	32,872円	34,355円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	79,718円	9,206,801円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	30,821,108円	15,369,659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)	11,362,729,500円	11,341,448,728円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	108,420,018円	106,482,768円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	39,657,049円	40,013,403円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	30,381円	23,270,239円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	85,457,525円	38,722,783円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	2,616,293円	117,038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)	706,709,914円	670,998,289円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,838,513,776円	1,887,540,594円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,406,210,855円	2,485,634,300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)	89,899,928円	94,839,111円
	計	138,587,667,315円	137,895,802,136円
2.	受益権の総数	138,587,667,315口	137,895,802,136口
3.	2 差入代用有価証券	株式 4,056,500,000円	株式 3,377,500,000円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	36,798,017,926	5,214,721,901
合計	36,798,017,926	5,214,721,901

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年2月10日から平成27年7月13日まで及び平成27年2月10日から平成28年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成27年7月13日 現在				平成28年1月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買建	6,169,032,000	-	6,099,030,000	70,002,000	3,312,334,000	-	3,051,765,000	260,569,000
合計	6,169,032,000	-	6,099,030,000	70,002,000	3,312,334,000	-	3,051,765,000	260,569,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	2.3139円	2.0291円
（1万口当たり純資産額）	(23,139円)	(20,291円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年1月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	65,000	264.00	17,160,000	
日本水産	172,500	625.00	107,812,500	
マルハニチロ	30,700	1,974.00	60,601,800	
ハウスイ	12,000	126.00	1,512,000	
サカタのタネ	24,100	2,589.00	62,394,900	
ホクト	15,300	2,150.00	32,895,000	
ショーボンドホールディングス	14,500	4,125.00	59,812,500	
ミライト・ホールディングス	46,100	912.00	42,043,200	
タマホーム	11,100	407.00	4,517,700	
サンヨーホームズ	2,700	471.00	1,271,700	
住石ホールディングス	44,500	100.00	4,450,000	
日鉄鉱業	42,000	474.00	19,908,000	
三井松島産業	98,000	125.00	12,250,000	
国際石油開発帝石	787,400	1,035.00	814,959,000	
日本海洋掘削	4,500	2,364.00	10,638,000	
石油資源開発	23,700	2,851.00	67,568,700	
K & Oエナジーグループ	10,100	1,449.00	14,634,900	
ダイセキ環境ソリューション	3,500	1,329.00	4,651,500	
安藤・間	99,800	566.00	56,486,800	
東急建設	48,600	810.00	39,366,000	
コムシスホールディングス	64,200	1,538.00	98,739,600	
ミサワホーム	17,700	799.00	14,142,300	
高松コンストラクショングループ	11,300	2,331.00	26,340,300	
東建コーポレーション	5,600	8,580.00	48,048,000	
ヤマウラ	7,200	430.00	3,096,000	
大成建設	776,000	720.00	558,720,000	
大林組	448,000	1,023.00	458,304,000	
清水建設	457,000	919.00	419,983,000	
飛鳥建設	103,600	169.00	17,508,400	
長谷工コーポレーション	174,400	1,207.00	210,500,800	
松井建設	16,100	649.00	10,448,900	
銭高組	21,000	500.00	10,500,000	
鹿島建設	701,000	659.00	461,959,000	
不動テトラ	106,100	128.00	13,580,800	
大末建設	5,800	857.00	4,970,600	
鉄建建設	91,000	270.00	24,570,000	
西松建設	173,000	437.00	75,601,000	
三井住友建設	572,700	98.00	56,124,600	
大豊建設	58,000	530.00	30,740,000	
前田建設工業	92,000	741.00	68,172,000	
佐田建設	10,400	400.00	4,160,000	
ナカノフドー建設	11,500	681.00	7,831,500	
奥村組	142,000	607.00	86,194,000	

東鉄工業	18,000	2,779.00	50,022,000
イチケン	17,000	381.00	6,477,000
浅沼組	48,000	291.00	13,968,000
戸田建設	174,000	572.00	99,528,000
熊谷組	219,000	331.00	72,489,000
青木あすなろ建設	9,900	738.00	7,306,200
北野建設	32,000	291.00	9,312,000
植木組	19,000	238.00	4,522,000
三井ホーム	20,000	498.00	9,960,000
矢作建設工業	20,300	741.00	15,042,300
ピーエス三菱	17,300	365.00	6,314,500
日本ハウスホールディングス	30,300	413.00	12,513,900
大東建託	55,800	13,870.00	773,946,000
新日本建設	17,900	572.00	10,238,800
N I P P O	35,000	1,793.00	62,755,000
東亜道路工業	28,000	396.00	11,088,000
前田道路	47,000	1,916.00	90,052,000
日本道路	45,000	546.00	24,570,000
東亜建設工業	131,000	287.00	37,597,000
若築建設	87,000	129.00	11,223,000
東洋建設	47,000	493.00	23,171,000
五洋建設	165,900	454.00	75,318,600
大林道路	18,000	742.00	13,356,000
世紀東急工業	23,500	542.00	12,737,000
福田組	24,000	1,059.00	25,416,000
日本ドライケミカル	1,900	2,198.00	4,176,200
住友林業	102,900	1,499.00	154,247,100
日本基礎技術	16,700	434.00	7,247,800
日成ビルド工業	41,000	364.00	14,924,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	75,000	75.00	5,625,000
巴コーポレーション	18,800	351.00	6,598,800
パナホーム	56,000	836.00	46,816,000
大和ハウス工業	441,500	3,154.00	1,392,491,000
ライト工業	28,800	1,047.00	30,153,600
積水ハウス	499,700	1,819.00	908,954,300
日特建設	16,600	451.00	7,486,600
北陸電気工事	5,500	870.00	4,785,000
ユアテック	24,000	1,032.00	24,768,000
西部電気工業	12,000	425.00	5,100,000
四電工	6,000	414.00	2,484,000
中電工	21,600	2,555.00	55,188,000
関電工	60,000	743.00	44,580,000
きんでん	90,400	1,426.00	128,910,400
東京エネシス	17,000	918.00	15,606,000
トーエネック	21,000	747.00	15,687,000
住友電設	11,900	1,511.00	17,980,900
日本電設工業	24,400	2,384.00	58,169,600
協和エクシオ	58,700	1,129.00	66,272,300
新日本空調	12,700	968.00	12,293,600
日本工営	47,000	389.00	18,283,000

N D S	25,000	320.00	8,000,000
九電工	27,000	2,102.00	56,754,000
三機工業	32,900	913.00	30,037,700
日揮	150,000	1,685.00	252,750,000
中外炉工業	46,000	213.00	9,798,000
ヤマト	13,700	446.00	6,110,200
太平電業	22,000	1,182.00	26,004,000
高砂熱学工業	44,600	1,569.00	69,977,400
三晃金属工業	15,000	246.00	3,690,000
N E C ネットエスアイ	16,600	1,955.00	32,453,000
朝日工業社	16,000	447.00	7,152,000
明星工業	26,900	461.00	12,400,900
大気社	18,300	2,600.00	47,580,000
ダイダン	20,000	781.00	15,620,000
日比谷総合設備	18,000	1,465.00	26,370,000
東芝プラントシステム	24,300	1,300.00	31,590,000
日本製粉	99,000	799.00	79,101,000
日清製粉グループ本社	163,900	1,860.00	304,854,000
日東富士製粉	8,000	369.00	2,952,000
昭和産業	62,000	435.00	26,970,000
鳥越製粉	12,600	716.00	9,021,600
中部飼料	14,000	859.00	12,026,000
フィード・ワン	90,700	126.00	11,428,200
東洋精糖	25,000	104.00	2,600,000
日本甜菜製糖	79,000	198.00	15,642,000
三井製糖	59,000	520.00	30,680,000
塩水港精糖	16,700	238.00	3,974,600
日新製糖	2,100	4,545.00	9,544,500
ネクスト	39,400	1,254.00	49,407,600
ジェイエシーリクルートメント	6,500	843.00	5,479,500
日本M&Aセンター	21,500	5,300.00	113,950,000
ノバレーゼ	3,800	862.00	3,275,600
アコーディア・ゴルフ	38,700	1,085.00	41,989,500
タケエイ	12,000	935.00	11,220,000
トラスト・テック	2,400	2,289.00	5,493,600
パソナグループ	10,400	777.00	8,080,800
C D S	3,300	874.00	2,884,200
リンクアンドモチベーション	27,500	115.00	3,162,500
G C A サヴィアン	12,500	1,068.00	13,350,000
エス・エム・エス	17,400	2,353.00	40,942,200
テンプホールディングス	97,500	1,679.00	163,702,500
リニカル	8,200	1,443.00	11,832,600
クックパッド	31,000	2,220.00	68,820,000
エスクリ	5,900	975.00	5,752,500
アイ・ケイ・ケイ	7,600	575.00	4,370,000
森永製菓	135,000	601.00	81,135,000
中村屋	35,000	446.00	15,610,000
江崎グリコ	34,500	6,000.00	207,000,000
名糖産業	7,000	1,288.00	9,016,000
不二家	88,000	190.00	16,720,000

山崎製パン	110,000	2,526.00	277,860,000
第一屋製パン	24,000	101.00	2,424,000
モロゾフ	24,000	412.00	9,888,000
亀田製菓	8,400	4,860.00	40,824,000
寿スピリッツ	3,600	4,620.00	16,632,000
カルビー	55,400	4,600.00	254,840,000
森永乳業	134,000	507.00	67,938,000
六甲バター	6,700	1,584.00	10,612,800
ヤクルト本社	80,200	5,170.00	414,634,000
明治ホールディングス	88,500	9,310.00	823,935,000
雪印メグミルク	35,200	2,789.00	98,172,800
プリマハム	94,000	306.00	28,764,000
日本ハム	110,000	2,212.00	243,320,000
伊藤ハム	72,000	671.00	48,312,000
林兼産業	48,000	103.00	4,944,000
丸大食品	78,000	428.00	33,384,000
米久	4,800	2,432.00	11,673,600
S Foods	9,500	2,006.00	19,057,000
学情	5,200	1,189.00	6,182,800
スタジオアリス	6,500	1,913.00	12,434,500
シミックホールディングス	6,300	1,437.00	9,053,100
システナ	12,900	1,505.00	19,414,500
N J S	2,900	1,364.00	3,955,600
デジタルアーツ	6,400	2,151.00	13,766,400
新日鉄住金ソリューションズ	22,000	2,517.00	55,374,000
総合警備保障	46,500	5,190.00	241,335,000
キューブシステム	6,100	563.00	3,434,300
いちごグループホールディングス	109,200	326.00	35,599,200
日本駐車場開発	144,000	122.00	17,568,000
コア	5,800	1,783.00	10,341,400
カカクコム	101,000	2,241.00	226,341,000
アイロムグループ	3,900	1,084.00	4,227,600
ルネサンス	7,200	1,218.00	8,769,600
ディップ	15,400	2,332.00	35,912,800
S B Sホールディングス	13,100	830.00	10,873,000
オプトホールディング	8,700	599.00	5,211,300
新日本科学	13,300	390.00	5,187,000
ツクイ	16,500	1,215.00	20,047,500
キャリアデザインセンター	3,800	1,151.00	4,373,800
エムスリー	120,600	2,336.00	281,721,600
ツカダ・グローバルホールディング	10,400	724.00	7,529,600
アウトソーシング	6,500	3,065.00	19,922,500
ウェルネット	4,800	2,712.00	13,017,600
ディー・エヌ・エー	62,500	1,606.00	100,375,000
博報堂D Yホールディングス	193,100	1,207.00	233,071,700
ぐるなび	16,100	2,412.00	38,833,200
エスアールジータカミヤ	11,300	420.00	4,746,000
一休	9,700	3,415.00	33,125,500
ジャパンベストレスキューシステム	15,700	254.00	3,987,800
ファンコミュニケーションズ	32,100	676.00	21,699,600

ジェイコムホールディングス	3,300	1,639.00	5,408,700
WDBホールディングス	5,000	1,032.00	5,160,000
ティア	5,800	656.00	3,804,800
バリューコマース	12,800	448.00	5,734,400
インフォマート	20,100	1,070.00	21,507,000
サッポロホールディングス	229,000	503.00	115,187,000
アサヒグループホールディングス	280,500	3,645.00	1,022,422,500
麒麟ホールディングス	605,800	1,576.50	955,043,700
宝ホールディングス	108,300	855.00	92,596,500
オエノンホールディングス	43,000	208.00	8,944,000
養命酒製造	3,900	1,972.00	7,690,800
コカ・コーラウエスト	50,700	2,338.00	118,536,600
コカ・コーライーストジャパン	52,900	1,758.00	92,998,200
サントリー食品インターナショナル	102,400	5,130.00	525,312,000
ダイドードリンコ	7,600	5,500.00	41,800,000
伊藤園	44,400	2,984.00	132,489,600
キーコーヒー	13,300	1,821.00	24,219,300
ユニカフェ	4,500	921.00	4,144,500
ジャパンフーズ	2,600	1,131.00	2,940,600
日清オイリオグループ	77,000	453.00	34,881,000
不二製油グループ本社	40,000	1,849.00	73,960,000
J・オイルミルズ	64,000	331.00	21,184,000
ローソン	49,900	9,240.00	461,076,000
サンエー	8,900	5,100.00	45,390,000
ダイユーエイト	3,000	822.00	2,466,000
カワチ薬品	10,200	2,192.00	22,358,400
エービーシー・マート	16,700	5,930.00	99,031,000
ハードオフコーポレーション	6,400	1,376.00	8,806,400
高千穂交易	5,000	980.00	4,900,000
アスクル	13,700	4,425.00	60,622,500
ゲオホールディングス	24,900	1,766.00	43,973,400
アダストリア	12,100	6,120.00	74,052,000
ジーフット	7,900	903.00	7,133,700
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	17,000	95.00	1,615,000
伊藤忠食品	3,300	3,970.00	13,101,000
くらコーポレーション	7,700	4,730.00	36,421,000
キャンドウ	7,200	1,531.00	11,023,200
エレマテック	6,100	2,619.00	15,975,900
パル	7,700	2,590.00	19,943,000
JALUX	4,200	2,294.00	9,634,800
エディオン	55,800	885.00	49,383,000
あらた	5,900	2,281.00	13,457,900
サーラコーポレーション	11,200	615.00	6,888,000
ワッツ	5,400	810.00	4,374,000
トーメンデバイス	1,900	1,855.00	3,524,500
ハローズ	3,900	2,903.00	11,321,700
JPHホールディングス	34,800	307.00	10,683,600
あみやき亭	2,500	4,540.00	11,350,000
東京エレクトロン デバイス	4,600	1,536.00	7,065,600
ひらまつ	18,300	681.00	12,462,300

フィールズ	8,600	1,945.00	16,727,000
双日	829,300	236.00	195,714,800
ゲンキー	2,600	3,255.00	8,463,000
アルフレッサ ホールディングス	165,500	2,202.00	364,431,000
サッポロドラッグストア	1,000	2,427.00	2,427,000
大黒天物産	3,200	4,090.00	13,088,000
ハニーズ	11,800	1,007.00	11,882,600
ファーマライズホールディングス	2,900	536.00	1,554,400
キッコーマン	113,000	3,780.00	427,140,000
味の素	320,000	2,646.50	846,880,000
キュービー	76,100	2,593.00	197,327,300
ハウス食品グループ本社	51,200	2,211.00	113,203,200
カゴメ	53,800	2,011.00	108,191,800
焼津水産化学工業	7,700	1,007.00	7,753,900
アリアケジャパン	12,200	6,000.00	73,200,000
エバラ食品工業	2,800	1,977.00	5,535,600
ニチレイ	159,000	838.00	133,242,000
横浜冷凍	32,900	1,008.00	33,163,200
東洋水産	73,500	3,925.00	288,487,500
イートアンド	1,700	2,226.00	3,784,200
日清食品ホールディングス	63,300	5,930.00	375,369,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,051.00	7,357,000
一正蒲鉾	5,200	972.00	5,054,400
フジッコ	14,600	1,975.00	28,835,000
ロック・フィールド	7,800	2,762.00	21,543,600
日本たばこ産業	883,600	4,083.00	3,607,738,800
ケンコーマヨネーズ	5,100	2,184.00	11,138,400
わらべや日洋	8,100	2,268.00	18,370,800
なとり	7,100	1,633.00	11,594,300
ユーグレナ	50,300	1,667.00	83,850,100
片倉工業	17,600	1,201.00	21,137,600
ゲンゼ	113,000	329.00	37,177,000
ヒューリック	274,400	954.00	261,777,600
神栄	19,000	136.00	2,584,000
山下医科器械	1,200	1,588.00	1,905,600
ラサ商事	6,700	577.00	3,865,900
アルペン	11,800	1,960.00	23,128,000
クオール	13,400	1,528.00	20,475,200
アルコニックス	7,500	1,453.00	10,897,500
神戸物産	8,500	3,185.00	27,072,500
ジェイアイエヌ	8,900	4,350.00	38,715,000
ビックカメラ	68,100	975.00	66,397,500
DCMホールディングス	64,800	813.00	52,682,400
Monotaro	46,300	2,909.00	134,686,700
東京一番フーズ	2,100	587.00	1,232,700
ダイヤモンドダイニング	2,000	1,179.00	2,358,000
あいホールディングス	21,100	2,761.00	58,257,100
ディービーエクス	3,600	1,055.00	3,798,000
きちり	3,500	624.00	2,184,000
アークランドサービス	4,200	2,632.00	11,054,400

Ｊ．フロント リテイリング	166,600	1,610.00	268,226,000
ドトール・日レスホールディングス	23,100	1,810.00	41,811,000
マツモトキヨシホールディングス	27,200	5,580.00	151,776,000
ブロンコビリー	5,200	2,166.00	11,263,200
スタートトゥデイ	41,000	3,530.00	144,730,000
トレジャー・ファクトリー	3,600	986.00	3,549,600
物語コーポレーション	3,700	5,100.00	18,870,000
ココカラファイン	13,700	4,695.00	64,321,500
三越伊勢丹ホールディングス	261,800	1,513.00	396,103,400
東洋紡	554,000	158.00	87,532,000
ユニチカ	407,000	50.00	20,350,000
富士紡ホールディングス	68,000	204.00	13,872,000
日清紡ホールディングス	74,100	1,184.00	87,734,400
倉敷紡績	143,000	195.00	27,885,000
ダイワボウホールディングス	120,000	224.00	26,880,000
シキボウ	81,000	113.00	9,153,000
日東紡績	92,000	319.00	29,348,000
トヨタ紡織	46,600	2,200.00	102,520,000
マクニカ・富士エレホールディングス	23,700	1,388.00	32,895,600
ウエルシアホールディングス	11,400	6,140.00	69,996,000
クリエイトSDホールディングス	19,500	2,690.00	52,455,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	23,100	941.00	21,737,100
八洲電機	10,200	543.00	5,538,600
U K Cホールディングス	8,500	2,406.00	20,451,000
丸善C H Iホールディングス	16,000	341.00	5,456,000
O C H Iホールディングス	3,300	1,000.00	3,300,000
T O K A Iホールディングス	57,900	544.00	31,497,600
ミサワ	1,500	631.00	946,500
エー・ピーカンパニー	2,000	1,408.00	2,816,000
三洋貿易	7,300	1,337.00	9,760,100
チムニー	3,200	2,733.00	8,745,600
ウイン・パートナーズ	4,400	1,601.00	7,044,400
ネクステージ	2,000	652.00	1,304,000
ジョイフル本田	19,300	2,431.00	46,918,300
キリン堂ホールディングス	4,200	1,082.00	4,544,400
ホットランド	3,300	1,287.00	4,247,100
すかいらーく	40,300	1,439.00	57,991,700
日本毛織	44,000	838.00	36,872,000
大東紡織	22,000	60.00	1,320,000
トーア紡コーポレーション	6,300	578.00	3,641,400
ガイドーリミテッド	15,900	491.00	7,806,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,800	1,046.00	45,814,800
三栄建築設計	5,300	1,229.00	6,513,700
野村不動産ホールディングス	87,300	2,070.00	180,711,000
三重交通グループホールディングス	23,500	451.00	10,598,500
サムティ	6,900	1,115.00	7,693,500
ディア・ライフ	6,500	333.00	2,164,500
日本商業開発	4,300	1,623.00	6,978,900

プレサンスコーポレーション	4,500	3,585.00	16,132,500
ユニゾホールディングス	8,200	4,210.00	34,522,000
日本管理センター	8,500	1,219.00	10,361,500
サンセイランディック	2,900	854.00	2,476,600
エストラスト	1,500	622.00	933,000
フージャースホールディングス	18,400	502.00	9,236,800
オープンハウス	19,000	2,000.00	38,000,000
東急不動産ホールディングス	318,600	708.00	225,568,800
飯田グループホールディングス	121,900	1,936.00	235,998,400
帝国繊維	14,600	1,344.00	19,622,400
ブックオフコーポレーション	7,700	970.00	7,469,000
日本コークス工業	114,200	87.00	9,935,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,600	709.00	1,843,400
ミタチ産業	3,300	689.00	2,273,700
あさひ	9,700	1,290.00	12,513,000
日本調剤	3,300	4,270.00	14,091,000
コスモス薬品	6,600	17,600.00	116,160,000
シップヘルスケアホールディングス	26,700	2,800.00	74,760,000
トーエル	7,200	642.00	4,622,400
一六堂	3,600	370.00	1,332,000
ソフトクリエイイトホールディングス	4,700	901.00	4,234,700
セブン&アイ・ホールディングス	550,700	4,980.00	2,742,486,000
薬王堂	1,900	2,699.00	5,128,100
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	11,800	3,040.00	35,872,000
明治電機工業	4,000	1,135.00	4,540,000
ツルハホールディングス	28,200	9,920.00	279,744,000
デリカフーズ	2,300	941.00	2,164,300
スターティア	2,600	575.00	1,495,000
サンマルクホールディングス	10,400	3,090.00	32,136,000
フェリシモ	3,400	1,015.00	3,451,000
トリドール	16,100	2,122.00	34,164,200
クスリのアオキ	10,400	5,350.00	55,640,000
帝人	571,000	396.00	226,116,000
東レ	1,014,000	1,020.00	1,034,280,000
クラレ	220,500	1,360.00	299,880,000
旭化成	871,000	763.90	665,356,900
サカイオーベックス	37,000	202.00	7,474,000
稲葉製作所	7,600	1,261.00	9,583,600
宮地エンジニアリンググループ	43,000	172.00	7,396,000
トーカロ	9,800	2,216.00	21,716,800
アルファ	4,800	1,210.00	5,808,000
SUMCO	109,300	784.00	85,691,200
川田テクノロジーズ	2,700	3,500.00	9,450,000
住江織物	35,000	304.00	10,640,000
日本フェルト	7,800	493.00	3,845,400
イチカワ	10,000	314.00	3,140,000
エコナックホールディングス	43,000	50.00	2,150,000
日東製網	18,000	139.00	2,502,000
芦森工業	31,000	185.00	5,735,000

アツギ	118,000	114.00	13,452,000
ダイニック	28,000	158.00	4,424,000
共和レザー	9,200	821.00	7,553,200
セーレン	34,800	1,240.00	43,152,000
東海染工	22,000	126.00	2,772,000
小松精練	21,500	624.00	13,416,000
ワコールホールディングス	83,000	1,363.00	113,129,000
ホギメディカル	8,800	5,840.00	51,392,000
レナウン	34,300	110.00	3,773,000
クラウディア	3,600	522.00	1,879,200
T S Iホールディングス	62,300	784.00	48,843,200
I Tホールディングス	43,600	2,648.00	115,452,800
ネオス	3,700	505.00	1,868,500
電算システム	4,600	1,700.00	7,820,000
グリー	79,900	527.00	42,107,300
コーエーテクモホールディングス	31,200	1,667.00	52,010,400
三菱総合研究所	5,200	3,365.00	17,498,000
ボルテージ	2,400	1,004.00	2,409,600
電算	1,600	2,282.00	3,651,200
A G S	2,400	946.00	2,270,400
ファインデックス	8,600	799.00	6,871,400
ヒト・コミュニケーションズ	1,500	2,711.00	4,066,500
ブレインパッド	1,600	740.00	1,184,000
K L a b	20,300	713.00	14,473,900
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,700	1,145.00	9,961,500
イーブクイニシアティブジャパン	3,000	705.00	2,115,000
ネクソン	125,600	1,812.00	227,587,200
アイスタイル	11,200	1,809.00	20,260,800
エムアップ	3,500	586.00	2,051,000
エイチーム	4,800	1,526.00	7,324,800
テクノスジャパン	1,400	3,210.00	4,494,000
e n i s h	3,800	574.00	2,181,200
コロブラ	36,200	2,089.00	75,621,800
モバイルクリエイト	7,600	470.00	3,572,000
オルトプラス	4,700	336.00	1,579,200
ブロードリーフ	13,600	1,092.00	14,851,200
ハーツユナイテッドグループ	4,000	2,389.00	9,556,000
ブイキューブ	6,400	960.00	6,144,000
VOYAGE GROUP	2,900	1,345.00	3,900,500
特種東海製紙	81,000	346.00	28,026,000
ベリサーブ	1,500	1,714.00	2,571,000
ティーガイア	13,100	1,332.00	17,449,200
日本アジアグループ	11,200	605.00	6,776,000
豆蔵ホールディングス	10,300	640.00	6,592,000
テクマトリックス	5,700	1,600.00	9,120,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	230,000	293.00	67,390,000
G M Oペイメントゲートウェイ	11,400	5,490.00	62,586,000
ザッパラス	7,500	428.00	3,210,000

インターネットイニシアティブ	21,300	2,290.00	48,777,000
さくらインターネット	6,500	1,760.00	11,440,000
GMOクラウド	2,800	714.00	1,999,200
SRAホールディングス	7,500	2,770.00	20,775,000
システムインテグレータ	1,800	788.00	1,418,400
朝日ネット	12,600	505.00	6,363,000
コムチュア	2,200	2,073.00	4,560,600
王子ホールディングス	573,000	453.00	259,569,000
日本製紙	72,200	1,786.00	128,949,200
三菱製紙	215,000	81.00	17,415,000
北越紀州製紙	86,700	669.00	58,002,300
中越パルプ工業	54,000	212.00	11,448,000
巴川製紙所	21,000	204.00	4,284,000
大王製紙	61,900	973.00	60,228,700
gumi	13,500	675.00	9,112,500
パイプドHD	1,600	1,205.00	1,928,000
レンゴー	123,000	502.00	61,746,000
トーモク	44,000	251.00	11,044,000
ザ・バック	9,900	2,688.00	26,611,200
昭和電工	930,000	131.00	121,830,000
住友化学	1,028,000	575.00	591,100,000
日本化成	27,000	124.00	3,348,000
住友精化	29,000	686.00	19,894,000
日産化学工業	84,000	2,555.00	214,620,000
ラサ工業	53,000	124.00	6,572,000
クレハ	106,000	420.00	44,520,000
多木化学	8,000	709.00	5,672,000
テイカ	24,000	543.00	13,032,000
石原産業	251,000	90.00	22,590,000
片倉コープアグリ	16,000	229.00	3,664,000
日東エフシー	8,200	866.00	7,101,200
日本曹達	90,000	664.00	59,760,000
東ソー	377,000	557.00	209,989,000
トクヤマ	232,000	231.00	53,592,000
セントラル硝子	151,000	570.00	86,070,000
東亜合成	87,500	937.00	81,987,500
大阪ソーダ	60,000	414.00	24,840,000
関東電化工業	33,000	786.00	25,938,000
デンカ	290,000	492.00	142,680,000
イビデン	81,700	1,546.00	126,308,200
信越化学工業	250,600	6,104.00	1,529,662,400
日本カーバイド工業	48,000	147.00	7,056,000
堺化学工業	57,000	364.00	20,748,000
エア・ウォーター	115,000	1,802.00	207,230,000
大陽日酸	107,600	1,007.00	108,353,200
日本化学工業	52,000	228.00	11,856,000
日本パーカライジング	71,400	1,127.00	80,467,800
高压ガス工業	20,000	646.00	12,920,000
チタン工業	17,000	186.00	3,162,000
四国化成工業	20,000	1,015.00	20,300,000

戸田工業	28,000	287.00	8,036,000
ステラ ケミファ	7,300	1,919.00	14,008,700
保土谷化学工業	43,000	223.00	9,589,000
日本触媒	20,300	7,680.00	155,904,000
大日精化工業	54,000	491.00	26,514,000
カネカ	188,000	1,109.00	208,492,000
協和発酵キリン	167,000	1,806.00	301,602,000
三菱瓦斯化学	240,000	553.00	132,720,000
三井化学	593,000	480.00	284,640,000
J S R	131,100	1,689.00	221,427,900
東京応化工業	28,000	3,315.00	92,820,000
大阪有機化学工業	10,100	637.00	6,433,700
三菱ケミカルホールディングス	935,900	678.80	635,288,920
日本合成化学工業	33,000	791.00	26,103,000
ダイセル	196,500	1,613.00	316,954,500
住友ベークライト	131,000	457.00	59,867,000
積水化学工業	323,400	1,399.00	452,436,600
日本ゼオン	120,000	860.00	103,200,000
アイカ工業	42,000	2,121.00	89,082,000
宇部興産	748,000	231.00	172,788,000
積水樹脂	21,700	1,495.00	32,441,500
タキロン	32,000	570.00	18,240,000
旭有機材工業	46,000	205.00	9,430,000
日立化成	69,000	1,746.00	120,474,000
ニチバン	14,000	585.00	8,190,000
リケンテクノス	22,900	379.00	8,679,100
大倉工業	34,000	313.00	10,642,000
積水化成品工業	36,000	390.00	14,040,000
群栄化学工業	38,000	293.00	11,134,000
タイガースポリマー	7,000	676.00	4,732,000
ミライアル	5,100	1,000.00	5,100,000
ダイキアクシス	2,400	875.00	2,100,000
ダイキョーニシカワ	18,000	1,917.00	34,506,000
日本化薬	91,000	1,177.00	107,107,000
カーリットホールディングス	12,900	507.00	6,540,300
E P S ホールディングス	15,452	1,213.00	18,743,276
レグス	1,900	657.00	1,248,300
プレステージ・インターナショナル	11,700	1,156.00	13,525,200
フェイス	3,500	1,294.00	4,529,000
アミューズ	3,900	5,040.00	19,656,000
野村総合研究所	92,300	4,160.00	383,968,000
ドリームインキュベータ	4,600	2,303.00	10,593,800
サイバネットシステム	11,100	394.00	4,373,400
クイック	7,000	890.00	6,230,000
T A C	6,900	212.00	1,462,800
C E ホールディングス	1,800	1,009.00	1,816,200
ケネディクス	187,000	392.00	73,304,000
電通	155,300	6,130.00	951,989,000
インテージホールディングス	6,900	1,555.00	10,729,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,300	687.00	4,328,100

東邦システムサイエンス	4,100	683.00	2,800,300
ぴあ	4,200	2,184.00	9,172,800
イオンファンタジー	4,800	1,974.00	9,475,200
ソースネクスト	6,600	519.00	3,425,400
シーティーエス	3,000	730.00	2,190,000
ネクシィーズ	5,000	650.00	3,250,000
メディカルシステムネットワーク	14,800	576.00	8,524,800
ティー・ワイ・オー	17,700	189.00	3,345,300
日本精化	11,700	837.00	9,792,900
A D E K A	68,700	1,555.00	106,828,500
日油	107,000	825.00	88,275,000
ミヨシ油脂	53,000	126.00	6,678,000
新日本理化	22,400	165.00	3,696,000
ハリマ化成グループ	12,000	569.00	6,828,000
花王	375,800	5,643.00	2,120,639,400
第一工業製薬	31,000	337.00	10,447,000
三洋化成工業	44,000	853.00	37,532,000
武田薬品工業	556,400	5,625.00	3,129,750,000
アステラス製薬	1,564,500	1,606.50	2,513,369,250
大日本住友製薬	98,900	1,310.00	129,559,000
塩野義製薬	203,600	5,176.00	1,053,833,600
田辺三菱製薬	162,800	1,978.00	322,018,400
わかもと製薬	7,000	276.00	1,932,000
あすか製薬	17,700	1,260.00	22,302,000
日本新薬	32,000	4,170.00	133,440,000
バイオフェルミン製薬	2,300	3,625.00	8,337,500
中外製薬	139,100	3,885.00	540,403,500
科研製薬	24,100	7,580.00	182,678,000
エーザイ	172,000	7,540.00	1,296,880,000
理研ビタミン	4,500	3,840.00	17,280,000
ロート製薬	68,400	2,291.00	156,704,400
小野薬品工業	63,500	19,875.00	1,262,062,500
久光製薬	43,400	4,860.00	210,924,000
有機合成薬品工業	10,000	274.00	2,740,000
持田製薬	9,600	8,430.00	80,928,000
参天製薬	257,100	1,926.00	495,174,600
扶桑薬品工業	48,000	268.00	12,864,000
日本ケミファ	18,000	572.00	10,296,000
ツムラ	44,000	3,170.00	139,480,000
日医工	32,700	2,604.00	85,150,800
テルモ	204,500	3,580.00	732,110,000
みらかホールディングス	35,600	5,060.00	180,136,000
キッセイ薬品工業	24,800	2,796.00	69,340,800
生化学工業	26,700	1,670.00	44,589,000
栄研化学	11,800	2,290.00	27,022,000
日水製薬	5,800	1,340.00	7,772,000
鳥居薬品	9,600	2,636.00	25,305,600
J C Rファーマ	10,800	2,420.00	26,136,000
東和薬品	6,400	6,920.00	44,288,000
富士製薬工業	4,000	2,124.00	8,496,000

沢井製薬	23,700	7,830.00	185,571,000
ゼリア新薬工業	28,600	1,446.00	41,355,600
第一三共	469,900	2,284.00	1,073,251,600
キョーリン製薬ホールディングス	37,300	2,301.00	85,827,300
大幸薬品	6,800	1,635.00	11,118,000
ダイト	6,200	2,705.00	16,771,000
大塚ホールディングス	300,400	4,008.00	1,204,003,200
大正製薬ホールディングス	33,600	7,940.00	266,784,000
大日本塗料	80,000	198.00	15,840,000
日本ペイントホールディングス	107,800	2,352.00	253,545,600
関西ペイント	158,100	1,660.00	262,446,000
神東塗料	11,000	198.00	2,178,000
中国塗料	40,000	756.00	30,240,000
日本特殊塗料	9,800	945.00	9,261,000
藤倉化成	19,400	519.00	10,068,600
太陽ホールディングス	10,200	4,195.00	42,789,000
D I C	560,000	298.00	166,880,000
サカティンクス	28,600	1,097.00	31,374,200
東洋インキ S C ホールディングス	138,000	450.00	62,100,000
T & K T O K A	9,600	1,040.00	9,984,000
アルプス技研	5,100	2,210.00	11,271,000
サニックス	22,300	184.00	4,103,200
ダイオーズ	2,600	1,120.00	2,912,000
日本空調サービス	6,900	1,126.00	7,769,400
オリエンタルランド	150,600	7,137.00	1,074,832,200
ダスキン	39,500	2,057.00	81,251,500
パーク 2 4	66,300	2,705.00	179,341,500
明光ネットワークジャパン	16,200	1,216.00	19,699,200
ファルコホールディングス	6,200	1,398.00	8,667,600
クレスコ	3,000	1,738.00	5,214,000
フジ・メディア・ホールディングス	137,100	1,323.00	181,383,300
秀英予備校	2,500	609.00	1,522,500
田谷	3,000	676.00	2,028,000
ラウンドワン	43,200	532.00	22,982,400
リゾートトラスト	58,400	2,947.00	172,104,800
オービック	45,400	6,030.00	273,762,000
ジャストシステム	24,000	871.00	20,904,000
T D C ソフトウェアエンジニアリング	3,000	1,344.00	4,032,000
ヤフー	943,500	447.00	421,744,500
ビー・エム・エル	8,200	3,510.00	28,782,000
ワタベウェディング	4,300	440.00	1,892,000
トレンドマイクロ	63,900	4,690.00	299,691,000
りらいあコミュニケーションズ	23,100	1,075.00	24,832,500
インフォメーション・ディベロプメント	2,900	900.00	2,610,000
リソー教育	25,400	327.00	8,305,800
日本オラクル	21,100	5,330.00	112,463,000
早稲田アカデミー	2,400	836.00	2,006,400
アルファシステムズ	4,400	1,765.00	7,766,000
フューチャーアーキテクト	15,700	765.00	12,010,500

CAC Holdings	9,600	899.00	8,630,400
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,257.00	4,525,200
トーセ	3,600	704.00	2,534,400
ユー・エス・エス	168,700	1,742.00	293,875,400
オービックビジネスコンサルタント	6,700	6,210.00	41,607,000
伊藤忠テクノソリューションズ	29,800	2,211.00	65,887,800
アイティフォー	16,600	537.00	8,914,200
東京個別指導学院	6,900	673.00	4,643,700
東計電算	2,400	2,113.00	5,071,200
サイバーエージェント	34,000	4,400.00	149,600,000
楽天	651,600	1,212.00	789,739,200
エクスネット	1,600	1,502.00	2,403,200
テー・オー・ダブリュー	8,400	607.00	5,098,800
大塚商会	35,400	5,860.00	207,444,000
総合メディカル	6,400	3,785.00	24,224,000
サイボウズ	18,000	297.00	5,346,000
ソフトブレーン	19,100	155.00	2,960,500
セントラルスポーツ	4,800	2,241.00	10,756,800
バラカ	4,600	1,375.00	6,325,000
電通国際情報サービス	8,100	2,145.00	17,374,500
イーエムシステムズ	2,000	2,463.00	4,926,000
ウェザーニューズ	4,000	3,755.00	15,020,000
C I J	12,300	451.00	5,547,300
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,356.00	2,034,000
日本エンタープライズ	11,400	206.00	2,348,400
WOWOW	6,300	2,721.00	17,142,300
フュージョンパートナー	7,500	475.00	3,562,500
フルキャストホールディングス	12,800	652.00	8,345,600
富士フイルムホールディングス	319,700	4,554.00	1,455,913,800
コニカミノルタ	333,100	1,071.00	356,750,100
資生堂	265,100	2,259.00	598,860,900
ライオン	161,000	1,022.00	164,542,000
高砂香料工業	9,200	2,638.00	24,269,600
マンダム	13,000	4,810.00	62,530,000
ミルボン	8,300	4,820.00	40,006,000
ファンケル	32,400	1,529.00	49,539,600
コーセー	22,600	9,660.00	218,316,000
コタ	4,500	1,385.00	6,232,500
シーズ・ホールディングス	19,000	2,014.00	38,266,000
シーボン	1,600	2,505.00	4,008,000
ポーラ・オルビスホールディングス	14,200	7,360.00	104,512,000
ノエビアホールディングス	8,800	3,185.00	28,028,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	996.00	2,788,800
エステー	10,000	1,083.00	10,830,000
アグロ カネショウ	5,500	910.00	5,005,000
コニシ	11,000	2,390.00	26,290,000
長谷川香料	17,800	1,447.00	25,756,600
星光PMC	7,600	1,381.00	10,495,600
小林製薬	21,100	9,330.00	196,863,000
荒川化学工業	11,900	1,103.00	13,125,700

メック	10,900	763.00	8,316,700
日本高純度化学	4,100	2,203.00	9,032,300
J C U	4,100	3,775.00	15,477,500
新田ゼラチン	8,800	654.00	5,755,200
デクセリアルズ	31,300	1,200.00	37,560,000
アース製薬	10,100	4,665.00	47,116,500
イハラケミカル工業	21,500	1,374.00	29,541,000
北興化学工業	15,000	382.00	5,730,000
大成ラミック	4,000	2,981.00	11,924,000
クミアイ化学工業	28,800	1,233.00	35,510,400
日本農薬	31,900	707.00	22,553,300
昭和シェル石油	140,500	901.00	126,590,500
富士興産	5,500	435.00	2,392,500
ニチレキ	17,000	855.00	14,535,000
東燃ゼネラル石油	211,000	963.00	203,193,000
ユシロ化学工業	7,500	1,314.00	9,855,000
ビーピー・カストロール	5,800	1,139.00	6,606,200
富士石油	32,600	295.00	9,617,000
M O R E S C O	4,300	1,585.00	6,815,500
出光興産	72,900	1,735.00	126,481,500
J Xホールディングス	1,653,700	441.60	730,273,920
コスモエネルギーホールディングス	42,200	1,431.00	60,388,200
横浜ゴム	84,300	1,665.00	140,359,500
東洋ゴム工業	63,200	2,109.00	133,288,800
ブリヂストン	471,500	3,885.00	1,831,777,500
住友ゴム工業	130,700	1,410.00	184,287,000
藤倉ゴム工業	11,800	534.00	6,301,200
オカモト	43,000	944.00	40,592,000
アキレス	120,000	140.00	16,800,000
フコク	5,300	956.00	5,066,800
ニッタ	15,100	2,867.00	43,291,700
クリエートメディック	4,500	895.00	4,027,500
住友理工	30,100	920.00	27,692,000
三ツ星ベルト	34,000	845.00	28,730,000
パンドー化学	51,000	464.00	23,664,000
鬼怒川ゴム工業	31,000	584.00	18,104,000
旭硝子	737,000	638.00	470,206,000
日本板硝子	673,000	90.00	60,570,000
石塚硝子	19,000	200.00	3,800,000
有沢製作所	20,600	704.00	14,502,400
日本山村硝子	56,000	168.00	9,408,000
日本電気硝子	288,000	560.00	161,280,000
オハラ	5,300	567.00	3,005,100
住友大阪セメント	277,000	452.00	125,204,000
太平洋セメント	872,000	341.00	297,352,000
デイ・シイ	13,200	288.00	3,801,600
リゾートソリューション	14,000	302.00	4,228,000
日本ヒューム	13,600	660.00	8,976,000
日本コンクリート工業	28,600	332.00	9,495,200
三谷セキサン	7,100	1,495.00	10,614,500

アジアパイルホールディングス	17,300	484.00	8,373,200
東海カーボン	121,000	312.00	37,752,000
日本カーボン	69,000	275.00	18,975,000
東洋炭素	7,800	1,688.00	13,166,400
ノリタケカンパニーリミテド	79,000	253.00	19,987,000
T O T O	102,600	3,670.00	376,542,000
日本碍子	176,000	2,406.00	423,456,000
日本特殊陶業	120,400	2,857.00	343,982,800
ダントーホールディングス	17,000	185.00	3,145,000
M A R U W A	5,100	2,459.00	12,540,900
品川リフクトリーズ	35,000	242.00	8,470,000
黒崎播磨	30,000	246.00	7,380,000
ヨータイ	8,000	305.00	2,440,000
イソライト工業	7,100	207.00	1,469,700
東京窯業	17,000	181.00	3,077,000
ニッカトー	5,500	387.00	2,128,500
フジインコーポレーテッド	12,300	1,578.00	19,409,400
エーアンドエーマテリアル	30,000	78.00	2,340,000
ニチアス	71,000	730.00	51,830,000
新日鐵住金	629,800	2,147.50	1,352,495,500
神戸製鋼所	2,565,000	117.00	300,105,000
中山製鋼所	154,000	71.00	10,934,000
合同製鐵	78,000	212.00	16,536,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	381,700	1,694.50	646,790,650
日新製鋼	63,700	1,140.00	72,618,000
東京製鐵	77,000	711.00	54,747,000
共英製鋼	14,900	1,965.00	29,278,500
大和工業	31,100	2,785.00	86,613,500
東京鐵鋼	29,000	484.00	14,036,000
大阪製鐵	8,800	1,984.00	17,459,200
淀川製鋼所	20,800	2,188.00	45,510,400
東洋鋼鈹	33,400	365.00	12,191,000
丸一鋼管	46,700	3,290.00	153,643,000
モリ工業	21,000	332.00	6,972,000
大同特殊鋼	234,000	428.00	100,152,000
日本高周波鋼業	56,000	88.00	4,928,000
日本冶金工業	102,800	123.00	12,644,400
山陽特殊製鋼	83,000	505.00	41,915,000
愛知製鋼	82,000	480.00	39,360,000
日立金属	159,900	1,289.00	206,111,100
日本金属	36,000	120.00	4,320,000
大平洋金属	97,000	299.00	29,003,000
新日本電工	79,200	193.00	15,285,600
栗本鐵工所	67,000	205.00	13,735,000
虹 技	20,000	165.00	3,300,000
日本鑄鉄管	15,000	160.00	2,400,000
日本製鋼所	231,000	384.00	88,704,000
三菱製鋼	97,000	203.00	19,691,000
日亜鋼業	18,800	275.00	5,170,000

日本精線	10,000	511.00	5,110,000
大紀アルミニウム工業所	22,000	296.00	6,512,000
日本軽金属ホールディングス	316,000	194.00	61,304,000
三井金属鉱業	356,000	198.00	70,488,000
東邦亜鉛	73,000	245.00	17,885,000
三菱マテリアル	871,000	347.00	302,237,000
住友金属鉱山	385,000	1,224.50	471,432,500
D O W Aホールディングス	180,000	757.00	136,260,000
古河機械金属	218,000	216.00	47,088,000
エス・サイエンス	65,100	40.00	2,604,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,700	2,168.00	29,701,600
東邦チタニウム	23,600	849.00	20,036,400
U A C J	195,000	246.00	47,970,000
古河電気工業	439,000	256.00	112,384,000
住友電気工業	559,000	1,519.50	849,400,500
フジクラ	194,000	594.00	115,236,000
昭和電線ホールディングス	164,000	65.00	10,660,000
東京特殊電線	1,900	955.00	1,814,500
タツタ電線	28,600	393.00	11,239,800
沖電線	15,000	256.00	3,840,000
カナレ電気	2,200	1,834.00	4,034,800
平河ヒューテック	3,300	1,590.00	5,247,000
リョービ	85,000	446.00	37,910,000
アーレスティ	16,200	660.00	10,692,000
アサヒホールディングス	21,100	1,706.00	35,996,600
東洋製罐グループホールディングス	99,200	2,100.00	208,320,000
ホッカンホールディングス	35,000	293.00	10,255,000
コロナ	7,400	1,083.00	8,014,200
横河ブリッジホールディングス	26,500	1,211.00	32,091,500
O S J Bホールディングス	30,100	227.00	6,832,700
駒井ハルテック	25,000	220.00	5,500,000
高田機工	12,000	201.00	2,412,000
三和ホールディングス	141,400	870.00	123,018,000
文化シャッター	38,900	911.00	35,437,900
三協立山	18,300	1,437.00	26,297,100
アルインコ	7,500	1,075.00	8,062,500
東洋シャッター	3,600	675.00	2,430,000
L I X I Lグループ	194,500	2,517.00	489,556,500
日本フィルコン	10,400	450.00	4,680,000
ノーリツ	27,400	1,707.00	46,771,800
長府製作所	14,900	2,406.00	35,849,400
リンナイ	26,000	10,170.00	264,420,000
ユニプレス	27,600	2,488.00	68,668,800
ダイニチ工業	7,300	673.00	4,912,900
日東精工	20,000	297.00	5,940,000
三洋工業	19,000	167.00	3,173,000
岡部	29,100	835.00	24,298,500
ジーテクト	14,600	1,482.00	21,637,200
中国工業	2,500	701.00	1,752,500
東プレ	26,900	2,584.00	69,509,600

高周波熱錬	25,700	817.00	20,996,900
東京製綱	95,000	172.00	16,340,000
サンコール	7,800	544.00	4,243,200
モリテックスチール	7,500	275.00	2,062,500
パイオラックス	7,100	5,800.00	41,180,000
日本発条	131,400	1,099.00	144,408,600
中央発條	17,000	281.00	4,777,000
アドバネクス	2,600	1,690.00	4,394,000
三浦工業	62,300	1,648.00	102,670,400
タクマ	52,000	894.00	46,488,000
テクノプロ・ホールディングス	19,800	3,240.00	64,152,000
リブセンス	9,300	301.00	2,799,300
ジャパンマテリアル	5,800	2,290.00	13,282,000
ベクトル	4,300	1,844.00	7,929,200
ウチヤマホールディングス	7,500	475.00	3,562,500
サクセスホールディングス	1,300	1,304.00	1,695,200
キャリアリンク	1,800	1,555.00	2,799,000
I B J	8,100	430.00	3,483,000
アサンテ	5,000	1,411.00	7,055,000
N・フィールド	4,900	1,102.00	5,399,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,100	1,818.00	1,999,800
ライドオン・エクスプレス	2,200	1,902.00	4,184,400
E R Iホールディングス	3,600	819.00	2,948,400
アビスト	1,400	2,006.00	2,808,400
ウィルグループ	3,000	806.00	2,418,000
日本ビューホテル	1,500	1,744.00	2,616,000
リクルートホールディングス	281,000	3,410.00	958,210,000
ツガミ	40,000	464.00	18,560,000
オークマ	91,000	887.00	80,717,000
東芝機械	76,000	361.00	27,436,000
アマダホールディングス	203,600	1,066.00	217,037,600
アイダエンジニアリング	36,600	1,091.00	39,930,600
滝澤鉄工所	44,000	143.00	6,292,000
富士機械製造	45,600	1,088.00	49,612,800
牧野フライス製作所	70,000	804.00	56,280,000
オーエスジー	63,600	2,047.00	130,189,200
ダイジェット工業	17,000	151.00	2,567,000
旭ダイヤモンド工業	38,200	1,191.00	45,496,200
D M G 森精機	77,100	1,202.00	92,674,200
ソディック	26,500	776.00	20,564,000
ディスコ	17,800	10,430.00	185,654,000
日東工器	8,200	2,335.00	19,147,000
パンチ工業	5,500	843.00	4,636,500
日本郵政	307,300	1,697.00	521,488,100
ベルシステム24ホールディングス	20,400	1,229.00	25,071,600
豊田自動織機	121,500	5,780.00	702,270,000
豊和工業	8,100	601.00	4,868,100
O K K	54,000	128.00	6,912,000
石川製作所	35,000	79.00	2,765,000
東洋機械金属	10,400	406.00	4,222,400

津田駒工業	34,000	109.00	3,706,000
エンシュウ	35,000	83.00	2,905,000
島精機製作所	19,700	1,732.00	34,120,400
日阪製作所	17,700	851.00	15,062,700
やまびこ	25,600	906.00	23,193,600
ペガサスミシン製造	14,400	430.00	6,192,000
ナブテスコ	74,400	2,185.00	162,564,000
三井海洋開発	16,300	1,490.00	24,287,000
レオン自動機	11,600	760.00	8,816,000
S M C	41,900	27,525.00	1,153,297,500
新川	12,400	560.00	6,944,000
ホソカワミクロン	23,000	573.00	13,179,000
ユニオンツール	6,000	3,015.00	18,090,000
オイレス工業	18,000	1,855.00	33,390,000
日精エー・エス・ビー機械	5,100	1,849.00	9,429,900
サトーホールディングス	18,800	2,192.00	41,209,600
日本エアテック	4,800	613.00	2,942,400
日精樹脂工業	10,200	859.00	8,761,800
ワイエイシイ	5,700	774.00	4,411,800
小松製作所	684,400	1,778.50	1,217,205,400
住友重機械工業	407,000	491.00	199,837,000
日立建機	62,400	1,724.00	107,577,600
日工	19,000	366.00	6,954,000
巴工業	5,700	1,500.00	8,550,000
井関農機	143,000	173.00	24,739,000
T O W A	13,500	676.00	9,126,000
丸山製作所	29,000	180.00	5,220,000
北川鉄工所	64,000	234.00	14,976,000
シンニッタ	12,700	562.00	7,137,400
クボタ	671,000	1,688.00	1,132,648,000
荏原実業	4,300	1,351.00	5,809,300
東洋エンジニアリング	80,000	294.00	23,520,000
三菱化工機	46,000	221.00	10,166,000
月島機械	26,500	1,035.00	27,427,500
帝国電機製作所	10,100	896.00	9,049,600
東京機械製作所	51,000	43.00	2,193,000
新東工業	31,700	875.00	27,737,500
澁谷工業	11,700	1,581.00	18,497,700
アイチコーポレーション	19,800	772.00	15,285,600
小森コーポレーション	33,900	1,277.00	43,290,300
鶴見製作所	10,400	1,693.00	17,607,200
住友精密工業	22,000	406.00	8,932,000
酒井重工業	27,000	202.00	5,454,000
荏原製作所	309,000	535.00	165,315,000
石井鐵工所	21,000	175.00	3,675,000
西島製作所	14,800	903.00	13,364,400
北越工業	15,100	741.00	11,189,100
千代田化工建設	108,000	837.00	90,396,000
ダイキン工業	194,300	7,804.00	1,516,317,200
オルガノ	24,000	442.00	10,608,000

トーヨーカネツ	75,000	250.00	18,750,000
栗田工業	83,900	2,378.00	199,514,200
椿本チエイン	79,000	815.00	64,385,000
大同工業	27,000	202.00	5,454,000
日本コンベヤ	46,000	139.00	6,394,000
日機装	49,900	838.00	41,816,200
木村化工機	12,000	396.00	4,752,000
新興プランテック	30,700	909.00	27,906,300
アネスト岩田	22,600	904.00	20,430,400
ダイフク	69,500	1,830.00	127,185,000
サムコ	2,300	917.00	2,109,100
加藤製作所	32,000	462.00	14,784,000
油研工業	27,000	236.00	6,372,000
タダノ	64,000	1,235.00	79,040,000
フジテック	38,800	1,124.00	43,611,200
C K D	37,100	1,058.00	39,251,800
キトー	16,900	986.00	16,663,400
平和	41,400	2,167.00	89,713,800
理想科学工業	14,700	1,766.00	25,960,200
S A N K Y O	37,100	4,250.00	157,675,000
日本金銭機械	12,300	1,032.00	12,693,600
マースエンジニアリング	7,600	1,936.00	14,713,600
福島工業	8,200	2,521.00	20,672,200
オーイズミ	5,500	615.00	3,382,500
ダイコク電機	5,600	1,455.00	8,148,000
竹内製作所	19,800	2,028.00	40,154,400
アマノ	41,300	1,466.00	60,545,800
J U K I	19,800	942.00	18,651,600
サンデンホールディングス	81,000	330.00	26,730,000
蛇の目ミシン工業	13,000	692.00	8,996,000
ブラザー工業	172,400	1,241.00	213,948,400
マックス	20,000	1,189.00	23,780,000
モリタホールディングス	23,400	1,202.00	28,126,800
グローリー	45,500	3,355.00	152,652,500
新晃工業	9,400	1,483.00	13,940,200
大和冷機工業	21,500	855.00	18,382,500
セガサミーホールディングス	143,300	1,067.00	152,901,100
日本ピストンリング	5,500	1,900.00	10,450,000
リケン	61,000	382.00	23,302,000
T P R	16,400	2,928.00	48,019,200
ホシザキ電機	29,200	7,820.00	228,344,000
大豊工業	10,800	1,284.00	13,867,200
日本精工	274,000	1,186.00	324,964,000
N T N	331,000	446.00	147,626,000
ジェイテクト	142,200	1,810.00	257,382,000
不二越	124,000	468.00	58,032,000
ミネベア	215,000	943.00	202,745,000
日本トムソン	46,000	447.00	20,562,000
T H K	88,700	2,078.00	184,318,600
ユーシン精機	5,200	2,129.00	11,070,800

前澤給装工業	5,300	1,480.00	7,844,000
イーグル工業	16,500	1,915.00	31,597,500
前澤工業	9,900	308.00	3,049,200
日本ピラー工業	13,600	969.00	13,178,400
キッツ	64,800	507.00	32,853,600
日立製作所	3,403,000	613.40	2,087,400,200
東芝	2,808,000	227.00	637,416,000
三菱電機	1,423,000	1,119.50	1,593,048,500
富士電機	402,000	458.00	184,116,000
東洋電機製造	26,000	386.00	10,036,000
安川電機	165,200	1,424.00	235,244,800
シンフォニアテクノロジー	86,000	174.00	14,964,000
明電舎	123,000	445.00	54,735,000
オリジン電気	20,000	294.00	5,880,000
山洋電気	35,000	672.00	23,520,000
デンヨー	12,300	1,703.00	20,946,900
日立工機	35,700	780.00	27,846,000
三櫻工業	17,000	686.00	11,662,000
マキタ	87,000	6,510.00	566,370,000
東芝テック	95,000	408.00	38,760,000
芝浦メカトロニクス	22,000	205.00	4,510,000
マブチモーター	38,200	5,930.00	226,526,000
日本電産	160,500	7,755.00	1,244,677,500
東光高岳	7,300	1,452.00	10,599,600
ダブル・スコープ	4,000	3,825.00	15,300,000
宮越ホールディングス	4,600	385.00	1,771,000
ダイヘン	79,000	611.00	48,269,000
田淵電機	15,100	688.00	10,388,800
ヤーマン	1,800	1,908.00	3,434,400
JVCケンウッド	97,900	311.00	30,446,900
ミマキエンジニアリング	9,000	452.00	4,068,000
第一精工	5,500	1,402.00	7,711,000
日新電機	31,300	832.00	26,041,600
大崎電気工業	24,000	616.00	14,784,000
オムロン	153,100	3,590.00	549,629,000
日東工業	21,400	1,878.00	40,189,200
I D E C	16,900	1,010.00	17,069,000
不二電機工業	1,300	1,449.00	1,883,700
ジーエス・ユアサコーポレーション	257,000	407.00	104,599,000
サクサホールディングス	34,000	201.00	6,834,000
メルコホールディングス	7,400	2,008.00	14,859,200
テクノメディカ	3,000	2,693.00	8,079,000
日本電気	1,834,000	351.00	643,734,000
富士通	1,286,000	564.10	725,432,600
沖電気工業	578,000	133.00	76,874,000
岩崎通信機	60,000	69.00	4,140,000
電気興業	35,000	493.00	17,255,000
サンケン電気	73,000	380.00	27,740,000
ナカヨ	13,000	340.00	4,420,000
アイホン	7,600	1,774.00	13,482,400

ルネサスエレクトロニクス	69,100	719.00	49,682,900
セイコーエプソン	198,600	1,640.00	325,704,000
ワコム	105,000	447.00	46,935,000
アルバック	22,500	2,895.00	65,137,500
アクセル	6,500	1,126.00	7,319,000
E I Z O	13,200	2,709.00	35,758,800
ジャパンディスプレイ	249,000	289.00	71,961,000
日本信号	36,800	1,166.00	42,908,800
京三製作所	32,000	334.00	10,688,000
能美防災	15,100	1,330.00	20,083,000
ホーチキ	9,700	978.00	9,486,600
エレコム	11,600	1,500.00	17,400,000
日本無線	34,000	340.00	11,560,000
パナソニック	1,524,100	1,117.00	1,702,419,700
シャープ	1,127,000	112.00	126,224,000
アンリツ	80,100	747.00	59,834,700
富士通ゼネラル	41,000	1,427.00	58,507,000
日立国際電気	30,000	1,521.00	45,630,000
ソニー	941,100	2,675.00	2,517,442,500
T D K	80,500	6,710.00	540,155,000
帝国通信工業	32,000	185.00	5,920,000
ミツミ電機	50,700	626.00	31,738,200
タムラ製作所	51,000	314.00	16,014,000
アルプス電気	112,700	2,806.00	316,236,200
池上通信機	43,000	161.00	6,923,000
パイオニア	215,800	282.00	60,855,600
日本電波工業	12,200	728.00	8,881,600
鈴木	3,600	555.00	1,998,000
日本トリム	3,600	4,095.00	14,742,000
ローランド ディー・ジー	6,600	2,293.00	15,133,800
日本コロムビア	4,500	435.00	1,957,500
フォスター電機	16,700	2,355.00	39,328,500
クラリオン	70,000	405.00	28,350,000
S M K	39,000	558.00	21,762,000
ヨコオ	9,700	534.00	5,179,800
東光	27,000	372.00	10,044,000
ティアック	94,000	45.00	4,230,000
ホシデン	40,400	581.00	23,472,400
ヒロセ電機	21,500	12,900.00	277,350,000
日本航空電子工業	38,000	1,459.00	55,442,000
T O A	15,600	1,130.00	17,628,000
日立マクセル	22,100	1,879.00	41,525,900
古野電気	15,800	769.00	12,150,200
ユニデンホールディングス	41,000	127.00	5,207,000
アルパイン	31,800	1,603.00	50,975,400
スミダコーポレーション	10,900	662.00	7,215,800
アイコム	7,400	2,222.00	16,442,800
リオン	5,100	1,954.00	9,965,400
船井電機	13,500	913.00	12,325,500
横河電機	133,500	1,300.00	173,550,000

新電元工業	47,000	410.00	19,270,000
アズビル	43,600	2,851.00	124,303,600
東亜ディーケーケー	5,800	507.00	2,940,600
日本光電工業	55,700	2,511.00	139,862,700
チノー	4,900	1,060.00	5,194,000
共和電業	16,700	386.00	6,446,200
日本電子材料	5,500	550.00	3,025,000
堀場製作所	24,700	4,145.00	102,381,500
アドバンテスト	90,900	950.00	86,355,000
小野測器	6,700	791.00	5,299,700
エスベック	13,800	1,263.00	17,429,400
パナソニック デバイスSUNX	11,800	593.00	6,997,400
キーエンス	30,200	56,470.00	1,705,394,000
日置電機	7,000	1,923.00	13,461,000
シスメックス	103,500	7,170.00	742,095,000
日本マイクロニクス	17,400	1,123.00	19,540,200
メガチップス	14,000	995.00	13,930,000
OBARA GROUP	8,600	3,730.00	32,078,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	10,900	422.00	4,599,800
澤藤電機	8,000	215.00	1,720,000
デンソー	329,500	5,069.00	1,670,235,500
コーセル	18,600	972.00	18,079,200
新日本無線	10,000	491.00	4,910,000
オプテックス	9,900	2,639.00	26,126,100
千代田インテグレ	7,000	2,594.00	18,158,000
レーザーテック	13,700	1,259.00	17,248,300
スタンレー電気	95,700	2,383.00	228,053,100
岩崎電気	46,000	223.00	10,258,000
ウシオ電機	81,000	1,518.00	122,958,000
岡谷電機産業	7,000	394.00	2,758,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,400	400.00	4,560,000
日本セラミック	7,700	1,758.00	13,536,600
遠藤照明	6,700	1,115.00	7,470,500
日本デジタル研究所	11,300	1,525.00	17,232,500
古河電池	10,000	728.00	7,280,000
双信電機	6,900	288.00	1,987,200
山一電機	11,600	809.00	9,384,400
図研	9,700	1,106.00	10,728,200
日本電子	53,000	686.00	36,358,000
カシオ計算機	133,700	2,534.00	338,795,800
ファナック	136,500	18,800.00	2,566,200,000
日本シイエムケイ	28,900	311.00	8,987,900
エンプラス	6,800	3,930.00	26,724,000
大真空	25,000	206.00	5,150,000
ローム	65,700	5,390.00	354,123,000
浜松ホトニクス	104,100	2,946.00	306,678,600
三井ハイテック	19,000	639.00	12,141,000
新光電気工業	50,400	705.00	35,532,000
京セラ	219,000	5,085.00	1,113,615,000

協栄産業	15,000	149.00	2,235,000	
太陽誘電	64,900	1,468.00	95,273,200	
村田製作所	140,000	14,755.00	2,065,700,000	
ユーシン	17,000	660.00	11,220,000	
双葉電子工業	22,800	1,467.00	33,447,600	
日東電工	108,000	7,239.00	781,812,000	
北陸電気工業	54,000	150.00	8,100,000	
東海理化電機製作所	39,000	2,728.00	106,392,000	
ニチコン	42,000	848.00	35,616,000	
日本ケミコン	108,000	188.00	20,304,000	
K O A	18,500	877.00	16,224,500	
三井造船	517,000	171.00	88,407,000	
日立造船	104,300	591.00	61,641,300	
三菱重工業	2,376,000	482.00	1,145,232,000	
川崎重工業	1,038,000	393.00	407,934,000	
I H I	1,025,000	288.00	295,200,000	
名村造船所	40,000	853.00	34,120,000	
サノヤスホールディングス	16,300	222.00	3,618,600	
日本車輛製造	55,000	252.00	13,860,000	
ニチュ三菱フォークリフト	15,500	460.00	7,130,000	
近畿車輛	20,000	366.00	7,320,000	
F P G	39,000	873.00	34,047,000	
島根銀行	3,100	1,374.00	4,259,400	
じもとホールディングス	95,000	180.00	17,100,000	
全国保証	34,200	3,765.00	128,763,000	
足利ホールディングス	93,700	426.00	39,916,200	
東京T Yフィナンシャルグループ	18,200	3,585.00	65,247,000	
九州フィナンシャルグループ	201,500	751.00	151,326,500	
かんぽ生命保険	40,200	2,753.00	110,670,600	
ゆうちょ銀行	253,000	1,572.00	397,716,000	
日産自動車	1,872,500	1,121.00	2,099,072,500	
いすゞ自動車	386,600	1,155.00	446,523,000	
トヨタ自動車	1,659,100	6,755.00	11,207,220,500	*
日野自動車	190,400	1,269.00	241,617,600	
三菱自動車工業	529,700	944.00	500,036,800	
エフテック	7,200	1,106.00	7,963,200	
レシップホールディングス	4,500	767.00	3,451,500	
G M B	2,200	990.00	2,178,000	
ファルテック	2,100	1,467.00	3,080,700	
武蔵精密工業	14,200	2,266.00	32,177,200	
日産車体	65,200	1,150.00	74,980,000	
新明和工業	58,000	990.00	57,420,000	
極東開発工業	26,600	1,193.00	31,733,800	
日信工業	29,800	1,569.00	46,756,200	
トビー工業	110,000	231.00	25,410,000	
ティラド	52,000	195.00	10,140,000	
曙ブレーキ工業	67,200	269.00	18,076,800	
タチエス	21,200	1,789.00	37,926,800	
N O K	64,500	2,520.00	162,540,000	
フタバ産業	40,700	500.00	20,350,000	

K Y B	149,000	332.00	49,468,000
シロキ工業	33,000	340.00	11,220,000
市光工業	32,000	200.00	6,400,000
大同メタル工業	18,700	981.00	18,344,700
プレス工業	70,900	470.00	33,323,000
ミクニ	12,900	370.00	4,773,000
カルソニックカンセイ	102,000	926.00	94,452,000
太平洋工業	29,500	1,212.00	35,754,000
ケーヒン	30,600	1,827.00	55,906,200
河西工業	16,400	1,529.00	25,075,600
アイシン精機	134,200	4,660.00	625,372,000
富士機工	15,600	438.00	6,832,800
マツダ	422,400	2,113.00	892,531,200
ダイハツ工業	159,200	1,502.00	239,118,400
今仙電機製作所	12,000	1,147.00	13,764,000
本田技研工業	1,200,500	3,503.00	4,205,351,500
スズキ	278,900	3,429.00	956,348,100
富士重工業	421,500	4,359.00	1,837,318,500
安永	4,300	540.00	2,322,000
ヤマハ発動機	188,400	2,418.00	455,551,200
ショーワ	34,500	1,020.00	35,190,000
小糸製作所	79,900	4,415.00	352,758,500
T B K	16,100	435.00	7,003,500
エクセディ	18,100	2,644.00	47,856,400
ミツバ	22,700	1,541.00	34,980,700
豊田合成	48,500	2,491.00	120,813,500
愛三工業	23,200	1,085.00	25,172,000
盟和産業	1,300	1,052.00	1,367,600
ヨロズ	12,500	2,544.00	31,800,000
エフ・シー・シー	21,800	2,261.00	49,289,800
新家工業	29,000	128.00	3,712,000
シマノ	53,800	16,970.00	912,986,000
タカタ	24,200	787.00	19,045,400
テイ・エス テック	31,000	2,848.00	88,288,000
ジャムコ	5,800	3,395.00	19,691,000
小野建	11,500	1,080.00	12,420,000
はるやま商事	5,700	750.00	4,275,000
佐鳥電機	10,400	700.00	7,280,000
カッパ・クリエイト	18,600	1,182.00	21,985,200
エコートレーディング	3,400	628.00	2,135,200
伯東	9,500	1,111.00	10,554,500
コンドーテック	10,200	711.00	7,252,200
中山福	7,900	794.00	6,272,600
ライトオン	9,900	1,489.00	14,741,100
ナガイレーベン	19,000	1,928.00	36,632,000
ジーンズメイト	4,600	218.00	1,002,800
三菱食品	14,500	2,749.00	39,860,500
良品計画	15,100	23,810.00	359,531,000
三城ホールディングス	16,800	453.00	7,610,400
松田産業	9,600	1,351.00	12,969,600

メディバルホールディングス	131,700	1,964.00	258,658,800
アドヴァン	13,400	1,128.00	15,115,200
S P K	3,100	2,111.00	6,544,100
萩原電気	3,400	1,970.00	6,698,000
アルピス	3,300	1,980.00	6,534,000
アズワン	10,300	4,385.00	45,165,500
スズデン	4,400	1,089.00	4,791,600
尾家産業	4,800	872.00	4,185,600
シモジマ	8,000	1,043.00	8,344,000
ドウシシャ	15,500	2,370.00	36,735,000
小津産業	2,700	2,016.00	5,443,200
コナカ	15,600	605.00	9,438,000
高速	8,200	994.00	8,150,800
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,440.00	2,448,000
G - 7ホールディングス	3,800	1,414.00	5,373,200
たけびし	4,700	1,011.00	4,751,700
イオン北海道	8,700	538.00	4,680,600
コジマ	19,600	261.00	5,115,600
ヒマラヤ	4,100	1,000.00	4,100,000
コーナン商事	18,700	1,584.00	29,620,800
黒田電気	24,500	2,036.00	49,882,000
ネットワンシステムズ	57,000	688.00	39,216,000
エコス	4,700	1,381.00	6,490,700
ワタミ	15,700	785.00	12,324,500
マルシェ	3,400	840.00	2,856,000
ドンキホーテホールディングス	85,100	3,915.00	333,166,500
丸文	11,600	865.00	10,034,000
西松屋チェーン	26,000	982.00	25,532,000
ゼンショーホールディングス	67,900	1,413.00	95,942,700
ハビネット	11,900	1,090.00	12,971,000
幸楽苑ホールディングス	8,500	1,529.00	12,996,500
ハークスレイ	3,700	1,266.00	4,684,200
橋本総業	2,600	1,410.00	3,666,000
サイゼリヤ	21,700	2,818.00	61,150,600
エクセル	6,400	1,406.00	8,998,400
V Tホールディングス	44,600	646.00	28,811,600
マルカキカイ	4,300	1,599.00	6,875,700
アルゴグラフィックス	6,000	1,726.00	10,356,000
魚力	3,900	1,315.00	5,128,500
ガリバーインターナショナル	35,400	1,106.00	39,152,400
日本エム・ディ・エム	11,000	676.00	7,436,000
ポブラ	3,500	520.00	1,820,000
ユナイテッドアローズ	18,800	5,060.00	95,128,000
進和	7,800	1,521.00	11,863,800
エスケイジャパン	3,200	503.00	1,609,600
ダイトエレクトロン	6,100	693.00	4,227,300
ハイデイ日高	10,000	3,485.00	34,850,000
シークス	8,300	3,205.00	26,601,500
京都きもの友禅	8,100	893.00	7,233,300
コロワイド	43,700	1,755.00	76,693,500

ピーシーデポコーポレーション	10,900	868.00	9,461,200
田中商事	4,400	677.00	2,978,800
オーハシテクニカ	7,500	1,234.00	9,255,000
壱番屋	6,000	5,670.00	34,020,000
白銅	3,800	1,177.00	4,472,600
トップカルチャー	5,900	479.00	2,826,100
P L A N T	3,100	1,265.00	3,921,500
スギホールディングス	23,600	6,340.00	149,624,000
島津製作所	172,000	1,778.00	305,816,000
J M S	24,000	288.00	6,912,000
クボテック	3,000	544.00	1,632,000
モリテックス	3,000	215.00	645,000
長野計器	8,600	677.00	5,822,200
ブイ・テクノロジー	3,200	3,965.00	12,688,000
スター精密	25,300	1,356.00	34,306,800
東京計器	43,000	210.00	9,030,000
愛知時計電機	18,000	318.00	5,724,000
オーバル	12,700	244.00	3,098,800
東京精密	25,700	2,421.00	62,219,700
マニー	12,200	2,015.00	24,583,000
ニコン	249,100	1,598.00	398,061,800
トプコン	44,800	1,661.00	74,412,800
オリンパス	198,700	4,380.00	870,306,000
理研計器	10,800	1,231.00	13,294,800
S C R E E Nホールディングス	137,000	810.00	110,970,000
キヤノン電子	12,300	1,815.00	22,324,500
タムロン	10,800	2,002.00	21,621,600
H O Y A	310,400	4,504.00	1,398,041,600
ノーリツ鋼機	12,300	560.00	6,888,000
エー・アンド・デイ	12,300	393.00	4,833,900
キヤノン	718,200	3,285.00	2,359,287,000
リコー	432,000	1,115.00	481,680,000
シチズンホールディングス	164,200	800.00	131,360,000
リズム時計工業	59,000	143.00	8,437,000
大研医器	10,300	928.00	9,558,400
メニコン	6,700	3,515.00	23,550,500
パラマウントベッドホールディングス	14,100	4,075.00	57,457,500
トランザクション	1,900	570.00	1,083,000
S H O B I	5,000	394.00	1,970,000
ニホンフラッシュ	3,800	1,137.00	4,320,600
前田工織	14,700	995.00	14,626,500
永大産業	19,000	405.00	7,695,000
アートネイチャー	10,500	961.00	10,090,500
ダンロップスポーツ	8,600	910.00	7,826,000
バンダイナムコホールディングス	137,900	2,483.00	342,405,700
アイフィスジャパン	1,800	445.00	801,000
共立印刷	22,900	293.00	6,709,700
S H O E I	6,400	2,205.00	14,112,000
フランスベッドホールディングス	18,800	944.00	17,747,200
マーベラス	22,200	808.00	17,937,600

パイロットコーポレーション	23,300	4,255.00	99,141,500
萩原工業	2,800	2,200.00	6,160,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	24,200	1,248.00	30,201,600
トッパン・フォームズ	23,800	1,282.00	30,511,600
フジシールインターナショナル	16,200	3,470.00	56,214,000
タカラトミー	44,100	702.00	30,958,200
廣済堂	12,600	375.00	4,725,000
アーク	54,300	99.00	5,375,700
レック	4,600	1,310.00	6,026,000
タカノ	6,000	638.00	3,828,000
プロネクサス	12,600	925.00	11,655,000
ホクシン	11,900	116.00	1,380,400
ウッドワン	23,000	245.00	5,635,000
大建工業	52,000	299.00	15,548,000
きもと	23,200	239.00	5,544,800
凸版印刷	377,000	1,020.00	384,540,000
大日本印刷	395,000	1,082.00	427,390,000
図書印刷	25,000	500.00	12,500,000
共同印刷	44,000	315.00	13,860,000
日本写真印刷	22,400	2,116.00	47,398,400
光村印刷	3,000	238.00	714,000
藤森工業	12,000	2,864.00	34,368,000
宝印刷	7,000	1,272.00	8,904,000
前澤化成工業	10,000	1,057.00	10,570,000
アシックス	124,200	2,234.00	277,462,800
ツツミ	6,700	2,429.00	16,274,300
J S P	9,100	2,281.00	20,757,100
ニチハ	18,600	1,660.00	30,876,000
エフピコ	12,400	4,110.00	50,964,000
小松ウオール工業	4,300	1,942.00	8,350,600
ヤマハ	98,100	2,619.00	256,923,900
河合楽器製作所	4,900	2,081.00	10,196,900
クリナップ	15,300	667.00	10,205,100
ピジョン	75,600	2,543.00	192,250,800
天馬	10,800	2,055.00	22,194,000
兼松日産農林	14,000	153.00	2,142,000
キングジム	11,300	790.00	8,927,000
リンテック	31,700	2,369.00	75,097,300
T A S A K I	2,500	1,486.00	3,715,000
信越ポリマー	27,400	604.00	16,549,600
東リ	36,000	307.00	11,052,000
イトーキ	28,100	773.00	21,721,300
任天堂	82,100	14,460.00	1,187,166,000
三菱鉛筆	10,000	4,910.00	49,100,000
松風	6,600	1,335.00	8,811,000
タカラスタンダード	55,000	844.00	46,420,000
コクヨ	69,400	1,167.00	80,989,800
ナカバヤシ	28,000	276.00	7,728,000
ニフコ	26,700	5,040.00	134,568,000

立川ブラインド工業	5,700	692.00	3,944,400
グロープライド	6,500	1,433.00	9,314,500
岡村製作所	46,600	1,097.00	51,120,200
日本バルカー工業	55,000	292.00	16,060,000
MUTOHホールディングス	16,000	247.00	3,952,000
伊藤忠商事	1,033,100	1,297.00	1,339,930,700
丸紅	1,295,700	565.20	732,329,640
スクロール	19,700	384.00	7,564,800
高島	25,000	203.00	5,075,000
ヨンドシーホールディングス	10,000	2,520.00	25,200,000
三陽商会	78,000	277.00	21,606,000
長瀬産業	79,200	1,401.00	110,959,200
ナイガイ	52,000	48.00	2,496,000
蝶理	8,500	1,632.00	13,872,000
豊田通商	146,700	2,585.00	379,219,500
オンワードホールディングス	93,000	721.00	67,053,000
三共生興	20,200	448.00	9,049,600
兼松	280,000	185.00	51,800,000
美津濃	72,000	542.00	39,024,000
ツカモトコーポレーション	24,000	117.00	2,808,000
ファミリーマート	40,500	5,460.00	221,130,000
ルック	25,000	153.00	3,825,000
三井物産	1,190,500	1,330.00	1,583,365,000
日本紙パルプ商事	69,000	323.00	22,287,000
東京エレクトロン	119,700	6,876.00	823,057,200
日立ハイテクノロジーズ	45,600	2,967.00	135,295,200
カメイ	17,200	1,117.00	19,212,400
東都水産	24,000	181.00	4,344,000
OUGホールディングス	20,000	242.00	4,840,000
スターゼン	4,800	3,220.00	15,456,000
セイコーホールディングス	86,000	632.00	54,352,000
山善	50,600	989.00	50,043,400
椿本興業	15,000	304.00	4,560,000
住友商事	828,700	1,156.50	958,391,550
日本ユニシス	36,400	1,232.00	44,844,800
内田洋行	33,000	419.00	13,827,000
三菱商事	987,900	1,861.50	1,838,975,850
第一実業	30,000	494.00	14,820,000
キヤノンマーケティングジャパン	37,600	1,746.00	65,649,600
西華産業	43,000	269.00	11,567,000
佐藤商事	11,800	708.00	8,354,400
菱洋エレクトロ	15,200	1,266.00	19,243,200
東京産業	12,900	458.00	5,908,200
ユアサ商事	12,400	2,701.00	33,492,400
神鋼商事	30,000	218.00	6,540,000
小林産業	9,800	195.00	1,911,000
阪和興業	132,000	463.00	61,116,000
カナデン	12,000	901.00	10,812,000
菱電商事	21,000	747.00	15,687,000
ニプロ	99,400	1,212.00	120,472,800

フルサト工業	7,300	1,686.00	12,307,800
岩谷産業	156,000	595.00	92,820,000
すてきナイスグループ	56,000	161.00	9,016,000
昭光通商	48,000	75.00	3,600,000
ニチモウ	21,000	181.00	3,801,000
極東貿易	19,000	225.00	4,275,000
イワキ	21,000	201.00	4,221,000
兼松エレクトロニクス	8,400	1,972.00	16,564,800
三愛石油	34,000	874.00	29,716,000
稲畑産業	31,600	1,090.00	34,444,000
G S Iクレオス	36,000	110.00	3,960,000
明和産業	11,800	373.00	4,401,400
キムラタン	588,000	8.00	4,704,000
ゴールドウイン	5,900	5,390.00	31,801,000
ユニ・チャーム	282,900	2,106.50	595,928,850
デサント	31,900	1,581.00	50,433,900
キング	6,900	406.00	2,801,400
ワキタ	28,100	922.00	25,908,200
ヤマトインターナショナル	9,200	403.00	3,707,600
東邦ホールディングス	42,200	2,722.00	114,868,400
サンゲツ	47,900	2,020.00	96,758,000
ミツウロコグループホールディングス	21,300	543.00	11,565,900
シナネンホールディングス	28,000	449.00	12,572,000
伊藤忠エネクス	33,800	838.00	28,324,400
サンリオ	40,600	2,569.00	104,301,400
サンワテクノス	8,400	890.00	7,476,000
リョーサン	20,900	2,891.00	60,421,900
新光商事	15,500	1,229.00	19,049,500
トーヨー	6,000	2,333.00	13,998,000
三信電気	18,200	1,147.00	20,875,400
東陽テクニカ	19,300	1,015.00	19,589,500
モスフードサービス	17,300	3,090.00	53,457,000
加賀電子	11,900	1,551.00	18,456,900
三益半導体工業	10,400	1,006.00	10,462,400
ソーダニッカ	12,000	490.00	5,880,000
立花エレテック	9,800	1,226.00	12,014,800
木曽路	16,300	2,047.00	33,366,100
サトレストランシステムズ	15,300	850.00	13,005,000
千趣会	26,200	724.00	18,968,800
タカキュー	9,900	193.00	1,910,700
ケーヨー	23,100	497.00	11,480,700
アデランス	23,100	740.00	17,094,000
上新電機	28,000	924.00	25,872,000
日本瓦斯	15,100	2,621.00	39,577,100
ベスト電器	42,600	115.00	4,899,000
ロイヤルホールディングス	22,000	2,109.00	46,398,000
東天紅	10,000	140.00	1,400,000
いなげや	14,800	1,245.00	18,426,000
島忠	34,100	2,709.00	92,376,900
チヨダ	15,500	3,205.00	49,677,500

ライフコーポレーション	8,300	2,578.00	21,397,400
リンガーハット	11,900	2,622.00	31,201,800
さが美	10,000	101.00	1,010,000
MR MAX	11,600	313.00	3,630,800
テンアライド	11,500	380.00	4,370,000
AOKIホールディングス	30,100	1,444.00	43,464,400
オークワ	20,000	1,047.00	20,940,000
コメリ	20,300	2,235.00	45,370,500
青山商事	25,200	4,345.00	109,494,000
しまむら	15,300	13,030.00	199,359,000
はせがわ	4,800	443.00	2,126,400
高島屋	191,000	988.00	188,708,000
松屋	26,500	1,106.00	29,309,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,400	2,183.00	147,134,200
近鉄百貨店	51,000	303.00	15,453,000
丸栄	24,000	96.00	2,304,000
ニッセンホールディングス	19,700	172.00	3,388,400
パルコ	12,700	1,004.00	12,750,800
丸井グループ	161,600	1,848.00	298,636,800
クレディセゾン	99,900	2,149.00	214,685,100
アクシアル リテイリング	10,200	3,595.00	36,669,000
井筒屋	73,000	55.00	4,015,000
イオン	541,700	1,602.00	867,803,400
ユニグループ・ホールディングス	126,200	743.00	93,766,600
イズミ	26,100	4,155.00	108,445,500
東武ストア	17,000	298.00	5,066,000
フォーバル	5,200	581.00	3,021,200
平和堂	26,700	2,390.00	63,813,000
フジ	14,700	2,308.00	33,927,600
ヤオコー	14,900	4,645.00	69,210,500
ゼビオホールディングス	17,900	2,112.00	37,804,800
ケーズホールディングス	27,800	3,875.00	107,725,000
PALTAC	21,100	2,016.00	42,537,600
三谷産業	14,100	320.00	4,512,000
Olympicグループ	7,200	577.00	4,154,400
日産東京販売ホールディングス	22,300	269.00	5,998,700
新生銀行	1,140,000	207.00	235,980,000
あおぞら銀行	834,000	402.00	335,268,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,563,700	677.00	7,151,624,900
りそなホールディングス	1,540,500	540.00	831,870,000
三井住友トラスト・ホールディングス	2,749,000	412.90	1,135,062,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,054,200	4,156.00	4,381,255,200
第四銀行	167,000	482.00	80,494,000
北越銀行	143,000	230.00	32,890,000
西日本シティ銀行	429,000	286.00	122,694,000
千葉銀行	508,000	786.00	399,288,000
横浜銀行	883,000	685.10	604,943,300
常陽銀行	476,000	515.00	245,140,000
群馬銀行	292,000	653.00	190,676,000
武蔵野銀行	21,000	3,990.00	83,790,000

千葉興業銀行	35,300	598.00	21,109,400
筑波銀行	54,900	377.00	20,697,300
七十七銀行	206,000	577.00	118,862,000
青森銀行	97,000	360.00	34,920,000
秋田銀行	87,000	377.00	32,799,000
山形銀行	74,000	440.00	32,560,000
岩手銀行	9,200	4,620.00	42,504,000
東邦銀行	118,000	403.00	47,554,000
東北銀行	69,000	148.00	10,212,000
みちのく銀行	67,000	199.00	13,333,000
ふくおかフィナンシャルグループ	570,000	547.00	311,790,000
静岡銀行	386,000	1,065.00	411,090,000
十六銀行	165,000	428.00	70,620,000
スルガ銀行	139,000	2,176.00	302,464,000
八十二銀行	238,000	675.00	160,650,000
山梨中央銀行	82,000	555.00	45,510,000
大垣共立銀行	175,000	438.00	76,650,000
福井銀行	113,000	220.00	24,860,000
北國銀行	147,000	361.00	53,067,000
清水銀行	4,500	2,724.00	12,258,000
富山銀行	2,500	3,900.00	9,750,000
滋賀銀行	124,000	566.00	70,184,000
南都銀行	127,000	353.00	44,831,000
百五銀行	118,000	532.00	62,776,000
京都銀行	251,000	984.00	246,984,000
紀陽銀行	51,700	1,566.00	80,962,200
三重銀行	59,000	242.00	14,278,000
ほくほくフィナンシャルグループ	895,000	224.00	200,480,000
広島銀行	388,000	611.00	237,068,000
山陰合同銀行	79,800	896.00	71,500,800
中国銀行	93,300	1,461.00	136,311,300
鳥取銀行	42,000	203.00	8,526,000
伊予銀行	140,800	1,061.00	149,388,800
百十四銀行	145,000	418.00	60,610,000
四国銀行	102,000	248.00	25,296,000
阿波銀行	108,000	653.00	70,524,000
大分銀行	76,000	428.00	32,528,000
宮崎銀行	88,000	349.00	30,712,000
佐賀銀行	80,000	259.00	20,720,000
十八銀行	81,000	333.00	26,973,000
沖縄銀行	10,500	4,265.00	44,782,500
琉球銀行	27,200	1,584.00	43,084,800
セブン銀行	493,200	484.00	238,708,800
みずほフィナンシャルグループ	18,542,400	221.80	4,112,704,320
高知銀行	52,000	131.00	6,812,000
山口フィナンシャルグループ	123,000	1,303.00	160,269,000
アクリーティブ	10,700	385.00	4,119,500
芙蓉総合リース	15,100	5,150.00	77,765,000
興銀リース	24,800	2,273.00	56,370,400
東京センチュリーリース	30,900	3,960.00	122,364,000

S B I ホールディングス	158,100	1,134.00	179,285,400
日本証券金融	58,100	570.00	33,117,000
アイフル	220,300	354.00	77,986,200
日本アジア投資	8,900	282.00	2,509,800
ポケットカード	12,800	498.00	6,374,400
長野銀行	45,000	194.00	8,730,000
名古屋銀行	111,000	403.00	44,733,000
北洋銀行	198,300	382.00	75,750,600
愛知銀行	4,400	5,840.00	25,696,000
第三銀行	75,000	168.00	12,600,000
中京銀行	55,000	217.00	11,935,000
東日本銀行	61,000	366.00	22,326,000
大光銀行	47,000	235.00	11,045,000
愛媛銀行	79,000	245.00	19,355,000
トマト銀行	53,000	167.00	8,851,000
みなと銀行	119,000	185.00	22,015,000
京葉銀行	109,000	522.00	56,898,000
関西アーバン銀行	18,400	1,260.00	23,184,000
栃木銀行	70,000	604.00	42,280,000
北日本銀行	4,200	3,170.00	13,314,000
東和銀行	186,000	96.00	17,856,000
福島銀行	163,000	91.00	14,833,000
大東銀行	79,000	195.00	15,405,000
リコーリース	10,400	3,430.00	35,672,000
イオンフィナンシャルサービス	86,400	2,412.00	208,396,800
アコム	264,400	509.00	134,579,600
ジャックス	73,000	392.00	28,616,000
オリエントコーポレーション	569,200	222.00	126,362,400
日立キャピタル	31,000	2,900.00	89,900,000
アプラスフィナンシャル	63,900	100.00	6,390,000
オリックス	932,300	1,569.00	1,462,778,700
三菱UFJリース	333,900	554.00	184,980,600
ジャフコ	22,000	3,985.00	87,670,000
トモニホールディングス	101,300	420.00	42,546,000
大和証券グループ本社	1,232,000	680.50	838,376,000
野村ホールディングス	2,533,200	611.80	1,549,811,760
岡三証券グループ	112,000	609.00	68,208,000
丸三証券	39,100	1,151.00	45,004,100
東洋証券	51,000	339.00	17,289,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	151,000	632.00	95,432,000
光世証券	32,000	149.00	4,768,000
水戸証券	41,000	366.00	15,006,000
いちよし証券	29,200	1,005.00	29,346,000
松井証券	67,000	1,004.00	67,268,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	292,500	3,515.00	1,028,137,500
だいこう証券ビジネス	6,400	960.00	6,144,000
日本取引所グループ	386,600	1,677.00	648,328,200
マネックスグループ	154,800	274.00	42,415,200

カブドットコム証券	116,700	324.00	37,810,800
極東証券	17,700	1,424.00	25,204,800
岩井コスモホールディングス	12,500	1,255.00	15,687,500
藍澤證券	18,500	633.00	11,710,500
フィデアホールディングス	80,700	239.00	19,287,300
池田泉州ホールディングス	135,400	477.00	64,585,800
アニコムホールディングス	8,900	2,740.00	24,386,000
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	393,500	3,094.00	1,217,489,000
マネースクウェアHD	4,500	1,376.00	6,192,000
ソニーフィナンシャルホールディング ス	126,200	1,943.00	245,206,600
マネーパートナーズグループ	12,200	406.00	4,953,200
小林洋行	4,700	264.00	1,240,800
第一生命保険	843,600	1,774.00	1,496,546,400
東京海上ホールディングス	533,400	4,178.00	2,228,545,200
イー・ギャランティ	4,300	2,574.00	11,068,200
アサックス	2,400	1,525.00	3,660,000
NECキャピタルソリューション	5,400	1,587.00	8,569,800
T & Dホールディングス	479,900	1,426.00	684,337,400
三井不動産	698,000	2,817.50	1,966,615,000
三菱地所	979,000	2,307.00	2,258,553,000
平和不動産	24,900	1,200.00	29,880,000
東京建物	143,800	1,219.00	175,292,200
ダイビル	34,000	930.00	31,620,000
京阪神ビルディング	22,100	648.00	14,320,800
住友不動産	316,000	3,118.00	985,288,000
太平洋興発	54,000	81.00	4,374,000
大京	244,000	179.00	43,676,000
テオーシー	51,000	918.00	46,818,000
東京楽天地	21,000	497.00	10,437,000
レオパレス21	155,100	624.00	96,782,400
スターツコーポレーション	15,100	2,149.00	32,449,900
フジ住宅	17,300	693.00	11,988,900
空港施設	16,000	531.00	8,496,000
明和地所	7,400	474.00	3,507,600
住友不動産販売	9,500	2,568.00	24,396,000
ゴールドクレスト	10,400	2,022.00	21,028,800
リロ・ホールディング	5,200	13,310.00	69,212,000
日本エスリード	5,400	1,096.00	5,918,400
日神不動産	17,800	385.00	6,853,000
タカラレーベン	58,300	603.00	35,154,900
サンヨーハウジング名古屋	7,500	1,117.00	8,377,500
イオンモール	84,900	1,885.00	160,036,500
ファースト住建	5,000	1,309.00	6,545,000
ランド	54,300	12.00	651,600
東祥	4,100	3,160.00	12,956,000
トーセイ	20,000	708.00	14,160,000
穴吹興産	13,000	243.00	3,159,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	81,800	1,094.00	89,489,200

サンフロンティア不動産	15,900	809.00	12,863,100
エフ・ジェー・ネクスト	10,900	492.00	5,362,800
ランドビジネス	7,100	336.00	2,385,600
グランディハウス	11,600	375.00	4,350,000
東武鉄道	713,000	556.00	396,428,000
相鉄ホールディングス	229,000	655.00	149,995,000
東京急行電鉄	777,000	888.00	689,976,000
京浜急行電鉄	366,000	950.00	347,700,000
小田急電鉄	427,000	1,199.00	511,973,000
京王電鉄	373,000	983.00	366,659,000
京成電鉄	200,000	1,477.00	295,400,000
富士急行	36,000	1,125.00	40,500,000
新京成電鉄	18,000	408.00	7,344,000
東日本旅客鉄道	243,900	10,355.00	2,525,584,500
西日本旅客鉄道	128,400	7,685.00	986,754,000
東海旅客鉄道	119,500	19,765.00	2,361,917,500
西武ホールディングス	106,300	2,278.00	242,151,400
鴻池運輸	18,800	1,459.00	27,429,200
西日本鉄道	173,000	696.00	120,408,000
ハマキョウレックス	10,100	1,977.00	19,967,700
サカイ引越センター	5,200	2,954.00	15,360,800
近鉄グループホールディングス	1,343,000	468.00	628,524,000
阪急阪神ホールディングス	895,000	731.00	654,245,000
南海電気鉄道	300,000	676.00	202,800,000
京阪電気鉄道	299,000	723.00	216,177,000
神戸電鉄	33,000	351.00	11,583,000
名古屋鉄道	486,000	488.00	237,168,000
山陽電気鉄道	47,000	458.00	21,526,000
トランコム	3,900	6,400.00	24,960,000
日本通運	516,000	504.00	260,064,000
ヤマトホールディングス	246,500	2,281.50	562,389,750
山九	176,000	564.00	99,264,000
日新	54,000	319.00	17,226,000
丸運	8,600	248.00	2,132,800
丸全昭和運輸	45,000	404.00	18,180,000
センコー	60,000	747.00	44,820,000
トナミホールディングス	27,000	314.00	8,478,000
ニッコンホールディングス	43,600	2,092.00	91,211,200
日本石油輸送	17,000	237.00	4,029,000
福山通運	81,000	554.00	44,874,000
セイノーホールディングス	94,600	1,116.00	105,573,600
神奈川中央交通	16,000	682.00	10,912,000
日立物流	27,800	1,875.00	52,125,000
丸和運輸機関	2,900	2,144.00	6,217,600
C & F ロジホールディングス	12,000	870.00	10,440,000
日本郵船	1,197,000	262.00	313,614,000
商船三井	649,000	264.00	171,336,000
川崎汽船	583,000	220.00	128,260,000
N S ユナイテッド海運	59,000	190.00	11,210,000
明治海運	12,000	453.00	5,436,000

飯野海運	69,200	433.00	29,963,600
共栄タンカー	12,000	188.00	2,256,000
日本航空	255,300	4,040.00	1,031,412,000
A N Aホールディングス	2,476,000	320.50	793,558,000
パスコ	13,000	417.00	5,421,000
三菱倉庫	95,000	1,450.00	137,750,000
三井倉庫ホールディングス	78,000	306.00	23,868,000
住友倉庫	97,000	573.00	55,581,000
澁澤倉庫	35,000	295.00	10,325,000
ヤマタネ	62,000	175.00	10,850,000
東陽倉庫	24,000	243.00	5,832,000
乾汽船	10,100	921.00	9,302,100
日本トランスシティ	31,000	425.00	13,175,000
ケイヒン	25,000	160.00	4,000,000
中央倉庫	7,900	956.00	7,552,400
安田倉庫	10,600	853.00	9,041,800
東洋埠頭	39,000	170.00	6,630,000
宇徳	11,000	383.00	4,213,000
上組	159,000	940.00	149,460,000
サンリツ	1,700	515.00	875,500
キムラユニティー	3,500	1,165.00	4,077,500
キューソー流通システム	3,700	2,744.00	10,152,800
郵船ロジスティクス	12,300	1,478.00	18,179,400
近鉄エクスプレス	23,900	1,905.00	45,529,500
東海運	8,300	276.00	2,290,800
エーアイティー	6,200	1,075.00	6,665,000
内外トランスライン	3,200	1,015.00	3,248,000
東京放送ホールディングス	78,900	1,749.00	137,996,100
日本テレビホールディングス	120,200	2,047.00	246,049,400
朝日放送	13,100	758.00	9,929,800
テレビ朝日ホールディングス	36,000	1,911.00	68,796,000
スカパーJ S A Tホールディングス	100,000	634.00	63,400,000
テレビ東京ホールディングス	11,800	2,098.00	24,756,400
日本B S放送	2,200	1,067.00	2,347,400
コネクシオ	11,300	1,044.00	11,797,200
日本通信	70,000	240.00	16,800,000
クロップス	1,400	530.00	742,000
日本電信電話	1,017,700	4,689.00	4,771,995,300
K D D I	1,337,500	2,948.50	3,943,618,750
光通信	15,800	7,650.00	120,870,000
N T Tドコモ	1,015,400	2,411.50	2,448,637,100
エムティーアイ	16,900	635.00	10,731,500
G M Oインターネット	48,800	1,417.00	69,149,600
カドカワ	41,100	1,659.00	68,184,900
学研ホールディングス	45,000	245.00	11,025,000
ゼンリン	17,400	2,432.00	42,316,800
昭文社	7,400	695.00	5,143,000
インプレスホールディングス	9,900	137.00	1,356,300
東京電力	1,131,600	659.00	745,724,400
中部電力	408,200	1,534.00	626,178,800

関西電力	544,400	1,349.00	734,395,600
中国電力	184,500	1,548.00	285,606,000
北陸電力	130,700	1,679.00	219,445,300
東北電力	333,300	1,465.00	488,284,500
四国電力	120,200	1,759.00	211,431,800
九州電力	294,600	1,231.00	362,652,600
北海道電力	124,900	1,175.00	146,757,500
沖縄電力	14,100	2,868.00	40,438,800
電源開発	113,700	3,945.00	448,546,500
東京瓦斯	1,489,000	530.00	789,170,000
大阪瓦斯	1,381,000	414.80	572,838,800
東邦瓦斯	336,000	747.00	250,992,000
北海道瓦斯	30,000	279.00	8,370,000
広島ガス	21,600	417.00	9,007,200
西部瓦斯	151,000	265.00	40,015,000
静岡ガス	38,100	750.00	28,575,000
メタウォーター	8,600	2,648.00	22,772,800
アイネット	7,200	1,130.00	8,136,000
松竹	87,000	1,090.00	94,830,000
東宝	94,000	3,120.00	293,280,000
エイチ・アイ・エス	22,700	3,665.00	83,195,500
東映	49,000	1,065.00	52,185,000
AOI Pro.	6,500	945.00	6,142,500
エヌ・ティ・ティ・データ	81,300	5,570.00	452,841,000
共立メンテナンス	10,400	9,000.00	93,600,000
イチネンホールディングス	14,800	1,030.00	15,244,000
建設技術研究所	8,300	1,089.00	9,038,700
スペース	7,600	1,207.00	9,173,200
アインホールディングス	15,900	5,450.00	86,655,000
燦ホールディングス	2,900	1,460.00	4,234,000
ピー・シー・エー	1,500	1,480.00	2,220,000
スバル興業	3,000	426.00	1,278,000
東京テアトル	54,000	133.00	7,182,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	987.00	1,677,900
よみうりランド	28,000	383.00	10,724,000
東京都競馬	96,000	258.00	24,768,000
常磐興産	52,000	150.00	7,800,000
カナモト	19,400	2,677.00	51,933,800
東京ドーム	111,000	599.00	66,489,000
D T S	14,600	2,503.00	36,543,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,700	2,759.00	153,676,300
シーイーシー	8,600	1,108.00	9,528,800
カブコン	33,700	2,737.00	92,236,900
西尾レントオール	11,200	2,967.00	33,230,400
アイ・エス・ピー	1,200	679.00	814,800
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	67,000	38.00	2,546,000
日本空港ビルデング	42,000	4,625.00	194,250,000
トランス・コスモス	16,200	2,911.00	47,158,200

乃村工藝社	29,800	1,598.00	47,620,400
ジャステック	8,100	1,015.00	8,221,500
S C S K	31,300	4,525.00	141,632,500
藤田観光	51,000	546.00	27,846,000
K N T - C Tホールディングス	67,000	217.00	14,539,000
日本管財	12,000	1,768.00	21,216,000
トーカイ	6,200	3,185.00	19,747,000
白洋舎	5,000	256.00	1,280,000
セコム	144,900	7,672.00	1,111,672,800
日本システムウエア	5,000	840.00	4,200,000
セントラル警備保障	6,200	1,804.00	11,184,800
アイネス	18,600	1,018.00	18,934,800
丹青社	26,100	842.00	21,976,200
メイテック	17,400	3,820.00	66,468,000
T K C	12,200	2,921.00	35,636,200
アサツー ディ・ケイ	24,500	2,608.00	63,896,000
富士ソフト	19,600	2,514.00	49,274,400
応用地質	14,700	1,167.00	17,154,900
船井総研ホールディングス	19,440	1,541.00	29,957,040
N S D	28,000	1,629.00	45,612,000
進学会	6,300	600.00	3,780,000
丸紅建材リース	12,000	199.00	2,388,000
オオバ	7,400	446.00	3,300,400
コナミホールディングス	59,400	2,726.00	161,924,400
学究社	2,000	1,281.00	2,562,000
ベネッセホールディングス	46,700	3,245.00	151,541,500
イオンディライト	13,500	3,680.00	49,680,000
ナック	8,700	907.00	7,890,900
福井コンピュータホールディングス	2,900	1,178.00	3,416,200
ニチイ学館	24,300	804.00	19,537,200
ダイセキ	26,200	1,780.00	46,636,000
ステップ	4,900	1,035.00	5,071,500
日鉄住金物産	87,000	372.00	32,364,000
元気寿司	3,700	2,069.00	7,655,300
トラスコ中山	15,000	4,180.00	62,700,000
ヤマダ電機	400,300	518.00	207,355,400
オートバックスセブン	50,500	1,978.00	99,889,000
アークランドサカモト	11,100	2,510.00	27,861,000
ニトリホールディングス	56,900	9,080.00	516,652,000
グルメ杵屋	9,000	975.00	8,775,000
愛眼	10,800	232.00	2,505,600
ケーユーホールディングス	6,900	771.00	5,319,900
吉野家ホールディングス	48,700	1,492.00	72,660,400
加藤産業	20,600	2,730.00	56,238,000
イノテック	12,400	513.00	6,361,200
イエローハット	12,400	2,207.00	27,366,800
松屋フーズ	6,400	2,725.00	17,440,000
J B C Cホールディングス	11,300	709.00	8,011,700
J Kホールディングス	13,500	480.00	6,480,000
サガミチェーン	17,400	1,203.00	20,932,200

日伝	5,500	2,764.00	15,202,000
関西スーパーマーケット	10,300	797.00	8,209,100
ミロク情報サービス	9,500	879.00	8,350,500
北沢産業	11,000	178.00	1,958,000
杉本商事	7,400	1,293.00	9,568,200
因幡電機産業	18,400	3,550.00	65,320,000
王将フードサービス	9,700	4,000.00	38,800,000
プレナス	14,800	1,894.00	28,031,200
ミニストップ	9,700	2,106.00	20,428,200
アークス	24,600	2,397.00	58,966,200
パローホールディングス	28,400	2,560.00	72,704,000
バイテックホールディングス	4,100	1,188.00	4,870,800
ミスミグループ本社	147,700	1,481.00	218,743,700
アルテック	10,900	166.00	1,809,400
ベルク	6,400	4,095.00	26,208,000
大 庄	6,300	1,450.00	9,135,000
タキヒヨー	22,000	465.00	10,230,000
ファーストリテイリング	26,400	37,630.00	993,432,000
ソフトバンクグループ	746,000	5,528.00	4,123,888,000
蔵王産業	2,000	1,346.00	2,692,000
スズケン	59,900	4,260.00	255,174,000
サンドラッグ	27,800	7,400.00	205,720,000
サックスパー ホールディングス	12,300	1,665.00	20,479,500
ジェコス	9,100	954.00	8,681,400
ヤマザワ	2,900	1,661.00	4,816,900
やまや	2,600	1,946.00	5,059,600
ルネサスイーストン	7,700	426.00	3,280,200
ベルーナ	32,900	598.00	19,674,200
合計	221,003,592		276,342,361,426

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,934,112,077	3,378,512,489
国債証券		339,419,433,800	339,001,056,200
地方債証券		27,806,378,865	27,726,101,297
特殊債券		26,394,939,609	23,820,724,355
社債券		22,467,211,060	21,974,406,920
未収利息		1,082,770,376	1,017,983,517
前払費用		22,151,015	20,720,985
流動資産合計		421,126,996,802	416,939,505,763
資産合計		421,126,996,802	416,939,505,763
負債の部			
流動負債			
未払金		-	851,602,400
未払解約金		2,918,128,000	227,765,000
流動負債合計		2,918,128,000	1,079,367,400
負債合計		2,918,128,000	1,079,367,400
純資産の部			
元本等			
元本	1	341,625,978,311	332,334,674,604
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		76,582,890,491	83,525,463,759
元本等合計		418,208,868,802	415,860,138,363
純資産合計		418,208,868,802	415,860,138,363
負債純資産合計		421,126,996,802	416,939,505,763

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	355,706,109,986円	341,625,978,311円
同期中追加設定元本額	32,021,080,215円	51,561,686,310円
同期中一部解約元本額	46,101,211,890円	60,852,990,017円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	10,194,070,381円	10,422,340,439円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	179,996,085円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	134,619,110円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	58,341,657円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	441,457,931円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	110,920,540円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	19,733,972円
たわらノーロード 国内債券	- 円	145,101,455円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	10,964,684,981円	11,440,979,213円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,504,016,816円	4,607,514,076円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	7,051,594,720円	6,981,550,379円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,885,281,806円	2,859,964,156円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,727,685,920円	1,702,593,088円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,922,594,428円	1,868,821,247円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	285,162,823円	277,399,912円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	124,568,526円	116,791,587円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,344,669,637円	2,431,182,324円

マネックス資産設計ファンド エボ リューション	6,016,165円	9,416,069円
D I A M D C 8資産バランスファ ンド(新興国10)	182,328,817円	238,570,350円
D I A M D C 8資産バランスファ ンド(新興国20)	141,269,796円	171,177,768円
D I A M D C 8資産バランスファ ンド(新興国30)	42,287,045円	45,802,577円
投資のソムリエ	9,912,612,951円	7,838,572,612円
クルーズコントロール	333,830,632円	909,261,368円
投資のソムリエ<DC年金>	139,816,158円	140,353,064円
D I A M 8資産バランスファンドN <DC年金>	505,119,320円	696,372,772円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	17,797,024円	48,959,007円
クルーズコントロール<DC年金>	94,924円	144,945円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実 型)	- 円	3,304,061円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極 型)	- 円	4,498,216円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑 制型	- 円	2,924,563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)	12,027,510,061円	31,119,371,814円
D I A Mアクティブアロケーション私 募ファンド(適格機関投資家限定)	24,226,043円	775,948,701円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	695,661,130円	627,350,416円
D I A Mグローバル・バランスファン ド25VA(適格機関投資家限定)	2,756,649,468円	1,243,748,653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)	383,538,547円	333,618,744円
D I A M国際分散バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	196,961,758円	168,338,894円
D I A M国際分散バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	583,185,967円	442,409,232円
D I A M国内重視バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	224,202,904円	177,024,127円
D I A M国内重視バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	189,733,936円	141,749,531円
D I A M世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	19,874,418,620円	14,319,323,771円
D I A M世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	7,566,552,491円	5,433,174,282円

D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	11,638,320,717円	9,230,597,150円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	4,614,755,065円	4,137,017,580円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,013,294,102円	7,238,748,293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)	947,817,654円	844,399,916円
D I A Mグローバル・アセット・バ ランスVA2(適格機関投資家限定)	4,155,687,596円	3,663,128,444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)	5,746,873,429円	5,142,793,879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)	7,904,120,989円	7,021,084,542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)	900,011,011円	884,082,241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)	7,874,894,570円	7,038,621,101円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	8,201,760,441円	7,564,188,784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)	260,636,911円	- 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)	102,773,581,647円	95,566,153,088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)	1,557,161,668円	1,372,854,302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)	8,971,992,352円	8,115,982,356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)	32,496,632,249円	30,286,852,009円
D I A Mバランス30VA(適格機関 投資家限定)	502,014円	495,530円
D I A Mバランス50VA(適格機関 投資家限定)	380,784円	41,401,133円
D I A Mバランス70VA(適格機関 投資家限定)	58,836,852円	27,629,632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)	36,228,782,319円	33,976,620,681円
D I A M世界バランス25VA(適格 機関投資家限定)	681,242,814円	630,558,152円
D I A M国内バランス30VA(適格 機関投資家限定)	176,716,604円	167,965,929円
D I A Mバランス20VA(適格機関 投資家限定)	578,700円	418,821,258円
D I A Mバランス40VA(適格機関 投資家限定)	575,067,603円	243,744,056円
D I A Mバランス60VA(適格機関 投資家限定)	8,325,586円	351,001円

計	341,625,978,311円	332,334,674,604円
2. 受益権の総数	341,625,978,311口	332,334,674,604口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	991,042,600	7,438,289,000
地方債証券	69,832,134	44,591,254
特殊債券	58,685,468	59,337,796
社債券	81,562,520	87,441,060
合計	780,962,478	7,336,101,398

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年2月17日から平成27年7月13日まで及び平成27年2月17日から平成28年1月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.2242円	1.2513円
(1万口当たり純資産額)	(12,242円)	(12,513円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年1月12日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	350回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,720,000	
	351回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,503,000,000	
	353回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,004,520,000	
	354回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,503,585,000	
	355回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,007,350,000	
	356回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,005,160,000	
	103回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,519,080,000	
	105回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,516,740,000	
	106回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,519,305,000	
	107回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,315,279,000	
	109回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,005,440,000	
	110回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,014,160,000	
	112回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,515,315,000	
	113回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,022,950,000	
	114回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,530,030,000	
	116回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,227,090,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,530,735,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,532,400,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,460,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,506,075,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,518,540,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,020,850,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,021,000,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,021,050,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	754,920,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,259,150,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,261,400,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	963,880,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,057,878,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	891,880,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	715,379,000	
	285回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,531,020,000	
	286回 利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,669,212,000	
	288回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,544,310,000	
	289回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,294,912,000	
	290回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,031,050,000	
	293回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,297,064,000	
	296回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,121,950,000	
	297回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,395,427,000	
	299回 利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,187,444,000	

301回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,050,249,000
303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,419,002,000
305回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,678,850,000
306回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,645,675,000
308回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,374,256,000
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,096,520,000
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,929,024,000
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,328,458,000
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,199,440,000
315回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,341,438,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,061,590,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,795,064,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,596,435,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,799,229,000
321回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,182,370,000
324回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,625,225,000
325回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	3,996,460,000
326回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,778,778,000
328回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,599,275,000
329回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,371,149,000
330回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,110,740,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,600,400,000
333回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,120,390,000
334回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,432,165,000
335回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,578,300,000
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,546,260,000
337回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,026,440,000
338回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,574,340,000
339回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,081,600,000
340回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,097,400,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	131,048,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,023,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,522,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,274,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,748,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,940,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	376,755,000
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	353,211,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	463,576,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	367,239,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	361,845,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	636,555,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,924,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	515,548,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	254,284,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,027,074,600
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,238,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,067,000
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	625,165,000
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	604,612,700

23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	772,326,000
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,388,000
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	750,594,000
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,271,330,000
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,163,349,000
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,035,680,000
29回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,405,503,000
30回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,638,026,000
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,116,405,000
32回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,768,130,000
33回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,798,710,000
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,865,790,000
35回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,799,160,000
36回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	2,040,000,000
37回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,881,488,000
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,151,270,000
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	939,808,000
40回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,150,980,000
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	901,592,000
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,126,640,000
43回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,126,280,000
44回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,238,490,000
45回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,183,578,000
46回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,505,406,000
47回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,650,225,000
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,154,461,000
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	631,764,000
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	422,928,000
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	764,719,200
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	866,648,000
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	952,183,400
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	990,243,000
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	548,545,000
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,047,422,500
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	561,400,000
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	856,596,000
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	664,830,000
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	615,307,000
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	790,874,000
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	909,281,700
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,266,831,700
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	675,048,000
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,083,436,200
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	854,968,000
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,371,149,000
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	683,898,000
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,257,289,000
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,177,419,000
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,489,087,500
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,462,037,500

73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,385,850,200	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,646,400,000	
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,682,029,000	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,640,128,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,658,216,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,018,155,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,816,260,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,684,914,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,554,254,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	830,494,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	958,328,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,834,575,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,699,264,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,686,398,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,827,315,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,116,381,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,815,450,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,060,400,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,901,616,000	
111回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,211,534,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,314,485,000	
114回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,437,400,000	
116回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,714,910,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,206,750,000	
119回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,414,716,000	
121回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,266,928,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,323,985,000	
125回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,476,160,000	
128回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,075,104,000	
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,061,514,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,005,337,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,210,327,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,060,821,000	
135回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,163,070,000	
137回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,323,800,000	
140回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,206,888,000	
141回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,554,288,000	
143回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,745,936,000	
145回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,201,986,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,198,946,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,163,796,000	
148回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,239,940,000	
149回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,570,963,000	
150回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,196,820,000	
151回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,441,220,000	
152回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,905,444,000	
153回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,683,125,000	
154回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,895,040,000	
国債証券 合計		310,820,000,000	339,001,056,200	
地方債証券	659回 東京都公募公債	203,500,000	211,222,825	

6 6 4 回	東京都公募公債	300,000,000	311,745,000	
6 6 7 回	東京都公募公債	300,000,000	314,394,000	
6 8 0 回	東京都公募公債	200,000,000	211,092,000	
6 8 5 回	東京都公募公債	500,000,000	523,535,000	
6 8 8 回	東京都公募公債	200,000,000	208,120,000	
6 9 7 回	東京都公募公債	500,000,000	527,835,000	
7 0 1 回	東京都公募公債	700,000,000	736,008,000	
7 0 8 回	東京都公募公債	500,000,000	525,425,000	
7 2 0 回	東京都公募公債	300,000,000	315,765,000	
7 2 6 回	東京都公募公債	400,000,000	417,048,000	
9 回	東京都公募公債 20年	200,000,000	242,330,000	
1 9 年度 4 回	北海道公募公債	300,000,000	308,049,000	
2 1 年度 6 回	北海道公募公債	200,000,000	210,638,000	
2 2 年度 1 2 回	北海道公募公債	200,000,000	211,360,000	
1 6 6 回	神奈川県公募公債	300,000,000	314,241,000	
1 9 4 回	神奈川県公募公債	300,000,000	313,629,000	
2 0 8 回	神奈川県公募公債	300,000,000	306,951,000	
3 0 1 回	大阪府公募公債	100,000,000	102,166,000	
3 0 7 回	大阪府公募公債	100,000,000	103,037,000	
3 1 0 回	大阪府公募公債	240,000,000	247,257,600	
3 1 9 回	大阪府公募公債	200,000,000	208,668,000	
3 3 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	211,096,000	
3 4 5 回	大阪府公募公債	300,000,000	316,131,000	
3 5 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	210,430,000	
3 6 4 回	大阪府公募公債	300,000,000	311,823,000	
3 7 4 回	大阪府公募公債	300,000,000	315,510,000	
2 6 年度 1 1 回	京都府公募公債	350,000,000	355,218,500	
1 9 年度 2 回	兵庫県公募公債	200,000,000	204,546,000	
2 6 年度 1 7 回	兵庫県公募公債	200,000,000	201,948,000	
1 回	兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	319,782,000	
2 1 年度 5 回	静岡県公募公債	197,000,000	206,444,180	
2 2 年度 8 回	静岡県公募公債	200,000,000	209,004,000	
2 3 年度 9 回	静岡県公募公債	200,000,000	211,024,000	
2 0 年度 4 回	愛知県公募公債	100,000,000	104,126,000	
2 2 年度 6 回	愛知県公募公債	200,000,000	209,944,000	
2 3 年度 2 0 回	愛知県公募公債	500,000,000	530,200,000	
2 5 年度 4 回	愛知県公募公債	300,000,000	315,336,000	
2 2 年度 1 回	広島県公募公債	200,000,000	211,234,000	
2 1 年度 4 回	埼玉県公募公債	440,000,000	461,568,800	
2 3 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	211,614,000	
2 6 年度 5 回	埼玉県公募公債	400,000,000	411,228,000	
2 1 年度 3 回	福岡県公募公債	200,000,000	210,688,000	
2 5 年度 1 1 回	福岡県公募公債	200,000,000	207,068,000	
1 9 年度 5 回	千葉県公募公債	300,000,000	309,447,000	
2 1 年度 6 回	千葉県公募公債	200,000,000	209,900,000	
2 4 年度 7 回	千葉県公募公債	300,000,000	312,588,000	
2 5 年度 5 回	千葉県公募公債	200,000,000	210,078,000	
5 4 回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,916,000	
5 5 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,260,000	
5 7 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,058,000	

6 1 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,041,000		
6 5 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,017,000		
7 5 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	526,840,000		
8 0 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	739,382,000		
9 4 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	528,290,000		
9 9 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	740,187,000		
1 0 6 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,447,000		
1 0 9 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	529,205,000		
1 1 1 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	734,713,000		
1 1 9 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,250,000		
1 2 1 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,125,000		
1 2 6 回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	832,229,492		
1 2 7 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,200,000		
1 2 8 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,049,000		
1 3 7 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,050,000		
1 3 9 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,910,000		
1 4 2 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,550,000		
1 4 4 回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,360,000		
1 4 6 回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,284,000		
1 4 8 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,920,000		
1 9 年度 5 回	大阪市公募公債	135,000,000	138,812,400		
4 8 8 回	名古屋市公募公債 1 0 年	450,000,000	461,979,000		
2 2 年度 3 回	横浜市公募公債	200,000,000	210,150,000		
2 2 年度 5 回	横浜市公募公債	200,000,000	211,388,000		
2 3 年度 4 回	横浜市公募公債	450,000,000	474,655,500		
2 5 年度 2 回	横浜市公募公債	400,000,000	421,584,000		
1 9 年度 7 回	札幌市公募公債	300,000,000	309,192,000		
2 5 年度 4 回	札幌市公募公債	200,000,000	209,326,000		
2 回	川崎市公募公債 1 5 年	100,000,000	106,882,000		
2 1 年度 2 回	北九州市公募公債	200,000,000	210,076,000		
2 3 年度 1 回	千葉市公募公債	200,000,000	213,280,000		
地方債証券 合計		26,559,400,000	27,726,101,297		
特殊債券	4 6 回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,908,000	
	2 5 回	高速道路機構債	300,000,000	308,592,000	
	3 5 回	高速道路機構債	400,000,000	413,468,000	
	4 8 回	高速道路機構債	700,000,000	734,951,000	
	9 6 回	高速道路機構債	700,000,000	728,252,000	
	1 1 6 回	高速道路機構債	100,000,000	103,524,000	
	9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,313,000	
	1 8 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	335,361,000	
	3 3 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	303,100,380	
	3 6 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	352,906,160	
	4 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	340,708,230	
	4 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,450,000	

5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,335,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,926,000	
6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	736,686,930	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	168,175,440	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	417,914,180	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	623,052,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	730,135,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,862,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,452,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	421,048,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,042,360,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,465,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	527,205,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	348,744,000	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,775,000	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	492,425,660	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	514,225,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	681,766,260	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,092,420	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,815,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,568,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,090,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,216,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,488,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,809,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,081,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	419,884,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	528,225,000	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,289,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	208,434,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,972,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,932,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	66,012,000	71,348,410	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	46,018,000	49,635,474	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	68,256,000	73,694,638	

2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	73,503,000	79,836,753	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	32,780,000	34,519,306	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	167,675,000	175,227,082	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,677,000	45,226,659	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,790,000	31,327,838	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	106,088,000	115,403,587	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	83,997,000	91,139,264	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,980,000	153,610,563	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	243,010,000	261,274,631	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	476,704,000	508,075,890	
7 5 5 号 利付商工債	260,000,000	260,795,600	
い第 7 6 9 号 利付商工債	200,000,000	200,516,000	
い第 7 7 9 号 利付商工債	200,000,000	200,340,000	
7 4 3 号 利附農林債	300,000,000	300,957,000	
7 5 3 号 利附農林債	300,000,000	300,333,000	
7 6 0 号 利附農林債	300,000,000	301,656,000	
7 6 4 号 利附農林債	500,000,000	502,145,000	
2 7 5 回 利附信金中金債	400,000,000	400,876,000	
2 8 2 回 利附信金中金債	300,000,000	300,933,000	
3 0 2 回 利附信金中金債	300,000,000	300,264,000	
1 7 1 号 利附商工債（3 年）	200,000,000	200,072,000	
1 8 6 号 利附商工債（3 年）	200,000,000	199,874,000	
2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	311,358,000	
5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	209,128,000	
5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	522,175,000	
特殊債券 合計	22,945,490,000	23,820,724,355	
社債券			
1 回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,701,000	
2 7 回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,482,000	
2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	311,706,000	
7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,518,000	
9 回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,374,000	
3 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	104,439,000	
4 1 回 住友化学社債	100,000,000	105,175,000	
3 7 回 三菱化学社債	100,000,000	104,815,000	
1 2 回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,433,000	
8 回 プリヂストン社債	200,000,000	200,786,000	
2 9 回 新日本製鐵社債	100,000,000	103,747,000	
6 4 回 新日本製鐵社債	100,000,000	105,223,000	
1 回 日本電産社債	100,000,000	100,460,000	
1 1 回 パナソニック社債	100,000,000	101,999,000	
1 2 回 パナソニック社債	200,000,000	200,620,000	
5 6 回 日産自動車社債	100,000,000	101,292,000	
1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	210,062,000	
1 6 回 トヨタ自動車社債	100,000,000	102,631,000	

4 9回	伊藤忠商事社債	100,000,000	105,111,000	
6 6回	伊藤忠商事社債	200,000,000	200,828,000	
9 1回	丸紅社債	100,000,000	100,458,000	
9 4回	丸紅社債	100,000,000	104,807,000	
4 5回	住友商事社債	100,000,000	104,374,000	
4 7回	住友商事社債	100,000,000	102,748,000	
6 9回	三菱商事社債	300,000,000	313,125,000	
4 8回	クレディセゾン社債	100,000,000	102,899,000	
7回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	308,889,000	
2 9回	みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	501,980,000	
3 1回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	300,894,000	
3 2回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,396,000	
7回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	107,336,000	
1 3 4回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,906,000	
1 4 0回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,417,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	214,420,000	
1 2回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,868,000	
2 5回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,522,000	
2 8回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,362,000	
3 2回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	320,709,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,321,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,068,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,102,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	106,927,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,258,000	
1 2回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,825,000	
1 0回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,820,000	
1 0回	セブン銀行社債	100,000,000	103,782,000	
5 7回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,807,000	
1 1回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	207,432,000	
2 0回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,694,000	
2 2回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,332,000	
2 3回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	425,104,000	
1 0回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,561,000	
1 4回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	213,356,000	
2 0回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,516,000	
2 3回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,372,000	
1 5回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	214,896,000	
4 7回	日立キャピタル社債	200,000,000	206,744,000	
1 4 4回	オリックス社債	100,000,000	102,352,000	
1 6 4回	オリックス社債	100,000,000	102,850,000	
1 6 7回	オリックス社債	200,000,000	200,878,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,828,000	
3 9回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,128,000	
4 6回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,382,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	103,081,000	
3 8回	三井不動産社債	200,000,000	210,000,000	
7 2回	三菱地所社債	100,000,000	115,919,000	
9 0回	三菱地所社債	100,000,000	103,531,000	
9 6回	三菱地所社債	200,000,000	210,304,000	

84回	住友不動産社債	100,000,000	100,351,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,038,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	104,178,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,138,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	334,077,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,080,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	345,627,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	310,137,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,833,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,358,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	339,612,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,879,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,137,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	194,176,200	
11回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,244,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	115,077,000	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	213,030,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,584,000	
5回	KDDI社債	100,000,000	104,011,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	207,384,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	316,647,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	208,924,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	207,806,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	510,695,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	104,643,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	520,940,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	314,157,000	
486回	関西電力社債	154,000,000	155,275,120	
492回	関西電力社債	200,000,000	201,726,000	
493回	関西電力社債	200,000,000	201,654,000	
310回	中国電力社債	200,000,000	209,262,000	
377回	中国電力社債	200,000,000	210,118,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	108,885,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	207,968,000	
471回	東北電力社債	200,000,000	209,974,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	303,708,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	105,158,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	208,296,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	204,492,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	210,142,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	414,520,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,206,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	164,638,600	
38回	電源開発社債	300,000,000	310,326,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	106,008,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	105,662,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	108,428,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	104,515,000	
社債券 合計		21,105,000,000	21,974,406,920	
合計		381,429,890,000	412,522,288,772	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		514,592,003	64,656,718
投資証券		20,592,277,900	22,044,521,100
未収入金		-	1,934,442,837
未収配当金		203,063,456	196,965,222
流動資産合計		21,309,933,359	24,240,585,877
資産合計		21,309,933,359	24,240,585,877
負債の部			
流動負債			
未払金		432,153,693	490,278
未払解約金		2,791,000	104,733,000
流動負債合計		434,944,693	105,223,278
負債合計		434,944,693	105,223,278
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,080,131,931	15,337,732,833
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		7,794,856,735	8,797,629,766
元本等合計		20,874,988,666	24,135,362,599
純資産合計		20,874,988,666	24,135,362,599
負債純資産合計		21,309,933,359	24,240,585,877

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	16,405,369,329円	13,080,131,931円
同期中追加設定元本額	7,771,120,284円	8,382,392,434円
同期中一部解約元本額	11,096,357,682円	6,124,791,532円
元本の内訳 ファンド名		
MITO ラップ型ファンド （安定型）	- 円	397,486円
MITO ラップ型ファンド （中立型）	- 円	1,218,861円
MITO ラップ型ファンド （積極型）	- 円	3,050,633円
グローバル8資産ラップファン ド（安定型）	- 円	971,903円
グローバル8資産ラップファン ド（中立型）	- 円	1,001,579円
グローバル8資産ラップファン ド（積極型）	- 円	1,030,011円
たわらノーロード 国内リー ト	- 円	67,911,873円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	19,617,425円	18,438,842円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	361,892,952円	375,068,015円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,559,190円	4,469,392円
D I A M D C 8資産 balan スファンド（新興国10）	7,439,572円	9,721,510円
D I A M D C 8資産 balan スファンド（新興国20）	20,152,377円	25,042,951円
D I A M D C 8資産 balan スファンド（新興国30）	56,381,518円	61,581,809円
投資のソムリエ	273,099,340円	577,590,467円
投資のソムリエ<DC年金>	3,553,582円	10,300,179円
D I A M 8資産バランスマ ンドN<DC年金>	19,370,382円	27,363,706円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	- 円	254,694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)	2,053,707,555円	2,017,708,759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)	1,109,657,775円	1,090,204,032円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	2,161,914,672円	2,124,936,873円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド(適格機関投資家向け)	6,177,926,213円	6,951,010,304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)	56,348,609円	57,261,963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)	40,588,147円	- 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)	273,826,779円	834,883,747円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	403,618,175円	1,038,835,576円
D I A M リスクコントロールJ - R E I Tファンド(適格機関投資家限定)	37,477,668円	37,477,668円
計	13,080,131,931円	15,337,732,833円
2 . 受益権の総数	13,080,131,931口	15,337,732,833口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	1,538,429,072	1,618,075,119
合計	1,538,429,072	1,618,075,119

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年6月9日から平成27年7月13日まで及び平成27年6月9日から平成28年1月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.5959円	1.5736円
(1万口当たり純資産額)	(15,959円)	(15,736円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年1月12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	5,751	600,979,500	
	MCUBS MidCity投資法人	590	190,275,000	
	SIA不動産投資法人	167	70,724,500	
	いちごオフィスリート投資法人	3,140	256,224,000	
	いちごホテルリート投資法人	307	42,151,100	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,322	666,288,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,882	728,569,600	
	イオンリート投資法人	2,417	307,684,100	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,202	114,430,400	
	インヴィンシブル投資法人	7,081	454,600,200	
	オリックス不動産投資法人	5,146	774,473,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	430	170,710,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	898	470,552,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	774	223,376,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	788	187,307,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,051	222,601,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	362	29,249,600	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	188	25,586,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,972	599,592,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,804	352,462,800	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,903	1,648,904,000	
	スターツプロシード投資法人	385	62,870,500	
	トーセイ・リート投資法人	357	39,448,500	
	トップリート投資法人	390	169,455,000	
	ヒューリックリート投資法人	1,732	280,064,400	
	フロンティア不動産投資法人	1,100	499,950,000	
	プレミアム投資法人	2,920	345,144,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	267	27,874,800	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,101	962,737,800	
	阪急リート投資法人	1,325	161,517,500	
	産業ファンド投資法人	782	419,152,000	
	森トラスト総合リート投資法人	2,927	561,984,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,481	515,188,000	
	星野リゾート・リート投資法人	173	206,389,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	2,257	223,443,000		
積水ハウス・リート投資法人	1,761	210,263,400		
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,658	381,008,400		
大和ハウスリート投資法人	778	342,320,000		
大和証券オフィス投資法人	1,073	670,625,000		

東急リアル・エステート投資法人	2,168	315,660,800	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,074	424,230,000	
日本ビルファンド投資法人	3,131	1,734,574,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,936	759,880,000	
日本プロロジスリート投資法人	3,838	752,631,800	
日本ヘルスケア投資法人	165	27,109,500	
日本リート投資法人	869	227,417,300	
日本リテールファンド投資法人	5,659	1,235,925,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,951	415,172,800	
日本賃貸住宅投資法人	3,636	280,335,600	
福岡リート投資法人	1,656	315,633,600	
平和不動産リート投資法人	2,250	177,750,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,253	1,162,022,400	
投資証券 合計	113,228	22,044,521,100	
合計	113,228	22,044,521,100	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,752,765,889	3,843,175,851
コール・ローン		1,282,659,298	99,622,215
株式		291,030,892,832	239,368,397,850
投資信託受益証券		848,351,630	710,818,356
投資証券		6,279,970,441	5,843,780,192
派生商品評価勘定		15,327,722	214,385
未収入金		69,728,729	1,939,313
未収配当金		364,321,040	344,637,908
差入委託証拠金		1,063,368,206	1,662,902,378
流動資産合計		302,707,385,787	251,875,488,448
資産合計		302,707,385,787	251,875,488,448
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,277,394	344,558,300
未払解約金		1,591,118,000	100,968,000
流動負債合計		1,598,395,394	445,526,300
負債合計		1,598,395,394	445,526,300
純資産の部			
元本等			
元本	1	101,093,625,635	97,735,137,391
剰余金			
剰余金又は欠損金()		200,015,364,758	153,694,824,757
元本等合計		301,108,990,393	251,429,962,148
純資産合計		301,108,990,393	251,429,962,148
負債純資産合計		302,707,385,787	251,875,488,448

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27年7月13日現在	平成28年1月12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	109,595,049,033円	101,093,625,635円
同期中追加設定元本額	7,048,160,386円	10,633,225,942円
同期中一部解約元本額	15,549,583,784円	13,991,714,186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	1,057,710,072円	1,152,620,379円
M I T O ラップ型ファンド （安定型）	- 円	4,948,687円
M I T O ラップ型ファンド （中立型）	- 円	10,286,868円
M I T O ラップ型ファンド （積極型）	- 円	25,891,522円
グローバル8資産ラップファン ド（安定型）	- 円	12,127,549円
グローバル8資産ラップファン ド（中立型）	- 円	8,505,193円
グローバル8資産ラップファン ド（積極型）	- 円	8,744,923円
たわらノーロード 先進国株式	- 円	271,389,618円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C年金>	33,874,452,407円	34,267,965,537円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	140,592,583円	156,636,797円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	828,101,362円	836,424,717円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,037,093,422円	1,060,659,656円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	137,192,322円	140,986,314円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	403,472,656円	406,671,520円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	330,112,172円	338,651,848円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	46,028,751円	42,663,525円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	842,449,000円	872,208,370円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	230,975,699円	231,794,603円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国1 0）	13,626,492円	18,857,253円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国2 0）	28,038,338円	36,754,707円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国3 0）	70,469,211円	80,148,275円
投資のソムリエ	246,196,365円	339,757,071円
クルーズコントロール	48,135,914円	159,910,174円

投資のソムリエ< D C 年金 >	3,430,343円	6,043,950円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C 年金 >	36,616,505円	53,767,391円
D I A M D C バランス・F (成長型)	6,359,319円	18,740,201円
クルーズコントロール< D C 年 金 >	13,159円	25,159円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	- 円	1,464,834円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	- 円	1,957,062円
投資のソムリエ< D C 年金 > リ スク抑制型	- 円	73,969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)	307,689,726円	251,105,219円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,402,793,462円	3,401,821,371円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	248,285,051円	174,358,190円
D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	37,428,332円	35,597,952円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	951,806,758円	451,682,842円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	397,074,310円	363,764,256円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	34,876,695円	31,437,072円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	241,092,306円	192,853,625円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	18,508,821円	15,423,325円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	39,300,546円	30,887,628円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	5,490,210,710円	4,160,443,133円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	3,135,710,029円	2,368,277,596円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,204,917,500円	1,005,184,802円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限定)	1,112,676,523円	1,051,917,126円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,321,021,838円	3,155,528,740円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	1,305,925,295円	1,233,229,496円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	2,062,752,135円	1,925,332,257円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	1,582,584,702円	1,492,762,853円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	1,085,198,775円	1,018,540,451円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	11,130,233円	11,130,233円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	4,894,631,283円	4,623,912,268円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	1,660,483,001円	1,693,059,024円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	11,112,697円	- 円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	10,638,721,878円	10,410,355,488円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	644,913,031円	598,466,354円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	1,858,539,067円	1,768,131,803円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	6,721,777,124円	6,600,216,428円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	128,952円	133,759円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	249,413円	28,727,295円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	89,390,196円	43,970,103円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	8,990,836,536円	8,884,320,454円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	69,952円	54,572,307円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	204,545,606円	91,043,052円

	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	6,177,060円	273,217円
計		101,093,625,635円	97,735,137,391円
2.	受益権の総数	101,093,625,635口	97,735,137,391口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	946,604,121	25,905,428,686
投資信託受益証券	57,578,495	62,123,082
投資証券	514,353,609	342,241,526
合計	1,518,536,225	26,309,793,294

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年2月17日から平成27年7月13日まで及び平成27年2月17日から平成28年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年7月13日 現在				平成28年1月12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	321,761,660	-	324,334,900	2,573,240	122,124,485	-	121,910,100	214,385
アメリカ・ドル	254,237,632	-	256,004,100	1,766,468	67,145,430	-	67,140,300	5,130
イギリス・ポンド	14,955,424	-	15,199,200	243,776	15,445,830	-	15,427,800	18,030
オーストラリア・ドル	8,173,260	-	8,190,900	17,640	2,473,620	-	2,473,200	420
カナダ・ドル	6,699,056	-	6,754,300	55,244	7,493,510	-	7,461,000	32,510
ユーロ	37,696,288	-	38,186,400	490,112	29,566,095	-	29,407,800	158,295
買 建	154,787,648	-	154,779,300	8,348	-	-	-	-
アメリカ・ドル	95,548,596	-	95,542,200	6,396	-	-	-	-
イギリス・ポンド	15,199,632	-	15,199,200	432	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	7,280,736	-	7,280,000	736	-	-	-	-
カナダ・ドル	6,754,776	-	6,754,300	476	-	-	-	-
ユーロ	30,003,908	-	30,003,600	308	-	-	-	-
合計	476,549,308	-	479,114,200	2,581,588	122,124,485	-	121,910,100	214,385

（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27年7月13日 現在				平成28年1月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,035,394,383	-	3,046,026,299	10,631,916	5,666,776,185	-	5,322,217,885	344,558,300
合計	3,035,394,383	-	3,046,026,299	10,631,916	5,666,776,185	-	5,322,217,885	344,558,300

(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27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	2.9785円	2.5726円
(1万口当たり純資産額)	(29,785円)	(25,726円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年1月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,121	617.740	18,606,946.540	
	ABBOTT LABORATORIES	114,220	40.730	4,652,180.600	
	AES CORP	47,729	9.030	430,992.870	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,398	133.230	9,379,125.540	
	ADOBE SYSTEMS INC	37,627	89.380	3,363,101.260	
	ACE LTD	24,550	110.290	2,707,619.500	
	AGCO CORP	6,536	45.210	295,492.560	
	AIRGAS INC	4,576	138.420	633,409.920	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,942	119.490	1,904,909.580	
	ENERGEN CORP	5,191	35.050	181,944.550	
	ALLEGHANY CORP	1,188	472.540	561,377.520	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	68,191	59.180	4,035,543.380	
	RALPH LAUREN CORP	4,294	102.040	438,159.760	
	ALLSTATE CORP	30,066	58.020	1,744,429.320	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	56,202	98.420	5,531,400.840	
	ALCOA INC	102,779	8.000	822,232.000	
	AMGEN INC	57,820	147.690	8,539,435.800	
	HESS CORP	20,456	41.690	852,810.640	
	AMERICAN EXPRESS CO	68,647	64.050	4,396,840.350	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	38,075	58.770	2,237,667.750	
	AFLAC INC	31,712	57.080	1,810,120.960	
	AMERICAN INTL GROUP	98,619	57.690	5,689,330.110	
	AMERCO	551	361.200	199,021.200	
	JARDEN CORP	13,598	52.670	716,206.660	
	ANALOG DEVICES	22,759	51.170	1,164,578.030	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	38,745	37.750	1,462,623.750	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,147	161.650	2,771,812.550	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	31,929	30.280	966,810.120	
	TIME WARNER	62,272	69.610	4,334,753.920	
	JONES LANG LASALLE INC	3,046	142.310	433,476.260	
	VALERO ENERGY CORP	37,975	69.070	2,622,933.250	
	APACHE CORP	29,768	35.060	1,043,666.080	
ANSYS INC	7,266	85.270	619,571.820		
APPLE INC	432,421	98.530	42,606,441.130		
APPLIED MATERIALS INC	92,368	16.680	1,540,698.240		
ALBEMARLE CORP	7,690	48.040	369,427.600		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,013	34.160	1,605,964.080	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	64.780	606,340.800	
AMEREN CORP	19,716	43.520	858,040.320	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	48.260	374,835.420	
ASHLAND INC	5,128	98.510	505,159.280	
AGL RESOURCES INC	8,945	63.740	570,154.300	
AUTOLIV INC	7,264	112.970	820,614.080	
AUTODESK INC	16,361	55.230	903,618.030	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,675	78.510	2,800,844.250	
AUTOZONE INC	2,371	718.690	1,704,013.990	
AVERY DENNISON CORP	5,989	59.710	357,603.190	
AVNET INC	10,288	39.010	401,334.880	
BAKER HUGHES INC	34,030	41.510	1,412,585.300	
BALL CORP	10,625	69.160	734,825.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	90,521	128.360	11,619,275.560	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,330	37.420	3,155,628.600	
CR BARD INC	5,892	177.960	1,048,540.320	
BAXTER INTERNATIONAL INC	41,887	35.590	1,490,758.330	
BED BATH & BEYOND INC	12,030	46.140	555,064.200	
BECTON DICKINSON & CO	15,840	141.150	2,235,816.000	
AMETEK INC	19,168	48.200	923,897.600	
BE AEROSPACE INC	7,540	40.110	302,429.400	
VERIZON COMM INC	308,032	45.090	13,889,162.880	
WR BERKLEY CORP	6,604	51.320	338,917.280	
BEST BUY CO INC	23,778	29.430	699,786.540	
YUM! BRANDS INC	32,120	68.020	2,184,802.400	
FIRSTENERGY CORP	33,061	32.070	1,060,266.270	
H&R BLOCK INC	16,944	32.390	548,816.160	
ENSCO PLC-CL A	16,993	11.770	200,007.610	
BOEING CO	49,242	130.210	6,411,800.820	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	43.800	475,054.800	
BORGWARNER INC	17,824	36.890	657,527.360	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,133	17.130	1,715,278.290	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	61.750	715,806.000	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	310.860	684,824.580	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	126,910	62.980	7,992,791.800	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	135.840	580,851.840	
ONEOK INC	16,401	22.610	370,826.610	
UNITED RENTALS INC	7,795	60.960	475,183.200	
SEMPRA ENERGY	18,407	89.690	1,650,923.830	
FEDEX CORP	20,227	132.970	2,689,584.190	

VERISIGN INC	7,229	78.070	564,368.030	
AMPHENOL CORP	23,947	46.270	1,108,027.690	
BROWN-FORMAN CORP	8,455	93.900	793,924.500	
QUANTA SERVICES INC	16,615	18.470	306,879.050	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	23,243	49.450	1,149,366.350	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	179,873	3.820	687,114.860	
CSX CORP	72,208	23.520	1,698,332.160	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,517	30.780	477,613.260	
CABOT OIL & GAS CORP	33,871	16.000	541,936.000	
CAMPBELL SOUP CO	13,787	51.400	708,651.800	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,338	31.350	731,646.300	
WHITING PETROLEUM CORP	15,410	7.280	112,184.800	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,276	147.050	1,952,235.800	
CARDINAL HEALTH INC	24,006	79.270	1,902,955.620	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	53.940	1,751,539.680	
CATERPILLAR INC	43,844	61.470	2,695,090.680	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,931	76.990	841,577.690	
CELGENE CORP	59,495	103.030	6,129,769.850	
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	93.720	296,061.480	
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	68.870	860,186.300	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	4.170	186,007.020	
CENTURYLINK INC	44,154	24.120	1,064,994.480	
CERNER CORP	22,587	57.260	1,293,331.620	
JPMORGAN CHASE & CO	279,991	58.830	16,471,870.530	
CHUBB CORP	17,289	128.770	2,226,304.530	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,603	82.620	876,019.860	
CIGNA CORP	20,009	134.730	2,695,812.570	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	55.890	661,290.480	
CINTAS CORP	7,454	85.310	635,900.740	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	79,229	4.515	357,718.930	
CISCO SYSTEMS INC	386,121	25.270	9,757,277.670	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	7,706	36.090	278,109.540	
CLOROX COMPANY	9,481	127.680	1,210,534.080	
COCA-COLA CO/THE	313,037	41.580	13,016,078.460	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	16,090	46.450	747,380.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	64,222	62.810	4,033,783.820	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	16,077	63.160	1,015,423.320	
COMERICA INC	13,912	38.750	539,090.000	
NRG ENERGY, INC.	23,703	10.230	242,481.690	
COMCAST CORP-CL A	187,605	54.720	10,265,745.600	

CA INC	26,267	26.200	688,195.400	
CONAGRA FOODS INC	31,664	40.190	1,272,576.160	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,012	66.310	1,459,615.720	
CMS ENERGY CORP	20,017	36.080	722,213.360	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,553	59.840	870,851.520	
COOPER COS INC	3,794	127.660	484,342.040	
MOLSON COORS BREWING CO	12,219	88.470	1,081,014.930	
CORNING INC	88,402	17.310	1,530,238.620	
SEALED AIR CORP	15,017	41.310	620,352.270	
BROADCOM CORP-CL A	42,246	54.180	2,288,888.280	
CUMMINS INC	12,850	85.420	1,097,647.000	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	115.890	767,075.910	
DR HORTON INC	26,166	27.700	724,798.200	
DANAHER CORP	46,109	88.450	4,078,341.050	
MOODY'S CORP	14,341	90.860	1,303,023.260	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	46,508	56.120	2,610,028.960	
TARGET CORP	45,615	72.420	3,303,438.300	
DEERE & CO	23,444	74.150	1,738,372.600	
MORGAN STANLEY	110,016	28.460	3,131,055.360	
REPUBLIC SERVICES INC	18,651	44.500	829,969.500	
THE WALT DISNEY CO	121,270	99.920	12,117,298.400	
DOLLAR TREE INC	16,163	77.360	1,250,369.680	
DOVER CORP	11,617	56.970	661,820.490	
DOW CHEMICAL	86,405	45.400	3,922,787.000	
OMNICOM GROUP	19,378	69.650	1,349,677.700	
DTE ENERGY CO	14,055	79.150	1,112,453.250	
XL GROUP PLC	23,051	36.090	831,910.590	
DUKE ENERGY CORP	51,470	71.830	3,697,090.100	
FLOWSERVE CORP	9,241	37.820	349,494.620	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	61.960	584,654.560	
EBAY INC	81,777	26.100	2,134,379.700	
EMC CORP/MASS	146,656	24.420	3,581,339.520	
BANK OF AMERICA CORP	789,755	15.310	12,091,149.050	
CITIGROUP INC	227,432	46.850	10,655,189.200	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,592	62.250	721,602.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,478	26.660	545,943.480	
EATON CORP PLC	33,977	49.150	1,669,969.550	
EATON VANCE CORP	9,128	28.480	259,965.440	
DISH NETWORK CORP	16,800	53.240	894,432.000	
ECOLAB INC	20,039	104.620	2,096,480.180	
ELECTRONIC ARTS INC	23,902	64.210	1,534,747.420	
SALESFORCE.COM INC	47,033	73.180	3,441,874.940	
EMERSON ELECTRIC CO	49,885	43.800	2,184,963.000	
WEATHERFORD INTL PLC	58,791	6.880	404,482.080	
ENTERGY CORP	13,984	67.550	944,619.200	
EOG RESOURCES INC	42,044	63.670	2,676,941.480	

EQUIFAX INC	8,986	101.830	915,044.380	
EQT CORP	12,314	52.550	647,100.700	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,081	82.880	1,415,673.280	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	42.990	613,854.210	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	51,530	85.970	4,430,034.100	
EXXON MOBIL CORP	315,538	73.690	23,251,995.220	
FMC CORP	9,724	35.160	341,895.840	
NEXTERA ENERGY INC	34,147	105.580	3,605,240.260	
ASSURANT INC	4,237	77.400	327,943.800	
FASTENAL CO	21,892	38.890	851,379.880	
FIFTH THIRD BANCORP	58,467	18.170	1,062,345.390	
M&T BANK CORP	10,650	109.130	1,162,234.500	
FISERV INC	17,221	87.940	1,514,414.740	
FLIR SYSTEMS INC	8,840	31.160	275,454.400	
MACY'S INC	24,650	38.820	956,913.000	
FORD MOTOR CO	282,813	12.770	3,611,522.010	
FRANKLIN RESOURCES INC	30,371	33.500	1,017,428.500	
FREEMPORT-MCMORAN INC	85,535	4.310	368,655.850	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	10.020	444,517.260	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,532	37.660	471,955.120	
TEGNA INC	14,989	23.090	346,096.010	
GAP INC/THE	18,180	22.680	412,322.400	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,729	55.880	599,536.520	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,562	131.290	2,699,584.980	
GENERAL MILLS INC	44,957	55.910	2,513,545.870	
GENUINE PARTS CO	10,814	79.070	855,062.980	
GILEAD SCIENCES INC	112,012	96.500	10,809,158.000	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	13,585	64.090	870,662.650	
GARTNER INC	5,772	85.720	494,775.840	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	19,208	28.590	549,156.720	
MCKESSON CORP	17,425	163.550	2,849,858.750	
NVIDIA CORP	39,189	29.680	1,163,129.520	
GENERAL ELECTRIC CO	714,650	28.580	20,424,697.000	
WW GRAINGER INC	4,603	189.120	870,519.360	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,464	90.210	763,537.440	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	18.940	421,149.840	
HALLIBURTON CO	64,473	31.550	2,034,123.150	
MONSTER BEVERAGE CORP	10,757	146.040	1,570,952.280	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,289	165.730	4,854,065.970	
HARLEY-DAVIDSON INC	15,057	42.900	645,945.300	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,014	85.920	430,802.880	
HARRIS CORP	8,710	86.940	757,247.400	
HASBRO INC	8,909	70.010	623,719.090	

HENRY SCHEIN INC	6,256	146.380	915,753.280	
HELMERICH & PAYNE INC	7,163	45.740	327,635.620	
HERSHEY FOODS CORP	12,284	84.250	1,034,927.000	
HP INC	140,131	10.650	1,492,395.150	
F5 NETWORKS INC	5,809	93.520	543,257.680	
CROWN HOLDINGS INC NPR	9,809	46.580	456,903.220	
REYNOLDS AMERICAN INC	65,630	48.450	3,179,773.500	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	103.870	1,077,028.030	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	138.340	476,857.980	
JUNIPER NETWORKS INC	25,642	26.010	666,948.420	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	38.070	528,716.160	
HOLOGIC INC	18,649	36.080	672,855.920	
UNUM GROUP	19,821	30.240	599,387.040	
HOME DEPOT INC	97,055	125.780	12,207,577.900	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,610	93.290	1,176,386.900	
HORMEL FOODS CORP	11,661	78.040	910,024.440	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	17.600	562,355.200	
HUMANA INC	11,070	169.010	1,870,940.700	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	67.350	447,001.950	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	10.100	606,606.000	
RED HAT INC	14,283	78.280	1,118,073.240	
BIOGEN INC	17,701	278.540	4,930,436.540	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,534	83.190	2,040,983.460	
INTUIT INC	20,568	94.000	1,933,392.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	9,222	50.190	462,852.180	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	51.480	1,084,323.240	
INTEL CORP	361,541	32.060	11,591,004.460	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,787	117.620	680,666.940	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,541	36.400	1,148,092.400	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,945	21.930	634,763.850	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	38.400	357,004.800	
INCYTE CORP	12,683	92.190	1,169,245.770	
JOHNSON & JOHNSON	209,656	97.570	20,456,135.920	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,997	40.920	1,227,477.240	
JOHNSON CONTROLS INC	48,081	35.370	1,700,624.970	
KLA-TENCOR CORP	12,621	65.510	826,801.710	
DEVON ENERGY CORP	28,689	26.970	773,742.330	
KELLOGG CO	20,813	71.550	1,489,170.150	
KEYCORP	66,833	11.940	797,986.020	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,934	125.710	3,511,583.140	

BLACKROCK INC/NEW YORK	9,284	308.320	2,862,442.880	
KOHL'S CORP	15,787	50.080	790,612.960	
KROGER CO	69,461	41.280	2,867,350.080	
LAM RESEARCH CORP	12,091	70.950	857,856.450	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,466	59.500	503,727.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	45.460	653,123.820	
LEGG MASON INC	6,295	34.970	220,136.150	
LEGGETT & PLATT INC	9,103	39.680	361,207.040	
LENNAR CORP	12,932	42.400	548,316.800	
LEUCADIA NATIONAL CORP	23,605	15.900	375,319.500	
ELI LILLY & CO	75,342	80.270	6,047,702.340	
L BRANDS INC	19,395	93.020	1,804,122.900	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,267	43.200	789,134.400	
LINEAR TECH CORP	18,324	39.060	715,735.440	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	53,051	91.660	4,862,654.660	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,536	37.940	892,955.840	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,278	215.350	4,582,217.300	
LOEWS CORP	21,320	35.850	764,322.000	
RANGE RESOURCES CORP	12,431	24.970	310,402.070	
LOWE'S COS INC	70,369	72.680	5,114,418.920	
DOMINION RESOURCES INC/VA	44,533	69.410	3,091,035.530	
SCANA CORP	9,574	60.890	582,960.860	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	20.830	702,575.070	
MCCORMICK & CO INC	9,163	84.100	770,608.300	
MCDONALD'S CORPORATION	71,767	116.690	8,374,491.230	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	21,226	88.470	1,877,864.220	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	175.650	574,726.800	
MANPOWERGROUP INC	5,703	76.370	435,538.110	
MARKEL CORPORATION	1,049	841.230	882,450.270	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,526	75.930	1,254,819.180	
MARSH & MCLENNAN COS	39,991	52.180	2,086,730.380	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,542	73.360	406,561.120	
MASCO CORP	25,045	25.150	629,881.750	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,501	124.730	561,409.730	
MATTEL INC	25,152	26.700	671,558.400	
METLIFE INC	71,390	41.710	2,977,676.900	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,891	33.060	723,716.460	
MEDTRONIC PLC	107,621	73.000	7,856,333.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,543	36.210	1,359,432.030	
CVS HEALTH CORP	83,949	94.920	7,968,439.080	

MERCK & CO. INC.	212,888	51.250	10,910,510.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,810	115.620	902,992.200	
MICROSOFT CORP	576,029	52.300	30,126,316.700	
MICRON TECH INC	83,952	12.530	1,051,918.560	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,953	41.500	620,549.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	8.320	256,988.160	
3M CO	46,990	140.460	6,600,215.400	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,675	175.680	821,304.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,590	64.370	746,048.300	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	69.770	606,929.230	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	18.320	227,955.760	
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,883	53.740	853,552.420	
MYLAN NV	32,656	49.500	1,616,472.000	
ILLUMINA INC	11,266	165.710	1,866,888.860	
XCEL ENERGY INC	38,007	36.470	1,386,115.290	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	27,349	29.950	819,102.550	
NETAPP INC	24,525	22.980	563,584.500	
NEWELL RUBBERMAID INC	21,322	39.350	839,020.700	
DUN & BRADSTREET CORP	2,194	94.540	207,420.760	
NEWMONT MINING CORP	37,881	17.010	644,355.810	
NIKE INC-CL B	103,374	59.550	6,155,921.700	
NOBLE ENERGY INC	30,599	28.990	887,065.010	
NORDSTROM INC	11,509	46.810	538,736.290	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,576	75.970	1,715,098.720	
EVERSOURCE ENERGY	23,786	51.030	1,213,799.580	
COACH INC	21,436	32.770	702,457.720	
NORTHERN TRUST CORP	15,954	65.890	1,051,209.060	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,722	188.110	2,581,245.420	
WELLS FARGO & CO	369,946	50.090	18,530,595.140	
NUCOR CORP	24,612	36.140	889,477.680	
MONSANTO CO	35,107	92.280	3,239,673.960	
CHENIERE ENERGY INC	17,814	33.790	601,935.060	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,273	64.760	2,672,839.480	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,995	61.220	3,489,233.900	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	33.210	301,580.010	
OGE ENERGY CORP	16,028	25.430	407,592.040	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,516	237.940	1,788,357.040	
ORACLE CORP	262,315	34.940	9,165,286.100	
PACCAR INC	27,939	45.230	1,263,680.970	
EXELON CORP	67,643	28.060	1,898,062.580	
PARKER HANNIFIN CORP	10,066	90.370	909,664.420	
PARTNERRE LTD	3,890	139.870	544,094.300	
PATTERSON COS INC	4,551	41.490	188,820.990	

PAYCHEX INC	25,896	47.420	1,227,988.320	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	54.870	467,437.530	
MEDNAX INC	7,106	67.190	477,452.140	
PPL CORPORATION	52,418	33.890	1,776,446.020	
PEPSICO INC	111,229	97.440	10,838,153.760	
PENTAIR PLC	14,306	45.500	650,923.000	
PFIZER INC	466,338	31.070	14,489,121.660	
CONOCOPHILLIPS	91,818	41.120	3,775,556.160	
PVH CORP	6,479	69.770	452,039.830	
PG&E CORP	36,973	52.230	1,931,099.790	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11,261	113.510	1,278,236.110	
ALTRIA GROUP INC	150,003	59.460	8,919,178.380	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,572	88.280	3,493,416.160	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	80.100	398,898.000	
GARMIN LTD	9,959	33.200	330,638.800	
AETNA INC	26,501	105.320	2,791,085.320	
FLUOR CORP (NEW)	11,793	41.830	493,301.190	
PPG INDUSTRIES INC	20,136	94.450	1,901,845.200	
PRAXAIR INC	21,891	98.440	2,154,950.040	
PRECISION CASTPARTS CORP	10,609	232.100	2,462,348.900	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,772	154.720	5,225,203.840	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,462	65.010	1,200,214.620	
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	67.940	751,144.640	
PROCTER & GAMBLE CO	205,544	76.670	15,759,058.480	
PROGRESSIVE CORP	45,883	30.640	1,405,855.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,399	38.600	1,520,801.400	
PULTE GROUP INC	25,477	16.160	411,708.320	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	37,710	15.300	576,963.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,632	58.520	563,664.640	
QUALCOMM INC	119,416	46.070	5,501,495.120	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	51.270	531,874.980	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	111.830	395,319.050	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,718	480.820	2,749,328.760	
AUTONATION INC	4,634	48.530	224,888.020	
RESMED INC	11,376	52.320	595,192.320	
US BANCORP	133,520	39.860	5,322,107.200	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,021	68.280	615,953.880	
RITE AID CORP	73,930	7.740	572,218.200	
ROSS STORES INC	32,109	52.590	1,688,612.310	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,434	173.470	1,289,575.980	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,766	93.450	912,632.700	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,330	93.600	1,247,688.000	
RAYTHEON COMPANY	23,040	123.530	2,846,131.200	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,648	253.120	1,176,501.760	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	25.440	476,720.160	
ACCENTURE PLC-CL A	46,854	99.230	4,649,322.420	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	122,857	41.680	5,120,679.760	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,266	114.970	1,180,282.020	
SANDISK CORP	16,366	74.010	1,211,247.660	
ROCKWELL COLLINS INC	9,595	87.340	838,027.300	
ST JUDE MEDICAL INC	20,652	57.180	1,180,881.360	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,590	106.790	2,519,176.100	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	20,743	58.940	1,222,592.420	
PRICELINE GROUP INC	3,863	1,136.280	4,389,449.640	
SCHLUMBERGER LTD	96,737	64.830	6,271,459.710	
SCHWAB (CHARLES) CORP	90,459	28.740	2,599,791.660	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12,739	99.800	1,271,352.200	
BUNGE LTD	11,801	66.450	784,176.450	
SEI INVESTMENTS CO	10,402	47.050	489,414.100	
ANTHEM INC	19,515	128.360	2,504,945.400	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,900	94.060	1,401,494.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	39.510	922,598.010	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,877	241.970	1,422,057.690	
CENTENE CORP	7,708	60.820	468,800.560	
ACUITY BRANDS INC	3,145	206.330	648,907.850	
SNAP-ON INC	4,354	163.050	709,919.700	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,611	72.890	2,522,795.790	
ADVANCE AUTO PARTS	5,295	147.050	778,629.750	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	6.540	185,265.120	
EDISON INTERNATIONAL	23,842	59.200	1,411,446.400	
SOUTHERN CO	68,059	46.840	3,187,883.560	
BB&T CORP	60,610	34.680	2,101,954.800	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	42.040	577,881.840	
AT&T INC	466,167	33.950	15,826,369.650	
CHEVRON CORP	143,151	80.770	11,562,306.270	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,011	96.290	1,156,539.190	
STAPLES INC	50,301	9.450	475,344.450	
STATE STREET CORP	31,417	58.440	1,836,009.480	
STARBUCKS CORP	113,294	57.820	6,550,659.080	
STRYKER CORP	25,186	87.530	2,204,530.580	
NETFLIX INC	30,983	114.970	3,562,115.510	
STERICYCLE INC	6,853	119.420	818,385.260	

SUNTRUST BANKS INC	38,067	38.710	1,473,573.570	
SYMANTEC CORP	49,628	20.360	1,010,426.080	
SYNOPSIS INC	11,163	42.090	469,850.670	
SYSCO CORP	43,896	40.120	1,761,107.520	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,954	539.580	1,593,919.320	
TESORO CORP	9,395	101.070	949,552.650	
TEXAS INSTRUMENTS INC	77,930	51.210	3,990,795.300	
TEXTRON INC	21,846	38.890	849,590.940	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,019	134.880	4,048,962.720	
TIFFANY & CO	10,305	67.840	699,091.200	
TOLL BROTHERS INC	12,654	29.890	378,228.060	
TORCHMARK CORP	10,414	54.440	566,938.160	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	45.460	619,938.020	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	67.230	937,589.580	
TRACTOR SUPPLY CO	9,788	82.650	808,978.200	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	19,110	19.640	375,320.400	
TYSON FOODS INC	22,383	52.720	1,180,031.760	
MARATHON OIL CORP	52,743	9.620	507,387.660	
UNION PACIFIC CORP	65,913	74.810	4,930,951.530	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,143	90.500	5,804,941.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	72,327	109.580	7,925,592.660	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	114.460	851,696.860	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	76.120	631,491.520	
VF CORP	25,690	56.450	1,450,200.500	
CBS CORP	33,562	46.780	1,570,030.360	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,746	103.950	1,948,646.700	
VULCAN MATERIALS CO	10,233	85.860	878,605.380	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	65,869	81.020	5,336,706.380	
WAL-MART STORES INC	123,017	64.220	7,900,151.740	
WASTE MANAGEMENT INC	34,984	52.860	1,849,254.240	
WATERS CORP	6,779	126.080	854,696.320	
ALLERGAN PLC	29,724	299.370	8,898,473.880	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,254	120.740	996,587.960	
WESTERN DIGITAL CORP	18,200	52.800	960,960.000	
WABTEC CORP	7,250	62.790	455,227.500	
WHIRLPOOL CORP	6,288	134.410	845,170.080	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,061	66.050	994,779.050	
WYNN RESORTS LTD	6,279	56.790	356,584.410	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	31.860	925,692.300	
NASDAQ INC	9,132	57.280	523,080.960	
CME GROUP INC	24,875	86.950	2,162,881.250	
WILLIAMS COS INC	53,337	18.690	996,868.530	

DICK'S SPORTING GOODS INC	5,927	34.420	204,007.340	
LKQ CORP	22,850	26.730	610,780.500	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	26.270	477,982.650	
ALLIANT ENERGY CORP	7,587	62.160	471,607.920	
WEC ENERGY GROUP INC	24,880	51.890	1,291,023.200	
FOOT LOCKER INC	11,034	62.620	690,949.080	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,310	30.670	653,577.700	
CARMAX INC	15,376	46.990	722,518.240	
XEROX CORP	74,880	9.400	703,872.000	
XILINX INC	20,017	43.120	863,133.040	
YAHOO! INC	66,184	30.170	1,996,771.280	
CIMAREX ENERGY CO	6,901	80.740	557,186.740	
TJX COMPANIES INC	52,219	67.800	3,540,448.200	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	97,600	6.470	631,472.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,740	79.680	457,363.200	
SIGNATURE BANK	3,706	136.500	505,869.000	
CBRE GROUP INC	21,235	30.090	638,961.150	
LIBERTY GLOBAL PLC	17,106	35.510	607,434.060	
REGIONS FINANCIAL CORP	94,526	8.680	820,485.680	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,417	45.160	199,471.720	
T-MOBILE US INC	23,522	39.680	933,352.960	
LAS VEGAS SANDS CORP	31,104	38.990	1,212,744.960	
MEDIVATION INC	12,474	36.170	451,184.580	
MOSAIC CO/THE	25,355	23.800	603,449.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	26.000	938,002.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	90,569	25.880	2,343,925.720	
CELANESE CORP	11,777	62.300	733,707.100	
IHS INC-CLASS A	5,758	109.270	629,176.660	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- A	9,144	25.830	236,189.520	
EXPEDIA INC	8,139	111.200	905,056.800	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,719	32.450	574,981.550	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,001	95.660	1,243,675.660	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	48,706	34.600	1,685,227.600	
GAMESTOP CORP. - CL. A	8,633	29.380	253,637.540	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,381	252.640	2,117,375.840	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,591	69.960	950,826.360	
VIACOM INC-CLASS B	27,414	40.970	1,123,151.580	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,433	411.100	1,000,206.300	

UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	51.620	359,326.820	
TRANSDIGM GROUP INC	4,061	228.550	928,141.550	
MASTERCARD INC	75,927	90.580	6,877,467.660	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	35,147	25.500	896,248.500	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	8,473	69.160	585,992.680	
HANESBRANDS INC	32,964	30.490	1,005,072.360	
WESTERN UNION CO	41,207	16.870	695,162.090	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	27,621	11.540	318,746.340	
AERCAP HOLDINGS NV	13,624	36.700	500,000.800	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	15,025	14.490	217,712.250	
SPECTRA ENERGY CORP	52,852	24.110	1,274,261.720	
TIME WARNER CABLE INC	21,778	183.300	3,991,907.400	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,191	14.990	287,673.090	
DELTA AIR LINES INC	15,148	46.740	708,017.520	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,680	21.030	182,540.400	
DISCOVER FINANCIAL	32,943	50.490	1,663,292.070	
TE CONNECTIVITY LTD	30,629	57.920	1,774,031.680	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	82.170	828,027.090	
WABCO HOLDING INC	4,395	89.500	393,352.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	54.730	420,326.400	
VMWARE INC	6,605	53.110	350,791.550	
TERADATA CORP	12,117	22.890	277,358.130	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	182.000	893,074.000	
INVESCO LTD	34,162	29.930	1,022,468.660	
NETSUITE INC	3,281	77.140	253,096.340	
CALPINE CORP NPR	26,738	14.410	385,294.580	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,365	89.170	10,554,607.050	
VISA INC	147,485	73.920	10,902,091.200	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,893	92.600	1,286,491.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,027	60.250	784,876.750	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,702	53.780	252,873.560	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	126.180	769,067.100	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,028	24.850	522,545.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	40,940	45.720	1,871,776.800	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,244	49.840	560,400.960	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	141,646	14.160	2,005,707.360	
XYLEM INC	12,112	34.080	412,776.960	
ALKERMES PLC	11,218	68.650	770,115.700	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	30,416	76.330	2,321,653.280	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	19,329	128.040	2,474,885.160	
LINKEDIN CORP	8,739	210.930	1,843,317.270	
SPLUNK INC	9,277	51.350	476,373.950	
HCA HOLDINGS INC	26,050	67.830	1,766,971.500	
VERISK ANALYTICS INC	11,487	74.040	850,497.480	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	123.580	602,328.920	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,223	125.560	781,359.880	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,779	70.550	1,113,208.450	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,944	61.810	676,448.640	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,182	175.630	1,085,744.660	
CIT GROUP INC	13,340	36.030	480,640.200	
NXP SEMICONDUCTOR NV	20,855	77.220	1,610,423.100	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	562,500	0.500	281,250.000	
LEAR CORP	6,259	110.100	689,115.900	
DOLLAR GENERAL CORP	21,623	69.640	1,505,825.720	
FORTINET INC	10,861	28.350	307,909.350	
AON PLC	21,841	86.410	1,887,280.810	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	33.240	381,063.360	
TESLA MOTORS INC	7,097	207.850	1,475,111.450	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,990	39.400	472,406.000	
GENERAL MOTORS CO	106,862	30.250	3,232,575.500	
VANTIV INC	12,141	45.740	555,329.340	
TRIPADVISOR INC	9,263	76.950	712,787.850	
ALLY FINANCIAL INC	35,836	16.800	602,044.800	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,570	37.140	615,409.800	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	32.240	536,280.160	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	21,511	75.840	1,631,394.240	
PHILLIPS 66	40,891	76.180	3,115,076.380	
LIBERTY MEDIA CORP	5,006	36.470	182,568.820	
FACEBOOK INC	162,626	97.510	15,857,661.260	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	7,204	64.570	465,162.280	
ADT CORP	11,734	29.910	350,963.940	
SERVICENOW INC	10,829	78.530	850,401.370	
WHITEWAVE FOODS CO	12,239	35.400	433,260.600	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,614	162.020	909,580.280	

TABLEAU SOFTWARE INC	3,880	87.130	338,064.400	
WORKDAY INC	7,948	70.250	558,347.000	
ABBVIE INC	126,588	53.880	6,820,561.440	
ZOETIS INC	34,943	44.580	1,557,758.940	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,645	56.000	708,120.000	
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	12.210	404,224.260	
MALLINCKRODT PLC	9,419	65.170	613,836.230	
CDW CORP	10,726	39.840	427,323.840	
SPRINT CORP	57,295	3.360	192,511.200	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	16,386	24.940	408,666.840	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,283	41.080	586,745.640	
FIREEYE INC	8,532	17.380	148,286.160	
ANTERO RESOURCES CORP	8,460	20.180	170,722.800	
TWITTER INC	43,632	19.650	857,368.800	
PLAINS GP HOLDINGS LP	16,533	7.610	125,816.130	
PERRIGO CO PLC	11,364	143.610	1,631,984.040	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	36,830	19.240	708,609.200	
ARAMARK	17,585	31.870	560,433.950	
IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,407	23.650	293,425.550	
SABRE CORP	13,133	25.960	340,932.680	
NAVIENT CORP	28,699	10.000	286,990.000	
FNF GROUP	18,087	32.310	584,390.970	
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	35.440	649,615.200	
SYNCHRONY FINANCIAL	64,620	28.700	1,854,594.000	
MOBILEYE NV	12,750	39.070	498,142.500	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	39,277	23.900	938,720.300	
CDK GLOBAL INC	9,646	43.680	421,337.280	
QORVO INC	12,235	44.220	541,031.700	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,524	25.130	314,728.120	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,310	44.990	1,183,686.900	
WESTROCK CO	19,981	39.760	794,444.560	
KRAFT HEINZ CO	46,578	72.270	3,366,192.060	
ALPHABET INC-CL A	21,961	733.070	16,098,950.270	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	140,131	13.260	1,858,137.060	
PAYPAL HOLDINGS INC	82,503	33.040	2,725,899.120	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	22.160	180,249.440	
ALPHABET INC-CL C	23,498	716.030	16,825,272.940	
COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	25,231	17.930	452,391.830	
BAXALTA INC	40,868	39.100	1,597,938.800	
アメリカ・ドル 小計	24,732,290		1,314,679,599.110 (154,869,256,775)	

イギリス・ボンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.499	178,281.150	
	AMEC FOSTER WHEELER PLC	28,599	3.720	106,388.280	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	3.877	100,433.680	
	ASHTAD GROUP	38,160	10.200	389,232.000	
	SEVERN TRENT PLC	19,770	21.300	421,101.000	
	BHP BILLITON PLC	160,521	6.361	1,021,074.080	
	BARCLAYS PLC	1,270,807	1.997	2,537,801.570	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	69,630	5.945	413,950.350	
	BT GROUP PLC	631,846	4.630	2,925,446.980	
	SKY PLC	82,222	10.860	892,930.920	
	AGGREKO PLC	18,550	8.395	155,727.250	
	BUNZL PLC	26,929	18.300	492,800.700	
	EASYJET PLC	13,628	17.180	234,129.040	
	CAPITA PLC	50,523	11.560	584,045.880	
	AVIVA PLC	299,716	4.737	1,419,754.690	
	CRODA INTERNATIONAL	9,774	28.290	276,506.460	
	DIAGEO PLC	190,831	18.055	3,445,453.700	
	SCHRODERS PLC	10,331	26.470	273,461.570	
	NATIONAL GRID PLC	277,487	9.410	2,611,152.670	
	GKN PLC	134,097	2.787	373,728.330	
	KINGFISHER PLC	163,294	3.306	539,849.960	
	BAE SYSTEMS PLC	245,770	5.265	1,293,979.050	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,370	32.000	363,840.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	140,455	36.485	5,124,500.670	
	COBHAM PLC	88,449	2.729	241,377.320	
	NEXT PLC	10,966	67.850	744,043.100	
	REXAM PLC	54,770	5.990	328,072.300	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	72,271	35.115	2,537,796.160	
	IMI PLC	22,272	7.875	175,392.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	13,463	24.800	333,882.400	
	SABMILLER PLC	74,731	40.500	3,026,605.500	
	ANGLO AMERICAN PLC	109,290	2.304	251,804.160	
	COMPASS GROUP PLC	125,596	11.330	1,423,002.680	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,491,958	4.978	7,426,966.920	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.448	1,132,696.940	
	ARM HOLDINGS PLC	109,575	9.530	1,044,249.750	
	CENTRICA PLC	386,570	2.062	797,107.340	
	UNILEVER PLC	98,435	27.630	2,719,759.050	
	MEGGITT PLC	54,676	3.607	197,216.330	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	188,216	1.523	286,652.960	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,266	9.365	498,836.090		
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	4.064	297,431.960		

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,749	30.360	842,459.640	
PEARSON PLC	65,464	6.825	446,791.800	
PERSIMMON PLC	23,150	19.910	460,916.500	
PRUDENTIAL PLC	197,057	13.635	2,686,872.190	
RIO TINTO PLC	94,846	16.970	1,609,536.620	
VODAFONE GROUP PLC	1,994,212	2.208	4,403,220.090	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,892	59.770	2,862,504.840	
RELX PLC	82,573	11.600	957,846.800	
OLD MUTUAL PLC	389,986	1.556	606,818.210	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	145,152	5.520	801,239.040	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	259,456	2.804	727,514.620	
ST JAMES'S PLACE PLC	41,514	9.070	376,531.980	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	19.300	383,973.500	
SSE PLC	76,640	14.750	1,130,440.000	
BP PLC	1,382,606	3.280	4,534,947.680	
SHIRE PLC	45,483	39.250	1,785,207.750	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.880	501,393.480	
SMITHS GROUP PLC	27,324	8.880	242,637.120	
STANDARD CHARTERED PLC	245,759	5.066	1,245,015.090	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,287,101	0.689	2,953,812.580	
TATE & LYLE PLC	39,915	5.715	228,114.220	
BG GROUP PLC	263,658	9.177	2,419,589.460	
TAYLOR WIMPLEY PLC	262,412	1.949	511,440.980	
TESCO PLC	631,592	1.454	918,334.760	
3I GROUP PLC	70,216	4.464	313,444.220	
SMITH & NEPHEW PLC	64,136	11.380	729,867.680	
GLAXOSMITHKLINE PLC	369,742	13.475	4,982,273.450	
WEIR GROUP	18,336	8.505	155,947.680	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,036	25.340	634,412.240	
BABCOCK INT'L GROUP	15,650	9.420	147,423.000	
WPP PLC	96,206	14.530	1,397,873.180	
WOLSELEY PLC	20,425	34.240	699,352.000	
ASTRAZENECA PLC	95,131	42.555	4,048,299.700	
WHITBREAD PLC	13,806	41.990	579,713.940	
CARNIVAL PLC	14,275	38.370	547,731.750	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	131,038	4.228	554,028.660	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	26.890	361,562.940	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.767	226,377.860	
BURBERRY GROUP PLC	36,044	10.840	390,716.960	
INVESTEC PLC	50,655	4.297	217,664.530	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	25.250	451,520.500	
ICAP PLC	36,584	4.808	175,895.870	
ITV PLC	301,405	2.661	802,038.700	
SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.433	216,960.340	

	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	43.510	377,362.230	
	G4S PLC	124,374	2.170	269,891.580	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	16.150	256,671.950	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	293,591	13.540	3,975,222.140	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	188,550	13.550	2,554,852.500	
	INMARSAT PLC	34,127	11.070	377,785.890	
	PETROFAC LTD	21,025	6.805	143,075.120	
	TUI AG-DI	19,394	12.510	242,618.940	
	STANDARD LIFE PLC	153,643	3.634	558,338.660	
	EXPERIAN PLC	70,055	11.010	771,305.550	
	MONDI PLC	25,855	12.170	314,655.350	
	SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	21,006	4.030	84,654.180	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	13.490	287,202.100	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	6.815	106,579.780	
	GLENCORE PLC	927,273	0.734	680,618.380	
	DIXONS CARPHONE PLC	72,841	4.639	337,909.390	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	98,404	3.622	356,419.280	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	14.070	188,622.420	
	ROYAL MAIL PLC	64,647	4.351	281,279.090	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	47,621	4.377	208,437.110	
	AUTO TRADER GROUP PLC	58,105	4.420	256,824.100	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	84,043	2.802	235,488.480	
イギリス・ポンド	小計	22,137,394		113,774,541.310 (19,504,369,617)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,152	19.360	1,977,662.720	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	13.630	1,693,800.100	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	8.500	1,599,955.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	38,983	15.970	622,558.510	
	NICE SYSTEMS LTD	3,882	222.700	864,521.400	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	69,952	249.300	17,439,033.600	
イスラエル・シュケル	小計	527,469		24,197,531.330 (723,990,138)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,999	63.650	572,786.350	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,911	25.150	5,505,611.650	
	AMCOR LTD	86,506	12.770	1,104,681.620	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,245	30.560	7,739,167.200	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	12.850	433,070.700	

FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	1.640	244,697.840	
TELSTRA CORP LTD	328,099	5.310	1,742,205.690	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	11.210	357,307.540	
AMP LTD	240,810	5.330	1,283,517.300	
ASX LTD	13,028	39.060	508,873.680	
BHP BILLITON LTD	246,516	15.550	3,833,323.800	
CALTEX AUSTRALIA LTD	21,516	36.710	789,852.360	
COMPUTERSHARE LT	34,030	10.850	369,225.500	
CSL LIMITED	34,693	102.900	3,569,909.700	
REA GROUP LTD	4,119	51.040	210,233.760	
TRANSURBAN GROUP	136,068	10.100	1,374,286.800	
COCA-COLA AMATIL LTD	35,256	9.000	317,304.000	
COCHLEAR LTD	5,226	91.180	476,506.680	
ORIGIN ENERGY LTD	132,102	4.250	561,433.500	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,560	78.640	10,188,598.400	
BORAL LIMITED	43,430	5.530	240,167.900	
RIO TINTO LIMITED	34,809	40.500	1,409,764.500	
APA GROUP	87,434	8.180	715,210.120	
ARISTOCRAT LEISU	40,226	9.550	384,158.300	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	174,456	5.030	877,513.680	
TPG TELECOM LTD	12,142	9.100	110,492.200	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	15.830	566,555.700	
ORICA LTD	34,301	14.040	481,586.040	
CIMIC GROUP LTD	7,290	22.420	163,441.800	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.040	514,185.200	
MACQUARIE GROUP LTD	23,603	74.300	1,753,702.900	
SUNCORP GROUP LTD	103,375	11.510	1,189,846.250	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	199,962	27.420	5,482,958.040	
NEWCREST MINING LTD	57,418	13.420	770,549.560	
OIL SEARCH LTD	103,413	6.500	672,184.500	
INCITEC PIVOT LTD	112,083	3.510	393,411.330	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	11.270	1,196,163.990	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	44,294	8.060	357,009.640	
SANTOS LTD	133,862	3.210	429,697.020	
SONIC HEALTHCARE	33,734	17.410	587,308.940	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.450	314,953.200	
WESFARMERS LTD	87,657	39.750	3,484,365.750	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.010	186,459.130	
ILUKA RESOURCES LIM	45,912	5.660	259,861.920	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	27.630	1,600,412.490	
WOOLWORTHS LTD	98,290	22.870	2,247,892.300	

	DUET GROUP	170,429	2.260	385,169.540	
	SEEK LTD	29,830	13.980	417,023.400	
	TATTS GROUP LTD	109,937	4.090	449,642.330	
	AUSNET SERVICES	122,966	1.420	174,611.720	
	AGL ENERGY LTD	48,662	17.700	861,317.400	
	BRAMBLES LTD	123,431	10.830	1,336,757.730	
	ASCIANO LTD	47,166	8.700	410,344.200	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.870	390,060.070	
	AURIZON HOLDINGS LTD	180,471	4.100	739,931.100	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	7.810	499,230.820	
	HEALTHSCOPE LTD	120,242	2.520	303,009.840	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.130	500,228.370	
	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	0.905	390,984.430	
	オーストラリア・ドル 小計	5,878,319		74,430,757.420 (6,137,560,256)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	13,502	40.690	549,396.380	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	31,291	59.560	1,863,691.960	
	BARRICK GOLD CORP	89,708	11.600	1,040,612.800	
	ATCO LTD	7,193	35.600	256,070.800	
	BANK OF MONTREAL	49,155	73.610	3,618,299.550	
	BANK OF NOVA SCOTIA	93,334	54.190	5,057,769.460	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,392	38.580	979,623.360	
	BCE INC	9,856	54.590	538,039.040	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,944	40.990	2,703,044.560	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,546	121.560	3,105,371.760	
	SAPUTO INC	20,680	32.270	667,343.600	
	BLACKBERRY LTD	38,780	10.670	413,782.600	
	CGI GROUP INC	17,094	53.350	911,964.900	
	CCL INDUSTRIES INC	2,207	219.670	484,811.690	
	CAE INC	17,352	15.200	263,750.400	
	CAMECO CORP	29,078	16.010	465,538.780	
	ROGERS COMM-CL B	29,459	48.550	1,430,234.450	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,014	88.730	2,663,142.220	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	80,262	25.810	2,071,562.220	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,911	105.350	622,723.850	
	CANADIAN UTILITIES LTD	8,537	32.250	275,318.250	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,409	73.470	4,438,249.230	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	17.950	204,935.150	
	AGRIUM INC	9,963	116.530	1,160,988.390	
	YAMANA GOLD INC	67,520	2.640	178,252.800	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	37.370	700,986.460	
	OPEN TEXT CORP	8,895	64.270	571,681.650	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.360	204,004.400	

EMPIRE CO LTD	15,093	25.020	377,626.860	
KINROSS GOLD CORP	125,461	2.430	304,870.230	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	17.560	301,329.600	
FORTIS INC	20,884	37.390	780,852.760	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	3.840	182,150.400	
TELUS CORP	18,945	37.400	708,543.000	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	32.990	819,372.630	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	41.180	942,321.940	
ENBRIDGE INC	65,595	44.330	2,907,826.350	
IGM FINANCIAL INC	8,010	33.630	269,376.300	
JEAN COUTU GROUP INC	3,791	17.460	66,190.860	
MANULIFE FINANCIAL CORP	146,416	18.940	2,773,119.040	
LINAMAR CORP	3,827	62.690	239,914.630	
LOBLAW CO LTD	17,936	64.080	1,149,338.880	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	41.130	396,081.900	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,039	50.860	1,629,503.540	
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,913	39.790	1,787,088.270	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,614	691.320	1,115,790.480	
METRO INC	16,790	38.060	639,027.400	
HUSKY ENERGY INC	27,568	13.040	359,486.720	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	13.180	486,605.600	
METHANEX CORP	7,381	37.820	279,149.420	
ONEX CORP	6,646	84.110	558,995.060	
GOLDCORP INC	67,652	16.800	1,136,553.600	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	65,526	21.960	1,438,950.960	
POWER CORP OF CANADA	25,308	27.720	701,537.760	
POWER FINANCIAL CORP	18,286	30.360	555,162.960	
ROYAL BANK OF CANADA	113,827	70.410	8,014,559.070	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,939	39.360	469,919.040	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,142	159.300	1,774,920.600	
SHAW COMM INC-B	29,011	23.620	685,239.820	
SUNCOR ENERGY INC	107,435	31.920	3,429,325.200	
ENCANA CORP	59,596	6.700	399,293.200	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	4.180	182,594.940	
THOMSON REUTERS CORP	26,087	50.230	1,310,350.010	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	142,651	51.390	7,330,834.890	
TRANSCANADA CORP	54,748	43.930	2,405,079.640	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,200	43.390	182,238.000	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	103.470	490,758.210	

INTACT FINANCIAL CORP	10,718	88.090	944,148.620	
SILVER WHEATON CORP	28,408	16.740	475,549.920	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	516.000	770,904.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	11,057	67.960	751,433.720	
CI FINANCIAL CORP	16,683	29.720	495,818.760	
VERESEN INC	17,460	7.890	137,759.400	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	22.470	354,554.130	
KEYERA CORP	13,728	37.930	520,703.040	
ALTAGAS LTD	12,358	28.630	353,809.540	
PEMBINA PIPELINE CORP	24,082	28.310	681,761.420	
DOLLARAMA INC	9,286	71.840	667,106.240	
CENOVUS ENERGY INC W/I	68,440	16.310	1,116,256.400	
VERMILION ENERGY INC	8,291	33.930	281,313.630	
ARC RESOURCES LTD	30,676	15.350	470,876.600	
CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	7.230	341,451.210	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	24.980	278,976.640	
ELEMENT FINANCIAL CORP	30,631	15.350	470,185.850	
INTER PIPELINE LTD	29,717	20.820	618,707.940	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,330	19.220	179,322.600	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	12,162	12.900	156,889.800	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	45.020	741,524.420	
カナダ・ドル 小計	2,846,821		97,832,124.360 (8,111,261,431)	
シンガポール・ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	2.900	362,500.000	
SEMBICORP INDUSTRIES	92,000	2.700	248,400.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.710	458,927.000	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.355	245,709.700	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	136,700	15.380	2,102,446.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	7.500	277,500.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	33.150	339,588.600	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	57,800	7.230	417,894.000	
CAPITALAND LTD	184,415	3.120	575,374.800	
GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.710	414,924.000	
KEPPEL CORP LTD	106,500	5.540	590,010.000	
COMFORTDELGRO CORP LTD	135,400	2.920	395,368.000	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	239,253	8.290	1,983,407.370	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	626,022	3.520	2,203,597.440	
SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.960	520,600.000	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	18.270	1,726,515.000	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	137,300	2.770	380,321.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.020	235,620.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	1.970	561,450.000	
シンガポール・ドル	小計	3,945,874		14,040,152.910 (1,152,696,554)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	137,671	19.670	2,707,988.570	
	SYNGENTA AG	7,218	363.600	2,624,464.800	
	NESTLE SA-REGISTERED	241,557	70.250	16,969,379.250	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,117	65.000	2,542,605.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	53,480	261.000	13,958,280.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	152.000	539,296.000	
	SIKA INHABER	157	3,488.000	547,616.000	
	SGS SA-REG	405	1,755.000	710,775.000	
	SULZER AG-REG	683	90.000	61,470.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	173,037	80.700	13,964,085.900	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,687	123.000	453,501.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	92	1,058.000	97,336.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,105	488.500	1,028,292.500	
	ABB LTD	168,155	16.360	2,751,015.800	
	ADECCO SA-REG	11,997	62.600	751,012.200	
	GEBERIT AG	3,062	316.100	967,898.200	
	LONZA GROUP AG-REG	3,997	154.200	616,337.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	65	5,700.000	370,500.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	68,490.000	616,410.000	
	GIVAUDAN-REG	679	1,739.000	1,180,781.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,478	248.300	2,849,987.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD	18,410	44.840	825,504.400	
	ACTELION	8,330	131.700	1,097,061.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	121.600	549,510.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	128.200	570,874.600	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,193	313.900	688,382.700	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,326	60.550	140,839.300	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	152.800	254,106.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,263	259.400	587,022.200	
	GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,461.000	445,605.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	808	416.000	336,128.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	76.700	459,433.000	
	DUFREY GROUP	3,162	109.800	347,187.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,056	341.500	360,624.000	
	ARYZTA AG	5,959	45.610	271,789.990	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,617	44.230	779,199.910	
	SWISS RE LTD	26,944	94.250	2,539,472.000	
	TRANSOCEAN LTD	26,823	10.420	279,495.660	

	UBS GROUP AG	275,018	17.530	4,821,065.540	
スイス・フラン	小計	1,270,038		81,662,333.720 (9,599,407,329)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	47,392	192.300	9,113,481.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,729	180.500	6,088,084.500	
	ERICSSON LM-B SHS	235,937	78.050	18,414,882.850	
	GETINGE AB-B SHS	14,684	202.900	2,979,383.600	
	SKF AB-B SHS	32,306	128.400	4,148,090.400	
	SANDVIK AB	77,917	67.800	5,282,772.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	110,157	82.350	9,071,428.950	
	SKANSKA AB-B SHS	26,640	154.200	4,107,888.000	
	SWEDBANK AB	70,859	177.200	12,556,214.800	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	43,886	228.100	10,010,396.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	105.600	12,556,790.400	
	VOLVO AB-B SHS	118,487	75.200	8,910,222.400	
	SWEDISH MATCH AB	16,323	298.100	4,865,886.300	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	80.850	1,965,059.250	
	NORDEA AB	227,871	89.200	20,326,093.200	
	INDUSTRIVARDEN C	10,813	134.100	1,450,023.300	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	191.200	3,306,995.200	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	117.900	3,214,071.900	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	290.900	10,433,128.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	72,949	277.700	20,257,937.300	
	ASSA ABLOY AB-B	71,533	167.600	11,988,930.800	
	TELIASONERA AB	194,938	39.970	7,791,671.860	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	102.400	1,797,632.000	
	BOLIDEN AB	17,761	124.700	2,214,796.700	
	ALFA LAVAL AB	24,553	142.300	3,493,891.900	
	KINNEVIK INVESTMENT B	18,310	239.100	4,377,921.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	452.500	2,328,112.500	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	290.000	1,716,800.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	50.400	1,566,784.800	
	HEXAGON AB	18,226	287.100	5,232,684.600	
スウェーデン・クローナ	小計	1,768,614		211,568,057.810 (2,917,523,517)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,563	579.000	4,378,977.000	
	A P MOLLER A/S	550	8,080.000	4,444,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	291	7,985.000	2,323,635.000	
	DANSKE BANK A/S	51,858	181.300	9,401,855.400	
	NOVOZYMES-B SHS	16,988	307.200	5,218,713.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	148,984	374.400	55,779,609.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,857	442.000	7,892,794.000	
	TDC A/S	70,447	34.430	2,425,490.210	

	COLOPLAST-B	8,513	523.500	4,456,555.500	
	DSV A/S	14,315	261.900	3,749,098.500	
	WILLIAM DEMANT	2,595	618.000	1,603,710.000	
	TRYG A/S	11,107	120.200	1,335,061.400	
	PANDORA A/S	8,054	878.000	7,071,412.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	396.700	3,057,763.600	
	ISS A/S	11,128	233.600	2,599,500.800	
デンマーク・クローネ 小計		377,958		115,738,176.610 (1,983,752,347)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	5.600	548,755.200	
	CONTACT ENERGY L	64,605	4.670	301,705.350	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	6.880	509,064.960	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	149,990	3.205	480,717.950	
ニュージーランド・ドル 小計		386,579		1,840,243.460 (142,232,417)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	68,855	100.300	6,906,156.500	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	28.690	3,071,608.780	
	TELENOR ASA	60,554	144.900	8,774,274.600	
	SCHIBSTED ASA	5,731	260.600	1,493,498.600	
	ORKLA ASA	59,907	65.600	3,929,899.200	
	STATOIL ASA	88,513	106.800	9,453,188.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,544	350.100	4,741,754.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,642	134.000	1,828,028.000	
	SCHIBSTED ASA	6,671	257.700	1,719,116.700	
ノルウェー・クローネ 小計		424,479		41,917,525.180 (553,311,332)	
ユーロ	CRH PLC	63,640	24.700	1,571,908.000	
	KERRY GROUP PLC-A	11,920	74.590	889,112.800	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.321	705,762.470	
	UMICORE	6,363	35.795	227,763.580	
	AIR LIQUIDE	26,318	93.960	2,472,839.280	
	AIRBUS GROUP SE	44,733	58.110	2,599,434.630	
	AXA	150,698	23.365	3,521,058.770	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,227	21.310	771,997.370	
	ADIDAS AG	16,367	85.260	1,395,450.420	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,408	15.410	1,346,957.280	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	39,703	13.355	530,233.560	
	DANONE	43,693	58.740	2,566,526.820	
	SAFRAN SA	22,153	58.610	1,298,387.330	
	INTESA SANPAOLO	951,540	2.858	2,719,501.320	
	INTESA SANPAOLO-RNC	59,714	2.634	157,286.670	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,705	83.140	2,053,973.700	
	ACCOR SA	14,860	37.075	550,934.500	

BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	34.965	207,447.340	
BOUYGUES	15,864	35.475	562,775.400	
BNP PARIBAS	81,517	47.900	3,904,664.300	
RELX NV	80,368	14.665	1,178,596.720	
THALES SA	8,128	71.780	583,427.840	
CAP GEMINI SA	12,448	80.680	1,004,304.640	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	39.845	163,723.100	
CHRISTIAN DIOR SE	4,128	144.650	597,115.200	
INGENICO GROUP	4,239	106.050	449,545.950	
UNICREDIT SPA	354,830	4.680	1,660,604.400	
NATIXIS	70,166	4.517	316,939.820	
KONINKLIJKE DSM NV	13,718	43.370	594,949.660	
DELHAIZE GROUP	8,529	89.320	761,810.280	
COMMERZBANK AG	80,064	8.676	694,635.260	
FRESENIUS SE & CO KGAA	29,762	59.420	1,768,458.040	
UNITED INTERNET	9,768	48.600	474,724.800	
FUCHS PETROLUB SE PREF	4,422	39.545	174,867.990	
PUBLICIS GROUPE	14,367	54.410	781,708.470	
MAN SE	3,396	91.000	309,036.000	
IBERDROLA SA	414,289	6.417	2,658,492.510	
ENI SPA	193,698	12.650	2,450,279.700	
IMERYS SA	2,738	58.560	160,337.280	
JERONIMO MARTINS	19,517	12.085	235,862.940	
KBC GROUPE	17,923	54.020	968,200.460	
HANNOVER RUECK SE	4,399	99.000	435,501.000	
WARTSILA OYJ	11,298	38.890	439,379.220	
L'OREAL	19,100	148.500	2,836,350.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,488	135.200	2,905,177.600	
LAGARDERE S.C.A.	6,993	25.160	175,943.880	
GEA GROUP AG	12,720	33.675	428,346.000	
BOLLORE	76,431	3.904	298,386.620	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.960	337,535.840	
MICHELIN(CGDE)-B	14,584	81.260	1,185,095.840	
CONTINENTAL AG	8,194	201.300	1,649,452.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	75,581	23.725	1,793,159.220	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	29.320	275,578.680	
AXEL SPRINGER SE	3,067	47.680	146,234.560	
OMV AG	9,779	23.410	228,926.390	
PERNOD-RICARD	16,699	99.210	1,656,707.790	
PEUGEOT SA	33,969	14.295	485,586.850	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,007	44.895	539,054.260	
RENAULT SA	14,323	84.760	1,214,017.480	
REPSOL SA	74,642	8.736	652,072.510	
REMY COINTREAU	905	61.740	55,874.700	
MERCK KGAA	9,627	81.800	787,488.600	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	60,666	109.700	6,655,060.200	

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,989	36.145	1,300,822.400	
SAIPEM	12,974	6.805	88,288.070	
RWE AG	41,149	10.950	450,581.550	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,658	56.300	768,945.400	
SOCIETE GENERALE-A	53,791	38.865	2,090,587.210	
VINCI S.A.	36,668	58.090	2,130,044.120	
SODEXO	7,368	88.110	649,194.480	
SOLVAY SA	5,034	85.140	428,594.760	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,735	48.705	2,032,703.170	
VIVENDI SA	90,768	18.720	1,699,176.960	
SAP SE	74,430	71.600	5,329,188.000	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	6,985	37.980	265,290.300	
TELEFONICA S.A	342,645	9.468	3,244,162.860	
TOTAL SA	163,395	37.350	6,102,803.250	
VALEO	5,590	128.650	719,153.500	
E.ON SE	151,587	8.173	1,238,920.550	
VOEST-ALPINE AG	9,875	25.295	249,788.120	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	20.090	307,015.380	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	81.000	697,734.000	
METRO AG	15,629	26.530	414,637.370	
SIEMENS AG-REG	60,030	82.970	4,980,689.100	
UPM-KYMMENE OYJ	38,638	16.560	639,845.280	
ING GROEP NV-CVA	296,220	11.490	3,403,567.800	
BAYER AG	62,860	102.800	6,462,008.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	7.925	353,542.170	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	12,800	93.960	1,202,688.000	
DAIMLER AG	73,572	68.130	5,012,460.360	
BASF SE	69,186	63.250	4,376,014.500	
BEIERSDORF AG	7,979	78.580	626,989.820	
HEIDELBERGCEMENT AG	10,251	69.000	707,319.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,963	75.960	1,288,509.480	
ORANGE	148,319	15.190	2,252,965.610	
SAMPO OYJ-A SHS	33,916	44.490	1,508,922.840	
RANDSTAD HOLDINGS	8,654	51.130	442,479.020	
ALLIANZ SE	34,514	152.400	5,259,933.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.200	611,500.800	
KONINKLIJKE AHOLD NV	62,779	19.540	1,226,701.660	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,917	45.045	762,026.260	
HERMES INTL	2,185	300.000	655,500.000	
ENDESA S.A.	27,930	18.245	509,582.850	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17,286	14.655	253,326.330	
ERSTE GROUP BANK AG	21,896	26.575	581,886.200	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,851	173.050	2,223,865.550	

ARCELOR MITTAL (NL)	76,767	3.336	256,094.710	
SOCIETE BIC SA	2,165	141.050	305,373.250	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,429	68.770	648,432.330	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,852	24.485	339,166.220	
HEINEKEN NV	17,289	75.980	1,313,618.220	
AKZO NOBEL	18,274	57.630	1,053,130.620	
ASML HOLDING NV	25,963	75.690	1,965,139.470	
AEGON NV	144,321	4.842	698,802.280	
BANKINTER S.A.	52,241	6.154	321,491.110	
VOLKSWAGEN AG	2,794	126.750	354,139.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,091	117.050	1,649,351.550	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	482,863	6.263	3,024,170.960	
KERING	6,033	142.350	858,797.550	
FORTUM OYJ	34,316	13.420	460,520.720	
AGEAS	14,964	40.215	601,777.260	
UCB SA	10,367	79.080	819,822.360	
THYSSENKRUPP AG	29,522	16.180	477,665.960	
UNILEVER NV-CVA	123,446	37.170	4,588,487.820	
CARREFOUR SA	40,618	24.815	1,007,935.670	
GAS NATURAL SDG SA	27,025	17.975	485,774.370	
ATOS SE	6,025	72.270	435,426.750	
NOKIA OYJ	439,256	6.890	3,026,473.840	
TUI AG	19,196	16.685	320,285.260	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	72,718	22.510	1,636,882.180	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	29.950	738,896.450	
SANOFI	89,647	73.650	6,602,501.550	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	5.730	338,127.300	
ELISA OYJ	9,367	34.700	325,034.900	
BANCO SANTANDER SA	1,077,800	4.079	4,396,346.200	
METSO OYJ	10,879	18.940	206,048.260	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	8,282	74.550	617,423.100	
QIAGEN N.V.	19,737	20.950	413,490.150	
LINDE AG	13,880	124.000	1,721,120.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	103,124	20.705	2,135,182.420	
BMW VORZUG	4,116	67.520	277,912.320	
K & S	13,745	20.715	284,727.670	
ZARDOYA OTIS	13,008	9.710	126,307.680	
ENEL SPA	534,274	3.746	2,001,390.400	
COLRUYT NV	4,673	46.700	218,229.100	
VOPAK (KON.)	5,364	36.595	196,295.580	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.045	152,357.980	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	246,729	15.665	3,865,009.780	
BANCO POPULAR ESPANOL	117,890	2.639	311,111.710	
FINMECCANICA SPA	34,431	12.450	428,665.950	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,012	12.000	984,144.000	

KONINKLIJKE KPN NV	257,686	3.333	858,867.430	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.140	196,862.880	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,463	74.620	1,079,229.060	
EURAZEO	3,870	55.110	213,275.700	
BANCO SABADELL	410,991	1.538	632,104.150	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,333	71.860	383,229.380	
FRAPORT AG	3,149	55.900	176,029.100	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	67.170	538,300.380	
INDITEX	84,555	29.435	2,488,876.420	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	195,575	0.925	180,906.870	
JC DECAUX SA	5,728	31.845	182,408.160	
ANDRITZ AG	4,704	42.565	200,225.760	
MAPFRE SA	80,219	2.106	168,941.210	
ESSILOR INTL	15,379	108.350	1,666,314.650	
SNAM SPA	158,640	4.982	790,344.480	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	10.055	860,557.170	
ENAGAS	16,043	25.870	415,032.410	
WENDEL	1,994	96.220	191,862.680	
TENARIS SA	33,458	9.760	326,550.080	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	5.510	412,996.540	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	1.073	937,487.610	
TELECOM ITALIA-RNC	432,141	0.860	371,641.260	
ATLANTIA SPA	33,870	23.020	779,687.400	
ILIAD SA	2,102	224.500	471,899.000	
PROXIMUS	13,498	29.895	403,522.710	
SES FDR	24,850	24.810	616,528.500	
TERNA SPA	110,846	4.724	523,636.500	
GRIFOLS SA	20,422	19.895	406,295.690	
FERROVIAL SA	35,009	20.030	701,230.270	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	37.160	254,768.960	
EXOR SPA	6,823	36.600	249,721.800	
NESTE OYJ	10,692	26.990	288,577.080	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	8,947	12.225	109,377.070	
KONE OYJ	25,273	36.600	924,991.800	
ENGIE	111,776	15.055	1,682,787.680	
ALSTOM	17,252	27.755	478,829.260	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	47.760	239,994.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,979	26.965	349,978.730	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,174	12.505	202,255.870	
DEUTSCHE WOHNEN AG	23,808	23.520	559,964.160	
ARKEMA SA	5,658	56.400	319,111.200	
LEGRAND SA	20,657	48.915	1,010,437.150	
ADP	2,313	102.250	236,504.250	
ORION OYJ	8,051	29.490	237,423.990	

RTL GROUP SA	2,768	73.340	203,005.120	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	9.351	318,102.310	
SYMRISE AG	9,463	57.160	540,905.080	
SCOR SE	10,052	30.955	311,159.660	
REXEL SA	20,799	11.000	228,789.000	
PRYSMIAN SPA	14,445	18.480	266,943.600	
BANCO POPOLARE SC	29,282	10.920	319,759.440	
CAIXABANK	202,918	2.941	596,781.830	
BUREAU VERITAS SA	23,255	17.275	401,730.120	
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,707	10.325	389,324.770	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	16.865	382,380.140	
ENGIE	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	33,641	38.820	1,305,943.620	
TNT EXPRESS NV W/I	44,157	7.720	340,892.040	
ENEL GREEN POWER SPA	118,550	1.800	213,390.000	
BRENTAG AG	11,108	45.975	510,690.300	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	67,082	7.880	528,606.160	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	38,477	4.881	187,806.230	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,928	27.850	276,494.800	
EDENRED	18,682	14.940	279,109.080	
BANKIA SA	330,088	0.988	326,126.940	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	39,139	4.724	184,892.630	
HUGO BOSS AG -ORD	5,197	69.090	359,060.730	
OSRAM LICHT AG	7,598	36.590	278,010.820	
GEMALTO	5,952	50.710	301,825.920	
VONOVIA SE	36,285	26.385	957,379.720	
FERRARI NV	7,011	39.320	275,672.520	
CNH INDUSTRIAL NV	67,754	5.810	393,650.740	
NUMERICABLE-SFR	9,058	36.850	333,787.300	
NN GROUP NV	20,757	31.805	660,176.380	
ZALANDO SE	6,674	33.030	220,442.220	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	7.325	513,555.750	
AENA SA	5,256	102.800	540,316.800	
ALTICE NV-A	27,159	14.165	384,707.230	
BANCO POPULAR ESPANOL SA-RTS	117,890	0.017	2,004.130	
LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	41.225	581,478.620	
REPSOL SA-RTS	74,624	0.422	31,491.320	
ユーロ 小計	20,754,848		240,027,606.410 (30,689,929,756)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	17,100	54.950	939,645.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	15.900	2,607,600.000	

BANK OF EAST ASIA	111,660	24.700	2,758,002.000	
CLP HOLDINGS LTD	155,000	62.750	9,726,250.000	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	12.920	1,111,120.000	
LI & FUNG LTD	532,400	4.650	2,475,660.000	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	69.050	3,383,450.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	87,240	182.100	15,886,404.000	
MTR CORP	103,000	36.250	3,733,750.000	
HANG SENG BANK LTD	57,100	135.100	7,714,210.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	85,657	44.050	3,773,190.850	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	102,500	68.000	6,970,000.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	39.900	4,778,025.000	
HONG KONG & CHINA GAS	560,535	14.480	8,116,546.800	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	21.400	4,044,600.000	
KERRY PROPERTIES LTD	65,000	19.380	1,259,700.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	265,000	21.900	5,803,500.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	54,000	24.200	1,306,800.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	429,266	6.950	2,983,398.700	
SINO LAND CO	255,400	10.320	2,635,728.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	90.050	12,516,950.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	79.500	3,378,750.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	29.400	2,660,700.000	
WHEELLOCK & CO LTD	76,000	30.000	2,280,000.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	4.750	931,000.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	7.520	1,275,392.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	8.470	355,740.000	
AIA GROUP LTD	928,227	42.300	39,264,002.100	
HKT TRUST / HKT LTD	178,000	9.430	1,678,540.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	22.300	4,005,080.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	21.000	2,188,200.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	270,000	6.050	1,633,500.000	
WH GROUP LTD	530,500	4.260	2,259,930.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	210,332	97.950	20,602,019.400	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	203,832	46.500	9,478,188.000	
香港・ドル 小計	6,848,899		196,515,571.850 (2,983,106,381)	
合計	91,899,582		239,368,397,850 (239,368,397,850)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	628,692.350	
		GOODMAN GROUP	128,133.000	779,048.640	
		GPT GROUP	131,618.000	600,178.080	
		LENLEASE GROUP	46,860.000	624,175.200	
		MIRVAC GROUP	235,066.000	443,099.410	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,692,357.000	
		STOCKLAND	163,015.000	653,690.150	
		VICINITY CENTRES	252,110.000	688,260.300	
	WESTFIELD CORP	140,072.000	1,287,261.680		
	オーストラリア・ドル	小計	1,597,573.000	7,396,762.810 (609,937,062)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	127,906.000	281,393.200	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	275,355.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	378,100.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	293,913.000	
	シンガポール・ドル	小計	730,006.000	1,228,761.200 (100,881,294)	
投資信託受益証券	合計		2,327,579	710,818,356 (710,818,356)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,741.000	451,239.730	
		AMERICAN TOWER CORP	31,858.000	3,009,943.840	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	727,987.920	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,455.000	1,887,545.700	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,437.000	1,403,091.160	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,569.000	345,602.430	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	471,312.150	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,026.000	2,178,115.940	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	853,124.400	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	575,942.620	
		EQUINIX INC	4,606.000	1,441,125.280	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,730.000	2,212,299.400	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	1,137,204.250	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,578.000	778,968.180	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	839,563.840	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	42,496.000	1,099,371.520	
		HCP INC	36,231.000	1,339,097.760	
HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	857,653.500			

	IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	360,304.460	
	KIMCO REALTY	32,980.000	844,947.600	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	312,780.630	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	589,490.800	
	PROLOGIS INC	40,935.000	1,679,153.700	
	PUBLIC STORAGE	11,398.000	2,845,738.660	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	876,097.470	
	REGENCY CENTERS CORP	5,842.000	399,768.060	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,460.000	4,380,216.600	
	SL GREEN	7,116.000	745,116.360	
	THE MACERICH COMPANY	10,631.000	837,403.870	
	UDR INC	21,797.000	793,410.800	
	VENTAS INC	24,973.000	1,412,972.340	
	VEREIT INC	65,404.000	497,724.440	
	VORNADO REALTY TRUST	13,114.000	1,254,747.520	
	WELLTOWER INC	26,264.000	1,800,397.200	
	WEYERHAEUSER CO	37,823.000	1,044,293.030	
アメリカ・ドル 小計		806,915.000	42,283,753.160 (4,981,026,122)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	67,982.000	503,746.620	
	HAMMERSON PLC	51,622.000	298,117.050	
	INTU PROPERTIES PLC	59,605.000	177,146.060	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	706,922.580	
	SEGRO PLC	46,137.000	193,959.940	
イギリス・ポンド 小計		288,577.000	1,879,892.250 (322,269,929)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	208,511.200	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	362,099.080	
カナダ・ドル 小計		26,512.000	570,610.280 (47,309,298)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	202,772.160	
	GECINA SA	2,710.000	306,772.000	
	ICADE	3,001.000	178,439.460	
	KLEPIERRE	15,834.000	608,421.450	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,388.000	1,658,606.000	
ユーロ 小計		31,525.000	2,955,011.070 (377,827,715)	
香港・ドル	LINK REIT	172,500.000	7,598,625.000	
香港・ドル 小計		172,500.000	7,598,625.000 (115,347,128)	
投資証券 合計		1,326,029	5,843,780,192 (5,843,780,192)	
合計			6,554,598,548 (6,554,598,548)	

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

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比 率
アメリカ・ドル	株式 604銘柄	61.60%	-%	-%	65.00%
	投資証券 35銘柄	-%	-%	1.98%	
イギリス・ポンド	株式 108銘柄	7.76%	-%	-%	8.06%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.29%	-%	-%	0.29%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.44%	-%	-%	2.74%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.24%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.23%	-%	-%	3.32%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 19銘柄	0.46%	-%	-%	0.51%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.82%	-%	-%	3.90%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.16%	-%	-%	1.19%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.79%	-%	-%	0.81%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.22%	-%	-%	0.22%
ユーロ	株式 233銘柄	12.21%	-%	-%	12.63%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.15%	
香港・ドル	株式 35銘柄	1.19%	-%	-%	1.26%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		38,813,330	70,002,610
コール・ローン		21,768,079	76,993,840
投資信託受益証券		3,018,096,857	2,607,796,512
投資証券		24,185,233,460	22,646,538,651
派生商品評価勘定		1,148	230,738
未収入金		63,318,366	3,783,993,877
未収配当金		105,771,519	115,614,586
流動資産合計		27,433,002,759	29,301,170,814
資産合計		27,433,002,759	29,301,170,814
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		238,112	-
未払解約金		32,124,000	11,000,000
流動負債合計		32,362,112	11,000,000
負債合計		32,362,112	11,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,916,186,903	26,797,491,574
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,484,453,744	2,492,679,240
元本等合計		27,400,640,647	29,290,170,814
純資産合計		27,400,640,647	29,290,170,814
負債純資産合計		27,433,002,759	29,301,170,814

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	23,304,470,195円	23,916,186,903円
同期中追加設定元本額	10,650,489,002円	23,147,260,633円
同期中一部解約元本額	10,038,772,294円	20,265,955,962円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国RE I Tイン デックスファンド<為替ヘッジ なし>(ファンドラップ)	- 円	12,611,597円
D I A M先進国RE I Tイン デックスファンド<為替ヘッジ あり>(ファンドラップ)	- 円	12,656,404円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	- 円	7,026,995円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	- 円	21,123,438円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	- 円	53,331,821円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	- 円	17,211,192円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	- 円	17,333,148円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	- 円	17,993,861円
たわらノーロード 先進国リー ト	- 円	137,172,128円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	10,436,797円	13,941,746円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	29,512,945円	35,855,071円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	82,215,705円	88,055,265円
投資のソムリエ	390,728,517円	815,172,778円
投資のソムリエ<DC年金>	5,472,193円	14,675,192円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	29,242,669円	39,421,540円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	- 円	277,120円
D I A M外国リートインデック スファンド<DC年金>	1,061,990円	1,586,314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)	1,140,701,755円	641,640,313円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	217,556,179円	134,590,667円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A(適格機関投資家 向け)	5,798,997,982円	4,975,148,032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)	14,126,422,170円	12,695,405,659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)	620,783,650円	2,895,193,944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)	898,947,891円	3,587,011,770円
D I A M海外リートインデック スファンド(適格機関投資家限 定)	564,106,460円	563,055,579円
計	23,916,186,903円	26,797,491,574円
2 . 受益権の総数	23,916,186,903口	26,797,491,574口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日	自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	39,572,815	98,556,904
投資証券	32,713,475	266,717,138
合計	72,286,290	365,274,042

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年6月23日から平成27年7月13日まで及び平成27年6月23日から平成28年1月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成27年7月13日 現在				平成28年1月12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	39,893,806	-	40,130,770	236,964	3,796,381,438	-	3,796,150,700	230,738
アメリカ・ドル	19,460,999	-	19,475,910	14,911	2,759,955,594	-	2,759,819,700	135,894
イギリス・ポンド	-	-	-	-	250,283,128	-	250,273,200	9,928
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	280,324,560	-	280,296,000	28,560
カナダ・ドル	-	-	-	-	59,692,896	-	59,688,000	4,896
シンガポール・ドル	-	-	-	-	105,075,840	-	105,075,200	640
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	17,773,710	-	17,772,100	1,610
ユーロ	13,059,071	-	13,228,860	169,789	255,725,600	-	255,720,000	5,600
香港・ドル	7,373,736	-	7,426,000	52,264	67,550,110	-	67,506,500	43,610
合計	39,893,806	-	40,130,770	236,964	3,796,381,438	-	3,796,150,700	230,738

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	1,1457円	1,0930円
(1万口当たり純資産額)	(11,457円)	(10,930円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年1月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	360 CAPITAL GROUP LTD	52,000.000	48,100.000	
		360 CAPITAL OFFICE FUND	11,233.000	22,802.990	
		ABACUS PROPERTY GROUP	58,900.000	186,124.000	
		ALE PROPERTY GROUP	41,000.000	157,030.000	
		ARENA REIT	50,161.000	87,781.750	
		ASPEN GROUP	31,613.000	39,516.250	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	14,500.000	73,660.000	
		BWP TRUST	105,320.000	323,332.400	
		CHARTER HALL GROUP	67,940.000	294,180.200	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	71,680.000	287,436.800	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	278,970.000	280,364.850	
		DEXUS PROPERTY GROUP	211,640.000	1,513,226.000	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	56,080.000	123,376.000	
		GALILEO JAPAN TRUST	25,000.000	47,500.000	
		GDI PROPERTY GROUP	132,800.000	112,880.000	
		GOODMAN GROUP	347,590.000	2,113,347.200	
		GPT GROUP	395,810.000	1,804,893.600	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	36,380.000	107,321.000	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	35,200.000	90,464.000	
		INDUSTRIA REIT	21,000.000	43,470.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	36,000.000	100,440.000	
		INVESTA OFFICE FUND	134,530.000	515,249.900	
		MIRVAC GROUP	804,970.000	1,517,368.450	
		NATIONAL STORAGE REIT	64,050.000	93,833.250	
		SCENTRE GROUP	1,176,090.000	4,821,969.000	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	157,190.000	320,667.600	
		STOCKLAND	524,500.000	2,103,245.000	
VICINITY CENTRES	720,640.000	1,967,347.200			
WESTFIELD CORP	422,170.000	3,879,742.300			
	オーストラリア・ドル 小計		6,084,957.000	23,076,669.740 (1,902,902,187)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	120,095.000	159,125.870	

ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	202,000.000	151,500.000	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	466,661.000	1,026,654.200	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	177,000.000	198,240.000	
CACHE LOGISTICS TRUST	179,000.000	157,520.000	
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	265,005.000	145,752.750	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	439,006.000	572,902.830	
CAPITALAND MALL TRUST	584,064.000	1,109,721.600	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	147,080.000	208,118.200	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	144,000.000	184,320.000	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	205,000.000	129,150.000	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	115,000.000	134,550.000	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	123,000.000	224,475.000	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	122,080.000	148,937.600	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000.000	105,700.000	
KEPPEL DC REIT	190,000.000	191,900.000	
KEPPEL REIT	378,000.000	340,200.000	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	479,000.000	143,700.000	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	291,000.000	369,570.000	
MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	383,000.000	335,125.000	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	259,020.000	388,530.000	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	324,020.000	315,919.500	
QUE COMMERCIAL REIT	102,000.000	65,280.000	
QUE HOSPITALITY TRUST	204,000.000	151,980.000	
PARKWAY LIFE REIT	83,000.000	185,090.000	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	135,000.000	94,500.000	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	151,000.000	113,250.000	
SPH REIT	184,000.000	170,200.000	
STARHILL GLOBAL REIT	296,000.000	214,600.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	555,091.000	849,289.230	
シンガポール・ドル 小計	7,443,122.000	8,585,801.780 (704,894,325)	
投資信託受益証券 合計	13,528,079	2,607,796,512	

				(2,607,796,512)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	15,240.000	486,613.200	
		AGREE REALTY CORP	4,260.000	141,176.400	
		ALEXANDER'S INC.	830.000	305,813.500	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,020.000	1,353,690.000	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,700.000	328,947.000	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	24,820.000	1,011,663.200	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	34,450.000	539,487.000	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	7,070.000	124,219.900	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	34,570.000	1,364,132.200	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,480.000	666,153.600	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	6,470.000	68,582.000	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	6,550.000	82,923.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	20,680.000	113,326.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	30,260.000	5,463,140.400	
		BIOMED REALTY TRUST INC	44,630.000	1,058,623.600	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	4,710.000	52,469.400	
		BOSTON PROPERTIES INC	33,950.000	4,164,986.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	38,680.000	516,764.800	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	37,590.000	957,417.300	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,190.000	1,439,058.100	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	14,190.000	96,633.900	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	18,500.000	560,920.000	
		CARETRUST REIT INC	10,570.000	110,350.800	
		CBL & ASSOCIATES	33,480.000	388,368.000	
		CEDAR REALTY TRUST INC	16,430.000	112,052.600	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,430.000	163,542.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	13,160.000	339,528.000	
		CITY OFFICE REIT INC	2,790.000	33,368.400	
		COLONY STARWOOD HOMES	8,360.000	182,080.800	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	27,460.000	631,854.600	
		CORESITE REALTY CORP	6,760.000	384,441.200	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	20,860.000	451,201.800	

CORRECTIONS CORP OF AMERICA	25,890.000	698,771.100	
COUSINS PROPERTIES INC	45,000.000	407,250.000	
CUBESMART	38,120.000	1,194,299.600	
CYRUSONE INC	14,620.000	543,717.800	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	19,510.000	713,675.800	
DDR CORP	67,210.000	1,091,490.400	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	44,290.000	402,153.200	
DIGITAL REALTY TRUST INC	32,350.000	2,542,710.000	
DOUGLAS EMMETT INC	30,800.000	900,592.000	
DUKE REALTY TRUST	76,300.000	1,528,289.000	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	14,430.000	442,135.200	
EAST GROUP	7,090.000	376,833.500	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,790.000	65,604.900	
EDUCATION REALTY TRUST INC	12,230.000	454,956.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	25,920.000	455,155.200	
EPR PROPERTIES	13,200.000	756,360.000	
EQUITY COMMONWEALTH	27,910.000	758,593.800	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,690.000	1,166,478.600	
EQUITY ONE INC	16,290.000	433,965.600	
EQUITY RESIDENTIAL	80,530.000	6,424,683.400	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,600.000	3,441,074.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	27,290.000	2,478,204.900	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,340.000	2,243,321.600	
FELCOR LODGING TR INC	29,040.000	194,568.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	24,450.000	515,895.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	12,710.000	136,251.200	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	8,470.000	197,520.400	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	19,630.000	200,029.700	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	20,340.000	540,027.000	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	128,720.000	3,329,986.400	
GEO GROUP INC	16,280.000	448,676.800	
GETTY REALTY CORP	6,650.000	113,781.500	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,650.000	80,173.500	

GLOBAL NET LEASE INC	37,270.000	262,380.800	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	15,670.000	228,311.900	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	92,820.000	681,298.800	
HCP INC	102,800.000	3,799,488.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,220.000	641,047.000	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	28,060.000	767,721.600	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,140.000	199,960.800	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	21,060.000	885,151.800	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	33,470.000	844,113.400	
HOST HOTELS & RESORTS INC	166,130.000	2,450,417.500	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	16,190.000	412,845.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	7,500.000	53,625.000	
INLAND REAL ESTATE CORP	19,940.000	212,361.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	27,630.000	186,226.200	
IRON MOUNTAIN INC	42,450.000	1,099,879.500	
KILROY REALTY CORP	20,360.000	1,211,216.400	
KIMCO REALTY	91,350.000	2,340,387.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	18,390.000	463,428.000	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	24,930.000	591,090.300	
LEXINGTON REALTY TRUST	46,720.000	354,137.600	
LIBERTY PROPERTY TRUST	32,650.000	991,580.500	
LTC PROPERTIES INC	7,840.000	341,275.200	
MACK CALI	19,710.000	425,933.100	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	52,510.000	589,162.200	
MID AMERICA	16,660.000	1,508,729.600	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	13,390.000	141,130.600	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	36,750.000	334,792.500	
NATIONAL HEALTH INVS INC	7,540.000	461,297.200	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	30,090.000	1,199,086.500	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	5,040.000	85,932.000	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	19,040.000	177,833.600	
NEW YORK REIT INC	35,860.000	395,894.400	

NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,530.000	71,613.500	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	13,850.000	142,516.500	
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	41,730.000	605,085.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	36,370.000	1,272,586.300	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,340.000	69,605.600	
PARKWAY PROPERTIES INC	17,960.000	261,138.400	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,860.000	416,642.200	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	15,260.000	320,460.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	19,220.000	318,667.600	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	32,130.000	589,264.200	
POST PROPERTIES, INC	11,950.000	689,754.000	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	5,810.000	71,288.700	
PROLOGIS INC	115,910.000	4,754,628.200	
PS BUSINESS PARKS	4,290.000	366,022.800	
PUBLIC STORAGE	32,540.000	8,124,261.800	
QTS REALTY TRUST INC	8,500.000	376,805.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	17,450.000	290,717.000	
REALTY INCOME CORP	55,170.000	2,883,735.900	
REGENCY CENTERS CORP	20,810.000	1,424,028.300	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	21,950.000	389,832.000	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	52,400.000	772,376.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	12,240.000	194,004.000	
RLJ LODGING TRUST	27,760.000	559,641.600	
ROUSE PROPERTIES INC	8,280.000	118,404.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,320.000	553,208.400	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	14,360.000	284,902.400	
SAUL CENTERS INC	2,510.000	125,123.500	
SELECT INCOME REIT	13,790.000	269,180.800	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	52,450.000	800,911.500	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	3,120.000	122,959.200	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	7,920.000	117,374.400	
SIMON PROPERTY GROUP INC	68,410.000	12,772,831.100	

SL GREEN	22,040.000	2,307,808.400	
SOVRAN SELF STORAGE INC	7,990.000	874,905.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	97,510.000	926,345.000	
STAG INDUSTRIAL INC	15,010.000	269,729.700	
STORE CAPITAL CORP	14,910.000	342,631.800	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,100.000	211,819.000	
SUN COMMUNITIES INC	12,770.000	867,849.200	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	46,050.000	538,324.500	
TANGER FACTORY OUTLET	20,920.000	680,527.600	
TAUBMAN CENTERS INC	13,310.000	984,141.400	
TERRENO REALTY CORP	9,540.000	208,449.000	
THE MACERICH COMPANY	29,750.000	2,343,407.500	
UDR INC	57,910.000	2,107,924.000	
UMH PROPERTIES INC	5,940.000	58,271.400	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,690.000	134,446.200	
URBAN EDGE PROPERTIES	20,380.000	464,052.600	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	5,820.000	109,765.200	
VENTAS INC	73,610.000	4,164,853.800	
VEREIT INC	199,990.000	1,521,923.900	
VORNADO REALTY TRUST	39,180.000	3,748,742.400	
WASHINGTON REIT	15,040.000	394,348.800	
WEINGARTEN REALTY INVST	25,190.000	848,399.200	
WELLTOWER INC	78,230.000	5,362,666.500	
WHITESTONE REIT	6,910.000	79,326.800	
WINTHROP REALTY TRUST	7,990.000	103,150.900	
WP CAREY INC	21,450.000	1,244,529.000	
WP GLIMCHER INC	40,890.000	408,491.100	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	24,630.000	358,366.500	
アメリカ・ドル 小計	4,373,600.000	155,103,255.500 (18,271,163,498)	
イギリス・債券			
ASSURA PLC	360,020.000	199,451.080	
BIG YELLOW GROUP PLC	32,610.000	249,955.650	
BRITISH LAND CO PLC	226,030.000	1,674,882.300	
DERWENT LONDON PLC	24,460.000	839,956.400	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	76,870.000	86,478.750	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,850.000	601,869.750	
HAMMERSON PLC	173,130.000	999,825.750	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	157,750.000	176,049.000	
INTU PROPERTIES PLC	180,090.000	535,227.480	
LAND SECURITIES GROUP PLC	176,970.000	1,978,524.600	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	137,850.000	218,078.700	
	MCKAY SECURITIES PLC	23,500.000	62,275.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	96,110.000	99,666.070	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	221,170.000	103,286.390	
	REGIONAL REIT LTD	47,310.000	49,912.050	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	45,300.000	162,445.800	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	131,560.000	77,620.400	
	SEGR0 PLC	163,680.000	688,110.720	
	SHAFTESBURY PLC	61,250.000	550,025.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	148,530.000	187,890.450	
	WORKSPACE GROUP PLC	25,820.000	231,863.600	
	イギリス・ボンド 小計	2,585,860.000	9,773,394.940 (1,675,453,094)	
イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	35,000.000	364,350.000	
	イスラエル・シケル 小計	35,000.000	364,350.000 (10,901,353)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	8,180.000	256,361.200	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,250.000	170,857.500	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,910.000	213,044.900	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,920.000	74,576.800	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	13,540.000	356,914.400	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	7,680.000	312,268.800	
	CHOICE PROPERTIES REIT	9,020.000	102,016.200	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	17,800.000	252,938.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	8,760.000	111,339.600	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,450.000	95,434.500	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,940.000	120,416.400	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	5,500.000	37,070.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,080.000	170,742.800	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,850.000	183,475.500	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	29,720.000	576,568.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	15,950.000	79,112.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,926.000	50,409.360	

	MILESTONE APARTMENTS REIT	6,800.000	99,212.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,920.000	30,514.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	8,230.000	105,508.600	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	6,020.000	99,390.200	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000.000	58,870.000	
	ONEREIT	9,828.000	30,368.520	
	PLAZA RETAIL REIT	10,210.000	44,924.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	25,450.000	107,144.500	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	34,310.000	788,100.700	
	SLATE RETAIL REIT	2,820.000	39,987.600	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,600.000	401,336.000	
カナダ・ドル	小計	311,664.000	4,968,902.080 (411,971,671)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	170,890.000	196,523.500	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	217,030.000	269,117.200	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	273,280.000	370,294.400	
	PRECINCT PROPERTIES	215,100.000	262,422.000	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	113,600.000	181,760.000	
	STRIDE PROPERTY LTD	82,800.000	177,606.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	65,500.000	122,485.000	
ニュージーランド・ドル	小計	1,138,200.000	1,580,208.100 (122,134,285)	
ユーロ	AEDIFICA	3,090.000	180,456.000	
	AFFINE	1,000.000	15,250.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	22,790.000	268,922.000	
	ALTAREA	470.000	78,490.000	
	ANF IMMOBILIER	2,200.000	45,870.000	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	12,840.000	162,426.000	
	BEFIMMO	4,450.000	239,899.500	
	BENI STABILI SPA	234,470.000	163,191.120	
	COFINIMMO SA	4,460.000	423,923.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10,520.000	407,597.400	
	FONCIERE DES MURS	2,010.000	52,742.400	
	FONCIERE DES REGIONS	9,610.000	751,790.300	
	GECINA SA	7,940.000	898,808.000	
	GREEN REIT PLC	150,070.000	221,353.250	
	HAMBORNER REIT AG	13,630.000	125,355.110	

	HIBERNIA REIT PLC	150,100.000	198,732.400	
	ICADE	7,830.000	465,571.800	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	71,000.000	58,930.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2,000.000	46,200.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	75,900.000	87,209.100	
	KLEPIERRE	41,680.000	1,601,554.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	13,180.000	119,147.200	
	MERCIALYS	4,020.000	74,068.500	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	67,780.000	713,384.500	
	NSI NV	29,630.000	112,001.400	
	RETAIL ESTATES	1,200.000	91,224.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	21,670.000	4,864,915.000	
	VASTNED RETAIL	4,190.000	169,757.850	
	WAREHOUSES DE PAUW	3,020.000	223,480.000	
	WERELDHAVE BELGIUM	430.000	44,634.000	
	WERELDHAVE NV	8,890.000	440,321.700	
	ユーロ 小計	982,070.000	13,347,205.530 (1,706,573,699)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	481,570.000	1,791,440.400	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	300,000.000	2,265,000.000	
	LINK REIT	498,023.000	21,937,913.150	
	NEW CENTURY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	102,000.000	295,800.000	
	PROSPERITY REIT	252,000.000	675,360.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	180,000.000	338,400.000	
	SPRING REIT	179,000.000	504,780.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	225,000.000	830,250.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	228,000.000	896,040.000	
	香港・ドル 小計	2,445,593.000	29,534,983.550 (448,341,051)	
	投資証券 合計	11,871,987	22,646,538,651 (22,646,538,651)	
	合計		25,254,335,163 (25,254,335,163)	

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 157銘柄	-%	62.38%	72.35%
イギリス・ポンド	投資証券 21銘柄	-%	5.72%	6.63%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.04%	0.04%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	6.50%	-%	7.53%
カナダ・ドル	投資証券 28銘柄	-%	1.41%	1.63%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	2.41%	-%	2.79%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	0.42%	0.48%
ユーロ	投資証券 31銘柄	-%	5.83%	6.76%
香港・ドル	投資証券 9銘柄	-%	1.53%	1.78%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		291,548,643	44,926,152
コール・ローン		2,799,948,962	3,031,892,875
国債証券		171,703,101,848	171,450,791,029
派生商品評価勘定		405,010,519	4,220,200,203
未収利息		1,700,017,354	1,612,739,797
前払費用		96,436,397	89,178,573
流動資産合計		176,996,063,723	180,449,728,629
資産合計		176,996,063,723	180,449,728,629
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		106,042,707	-
未払解約金		82,830,000	35,755,000
流動負債合計		188,872,707	35,755,000
負債合計		188,872,707	35,755,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	137,101,844,489	136,783,689,294
剰余金			
剰余金又は欠損金()		39,705,346,527	43,630,284,335
元本等合計		176,807,191,016	180,413,973,629
純資産合計		176,807,191,016	180,413,973,629
負債純資産合計		176,996,063,723	180,449,728,629

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	137,483,212,002円 12,453,078,932円 12,834,446,445円	137,101,844,489円 19,248,792,257円 19,566,947,452円
元本の内訳 ファンド名		
投資のソムリエ	4,368,825,148円	8,891,870,834円
投資のソムリエ＜DC年金＞	61,903,371円	158,922,634円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	- 円	2,703,138円
外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	- 円	2,686,498,877円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	49,081,687円	- 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）	24,409,282,571円	22,703,268,954円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	1,479,670,332円	1,305,762,161円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	8,520,422,751円	7,719,331,345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）	38,571,424,083円	36,009,496,664円

D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	177,196円	176,428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)	34,405,414,499円	32,316,010,251円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	164,757円	119,449,381円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	3,532,589,421円	3,411,082,738円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	9,187,464,016円	9,050,768,997円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	12,023,867,868円	11,925,143,688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)	491,556,789円	483,203,204円
計	137,101,844,489円	136,783,689,294円
2. 受益権の総数	137,101,844,489口	136,783,689,294口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日	自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	751,254,393	1,185,825,545
合計	751,254,393	1,185,825,545

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年6月23日から平成27年7月13日まで及び平成27年6月23日から平成28年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年7月13日 現在				平成28年1月12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	174,387,583,655	-	174,088,615,843	298,967,812	176,492,246,521	-	172,272,046,318	4,220,200,203
アメリカ・ドル	74,153,853,363	-	74,236,047,990	82,194,627	76,458,061,997	-	74,890,483,650	1,567,578,347
イギリス・ポンド	15,074,226,645	-	14,884,931,700	189,294,945	14,597,860,221	-	14,116,910,976	480,949,245
オーストラリア・ドル	2,933,147,677	-	2,840,587,113	92,560,564	3,228,257,404	-	3,043,740,100	184,517,304
カナダ・ドル	3,848,580,321	-	3,789,670,071	58,910,250	3,570,519,928	-	3,419,050,460	151,469,468
シンガポール・ドル	639,522,843	-	638,372,590	1,150,253	604,541,770	-	585,474,192	19,067,578
スウェーデン・クローナ	881,594,225	-	865,456,568	16,137,657	808,510,027	-	781,224,185	27,285,842
デンマーク・クローネ	1,245,722,308	-	1,245,381,668	340,640	1,095,429,760	-	1,072,055,580	23,374,180
ノルウェー・クローネ	487,334,554	-	478,110,804	9,223,750	449,906,094	-	436,601,998	13,304,096
ポーランド・ズロチ	1,015,484,187	-	1,019,124,459	3,640,272	945,190,963	-	911,039,836	34,151,127
マレーシア・リンギット	828,333,037	-	819,704,700	8,628,337	694,021,720	-	680,677,100	13,344,620
メキシコ・ペソ	1,769,163,689	-	1,763,373,000	5,790,689	1,740,865,289	-	1,647,179,154	93,686,135
ユーロ	70,574,082,757	-	70,594,270,296	20,187,539	71,587,297,452	-	70,044,743,683	1,542,553,769

南アフリ カ・ランド	936,538,049	-	913,584,884	22,953,165	711,783,896	-	642,865,404	68,918,492
合計	174,387,583,655	-	174,088,615,843	298,967,812	176,492,246,521	-	172,272,046,318	4,220,200,203

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.2896円	1.3190円
(1万口当たり純資産額)	(12,896円)	(13,190円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年1月12日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.5 07/31/17	10,000,000.000	9,941,000.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	12,300,000.000	12,259,041.000	
		US T N/B 0.625 08/31/17	19,000,000.000	18,910,130.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	5,000,000.000	4,971,050.000	
		US T N/B 0.75 03/31/18	13,600,000.000	13,516,496.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	9,000,000.000	8,961,300.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	13,900,000.000	13,869,003.000	
		US T N/B 0.875 04/30/17	14,400,000.000	14,407,200.000	
		US T N/B 0.875 05/15/17	4,000,000.000	4,001,400.000	
		US T N/B 1.0 06/30/19	5,000,000.000	4,945,500.000	
		US T N/B 1.0 09/15/18	5,000,000.000	4,981,800.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	7,400,000.000	7,282,636.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	2,600,000.000	2,601,820.000	
		US T N/B 1.25 10/31/18	20,000,000.000	20,042,000.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	4,000,000.000	3,979,680.000	
		US T N/B 1.25 11/30/18	1,000,000.000	1,001,950.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	7,660,000.000	7,613,274.000	
		US T N/B 1.5 01/31/22	3,000,000.000	2,947,710.000	
		US T N/B 1.5 02/28/19	5,000,000.000	5,038,650.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	8,400,000.000	8,460,984.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	5,600,000.000	5,648,552.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,358,925.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	2,880,000.000	2,831,616.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	12,770,000.000	12,701,042.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	8,500,000.000	8,380,405.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	9,600,000.000	9,510,720.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	6,720,000.000	6,823,420.800	
		US T N/B 1.875 09/30/17	6,000,000.000	6,095,100.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	7,710,000.000	7,803,599.400	
		US T N/B 2.0 02/15/23	4,000,000.000	4,022,160.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	12,100,000.000	11,960,971.000	
		US T N/B 2.0 02/28/21	5,000,000.000	5,090,600.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	4,360,000.000	4,432,855.600	
		US T N/B 2.0 07/31/20	29,500,000.000	30,090,000.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	7,700,000.000	7,810,649.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	6,660,000.000	6,792,134.400			
US T N/B 2.0 11/15/21	6,900,000.000	6,990,528.000			
US T N/B 2.125 05/15/25	9,900,000.000	9,881,388.000			
US T N/B 2.125 08/15/21	5,430,000.000	5,550,003.000			
US T N/B 2.125 08/31/20	1,480,000.000	1,516,881.600			

US T N/B 2.125 09/30/21	6,300,000.000	6,431,355.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	5,920,000.000	6,097,126.400	
US T N/B 2.25 07/31/18	4,000,000.000	4,115,440.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	1,500,000.000	1,512,060.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	4,300,000.000	4,435,708.000	
US T N/B 2.375 07/31/17	10,500,000.000	10,736,985.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	9,010,000.000	9,204,255.600	
US T N/B 2.375 12/31/20	1,450,000.000	1,504,592.500	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,000,000.000	3,633,120.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,090,000.000	10,415,503.400	
US T N/B 2.5 06/30/17	6,500,000.000	6,652,555.000	
US T N/B 2.625 04/30/18	4,300,000.000	4,452,650.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	5,150,000.000	5,394,985.500	
US T N/B 2.625 11/15/20	1,360,000.000	1,425,021.600	
US T N/B 2.75 02/15/19	3,700,000.000	3,873,123.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	4,630,000.000	4,873,399.100	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,270,000.000	2,197,110.300	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,100,000.000	7,490,500.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,950,000.000	1,884,480.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,480,000.000	3,437,857.200	
US T N/B 2.875 08/15/45	3,650,000.000	3,585,541.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	7,000,000.000	7,171,430.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,110,000.000	3,169,027.800	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,200,000.000	6,245,508.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	4,200,000.000	4,236,414.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,450,000.000	1,462,571.500	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,110,000.000	1,159,683.600	
US T N/B 3.125 02/15/43	3,340,000.000	3,466,652.800	
US T N/B 3.125 04/30/17	4,000,000.000	4,118,120.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,769,640.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	5,430,000.000	5,830,842.600	
US T N/B 3.125 08/15/44	5,540,000.000	5,731,684.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,400,000.000	2,509,872.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,000,000.000	7,204,190.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	4,900,000.000	5,017,306.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,540,000.000	3,845,325.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	2,500,000.000	2,628,200.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,472,000.000	1,647,712.640	
US T N/B 3.5 05/15/20	7,910,000.000	8,567,162.800	
US T N/B 3.625 02/15/20	11,890,000.000	12,915,036.900	
US T N/B 3.625 02/15/44	3,250,000.000	3,701,165.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	17,000,000.000	18,358,640.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	3,100,000.000	3,535,209.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,840,000.000	2,138,411.200	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,400,000.000	5,133,524.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	5,800,000.000	6,184,888.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,500,000.000	1,773,750.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	790,000.000	987,808.100	
US T N/B 4.25 11/15/17	3,000,000.000	3,179,880.000	

US T N/B 4.25 11/15/40	1,920,000.000	2,401,785.600	
US T N/B 4.375 02/15/38	910,000.000	1,161,524.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,060,000.000	2,621,906.200	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,600,000.000	2,042,000.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,400,000.000	1,781,598.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,680,000.000	2,180,976.000	
US T N/B 4.5 05/15/17	4,000,000.000	4,195,120.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	690,000.000	895,488.900	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,280,000.000	1,657,497.600	
US T N/B 4.625 02/15/17	6,000,000.000	6,248,880.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,820,000.000	2,397,850.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,080,000.000	1,451,628.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	3,700,000.000	3,925,885.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	690,000.000	955,650.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,098,903.400	
US T N/B 5.25 11/15/28	890,000.000	1,174,800.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,400,000.000	1,920,730.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	630,000.000	846,852.300	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,077,312.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,328,290.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	900,000.000	1,319,058.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,000,000.000	2,606,240.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	706,130.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,829,750.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	11,000,000.000	13,613,270.000	
アメリカ・ドル 小計	612,732,000.000 (72,179,829,600)	635,506,323.340 (74,862,644,889)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	1,970,000.000	1,985,957.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	4,510,000.000	4,573,140.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/17	920,000.000	932,972.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	2,100,000.000	2,158,863.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,000,000.000	2,040,400.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	2,400,000.000	2,491,656.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,910,000.000	1,949,155.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,260,000.000	2,371,915.200	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,220,000.000	2,412,252.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,350,000.000	2,675,240.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,230,000.000	2,661,282.000	

UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,230,000.000	2,948,060.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,530,000.000	2,008,890.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	1,870,000.000	2,062,049.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,800,000.000	3,140,200.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,400,000.000	2,728,368.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,150,000.000	1,645,420.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,900,000.000	2,204,760.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	2,709,840.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,930,000.000	2,460,171.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,420,000.000	1,858,070.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,320,000.000	1,647,624.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,680,000.000	2,215,920.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,630,000.000	2,237,827.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,360,000.000	1,915,016.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,630,000.000	2,397,893.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,000,000.000	2,233,400.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,200,000.000	2,910,380.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,850,000.000	2,561,880.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,300,000.000	1,499,810.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,840,000.000	2,453,456.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,246,594.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/18	880,000.000	965,096.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,730,000.000	2,222,012.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,050,000.000	1,537,935.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,720,000.000	2,332,320.000	

	UK TREASURY 8.75 08/25/17	1,230,000.000	1,397,895.000	
イギリス・ボンド 小計		69,230,000.000 (11,868,098,900)	82,793,718.200 (14,193,327,111)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,840,000.000	3,119,995.600	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,750,000.000	3,024,862.500	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,170,000.000	3,729,885.400	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	2,310,000.000	2,330,790.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	450,000.000	416,416.500	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,200,000.000	1,230,960.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,500,000.000	2,611,750.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	950,000.000	977,607.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	350,000.000	345,040.500	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	600,000.000	620,610.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	900,000.000	963,378.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,230,000.000	2,526,322.400	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	540,000.000	558,138.600	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,000,000.000	1,180,330.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,050,000.000	2,428,081.500	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,260,000.000	3,485,983.200	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,300,000.000	2,756,711.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,000,000.000	2,403,880.000	
AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	1,940,000.000	2,023,323.000		
オーストラリア・ドル 小計		33,340,000.000 (2,749,216,400)	36,734,065.200 (3,029,091,016)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	450,000.000	754,191.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	300,000.000	301,545.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,230,000.000	1,252,238.400	
	CANADA 1.25 09/01/18	1,850,000.000	1,890,866.500	
	CANADA 1.5 03/01/17	4,380,000.000	4,434,618.600	
	CANADA 1.5 03/01/20	650,000.000	674,966.500	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,500,000.000	1,543,635.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	600,000.000	603,594.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	3,000,000.000	3,053,820.000	
	CANADA 1.75 09/01/19	1,600,000.000	1,670,704.000	

	CANADA 2.25 06/01/25	1,350,000.000	1,461,847.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,430,000.000	1,577,876.300	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,310,000.000	1,456,248.400	
	CANADA 2.75 12/01/48	200,000.000	230,258.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	420,000.000	508,901.400	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,400,000.000	1,582,924.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,430,000.000	2,736,277.200	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,950,000.000	2,562,300.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	2,050,000.000	2,275,254.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	1,280,000.000	1,343,577.600	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,550,000.000	2,131,746.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,200,000.000	1,309,296.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,350,000.000	2,036,677.500	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,020,000.000	1,512,915.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,270,000.000	1,984,616.300	
カナダ・ドル 小計		35,770,000.000 (2,965,690,700)	40,890,894.200 (3,390,264,038)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	940,000.000	924,772.000	
	SINGAPORE 1.625 10/01/19	800,000.000	797,200.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	300,000.000	297,123.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	420,000.000	408,609.600	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	202,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	373,825.800	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	340,000.000	353,090.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	890,000.000	931,830.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,032,920.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	270,000.000	290,463.300	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	540,000.000	584,280.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	830,000.000	886,191.000	
	シンガポール・ドル 小計		6,880,000.000 (564,848,000)	7,082,704.700 (581,490,056)
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	7,400,000.000	7,851,548.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,500,000.000	6,314,770.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,210,000.000	6,685,628.300	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	8,080,000.000	9,628,128.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	6,060,000.000	6,471,474.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,080,000.000	9,232,208.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	8,140,000.000	10,061,691.200	
スウェーデン・クローナ 小計		48,470,000.000 (668,401,300)	56,245,447.500 (775,624,721)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	6,570,000.000	7,039,755.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,400,000.000	5,846,472.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,830,000.000	10,204,389.500	

	DENMARK 4.0 11/15/17	4,260,000.000	4,600,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	10,110,000.000	11,692,821.600	
	DENMARK 4.5 11/15/39	12,130,000.000	19,505,040.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	2,300,000.000	3,569,140.000	
デンマーク・クローネ 小計		49,600,000.000 (850,144,000)	62,458,418.100 (1,070,537,286)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.75 03/13/25	2,600,000.000	2,691,728.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	4,600,000.000	4,875,816.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	4,400,000.000	5,004,780.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	6,560,000.000	7,531,536.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	5,500,000.000	5,767,300.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	5,960,000.000	6,723,178.000	
ノルウェー・クローネ 小計		29,620,000.000 (390,984,000)	32,594,338.000 (430,245,262)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	1,500,000.000	1,464,525.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	2,000,000.000	2,096,240.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,600,000.000	3,695,472.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	4,530,000.000	4,759,671.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,570,000.000	2,795,903.000	
	POLAND 4.75 04/25/17	700,000.000	730,450.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	3,430,000.000	3,657,889.200	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,277,440.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,110,000.000	2,377,970.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	900,000.000	1,137,150.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	2,180,000.000	2,606,190.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	1,780,000.000	2,105,740.000	
ポーランド・ズロチ 小計		28,180,000.000 (827,364,800)	30,704,640.200 (901,488,236)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.48 03/15/23	2,190,000.000	2,104,590.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,580,000.000	1,434,260.800	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	2,170,000.000	2,190,940.500	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	1,000,000.000	1,012,220.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	340,000.000	305,748.400	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,107,418.200	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	3,960,000.000	4,019,400.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	690,000.000	686,205.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	3,820,000.000	3,899,150.400	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	4,760,000.000	4,900,420.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,476,980.800	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	620,000.000	612,758.400	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	100,000.000	101,799.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,570,531.600	
マレーシア・リングgit 小計		25,370,000.000 (680,677,100)	25,422,423.100 (682,083,612)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	9,880,000.000	13,415,459.200	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	25,720,000.000	32,830,294.000	

	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	18,450,000.000	18,606,087.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	10,860,000.000	11,415,163.200	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	12,000,000.000	13,145,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	7,940,000.000	8,828,883.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	9,880,000.000	10,937,258.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	34,580,000.000	37,050,741.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	24,610,000.000	27,305,533.300	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	12,500,000.000	14,119,500.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	21,730,000.000	25,647,049.800	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	14,320,000.000	17,135,598.400	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	18,000,000.000	19,867,860.000	
	メキシコ・ペソ 小計	220,470,000.000 (1,452,897,300)	250,304,827.700 (1,649,508,815)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	530,000.000	538,114.300	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	730,000.000	754,674.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,070,000.000	1,160,393.600	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	820,000.000	899,950.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	540,000.000	580,181.400	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	550,000.000	630,118.500	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	580,000.000	771,690.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	420,000.000	436,464.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,000,000.000	1,209,540.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,730,000.000	2,062,160.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	850,000.000	1,031,900.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	320,000.000	518,454.400	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,447,000.000	1,704,566.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,100,000.000	1,611,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	1,130,000.000	1,218,140.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,720,000.000	1,969,744.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	980,000.000	1,078,000.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	800,000.000	1,110,840.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	710,000.000	1,115,161.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,400,000.000	1,388,968.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	350,000.000	323,578.500	
	BELGIUM 1.25 06/22/18	1,150,000.000	1,194,436.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	400,000.000	402,376.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,300,000.000	1,465,841.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	1,550,000.000	1,791,846.500	

BELGIUM 3.0 06/22/34	600,000.000	725,478.000	
BELGIUM 3.0 09/28/19	1,580,000.000	1,764,749.400	
BELGIUM 3.5 06/28/17	980,000.000	1,035,370.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	770,000.000	1,075,820.900	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,320,000.000	2,730,918.400	
BELGIUM 4.0 03/28/17	700,000.000	737,317.000	
BELGIUM 4.0 03/28/18	490,000.000	537,000.800	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,300,000.000	1,476,917.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,650,000.000	2,032,255.500	
BELGIUM 4.0 03/28/32	830,000.000	1,120,524.900	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,550,000.000	2,298,278.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,700,000.000	2,096,117.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,500,000.000	1,889,775.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	900,000.000	1,209,456.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,800,000.000	2,780,064.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,794,000.000	2,668,754.400	
BELGIUM 5.5 09/28/17	880,000.000	968,211.200	
BUNDESUBL 0.25 04/13/18	400,000.000	405,692.000	
BUNDESUBL 0.5 02/23/18	2,000,000.000	2,037,340.000	
BUNDESUBL 0.5 04/07/17	3,520,000.000	3,559,283.200	
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	3,600,000.000	3,696,660.000	
BUNDESUBL 0.5 10/13/17	2,230,000.000	2,264,899.500	
BUNDESUBL 04/17/20	3,400,000.000	3,429,104.000	
BUNDESUBL 1.0 10/12/18	900,000.000	933,624.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,900,000.000	2,907,250.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,300,000.000	3,471,270.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,700,000.000	1,773,610.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,700,000.000	1,858,780.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,070,000.000	2,264,931.900	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,810,000.000	1,982,746.400	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,600,000.000	2,839,096.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	300,000.000	334,755.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,510,000.000	2,778,319.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	1,600,000.000	1,787,920.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,000,000.000	2,265,180.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	1,900,000.000	2,113,370.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,600,000.000	2,935,530.000	

DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,510,000.000	1,919,663.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,230,000.000	1,568,065.500	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	2,410,000.000	2,753,063.500	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,619,585.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,100,000.000	3,659,550.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,390,000.000	1,984,225.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	2,910,000.000	3,294,993.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	3,000,000.000	3,123,570.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	2,400,000.000	2,693,400.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,550,000.000	3,859,418.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,250,000.000	3,382,380.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	3,200,000.000	3,420,128.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	1,600,000.000	1,783,760.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,400,000.000	2,235,380.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,080,000.000	1,588,572.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,000,000.000	3,193,800.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,550,000.000	2,666,775.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,700,000.000	2,767,430.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,450,000.000	2,261,420.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,736,724.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	960,000.000	1,638,720.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,090,000.000	1,790,216.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	330,000.000	335,996.100	
FINLAND 0.75 04/15/31	300,000.000	276,360.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	370,000.000	371,169.200	
FINLAND 1.125 09/15/18	540,000.000	560,595.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	500,000.000	538,700.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	550,000.000	598,977.500	

FINLAND 1.875 04/15/17	450,000.000	463,005.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	390,000.000	434,229.900	
FINLAND 2.625 07/04/42	370,000.000	462,000.500	
FINLAND 2.75 07/04/28	480,000.000	573,648.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	580,000.000	665,376.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	560,000.000	661,136.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	500,000.000	535,500.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	550,000.000	712,717.500	
FINLAND 4.375 07/04/19	400,000.000	463,640.000	
FR TREASURY 1.0 07/25/17	2,480,000.000	2,531,559.200	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,342,262.800	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,950,000.000	3,832,843.000	
FRANCE OAT 05/25/20	4,600,000.000	4,602,944.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	1,720,000.000	1,772,477.200	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,720,000.000	1,787,424.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	240,000.000	248,522.400	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	1,000,000.000	1,000,780.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,500,000.000	3,824,205.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,150,000.000	3,425,152.500	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,700,000.000	3,053,403.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,700,000.000	4,170,344.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,000,000.000	3,425,550.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	3,790,000.000	4,235,893.500	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,500,000.000	4,115,510.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	3,100,000.000	3,629,046.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,440,000.000	1,852,704.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,500,000.000	5,296,455.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,700,000.000	4,260,994.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,370,000.000	4,209,130.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	6,370,000.000	6,708,374.400	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	3,950,000.000	4,712,468.500	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	3,260,000.000	3,737,264.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	3,450,000.000	3,790,446.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,570,000.000	2,372,584.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,220,000.000	1,871,248.200	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,420,000.000	3,421,952.600	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	4,390,000.000	5,029,886.400	

FRANCE OAT 4.25 10/25/17	2,950,000.000	3,193,021.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	4,400,000.000	4,952,860.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,260,000.000	4,190,208.400	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,500,000.000	3,843,750.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,450,000.000	3,701,729.500	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,900,000.000	4,398,517.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,750,000.000	4,475,872.500	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,800,000.000	4,168,808.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	1,963,812.000	
IRISH 0.8 03/15/22	500,000.000	513,875.000	
IRISH 2.0 02/18/45	460,000.000	446,623.200	
IRISH 2.4 05/15/30	740,000.000	816,693.600	
IRISH 3.4 03/18/24	750,000.000	902,535.000	
IRISH 3.9 03/20/23	500,000.000	616,795.000	
IRISH 4.4 06/18/19	890,000.000	1,025,903.000	
IRISH 4.5 04/18/20	950,000.000	1,129,768.500	
IRISH 4.5 10/18/18	810,000.000	914,409.000	
IRISH 5.0 10/18/20	880,000.000	1,082,928.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,050,000.000	1,450,890.000	
IRISH 5.5 10/18/17	300,000.000	330,726.000	
IRISH 5.9 10/18/19	740,000.000	904,354.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	5,000,000.000	5,050,500.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,800,000.000	2,870,168.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	2,200,000.000	2,259,224.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	3,500,000.000	3,508,400.000	
ITALY BTPS 1.5 08/01/19	3,450,000.000	3,598,626.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,100,000.000	1,041,876.000	
ITALY BTPS 2.5 05/01/19	1,000,000.000	1,074,780.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,300,000.000	1,451,411.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,000,000.000	2,363,220.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	1,700,000.000	1,968,090.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	1,600,000.000	1,854,560.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,719,360.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	3,900,000.000	4,633,863.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	5,800,000.000	6,048,588.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,600,000.000	3,248,960.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	2,660,000.000	3,082,940.000	

ITALY BTPS 4.25 02/01/19	2,520,000.000	2,834,496.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,100,000.000	2,430,960.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	6,382,000.000	6,967,229.400	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	1,820,000.000	2,121,574.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	5,900,000.000	6,696,500.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,900,000.000	2,362,061.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,650,000.000	3,371,065.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,000,000.000	1,234,040.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,780,000.000	3,492,236.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	4,650,000.000	5,664,630.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.000	2,373,228.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,450,000.000	2,049,763.500	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	400,000.000	497,160.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,600,000.000	3,382,236.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,100,000.000	2,946,300.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,080,000.000	2,980,640.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,000,000.000	2,856,400.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	5,530,000.000	5,983,902.400	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,600,000.000	3,612,180.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,360,000.000	3,036,588.400	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,700,000.000	2,192,337.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	2,297,295.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,850,000.000	4,296,660.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,560,000.000	3,822,336.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	950,000.000	1,470,125.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,970,000.000	3,101,371.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	1,000,000.000	1,015,610.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,350,000.000	1,291,815.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	3,000,000.000	3,096,600.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	1,530,000.000	1,599,615.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,700,000.000	1,871,122.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,480,000.000	1,660,204.800	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,600,000.000	1,809,808.000	

NETHERLANDS 2.5 01/15/17	2,080,000.000	2,141,276.800	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,050,000.000	1,248,135.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	980,000.000	1,278,468.800	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,800,000.000	2,114,100.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,040,000.000	2,368,440.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,240,000.000	1,536,360.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,500,000.000	2,261,190.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,300,000.000	1,925,560.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	1,290,000.000	1,430,094.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,490,000.000	1,709,924.000	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	1,250,000.000	1,343,000.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,250,000.000	1,896,875.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,400,000.000	2,451,312.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	500,000.000	517,225.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,900,000.000	1,884,135.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,000,000.000	952,760.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,760,000.000	1,814,577.600	
SPAIN 2.75 04/30/19	1,800,000.000	1,942,902.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,500,000.000	2,720,850.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	2,700,000.000	2,968,515.000	
SPAIN 3.8 01/31/17	3,950,000.000	4,106,025.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	2,070,000.000	2,423,597.400	
SPAIN 4.0 04/30/20	2,570,000.000	2,943,292.500	
SPAIN 4.1 07/30/18	2,320,000.000	2,554,088.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,650,000.000	2,022,438.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	2,120,000.000	2,430,368.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,220,000.000	2,717,280.000	
SPAIN 4.5 01/31/18	2,420,000.000	2,639,736.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	2,610,000.000	3,002,022.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	2,100,000.000	2,642,430.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,360,000.000	1,789,624.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	1,480,000.000	1,853,034.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	1,800,000.000	2,151,990.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,350,000.000	1,818,450.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	1,350,000.000	1,801,710.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,170,000.000	1,652,660.100	
SPAIN 5.4 01/31/23	1,800,000.000	2,296,980.000	

	SPAIN 5.5 04/30/21	2,310,000.000	2,876,296.500	
	SPAIN 5.5 07/30/17	2,960,000.000	3,211,037.600	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,800,000.000	2,603,394.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,950,210.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,400,000.000	1,943,130.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,050,000.000	2,928,507.000	
ユーロ 小計		455,663,000.000 (58,261,071,180)	541,691,052.700 (69,260,617,998)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	16,940,000.000	17,908,629.200	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	12,410,000.000	8,306,633.500	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,780,000.000	5,162,030.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	16,150,000.000	14,460,225.500	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	8,690,000.000	6,552,260.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	6,020,000.000	5,103,455.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	12,500,000.000	12,226,375.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	2,500,000.000	2,125,125.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	5,100,000.000	4,336,275.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	3,500,000.000	2,987,985.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	11,460,000.000	9,827,866.800	
南アフリカ・ランド 小計		103,050,000.000 (722,380,500)	88,996,860.000 (623,867,989)	
国債証券 合計		154,181,603,780 (154,181,603,780)	171,450,791,029 (171,450,791,029)	
合計		154,181,603,780 (154,181,603,780)	171,450,791,029 (171,450,791,029)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 114銘柄	41.49%	43.66%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.87%	8.28%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	1.68%	1.77%
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	1.88%	1.98%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.32%	0.34%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.43%	0.45%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.59%	0.62%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.24%	0.25%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.50%	0.53%

マレーシア・リングgit	国債証券	14銘柄	0.38%	0.40%
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.91%	0.96%
ユーロ	国債証券	240銘柄	38.39%	40.40%
南アフリカ・ランド	国債証券	11銘柄	0.35%	0.36%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		248,464,699	504,593,573
コール・ローン		658,287,423	39,386,400
株式		36,292,364,793	30,903,849,398
投資信託受益証券		274,130,570	213,344,522
投資証券		96,583,938	99,523,361
派生商品評価勘定		544,512	-
未収入金		74,409	-
未収配当金		201,554,902	15,714,978
差入委託証拠金		112,423,029	296,519,211
流動資産合計		37,884,428,275	32,072,931,443
資産合計		37,884,428,275	32,072,931,443
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		8,084,635	50,458,335
未払金		-	126,028,250
未払解約金		896,208,000	16,871,000
流動負債合計		904,292,635	193,357,585
負債合計		904,292,635	193,357,585
純資産の部			
元本等			
元本	1	34,877,056,190	39,843,963,916
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	2,103,079,450	7,964,390,058
元本等合計		36,980,135,640	31,879,573,858
純資産合計		36,980,135,640	31,879,573,858
負債純資産合計		37,884,428,275	32,072,931,443

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27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	39,367,301,761円	34,877,056,190円
同期中追加設定元本額	5,795,099,854円	13,181,307,136円
同期中一部解約元本額	10,285,345,425円	8,214,399,410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 >	624,375,460円	870,537,540円
D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	- 円	19,979,163円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	- 円	8,599,925円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	- 円	25,440,862円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	- 円	81,231,193円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	- 円	21,077,324円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	- 円	21,035,717円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	- 円	27,436,748円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	471,911,104円	510,196,135円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	19,255,615円	29,658,485円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	52,387,010円	76,889,791円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	143,956,918円	188,143,542円
投資のソムリエ	993,644,405円	1,077,540,227円
クルーズコントロール	128,593,567円	462,865,911円
投資のソムリエ< D C 年金 >	13,059,934円	19,208,691円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C 年金 >	49,802,281円	84,150,830円
クルーズコントロール< D C 年 金 >	27,835円	72,955円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	- 円	8,415,198円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	- 円	11,161,515円
投資のソムリエ< D C 年金 >リ スク抑制型	- 円	234,481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)	6,483,405,232円	7,098,394,804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)	192,233,956円	191,028,343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)	2,125,053,586円	2,145,904,763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)	14,453,464,848円	16,439,453,886円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	9,125,884,439円	10,425,305,887円
	計	34,877,056,190円	39,843,963,916円
2 .	受益権の総数	34,877,056,190口	39,843,963,916口
3 .	2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,964,390,058円であり ます。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	3,390,798,067	7,723,490,794
投資信託受益証券	3,193,243	38,814,652
投資証券	2,292,501	6,865,722
合計	3,396,283,811	7,769,171,168

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年4月21日から平成27年7月13日まで及び平成27年4月21日から平成28年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年7月13日 現在				平成28年1月12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								
買 建	159,247,660	-	159,237,000	10,660	153,134,540	-	153,127,000	7,540
アメリカ・ドル	159,247,660	-	159,237,000	10,660	153,134,540	-	153,127,000	7,540
合計	159,247,660	-	159,237,000	10,660	153,134,540	-	153,127,000	7,540

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成27年7月13日 現在				平成28年1月12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	726,028,713	-	718,499,250	7,529,463	854,188,415	-	803,737,620	50,450,795
合計	726,028,713	-	718,499,250	7,529,463	854,188,415	-	803,737,620	50,450,795

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.0603円	0.8001円
(1万口当たり純資産額)	(10,603円)	(8,001円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年1月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	12,600	43.620	549,612.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,773	4.110	60,717.030	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PEF	65,500	5.800	379,900.000	
	CREDICORP LTD	5,849	88.390	516,993.110	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	45,025	5.410	243,585.250	
	NETEASE INC-ADR	3,300	158.790	524,007.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	13,580	23.390	317,636.200	
	LUKOIL SPON ADR	44,443	29.815	1,325,068.040	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	56,215	1.260	70,830.900	
	GAZPROM PAO ADR	511,429	3.413	1,745,507.170	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	91,542	3.925	359,302.350	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	38,100	3.557	135,521.700	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	64,186	4.330	277,925.380	
	SISTEMA JSFC GDR	15,837	5.930	93,913.410	
	NOVATEK OAO GDR	8,221	72.500	596,022.500	
	BAIDU INC -SPON ADR	11,700	170.370	1,993,329.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	50,244	11.330	569,264.520	
	ROSTELECOM SPON ADR	13,980	6.900	96,462.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	110,923	3.153	349,740.210	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	5,800	27.880	161,704.000	
	SEVERSTAL GDR	18,990	8.095	153,724.050	
	TATNEFT ADR	21,268	24.100	512,558.800	
	VTB BANK OJSC GDR	235,975	1.859	438,677.520	
	DP WORLD LTD	13,391	18.500	247,733.500	
	MAGNIT PJSC GDR	23,040	34.680	799,027.200	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	17,100	13.400	229,140.000	
	SOUFUN HOLDINGS LTD ADR	11,000	6.310	69,410.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	128,729	0.921	118,559.400	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	2,500	42.220	105,550.000	
	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO LTD ADR	4,200	69.880	293,496.000	
	YOUKU TUDOU INC ADR	5,200	27.000	140,400.000	
SBERBANK ADR	235,677	5.075	1,196,060.770		
YY INC-ADR	1,300	57.570	74,841.000		
MEGAFON PJSC GDR	9,393	10.750	100,974.750		

	58.COM INC ADR	3,500	59.420	207,970.000	
	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	2,300	37.360	85,928.000	
	JD.COM INC ADR	14,900	27.030	402,747.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	42,400	69.920	2,964,608.000	
アメリカ・ドル 小計		1,974,110		18,508,447.760 (2,180,295,147)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	73,108	11.600	848,052.800	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	77,215	5.650	436,264.750	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	150,204	16.050	2,410,774.200	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	160,957	5.710	919,064.470	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	55,579	7.500	416,842.500	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	285,887	5.040	1,440,870.480	
	ARABTEC HOLDING CO	206,802	1.230	254,366.460	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	265,978	2.150	571,852.700	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	190,449	1.120	213,302.880	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	178,166	2.510	447,196.660	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,644,345		7,958,587.900 (255,629,843)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	109,746	1,051.600	115,408,893.600	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	14,873	888.050	13,207,967.650	
	ASIAN PAINTS LTD	24,827	873.850	21,695,073.950	
	EICHER MOTORS LTD	972	17,239.100	16,756,405.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,835	1,162.600	37,011,371.000	
	SHREE CEMENT LTD	777	10,912.050	8,478,662.850	
	ICICI BANK LTD	89,560	239.450	21,445,142.000	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	3,586	2,246.650	8,056,486.900	
	STATE BANK OF INDIA LTD	129,505	204.300	26,457,871.500	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,923	1,281.250	3,745,093.750	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	23,672	500.150	11,839,550.800	
	TATA STEEL LTD	25,639	251.650	6,452,054.350	
	TATA MOTORS LTD	66,282	360.200	23,874,776.400	
	JSW STEEL LTD	6,621	1,019.650	6,751,102.650	
	TATA POWER CO LTD	97,018	67.150	6,514,758.700	
	NESTLE INDIA LTD	1,938	5,469.250	10,599,406.500	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	149.450	7,337,845.550	
	GAIL INDIA LTD	33,181	369.300	12,253,743.300	
	VEDANTA LTD	81,588	85.000	6,934,980.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	68,077	225.500	15,351,363.500	

GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	881	6,245.650	5,502,417.650	
LUPIN LTD	18,993	1,700.950	32,306,143.350	
ACC LTD	3,257	1,297.550	4,226,120.350	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	126,881	1,161.550	147,378,625.550	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	45,644	409.600	18,695,782.400	
INFOSYS LTD	155,782	1,055.700	164,459,057.400	
WIPRO LTD	53,121	537.450	28,549,881.450	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	64,039	811.750	51,983,658.250	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,999	1,360.850	9,524,589.150	
HCL TECHNOLOGIES LTD	48,215	814.550	39,273,528.250	
DABUR INDIA LTD	44,319	263.100	11,660,328.900	
HERO MOTOCORP LTD	3,771	2,505.450	9,448,051.950	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,169	2,931.500	29,810,423.500	
BHARTI AIRTEL LTD	101,979	321.150	32,750,555.850	
UNITED SPIRITS LTD	4,820	2,758.100	13,294,042.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	81,884	782.250	64,053,759.000	
DIVI'S LABORATORIES LTD	6,922	1,099.500	7,610,739.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,073	4,272.400	38,763,485.200	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,532	842.450	9,715,133.400	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,205	833.000	18,496,765.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	27,798	269.600	7,494,340.800	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	12,459	818.000	10,191,462.000	
CIPLA LTD/INDIA	27,514	610.050	16,784,915.700	
LARSEN & TOUBRO LTD	27,417	1,173.350	32,169,736.950	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,015	2,726.800	8,221,302.000	
ASHOK LEYLAND LTD	81,602	92.400	7,540,024.800	
BOSCH LTD	587	18,108.400	10,629,630.800	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	40,135	2,362.350	94,812,917.250	
NTPC LTD	95,427	141.600	13,512,463.200	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,629	954.300	6,326,054.700	
AMBUJA CEMENTS LTD	61,876	197.950	12,248,354.200	
BHARAT FORGE LTD	9,622	827.300	7,960,280.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,841	77.900	6,219,613.900	
ITC LTD	190,351	316.050	60,160,433.550	
UNITED PHOSPHORUS LTD	23,573	424.900	10,016,167.700	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	84,596	83.750	7,084,915.000	
SIEMENS INDIA LTD	5,173	1,127.850	5,834,368.050	
UNITED BREWERIES LTD	5,209	896.750	4,671,170.750	

	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	9,906	1,231.250	12,196,762.500	
	TECH MAHINDRA LTD	17,798	507.300	9,028,925.400	
	CAIRN INDIA LTD	43,218	130.200	5,626,983.600	
	IDEA CELLULAR LTD	94,970	129.800	12,327,106.000	
	MARICO LTD	38,600	221.500	8,549,900.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	188.600	4,859,279.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	68,199	234.050	15,961,975.950	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	25,236	212.900	5,372,744.400	
	BAJAJ AUTO LTD	7,326	2,360.500	17,293,023.000	
	COAL INDIA LTD	57,981	315.950	18,319,096.950	
	TATA MOTORS LTD	35,104	271.800	9,541,267.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	20,882	235.500	4,917,711.000	
	BHARTI INFRA TEL LTD	39,750	395.050	15,703,237.500	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	23,626	736.200	17,393,461.200	
	CADILA HEALTHCARE LTD	14,117	315.050	4,447,560.850	
インド・ルビー	小計	2,987,507		1,601,092,824.250 (2,849,945,227)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	107,000	7,225.000	773,075,000.000	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	16,000.000	560,000,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	144,301	15,875.000	2,290,778,375.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	372,500	5,525.000	2,058,062,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	135,000	35,325.000	4,768,875,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,739,000	5,950.000	10,347,050,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,362,900	3,060.000	13,350,474,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	512,900	2,840.000	1,456,636,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	43,300	54,500.000	2,359,850,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	30,800	91,000.000	2,802,800,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	124,000	19,750.000	2,449,000,000.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	736,600	1,565.000	1,152,779,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	2,900.000	842,206,400.000	
	BANK MANDIRI	763,600	9,100.000	6,948,760,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	198,800	16,150.000	3,210,620,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	960,300	11,375.000	10,923,412,500.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	913,700	2,480.000	2,265,976,000.000	

	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	593,800	4,935.000	2,930,403,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,645,000	1,385.000	2,278,325,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	229,800	10,700.000	2,458,860,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,070,600	12,750.000	13,650,150,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	188,000	3,385.000	636,380,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,601,200	1,010.000	1,617,212,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	625,200	960.000	600,192,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	1,645.000	770,682,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	5,625.000	1,054,687,500.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	1,765.000	1,046,292,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	486.000	529,983,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	85,400	13,950.000	1,191,330,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	151,500	5,650.000	855,975,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	535,800	3,040.000	1,628,832,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	20,535,717		99,809,658,775.000 (848,382,099)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	8,087	78.200	632,403.400	
	QATAR NATIONAL BANK	14,690	162.500	2,387,125.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	13,439	41.600	559,062.400	
	OOREDOO QSC	6,737	74.000	498,538.000	
	DOHA BANK QSC	10,788	40.000	431,520.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,398	202.100	484,635.800	
	INDUSTRIES QATAR QSC	13,005	104.000	1,352,520.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,187	95.600	495,877.200	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	24,643	22.020	542,638.860	
	MASRAF AL RAYAN	32,030	35.000	1,121,050.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	8,004	35.700	285,742.800	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	64,924	14.500	941,398.000	
	VODAFONE QATAR	26,910	11.800	317,538.000	
カタール・リアル	小計	230,842		10,050,049.460 (325,722,103)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	43,027	7,040.000	302,910,080.000	
	ECOPETROL SA	409,677	1,015.000	415,822,155.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	5,872	31,880.000	187,199,360.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	311,218	1,015.000	315,886,270.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	25,679	9,110.000	233,935,690.000	
	GRUPO ARGOS SA	24,900	15,500.000	385,950,000.000	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,515	20,840.000	740,132,600.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	19,788	32,140.000	635,986,320.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA-CD	6,465	36,020.000	232,869,300.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA ND	59	35,300.000	2,082,700.000	
コロンビア・ペソ	小計	882,200		3,452,774,475.000 (124,645,159)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	147.500	2,905,750.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	29.500	2,542,900.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	288,500	15.700	4,529,450.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	125,400	113.500	14,232,900.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	676,125	5.950	4,022,943.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	53,300	147.500	7,861,750.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,307,700	2.280	2,981,556.000	
	IRPC PCL NVDR	819,000	4.400	3,603,600.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	100,000	14.900	1,490,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	276,800	18.000	4,982,400.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	89,200	144.500	12,889,400.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	361,920	6.900	2,497,248.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	45,500	75.250	3,423,875.000	
	PTT PCL	85,500	211.000	18,040,500.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	164,100	16.900	2,773,290.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,050	416.000	4,596,800.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	40,700	333.000	13,553,100.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	27,100	416.000	11,273,600.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	95,800	147.000	14,082,600.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	116,800	44.000	5,139,200.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	326,000	21.300	6,943,800.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	214.000	6,484,200.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	121,210	31.250	3,787,812.500	
	THAI OIL PCL NVDR	75,100	64.750	4,862,725.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	77.000	3,203,200.000	
	CP ALL PCL NVDR	394,100	41.500	16,355,150.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	8.300	4,276,990.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	105,845	48.750	5,159,943.750	

	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	75,722	19.600	1,484,151.200	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	19.600	1,076,686.800	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	180,208	45.250	8,154,412.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	78,800	21.400	1,686,320.000	
タイ・パーツ 小計		6,789,513		200,898,254.000 (652,919,326)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,269	5,075.000	6,440,175.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	4,327	250.400	1,083,480.800	
	CEZ	15,455	412.900	6,381,369.500	
チェコ・コルナ 小計		21,051		13,905,025.300 (65,770,770)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,829,922	30.370	177,054,731.140	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,654	25,770.000	68,393,580.000	
	BANCO DE CHILE	2,124,153	69.530	147,692,358.090	
	EMPRESAS CMPC SA	114,623	1,471.100	168,621,895.300	
	EMPRESAS COPEC SA	38,000	5,725.400	217,565,200.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	7,163.300	94,483,927.000	
	ENTEL CHILE SA	12,381	6,421.700	79,507,067.700	
	ENDESA CHILE	268,589	859.950	230,973,110.550	
	ENERSIS SA	1,584,925	161.370	255,759,347.250	
	COLBUN SA	748,274	161.370	120,748,975.380	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	353.330	79,186,906.280	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	1,903.700	40,701,106.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,163	3,706.800	82,153,808.400	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	7,931	11,687.000	92,689,597.000	
	SACI FALABELLA	40,539	4,445.500	180,216,124.500	
	CORPBANCA	10,718,441	5.518	59,144,357.430	
	CENCOSUD SA	105,057	1,348.500	141,669,364.500	
SONDA SA	27,363	1,178.800	32,255,504.400		
AES GENER SA	209,506	314.000	65,784,884.000		
チリ・ペソ 小計		22,113,207		2,334,601,844.920 (375,870,898)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	178,357	6.770	1,207,476.890	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	17,225	18.050	310,911.250	
	ARCELIK	24,414	14.450	352,782.300	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	48,763	4.230	206,267.490	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	94,341	3.030	285,853.230	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	29.840	166,626.560	
	KOC HOLDING AS	54,199	10.990	595,647.010	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	32,248	4.860	156,725.280	

	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	52,710	2.900	152,859.000	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	13,047	19.120	249,458.640	
	TURK HAVA YOLLARI	44,435	7.290	323,931.150	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	69,478	9.890	687,137.420	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	188,907	7.100	1,341,239.700	
	TURKIYE IS BANKASI	128,792	4.580	589,867.360	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,797	73.300	791,420.100	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	14,893	17.900	266,584.700	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	78,404	3.300	258,733.200	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	89,021	7.950	707,716.950	
	COCA-COLA ICECEK AS	5,353	35.540	190,245.620	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	17,248	49.200	848,601.600	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	57,549	3.740	215,233.260	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	15,347	17.860	274,097.420	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	58,286	10.110	589,271.460	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	31,721	5.200	164,949.200	
	トルコ・リラ 小計	1,331,119		10,933,636.790 (424,225,108)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	12,643	5,840.000	73,835,120.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,094	13,600.000	42,078,400.000	
	OTP BANK NYRT	19,398	5,875.000	113,963,250.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	35,135		229,876,770.000 (92,571,376)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	638,200	30.000	19,146,000.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	163,750	54.500	8,924,375.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	59,536	81.250	4,837,300.000	
	AYALA CORP	17,983	665.000	11,958,695.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	190,100	14.600	2,775,460.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	11.720	4,123,682.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,960	1,686.000	4,990,560.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	58.000	2,359,440.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,940	65.500	13,096,070.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	37,710	194.000	7,315,740.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	22,601	69.000	1,559,469.000	

	BDO UNIBANK INC	141,338	95.000	13,427,110.000	
	MEGAWORLD CORP	1,126,000	3.520	3,963,520.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	7,735	1,920.000	14,851,200.000	
	ROBINSONS LAND CORP	175,600	23.500	4,126,600.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	671,975	19.200	12,901,920.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	72,020	173.600	12,502,672.000	
	SM INVESTMENTS CORP	14,032	769.500	10,797,624.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	748,500	5.540	4,146,690.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,180,800	5.060	5,974,848.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	39.400	4,842,260.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,715	1,292.000	8,675,780.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,992,925		177,297,015.000 (452,107,388)	
ブラジル・リアル	BRF SA	55,992	51.780	2,899,265.760	
	VALE SA	112,427	10.240	1,151,252.480	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	20.550	164,769.900	
	VALE SA-PREF A	161,096	7.920	1,275,880.320	
	RAIA DROGASIL SA	15,900	37.270	592,593.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	6.000	418,200.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	9.220	214,365.000	
	BANCO DO BRASIL SA	69,500	13.550	941,725.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	307,417	6.590	2,025,878.030	
	LOJAS AMERICANAS SA	41,395	18.460	764,151.700	
	LOJAS AMERICANAS SA	12,225	11.350	138,753.750	
	GERDAU SA	71,130	3.780	268,871.400	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	13,006	36.770	478,230.620	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	244,110	7.580	1,850,353.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	344,612	6.090	2,098,687.080	
	KROTON EDUCACIONAL SA	106,568	8.700	927,141.600	
	CCR SA	69,720	11.370	792,716.400	
	WEG SA	50,340	14.170	713,317.800	
	BANCO BRADESCO SA PEF	216,278	17.530	3,791,353.340	
	BANCO BRADESCO SA	63,292	18.930	1,198,117.560	
	NATURA COSMETICOS SA	14,400	22.680	326,592.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	43,206	3.370	145,604.220	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	16.580	520,612.000	
	CPFL ENERGIA SA	17,047	14.260	243,090.220	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	258,008	24.480	6,316,035.840	
	PORTO SEGURO SA	9,400	25.950	243,930.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	21,590	45.150	974,788.500	
	B2W CIA DIGITAL	10,300	14.060	144,818.000	

BRASKEM SA	14,130	27.760	392,248.800	
TRACTEBEL ENERGIA SA	12,870	31.400	404,118.000	
LOCALIZA RENT A CAR	9,205	24.040	221,288.200	
TELEFONICA BRASIL S.A.	31,428	33.210	1,043,723.880	
LOJAS RENNER SA	53,000	16.400	869,200.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	11.640	210,684.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,652	55.450	1,755,103.400	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,000	23.440	257,840.000	
TOTVS SA	9,900	28.770	284,823.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	15,100	34.240	517,024.000	
EMBRAER SA	53,860	28.260	1,522,083.600	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,000	12.200	207,400.000	
M DIAS BRANCO SA	3,300	60.600	199,980.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	6,800	16.250	110,500.000	
ODONTOPREV SA	22,300	9.300	207,390.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	38,000	10.850	412,300.000	
JBS SA	61,100	11.420	697,762.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	57,549	4.760	273,933.240	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,898	17.250	481,240.500	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	8,800	38.440	338,272.000	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	13.000	314,600.000	
DURATEX SA	17,637	5.520	97,356.240	
SUL AMERICA SA	15,448	17.350	268,022.800	
HYPERMARCAS SA	29,900	20.980	627,302.000	
BM&FBOVESPA SA	152,200	10.500	1,598,100.000	
QUALICORP SA	17,800	14.150	251,870.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	32,900	13.740	452,046.000	
CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	18,959	36.780	697,312.020	
CIELO SA	73,636	33.350	2,455,760.600	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	61,100	22.850	1,396,135.000	
BANCO BRADESCO SA-RTS	2,073	0.500	1,036.500	
BANCO BRADESCO SA PREF-RTS	6,390	0.850	5,431.500	
AMBEV SA	399,295	16.800	6,708,156.000	
KLABIN SA	49,200	19.750	971,700.000	
ブラジル・リアル 小計	3,865,057		57,872,838.600 (1,681,784,690)	

ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	59,382	5.260	312,349.320	
	MBANK	1,260	296.500	373,590.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,084	67.000	139,628.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,782	53.000	624,446.000	
	BANK PEKAO SA	10,798	129.650	1,399,960.700	
	ORANGE POLSKA SA	55,813	6.060	338,226.780	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	28,253	64.640	1,826,273.920	
	LPP SA	106	5,320.350	563,957.100	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,841	259.000	735,819.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	72,301	23.900	1,727,993.900	
	CCC SA	1,565	121.550	190,225.750	
	SYNTHOS SA	65,317	4.050	264,533.850	
	EUROCASH SA	7,580	49.850	377,863.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	26.150	208,598.550	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	145,475	4.580	666,275.500	
	CYFROWY POLSAT SA	10,341	20.300	209,922.300	
	GRUPA AZOTY SA	4,220	96.800	408,496.000	
	ENEA SA	18,176	9.940	180,669.440	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	67,514	11.880	802,066.320	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	2.620	216,212.880	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	46,240	31.710	1,466,270.400		
ALIOR BANK SA	4,463	57.230	255,417.490		
ENERGA SA	16,930	11.160	188,938.800		
ポーランド・ズロチ 小計	722,942		13,477,735.000 (395,706,300)		
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	170,200	4.360	742,072.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.300	232,780.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	431,900	4.150	1,792,385.000	
	DIGI.COM BHD	300,300	5.160	1,549,548.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	5.590	386,380.800	
	RHB CAPITAL BHD	46,680	5.430	253,472.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	33,500	6.650	222,775.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	69,235	3.020	209,089.700	
	GAMUDA BHD	159,300	4.550	724,815.000	
	GENTING BHD	195,000	7.250	1,413,750.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.520	562,415.200	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,056	13.720	275,168.320	

HONG LEONG BANK BHD	50,808	12.980	659,487.840		
IJM CORP BHD	256,360	3.370	863,933.200		
IOI CORP BHD	251,913	4.330	1,090,783.290		
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,800	22.800	816,240.000		
MALAYAN BANKING BHD	397,975	8.320	3,311,152.000		
LAFARGE MALAYSIA BHD	27,200	8.530	232,016.000		
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	85,100	3.380	287,638.000		
MISC BHD	87,080	9.060	788,944.800		
PPB GROUP BHD	38,000	15.720	597,360.000		
PETRONAS DAGANGAN BHD	23,600	23.900	564,040.000		
PETRONAS GAS BHD	56,900	21.280	1,210,832.000		
GENTING MALAYSIA BHD	254,500	4.140	1,053,630.000		
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	54.900	625,860.000		
TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.540	621,300.000		
TENAGA NASIONAL BHD	286,350	13.000	3,722,550.000		
UMW HOLDINGS BHD	52,000	7.470	388,440.000		
DIALOG GROUP BHD	375,644	1.580	593,517.520		
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	208,430	18.160	3,785,088.800		
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.450	211,501.350		
AIRASIA BHD	83,400	1.370	114,258.000		
SIME DARBY BERHAD	268,000	7.420	1,988,560.000		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	63,700	5.980	380,926.000		
AXIATA GROUP BERHAD	222,000	6.160	1,367,520.000		
BUMI ARMADA BHD	195,350	0.940	183,629.000		
MAXIS BHD	156,000	6.630	1,034,280.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	236,400	7.200	1,702,080.000		
SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	226,300	1.800	407,340.000		
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	142,900	2.480	354,392.000		
IHH HEALTHCARE BHD	216,100	6.460	1,396,006.000		
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	1.610	191,912.000		
WESTPORTS HOLDINGS BHD	99,600	3.900	388,440.000		
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	139,639	2.300	321,169.700		
マレーシア・リンギット 小計	6,796,413		39,619,478.920 (1,062,990,620)		
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	229,600	31.360	7,200,256.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	40,400	118.530	4,788,612.000	
	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV	39,200	31.840	1,248,128.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	15,500	207.460	3,215,630.000	

	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	149,500	27.640	4,132,180.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	207,500	92.940	19,285,050.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	136,300	47.320	6,449,716.000	
	GRUMA SAB DE CV	17,100	249.790	4,271,409.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,400	197.140	4,415,936.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	46,800	71.950	3,367,260.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	211,300	89.300	18,869,090.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	87,288	37.240	3,250,605.120	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,115	172.280	2,431,732.200	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	124,500	37.850	4,712,325.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	20,620	227.830	4,697,854.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	328,552	34.160	11,223,336.320	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,666,178	11.160	29,754,546.480	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	190,600	29.220	5,569,332.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	33,800	102.390	3,460,782.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	447,900	42.730	19,138,767.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,200	144.940	3,797,428.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	17.260	1,211,652.000	
	GENTERA SAB DE CV	90,100	29.410	2,649,841.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	29,000	45.570	1,321,530.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	56,500	39.690	2,242,485.000	
	CORP COMERCI SAB DE CV	39,200	16.010	627,592.000	
	メキシコ・ペソ 小計	5,340,353		173,333,075.720 (1,142,264,969)	
ユーロ	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.287	1,147.420	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	17.000	59,806.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	8.800	88,035.200	
	FF GROUP	3,130	14.330	44,852.900	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	0.955	1,556.650	
	OPAP SA	8,501	6.750	57,381.750	
	JUMBO SA	5,623	9.000	50,607.000	
	ユーロ 小計	36,404		303,386.920 (38,791,051)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,090	19,400.000	137,546,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	959	144,000.000	138,096,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,067	99,000.000	303,633,000.000	

SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,051	302,500.000	922,927,500.000	
DONGBU INSURANCE CO LTD	3,522	67,400.000	237,382,800.000	
COWAY CO LTD	4,722	89,200.000	421,202,400.000	
KT&G CORP	9,405	108,000.000	1,015,740,000.000	
S-1 CORPORATION	1,763	102,000.000	179,826,000.000	
KOREA GAS CORP	2,659	34,350.000	91,336,650.000	
CJ CORP	1,169	246,500.000	288,158,500.000	
KAKAO CORP	2,323	114,700.000	266,448,100.000	
SK TELECOM CO LTD	792	203,000.000	160,776,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,400	65,300.000	156,720,000.000	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	15,692	8,110.000	127,262,120.000	
NCSOFT CORPORATION	1,559	220,000.000	342,980,000.000	
LG UPLUS CORP	18,179	10,050.000	182,698,950.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	18,050.000	73,102,500.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	6,539	5,250.000	34,329,750.000	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	15,000.000	65,265,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	771	991,000.000	764,061,000.000	
LG CHEM LTD	3,918	322,500.000	1,263,555,000.000	
LG CHEM LTD	726	238,000.000	172,788,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	36,330	38,200.000	1,387,806,000.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	4,681	36,850.000	172,494,850.000	
S-OIL CORP	3,762	78,000.000	293,436,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	9,297	26,300.000	244,511,100.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,874	38,500.000	187,649,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,242	258,000.000	320,436,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,692	70,100.000	188,709,200.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,468	84,100.000	291,658,800.000	
HYUNDAI MOBIS	5,798	241,000.000	1,397,318,000.000	
SK HYNIX INC	49,514	28,650.000	1,418,576,100.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,637	28,800.000	162,345,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,048	98,000.000	200,704,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,104	140,000.000	1,834,560,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,357	46,800.000	297,507,600.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,033	11,750.000	270,637,750.000	
KCC CORP	426	401,500.000	171,039,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,452	49,600.000	1,113,619,200.000	
KOREA ZINC CO LTD	706	456,000.000	321,936,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,851	50,700.000	1,107,845,700.000	

HANWHA CORP	3,785	35,850.000	135,692,250.000	
KOREAN AIR CO LTD	3,154	25,950.000	81,846,300.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	71,700.000	107,550,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	533	202,500.000	107,932,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	720	51,800.000	37,296,000.000	
KT CORP	3,085	27,600.000	85,146,000.000	
LG ELECTRONICS INC	9,215	55,500.000	511,432,500.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	67	2,280,000.000	152,760,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	41	2,403,000.000	98,523,000.000	
HANSEM CO LTD	777	231,000.000	179,487,000.000	
LG CORP	8,298	67,000.000	555,966,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	8,970.000	103,962,300.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	20,800.000	82,056,000.000	
NAVER CORP	2,386	628,000.000	1,498,408,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	15,400.000	50,373,400.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,195	127,000.000	151,765,000.000	
DONGSUH CO INC	2,901	30,250.000	87,755,250.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,277	45,600.000	149,431,200.000	
OTTOGI CORP	83	1,283,000.000	106,489,000.000	
DOOSAN CORP	662	80,500.000	53,291,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,274	150,500.000	342,237,000.000	
KANGWON LAND INC	9,522	38,200.000	363,740,400.000	
POSCO	6,010	161,500.000	970,615,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,457	111,500.000	496,955,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,006	60,100.000	300,860,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	9,336	1,152,000.000	10,755,072,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	12,525	10,050.000	125,876,250.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,739	1,000,000.000	1,739,000,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	579	225,000.000	130,275,000.000	
HYOSUNG CORP	2,040	117,000.000	238,680,000.000	
ORION CORP	287	1,104,000.000	316,848,000.000	
YUHAN CORP	699	296,500.000	207,253,500.000	
HANON SYSTEMS	3,292	50,700.000	166,904,400.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	32,400.000	185,004,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,288	48,300.000	207,110,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,795	22,000.000	413,490,000.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	5,460.000	56,128,800.000	
CELLTRION INC	5,598	99,200.000	555,321,600.000	

HANA FINANCIAL GROUP	25,555	22,050.000	563,487,750.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,731	194,500.000	336,679,500.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	4,483	20,200.000	90,556,600.000	
LOTTE SHOPPING CO	974	231,000.000	224,994,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,881	104,500.000	719,064,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,773	405,500.000	1,124,451,500.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	692	224,000.000	155,008,000.000	
SAMSUNG CARD CO	3,209	28,700.000	92,098,300.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,577	126,500.000	705,490,500.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	710	391,500.000	277,965,000.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,752	91,200.000	159,782,400.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,196	88,200.000	105,487,200.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,891	239,000.000	690,949,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	33,025	31,600.000	1,043,590,000.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,454	112,000.000	162,848,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,522	64,900.000	228,577,800.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	20,349	8,100.000	164,826,900.000	
HANMI PHARM CO LTD	408	743,000.000	303,144,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	17,057	6,910.000	117,863,870.000	
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,369	80,000.000	109,520,000.000	
E-MART CO LTD	1,684	190,000.000	319,960,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	9,530.000	129,026,670.000	
GS RETAIL CO LTD	1,921	59,000.000	113,339,000.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,577	45,200.000	297,280,400.000	
BGF RETAIL CO LTD	717	197,500.000	141,607,500.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,648	242,000.000	640,816,000.000	
WOORI BANK	26,904	8,400.000	225,993,600.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,484	140,000.000	907,760,000.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC- RTS	3,249	1,385.000	4,499,865.000	
韓国・ウォン 小計	678,232		50,793,828,175.000 (4,972,715,779)	
香港・ドル				
JIANGXI COPPER CO LTD	103,000	8.290	853,870.000	
JIANGSU EXPRESS	110,000	8.970	986,700.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	4.750	769,500.000	
CHINA MOBILE LIMITED	518,500	80.600	41,791,100.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	98,000	17.380	1,703,240.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	256,000	2.230	570,880.000	
BEIJING ENTERPRISES	44,500	42.150	1,875,675.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	360,000	6.540	2,354,400.000	

ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	212,000	4.940	1,047,280.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	142,000	3.350	475,700.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	62,500	65.050	4,065,625.000	
HUADIAN POWER INTL CORP- H	128,000	4.840	619,520.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	78,320	15.150	1,186,548.000	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	244,000	7.530	1,837,320.000	
CNOOC LTD	1,510,000	7.310	11,038,100.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	240,000	8.250	1,980,000.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	344,000	7.630	2,624,720.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	333,120	22.600	7,528,512.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	234,888	18.680	4,387,707.840	
CITIC LTD	369,000	12.140	4,479,660.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	7.440	967,200.000	
LENOVO GROUP LTD	568,000	6.870	3,902,160.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,792,000	4.450	7,974,400.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	506,742	8.580	4,347,846.360	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	130,590	19.800	2,585,682.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,165,200	4.240	9,180,448.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	68,000	11.140	757,520.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,000	34.400	2,201,600.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	270,000	5.930	1,601,100.000	
COSCO PACIFIC LTD	138,000	8.130	1,121,940.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	636,180	1.170	744,330.600	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	96,000	21.500	2,064,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	362,000	2.270	821,740.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	15.280	1,191,840.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	146,000	10.040	1,465,840.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	440,000	3.340	1,469,600.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	78,000	19.160	1,494,480.000	
BYD CO LTD	51,500	35.950	1,851,425.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,180,000	3.360	3,964,800.000	

CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	5.530	884,800.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	830,000	1.700	1,411,000.000	
SINOTRANS LTD	147,000	3.770	554,190.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	204,000	8.520	1,738,080.000	
GOLDIN PROPERTIES HOLDINGS LTD	104,000	7.760	807,040.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	333,192	13.620	4,538,075.040	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	176,000	5.300	932,800.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	163,200	13.880	2,265,216.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	258,000	7.340	1,893,720.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	630,000	21.400	13,482,000.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	567,000	1.940	1,099,980.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	4.940	790,400.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,228,000	0.700	1,559,600.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	84,720	7.600	643,872.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	3.130	929,610.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	17.920	824,320.000	
TINGYI HOLDING CORP	154,000	9.680	1,490,720.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	31.050	931,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	224,000	9.700	2,172,800.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	98,000	15.280	1,497,440.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	128,000	7.910	1,012,480.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	372,000	5.520	2,053,440.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.750	495,250.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	236,000	11.300	2,666,800.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	436,800	138.000	60,278,400.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	441,000	36.350	16,030,350.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	366,000	4.450	1,628,700.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	992,240	1.150	1,141,076.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	3.980	1,082,560.000	

AIR CHINA / HONG KONG	162,000	4.950	801,900.000	
ZTE CORP	53,688	14.720	790,287.360	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	224,000	3.540	792,960.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	291,000	10.960	3,189,360.000	
COSCO HOLDINGS	174,500	3.350	584,575.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	736,205	4.910	3,614,766.550	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	152,000	11.660	1,772,320.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	63,000	46.500	2,929,500.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,101,530	4.920	34,939,527.600	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	48,000	39.850	1,912,800.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	226,000	9.250	2,090,500.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	141,000	4.050	571,050.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	192,000	3.330	639,360.000	
BANK OF CHINA LTD	6,711,200	3.120	20,938,944.000	
SHUI ON LAND LTD	338,100	1.910	645,771.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	117,500	11.520	1,353,600.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	90,800	8.350	758,180.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	389,470	15.600	6,075,732.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,233,235	4.220	26,304,251.700	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	2.710	568,016.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	380,000	6.710	2,549,800.000	
CHINA COAL ENERGY CO	256,000	2.770	709,120.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	10.320	557,280.000	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	41,500	35.350	1,467,025.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	13.120	1,377,600.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	489,142	3.010	1,472,317.420	
CHINA CITIC BANK-H	698,800	4.590	3,207,492.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	399,000	5.260	2,098,740.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	87,000	20.050	1,744,350.000	
FOSUN INTERNATIONAL	167,028	10.540	1,760,475.120	

CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	274,000	2.270	621,980.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	4.030	1,156,610.000	
SOHO CHINA LTD	196,000	3.350	656,600.000	
KINGSOFT CORP LTD	71,000	15.360	1,090,560.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	961,000	1.070	1,028,270.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	323,000	5.080	1,640,840.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	172,000	8.350	1,436,200.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	474,000	5.250	2,488,500.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	224,400	27.100	6,081,240.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	373,000	5.750	2,144,750.000	
CRRC CORP LTD - H	371,450	7.860	2,919,597.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	82,000	9.570	784,740.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	208,500	5.110	1,065,435.000	
SINOPHARM GROUP CO	102,400	28.400	2,908,160.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	195,805	6.250	1,223,781.250	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	182,000	3.990	726,180.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	265,000	5.020	1,330,300.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	58,800	14.880	874,944.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	1.980	677,160.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	320,000	4.377	1,400,640.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	178,000	4.670	831,260.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	126,500	10.260	1,297,890.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	67,100	28.550	1,915,705.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	478,880	6.900	3,304,272.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	306,000	3.420	1,046,520.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,946,000	2.880	5,604,480.000	
FAR EAST HORIZON LTD	159,000	6.450	1,025,550.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	186,500	15.100	2,816,150.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	264,000	11.080	2,925,120.000	

	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	49,400	12.800	632,320.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	518,000	3.370	1,745,660.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	19.440	651,240.000	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	114,000	6.010	685,140.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	276,000	6.110	1,686,360.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	545,000	2.980	1,624,100.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD-RTS	192,200	0.016	3,075.200	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	698,000	2.530	1,765,940.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	105,500	14.320	1,510,760.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	111,261	17.620	1,960,418.820	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	98,000	7.290	714,420.000	
	CAR INC	60,000	10.720	643,200.000	
	CGN POWER CO LTD	723,000	2.530	1,829,190.000	
	DALIAN WANDA COMMERCIAL PROPERTIES CO LTD	50,900	39.000	1,985,100.000	
	GF SECURITIES CO LTD	118,200	16.480	1,947,936.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	90,600	14.360	1,301,016.000	
	IMPERIAL PACIFIC INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,300,000	0.158	679,400.000	
	香港・ドル 小計	69,468,386		475,181,799.860 (7,213,259,722)	
台湾・ドル	ACER INC	274,532	10.700	2,937,492.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	59,554	275.500	16,407,127.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,616	75.000	2,671,200.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	536,729	34.550	18,543,986.950	
	ASIA CEMENT CORP	204,928	25.700	5,266,649.600	
	TAIWAN BUSINESS BANK	393,839	7.800	3,071,944.200	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	71,000	41.250	2,928,750.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	41.000	3,198,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,082	67.900	3,128,967.800	
	QUANTA COMPUTER INC	230,858	50.200	11,589,071.600	

HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	70,070	35.600	2,494,492.000	
EVA AIRWAYS CORP	139,624	17.350	2,422,476.400	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	222.000	12,378,720.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	395,393	15.150	5,990,203.950	
CHINA AIRLINES	232,156	11.050	2,565,323.800	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	125,169	52.000	6,508,788.000	
CHINA STEEL CORP	955,058	17.350	16,570,256.300	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	264,695	23.600	6,246,802.000	
ADVANTECH CO LTD	26,264	205.000	5,384,120.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	356,304	17.650	6,288,765.600	
DELTA ELECTRONICS INC	163,663	145.000	23,731,135.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	318,327	100.000	31,832,700.000	
AU OPTRONICS CORP	759,194	9.020	6,847,929.880	
TAIWAN MOBILE CO LTD	136,800	98.300	13,447,440.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	11.950	1,916,684.400	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	280,824	24.850	6,978,476.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	24,630	172.500	4,248,675.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	16,640	417.000	6,938,880.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	43,285	115.500	4,999,417.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	346,633	71.700	24,853,586.100	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	53,000	28.150	1,491,950.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	270,594	68.700	18,589,807.800	
TRANSCEND INFORMATION INC	11,897	84.000	999,348.000	
GIANT MANUFACTURING	24,151	203.000	4,902,653.000	
MEDIATEK INC	126,507	209.000	26,439,963.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	552,936	39.000	21,564,504.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	538,189	14.350	7,723,012.150	
HOTAI MOTOR CO LTD	21,000	340.000	7,140,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	138,000	66.100	9,121,800.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	27,088	97.200	2,632,953.600	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	792,141	10.800	8,555,122.800	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	688,920	39.000	26,867,880.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,175,403	7.400	8,697,982.200	

E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	593,128	17.500	10,379,740.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,216,120	75.400	91,695,448.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	903,495	20.100	18,160,249.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	1,935.000	15,905,700.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	684,751	10.250	7,018,697.750	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	739,724	6.200	4,586,288.800	
INVENTEC CO LTD	211,005	21.200	4,473,306.000	
HTC CORPORATION	52,832	73.000	3,856,736.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	187,893	29.750	5,589,816.750	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	37,496	61.000	2,287,256.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	833,650	8.540	7,119,371.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,297,452	15.600	20,240,251.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	734,323	14.700	10,794,548.100	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	18,950	149.000	2,823,550.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	62,560	65.700	4,110,192.000	
NAN YA PLASTICS CORP	399,828	56.900	22,750,213.200	
WISTRON CORP	186,601	17.200	3,209,537.200	
POU CHEN CORP	184,990	42.000	7,769,580.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	397,297	51.900	20,619,714.300	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,392	193.000	8,760,656.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	101,480	76.000	7,712,480.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	225.000	2,848,050.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	38.600	2,916,114.200	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	45,715	55.600	2,541,754.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	79,791	61.000	4,867,251.000	
SILICONWARE PRECISION INDS	182,743	51.400	9,392,990.200	
STANDARD FOODS CORP	32,120	77.100	2,476,452.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	124,666	30.250	3,771,146.500	
TAIWAN CEMENT CORP	281,874	26.000	7,328,724.000	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	175,000	24.700	4,322,500.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,080,083	133.000	276,651,039.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,001,525	11.050	11,066,851.250	

	YULON MOTOR CO	82,149	28.700	2,357,676.300	
	INOTERA MEMORIES INC	202,000	28.100	5,676,200.000	
	INNOLUX CORPORATION	693,345	9.350	6,482,775.750	
	WPG HOLDINGS CO LTD	137,526	30.300	4,167,037.800	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,879	116.000	1,957,964.000	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	891.000	2,673,000.000	
	PEGATRON CORP	155,554	64.600	10,048,788.400	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	78,076	51.300	4,005,298.800	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	141,000	10.300	1,452,300.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	68.500	2,355,372.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	603,424	13.100	7,904,854.400	
	OBI PHARMA INC	8,000	621.000	4,968,000.000	
	CASETEK HOLDINGS LTD	9,000	136.000	1,224,000.000	
台湾・ドル	小計	26,375,092		1,070,434,510.330 (3,778,633,822)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	BARLOWORLD LTD	18,561	52.710	978,350.310	
	BIDVEST GROUP LTD	27,439	319.580	8,768,955.620	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	35,258	85.880	3,027,957.040	
	DISCOVERY LTD	29,533	116.280	3,434,097.240	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	345,272	9.290	3,207,576.880	
	MASSMART HOLDINGS LTD	9,965	89.410	890,970.650	
	GOLD FIELDS LTD	73,055	54.600	3,988,803.000	
	REMGRO LTD	41,707	233.230	9,727,323.610	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	112.880	1,952,936.880	
	MMI HOLDINGS LTD	96,226	20.500	1,972,633.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,653	22.050	4,225,948.650	
	EXXARO RESOURCES LTD	12,410	42.120	522,709.200	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	490.000	1,560,160.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	10,532	106.390	1,120,499.480	
	MTN GROUP LTD	140,445	124.200	17,443,269.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	35,784	137.150	4,907,775.600	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	58.000	1,173,166.000	
	FIRSTRAND LTD	287,736	38.000	10,933,968.000	
	PSG GROUP LTD	8,154	185.000	1,508,490.000	
	NASPERS LTD	33,690	1,920.820	64,712,425.800	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	21,138	48.800	1,031,534.400	
	NEDBANK GROUP LTD	15,567	169.500	2,638,606.500	
	NETCARE LTD	84,426	32.200	2,718,517.200	
	PICK'N PAY STORES LTD	15,207	60.000	912,420.000	
	RMB HOLDINGS LTD	56,776	50.690	2,877,975.440	

ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	187.870	986,505.370	
SAPPI LTD	45,236	63.790	2,885,604.440	
SASOL LTD	46,901	394.300	18,493,064.300	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	37,014	127.710	4,727,057.940	
MR PRICE GROUP LTD	21,087	187.910	3,962,458.170	
BRAIT SE	27,704	157.380	4,360,055.520	
STANDARD BANK GROUP LTD	102,468	100.000	10,246,800.000	
SPAR GROUP LTD/THE	12,614	166.310	2,097,834.340	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	84,854	90.300	7,662,316.200	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	14,635	100.500	1,470,817.500	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	29,343	285.000	8,362,755.000	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	27,716	126.500	3,506,074.000	
TIGER BRANDS LTD	14,191	278.000	3,945,098.000	
SANLAM LTD	141,410	52.240	7,387,258.400	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	40,425	116.490	4,709,108.250	
INVESTEC LTD	23,104	101.560	2,346,442.240	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	51,499	28.360	1,460,511.640	
PIONEER FOODS LTD	10,546	140.000	1,476,440.000	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	18,715	185.440	3,470,509.600	
MONDI LTD	9,892	295.110	2,919,228.120	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	77,953	33.150	2,584,141.950	
RMI HOLDINGS	59,287	35.730	2,118,324.510	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	32,270	22.360	721,557.200	
VODACOM GROUP PTY LTD	30,669	146.590	4,495,768.710	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	15.600	1,231,573.200	
FORTRESS INCOME FUND LTD	57,017	32.090	1,829,675.530	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	203,249	75.000	15,243,675.000	
南アフリカ・ランド 小計	3,047,779		280,972,610.790 (1,969,618,001)	
合計	180,868,329		30,903,849,398 (30,903,849,398)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28年1月12日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,098,453.000	8,600,886.990	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	155,400.000	23,773,092.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,253,853.000	32,373,978.990 (213,344,522)	
投資信託受益証券	合計		1,253,853	213,344,522 (213,344,522)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	421,481.060	
	トルコ・リラ	小計	162,734.000	421,481.060 (16,353,465)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,600.000	7,691,082.000	
	メキシコ・ペソ	小計	208,600.000	7,691,082.000 (50,684,231)	
	南アフリカ・ラ ンド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,966.000	1,974,997.200	
		RESILIENT REIT LTD	23,961.000	2,659,191.780	
	南アフリカ・ランド	小計	44,927.000	4,634,188.980 (32,485,665)	
投資証券	合計		416,261	99,523,361 (99,523,361)	
合計				312,867,883 (312,867,883)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比 率
アメリカ・ドル	株式 38銘柄	6.84%	-%	-%	6.98%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.80%	-%	-%	0.82%
インド・ルピー	株式 73銘柄	8.94%	-%	-%	9.13%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.66%	-%	-%	2.72%
カタール・リアル	株式 13銘柄	1.02%	-%	-%	1.04%
コロンビア・ペソ	株式 10銘柄	0.39%	-%	-%	0.40%
タイ・バーツ	株式 32銘柄	2.05%	-%	-%	2.09%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.21%	-%	-%	0.21%
チリ・ペソ	株式 19銘柄	1.18%	-%	-%	1.20%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.33% -%	-% -%	-% 0.05%	1.41%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.29%	-%	-%	0.30%
フィリピン・ペソ	株式 22銘柄	1.42%	-%	-%	1.45%
ブラジル・レアル	株式 62銘柄	5.28%	-%	-%	5.39%
ポーランド・ズロチ	株式 23銘柄	1.24%	-%	-%	1.27%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	3.33%	-%	-%	3.41%
メキシコ・ペソ	株式 26銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	3.58% -% -%	-% 0.67% -%	-% -% 0.16%	4.50%
ユーロ	株式 7銘柄	0.12%	-%	-%	0.12%
韓国・ウォン	株式 108銘柄	15.60%	-%	-%	15.93%
香港・ドル	株式 145銘柄	22.63%	-%	-%	23.11%
台湾・ドル	株式 88銘柄	11.85%	-%	-%	12.10%
南アフリカ・ランド	株式 53銘柄 投資証券 2銘柄	6.18% -%	-% -%	-% 0.10%	6.41%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		623,791,834	1,681,575,183
コール・ローン		982,056,029	25,347,818
国債証券		48,532,599,607	45,261,801,641
派生商品評価勘定		-	290,000
未収入金		-	7,879,336,545
未収利息		767,284,639	689,019,990
前払費用		161,039,789	340,566,713
流動資産合計		51,066,771,898	55,877,937,890
資産合計		51,066,771,898	55,877,937,890
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		27,880	2,951,000
未払金		-	252,327,600
未払解約金		955,732,000	12,725,000
流動負債合計		955,759,880	268,003,600
負債合計		955,759,880	268,003,600
純資産の部			
元本等			
元本	1	27,089,131,404	32,117,451,125
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		23,021,880,614	23,492,483,165
元本等合計		50,111,012,018	55,609,934,290
純資産合計		50,111,012,018	55,609,934,290
負債純資産合計		51,066,771,898	55,877,937,890

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12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	23,920,411,405円	27,089,131,404円
同期中追加設定元本額	16,203,857,560円	29,628,419,874円
同期中一部解約元本額	13,035,137,561円	24,600,100,153円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	- 円	13,743,994円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	75,276,928円	62,230,620円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	10,713,973円	15,001,959円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	30,173,185円	38,845,125円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	83,712,861円	95,788,554円
投資のソムリエ	1,107,588,380円	1,426,851,882円
クルーズコントロール	82,664,940円	249,216,579円
投資のソムリエ< D C 年金 >	15,453,480円	25,542,585円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金 >	29,537,927円	42,875,511円
クルーズコントロール< D C 年金 >	22,814円	39,295円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	- 円	2,268,568円

D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	- 円	3,061,585円
投資のソムリエ< D C 年金 > リ スク抑制型	- 円	351,697円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	4,780,408,947円	5,714,487,906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)	430,579,099円	436,148,271円
エマージング債券パッシブファ ンドV A (適格機関投資家専 用)	3,864,258,176円	3,685,046,795円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	8,553,729,531円	8,357,358,025円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	5,402,368,452円	5,300,140,113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)	1,061,772,771円	2,965,384,800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)	1,560,869,940円	3,683,067,261円
計	27,089,131,404円	32,117,451,125円
2 . 受益権の総数	27,089,131,404口	32,117,451,125口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日	自 平成27年7月14日 至 平成28年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,567,189,560	1,784,591,995
合計	1,567,189,560	1,784,591,995

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年4月21日から平成27年7月13日まで及び平成27年4月21日から平成28年1月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年7月13日 現在				平成28年1月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000
買 建	416,493,880	-	416,466,000	27,880	-	-	-	-
アメリカ・ドル	416,493,880	-	416,466,000	27,880	-	-	-	-
合計	416,493,880	-	416,466,000	27,880	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000

（注）時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年7月13日現在	平成28年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.8499円	1.7315円
(1万口当たり純資産額)	(18,499円)	(17,315円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年1月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 10.125 05/15/27	2,100,000.000	2,521,050.000	
		BRAZIL 2.625 01/05/23	3,000,000.000	2,347,500.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	6,700,000.000	5,569,375.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	4,800,000.000	4,554,000.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	5,400,000.000	3,685,500.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	3,900,000.000	2,895,750.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	3,500,000.000	3,634,750.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	2,900,000.000	2,581,000.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	2,400,000.000	2,390,160.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	1,200,000.000	1,311,600.000	
		BRAZIL 8.875 04/15/24	2,000,000.000	2,252,800.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	1,200,000.000	1,362,000.000	
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,156,950.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,700,000.000	1,491,750.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	2,100,000.000	1,982,400.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	3,200,000.000	3,201,600.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	3,800,000.000	3,078,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	4,000,000.000	3,550,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	4,000,000.000	3,760,000.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	3,900,000.000	4,358,250.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	2,800,000.000	2,996,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,500,000.000	2,996,750.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	1,800,000.000	1,843,668.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	2,400,000.000	2,528,760.000	
		CROATIA 6.25 04/27/17	2,100,000.000	2,180,325.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	2,300,000.000	2,442,600.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	2,000,000.000	2,150,600.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	2,200,000.000	2,364,450.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	200,000.000	208,482.000	
		HUNGARY 4.125 02/19/18	2,700,000.000	2,810,430.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	1,900,000.000	2,068,283.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	2,600,000.000	2,854,280.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	3,400,000.000	3,806,640.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	3,700,000.000	4,140,744.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	3,800,000.000	4,323,260.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	1,700,000.000	2,318,375.000	
INDONESIA 11.625 03/04/19	3,600,000.000	4,527,000.000			
INDONESIA 3.375 04/15/23	1,900,000.000	1,772,358.000			
INDONESIA 3.75 04/25/22	2,200,000.000	2,126,608.000			

INDONESIA 4.125 01/15/25	2,800,000.000	2,691,892.000	
INDONESIA 4.625 04/15/43	1,600,000.000	1,384,128.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	3,300,000.000	3,437,214.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	2,800,000.000	2,545,928.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	3,100,000.000	2,820,194.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,300,000.000	1,363,947.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	2,200,000.000	2,370,808.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,100,000.000	2,291,835.000	
INDONESIA 6.625 02/17/37	1,900,000.000	2,014,760.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	2,500,000.000	2,685,225.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	1,800,000.000	1,957,590.000	
INDONESIA 6.875 03/09/17	1,250,000.000	1,323,062.500	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,100,000.000	2,480,940.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	2,300,000.000	2,893,285.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	2,000,000.000	1,965,000.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	2,600,000.000	2,823,600.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	3,200,000.000	3,764,480.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,400,000.000	1,743,000.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	1,600,000.000	2,211,760.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,300,000.000	1,868,750.000	
PERU 5.625 11/18/50	3,800,000.000	3,860,800.000	
PERU 6.55 03/14/37	1,600,000.000	1,839,200.000	
PERU 7.125 03/30/19	1,200,000.000	1,363,200.000	
PERU 7.35 07/21/25	3,000,000.000	3,750,000.000	
PERU 8.75 11/21/33	3,500,000.000	4,886,000.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	2,800,000.000	4,434,248.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	2,400,000.000	2,466,960.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	2,000,000.000	2,170,640.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	1,600,000.000	1,741,168.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	1,800,000.000	2,113,992.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	1,000,000.000	1,191,980.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	1,600,000.000	2,063,808.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,600,000.000	4,768,956.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	935,080.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	2,700,000.000	3,853,818.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	700,000.000	852,159.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	2,600,000.000	4,159,376.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,900,000.000	2,345,797.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	2,000,000.000	2,097,500.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	1,600,000.000	1,731,360.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	1,600,000.000	1,894,560.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	3,900,000.000	4,610,112.000	

RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	4,800,000.000	4,910,880.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	17,076,500.000	20,390,877.880	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	2,800,000.000	3,251,780.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	2,700,000.000	4,234,140.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17	3,600,000.000	3,594,420.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	3,200,000.000	3,144,416.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	2,400,000.000	2,382,336.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	4,200,000.000	4,191,978.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	3,200,000.000	2,927,840.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	2,400,000.000	2,262,168.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	1,800,000.000	1,719,000.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	1,200,000.000	1,061,508.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	2,400,000.000	2,472,000.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,600,000.000	1,670,000.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	2,600,000.000	2,639,104.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	1,000,000.000	1,003,750.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,700,000.000	2,917,350.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	1,500,000.000	2,418,450.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	2,500,000.000	2,262,975.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	3,000,000.000	2,779,050.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	3,900,000.000	3,336,918.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,527,825.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	3,100,000.000	3,256,736.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	3,100,000.000	3,233,920.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	3,900,000.000	3,886,935.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,000,000.000	2,154,240.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	1,700,000.000	1,860,650.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	2,200,000.000	2,353,890.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	2,300,000.000	2,502,446.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	3,600,000.000	3,923,280.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	3,100,000.000	3,379,000.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	2,900,000.000	3,204,790.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,400,000.000	1,606,990.000	

	TURKEY 7.375 02/05/25	3,100,000.000	3,572,750.000	
	TURKEY 7.5 07/14/17	3,400,000.000	3,626,134.000	
	TURKEY 7.5 11/07/19	1,800,000.000	2,011,212.000	
	TURKEY 8.0 02/14/34	2,100,000.000	2,580,186.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	600,000.000	609,300.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	3,600,000.000	3,501,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	3,500,000.000	3,515,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	6,300,000.000	6,363,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	3,400,000.000	2,996,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	6,200,000.000	5,595,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	3,800,000.000	4,136,300.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	4,400,000.000	4,449,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	4,400,000.000	4,070,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	2,600,000.000	2,885,350.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	4,700,000.000	5,117,125.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	2,600,000.000	3,117,140.000	
	UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	800,000.000	1,041,520.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	1,800,000.000	2,664,000.000	
	アメリカ・ドル 小計	359,826,500.000 (42,387,561,700)	384,225,820.380 (45,261,801,641)	
国債証券 合計		42,387,561,700 (42,387,561,700)	45,261,801,641 (45,261,801,641)	
合計		42,387,561,700 (42,387,561,700)	45,261,801,641 (45,261,801,641)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 132銘柄	81.39%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成28年1月29日現在

資産総額	568,125,985円
負債総額	1,343,451円
純資産総額（ - ）	566,782,534円
発行済数量	530,658,897口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0681円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	293,286,074,878円
負債総額	453,308,304円
純資産総額（ - ）	292,832,766,574円
発行済数量	141,236,785,989口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0733円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	413,798,704,557円
負債総額	3,063,227,000円
純資産総額（ - ）	410,735,477,557円
発行済数量	325,586,982,830口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2615円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	24,196,931,054円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	24,196,931,054円
発行済数量	14,183,817,839口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7060円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	264,859,245,840円
負債総額	5,005,365,921円
純資産総額（ - ）	259,853,879,919円
発行済数量	99,645,489,214口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6078円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	25,638,901,377円
負債総額	46,493,669円
純資産総額（ - ）	25,592,407,708円
発行済数量	23,290,163,547口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0989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28年1月29日現在

資産総額	183,155,958,486円
負債総額	1,586,563,983円
純資産総額（ - ）	181,569,394,503円
発行済数量	136,172,774,592口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3334円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	36,015,479,741円
負債総額	1,676,883,202円
純資産総額（ - ）	34,338,596,539円
発行済数量	41,848,243,611口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8206円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年1月29日現在

資産総額	48,554,248,526円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	48,554,248,526円
発行済数量	27,036,077,534口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7959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カ年の資本金の変動

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。

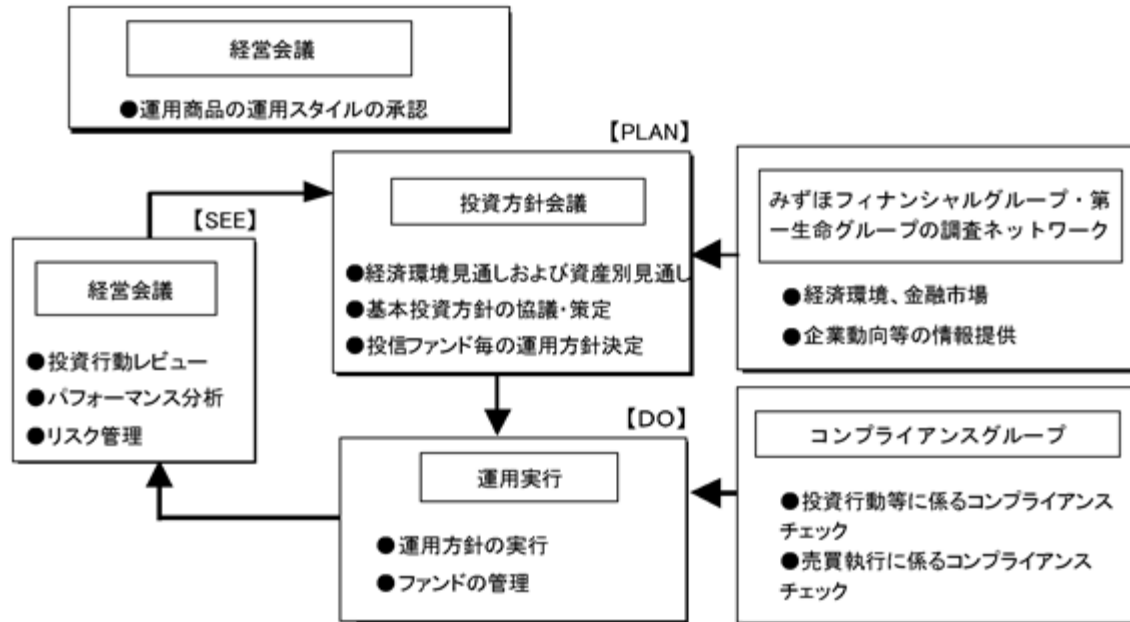
投資運用の意思決定機構

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28年1月29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28年1月29日現在、委託会社の運用する投資信託は414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	5	23,247,513,683
追加型株式投資信託	371	5,723,400,555,414
単位型公社債投資信託	38	284,901,599,073
追加型公社債投資信託	0	0
合計	414	6,031,549,668,170

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								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
会計方針の変 更による累積 的影響額									
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金の 積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		3,096,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

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

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額
該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり
ます。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46銭

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

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

	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
資産合計		38,994,807

（単位：千円）

	第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	956,031
未払金	2,105,195
未払収益分配金	44
未払償還金	49,873
未払手数料	1,770,062
その他未払金	285,213
未払費用	1,927,420
未払法人税等	1,486,583
未払消費税等	289,515
賞与引当金	724,368
その他	20,000
流動負債計	7,509,114
固定負債	
退職給付引当金	920,913
役員退職慰労引当金	137,750
固定負債計	1,058,663
負債合計	8,567,778
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	25,771,823
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	22,030,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	3,118,530
株主資本計	30,200,301
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	226,727
評価・換算差額等計	226,727
純資産合計	30,427,029
負債・純資産合計	38,994,807

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	15,465,477	
運用受託報酬	3,695,539	
投資助言報酬	510,549	
その他営業収益	383,893	
	営業収益計	20,055,459
営業費用		
支払手数料	6,672,717	
広告宣伝費	217,738	
公告費	129	
調査費	3,678,769	
調査費	2,272,268	
委託調査費	1,406,500	
委託計算費	207,057	
営業雑経費	280,193	
通信費	17,208	
印刷費	226,482	
協会費	11,849	
諸会費	17	
支払販売手数料	24,635	
	営業費用計	11,056,605
一般管理費		
給料	2,351,238	
役員報酬	121,094	
給料・手当	2,230,144	
交際費	19,774	
寄付金	2,156	
旅費交通費	119,653	
租税公課	94,838	
不動産賃借料	363,395	
退職給付費用	114,178	
固定資産減価償却費	1 362,235	
福利厚生費	10,385	
修繕費	30,844	
賞与引当金繰入額	724,368	
役員退職慰労引当金繰入額	27,285	
機器リース料	76	
事務委託費	137,814	
事務用消耗品費	33,473	
器具備品費	14,115	
諸経費	84,703	
	一般管理費計	4,490,538
営業利益		4,508,315

(単位:千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	8,323	
受取利息	1,015	
雑収入	5,491	
営業外収益計		14,830
営業外費用		
為替差損	3,664	
金銭の信託運用損	166,406	
営業外費用計		170,070
経常利益		4,353,076
特別損失		
固定資産除却損	182	
固定資産売却損	2,654	
ゴルフ会員権評価損	3,806	
特別損失計		6,642
税引前中間純利益		4,346,433
法人税、住民税及び事業税		1,434,006
法人税等調整額		14,388
法人税等合計		1,448,394
中間純利益		2,898,038

(3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	252,905	30,099,168
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	26,178	26,178
当中間期変動額 合計	26,178	327,860
当中間期末残高	226,727	30,427,029

重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
<p>当社は、平成27年9月30日開催の取締役会の決議に基づき、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」)の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」)、及び新光投信株式会社(以下「新光投信」)の機能統合に向けた具体的な準備を開始すべく、同日付で当社、TB、MHAM及び新光投信の間で「統合基本合意書」を締結いたしました。今後、統合に必要な各社の取締役会決議及び株主総会決議、国内外の関係当局への届出、許認可の取得等を前提として、平成28年度上期中の統合を予定しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: right;">...</td> <td style="width: 30%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 40%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: right;">...</td> <td style="width: 50%; text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,613,571	10,613,571	-
(2) 金銭の信託	14,000,363	14,000,363	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	493,805	493,805	-
資産計	25,107,739	25,107,739	-
(1) 未払法人税等	1,486,583	1,486,583	-
負債計	1,486,583	1,486,583	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,316,596
差入保証金	771,427

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

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

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

(有価証券関係)

第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式(中間貸借対照表計上額2,316,596千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
3. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他(投資信託)	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	493,805	159,101	334,703
(注)非上場株式(中間貸借対照表計上額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。			

(金銭の信託関係)

第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
1. 満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託(運用目的及び満期保有目的以外) 該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. セグメント情報

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

2．関連情報

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	15,465,477	4,206,088	383,893	20,055,459

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で中間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。

(1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,267,792円	89銭
1株当たり中間純利益金額	120,751円	62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
中間純利益	2,898,038千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,898,038千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第31期中間会計期間
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、平成27年9月25日開催の取締役会において、子会社であるDIAM International Ltdの増資引受を決議いたしました。

1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a．名称

みずほ信託銀行株式会社

b．資本金の額

平成27年3月末日現在 247,369百万円

c．事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北越銀行	24,538	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	343,104	日本において保険業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

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

この他に、委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【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27年10月13日
有価証券届出書	平成27年10月13日

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年2月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ<DC年金>の平成27年7月14日から平成28年1月12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28年1月12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。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。