【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年4月11日
【発行者名】	アセットマネジメント0ne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　西　惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	上野　圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書の提出に伴い、平成28年10月11日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

２【訂正の内容】

＿＿＿＿＿＿の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（３）【ファンドの仕組み】

＜訂正前＞

（略）

○委託会社の概況

（略）

① 資本金の額

20億円（平成28年10月1日現在）

（略）

③ 大株主の状況

（平成28年10月1日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

＜訂正後＞

（略）

○委託会社の概況

（略）

① 資本金の額

20億円（平成29年1月31日現在）

（略）

③ 大株主の状況

（平成29年1月31日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

２【投資方針】

（３）【運用体制】

＜訂正前＞

（略）

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

（略）

＜訂正後＞

（略）

※運用体制は平成29年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（略）

３【投資リスク】

＜リスク管理体制＞

＜訂正前＞

（略）

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

＜訂正後＞

（略）

※上記体制は平成29年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

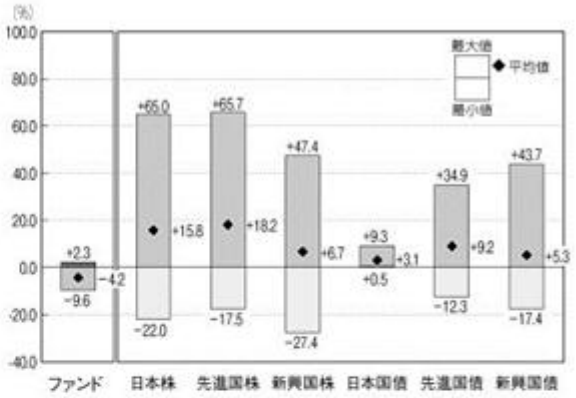
＜更新・訂正後＞

（参考情報）

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



ファンド：2015年9月～2017年1月
代表的な資産クラス：2012年2月～2017年1月

＊上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値-最大値-最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
＊全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

＊各資産クラスの指数
日本株……東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株…MSCIコクサイ・インデックス（円ベース、配当込み）
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円ベース、配当込み）
日本国債…NOMURA－BPI国債
先進国債…シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（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（㈱東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、㈱東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
●「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的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。
●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
●「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」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】

（５）【課税上の取扱い】

＜訂正前＞

（略）

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

（略）

＜訂正後＞

（略）

※上記は、平成29年1月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

（略）

５【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報　第1 ファンドの状況　5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

＜更新・訂正後＞

（１）【投資状況】

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		4,107,219	38.10
	内　日本	4,107,219	38.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,671,777	61.90
純資産総額		10,778,996	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		278,463,817,875	96.28
	内　日本	278,463,817,875	96.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,762,232,032	3.72
純資産総額		289,226,049,907	100.00

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		10,452,130,000	3.61
	内　日本	10,452,130,000	3.61

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		320,097,024,300	83.77
	内　日本	320,097,024,300	83.77
地方債証券		23,916,686,607	6.26
	内　日本	23,916,686,607	6.26
特殊債券		18,948,291,491	4.96
	内　日本	18,948,291,491	4.96
社債券		17,084,129,820	4.47
	内　日本	16,784,273,820	4.39
	内　オランダ	200,002,000	0.05
	内　イギリス	99,854,000	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,069,112,762	0.54
純資産総額		382,115,244,980	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29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		259,944,908,407	95.98
	内　アメリカ	161,077,340,660	59.47
	内　イギリス	18,170,321,652	6.71
	内　カナダ	10,854,411,687	4.01
	内　スイス	10,109,712,269	3.73
	内　ドイツ	9,993,764,716	3.69
	内　フランス	9,549,794,687	3.53
	内　オーストラリア	7,251,985,382	2.68
	内　オランダ	4,735,803,417	1.75
	内　アイルランド	4,291,866,587	1.58
	内　スペイン	3,313,936,135	1.22
	内　スウェーデン	3,047,388,843	1.13
	内　香港	2,511,915,128	0.93
	内　シンガポール	1,980,155,570	0.73
	内　デンマーク	1,772,293,938	0.65
	内　イタリア	1,756,606,331	0.65
	内　ジャージィー	1,637,980,411	0.60
	内　バミューダ	1,214,671,442	0.45
	内　ベルギー	1,208,335,424	0.45
	内　フィンランド	1,021,469,564	0.38
	内　オランダ領キュラソー	985,536,295	0.36
	内　ノルウェー	717,429,674	0.26
	内　ケイマン諸島	668,046,105	0.25
	内　イスラエル	651,194,346	0.24
	内　ルクセンブルグ	360,658,350	0.13
	内　オーストリア	229,878,998	0.08
	内　ニュージーランド	182,615,223	0.07

	内　パナマ	173,121,166	0.06
	内　ポルトガル	162,898,632	0.06
	内　リベリア	145,759,289	0.05
	内　イギリス領バージン諸島	56,707,217	0.02
	内　パプアニューギニア	55,997,898	0.02
	内　マン島	32,023,491	0.01
	内　モーリシャス	23,287,880	0.01
投資信託受益証券		802,682,922	0.30
	内　オーストラリア	680,260,493	0.25
	内　シンガポール	122,422,429	0.05
投資証券		6,122,013,845	2.26
	内　アメリカ	5,345,469,865	1.97
	内　フランス	343,927,798	0.13
	内　イギリス	255,612,231	0.09
	内　香港	127,482,666	0.05
	内　カナダ	49,521,285	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,968,736,590	1.47
純資産総額		270,838,341,764	100.00

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		319,718,600	0.12
	―	319,718,600	0.12
為替予約取引（売建）		140,086,000	△0.05
	―	140,086,000	△0.05
株価指数先物取引（買建）		3,743,603,504	1.38
	内　アメリカ	2,486,702,976	0.92
	内　ドイツ	677,042,010	0.25
	内　イギリス	280,957,418	0.10
	内　オーストラリア	156,785,947	0.06
	内　カナダ	142,115,153	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
（注4）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		242,895,838,840	96.65
	内　アメリカ	108,697,757,726	43.25
	内　フランス	23,888,698,260	9.51
	内　イタリア	23,075,105,395	9.18
	内　ドイツ	18,126,871,293	7.21
	内　イギリス	17,340,680,428	6.90
	内　スペイン	13,425,705,721	5.34
	内　ベルギー	6,035,895,890	2.40
	内　オランダ	5,616,150,188	2.23
	内　カナダ	5,274,458,559	2.10
	内　オーストラリア	5,221,954,919	2.08
	内　オーストリア	3,673,969,791	1.46
	内　メキシコ	1,830,527,181	0.73
	内　アイルランド	1,786,549,367	0.71
	内　デンマーク	1,521,603,517	0.61
	内　ポーランド	1,404,497,099	0.56
	内　フィンランド	1,373,429,311	0.55
	内　南アフリカ	1,234,787,647	0.49
	内　スウェーデン	1,017,963,342	0.41
	内　マレーシア	958,735,570	0.38
	内　シンガポール	855,698,774	0.34
	内　ノルウェー	534,798,862	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,414,868,439	3.35
純資産総額		251,310,707,279	100.00

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		1,359,066,730	0.54
	―	1,359,066,730	0.54
為替予約取引（売建）		72,142,590	△0.03
	―	72,142,590	△0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		39,305,224,317	95.46
	内　韓国	5,864,622,886	14.24
	内　台湾	4,742,594,896	11.52
	内　ケイマン諸島	4,641,197,753	11.27
	内　中国	4,088,121,311	9.93
	内　インド	3,309,740,597	8.04
	内　ブラジル	3,198,397,940	7.77
	内　南アフリカ	2,503,830,498	6.08
	内　ロシア	1,686,997,503	4.10
	内　香港	1,561,431,103	3.79
	内　メキシコ	1,072,689,412	2.61
	内　インドネシア	990,133,059	2.40
	内　マレーシア	981,412,972	2.38
	内　タイ	915,590,123	2.22
	内　フィリピン	486,206,513	1.18
	内　チリ	470,726,247	1.14
	内　ポーランド	468,999,320	1.14
	内　バミューダ	411,518,644	1.00
	内　トルコ	389,915,715	0.95
	内　カタール	345,683,658	0.84
	内　アラブ首長国連邦	329,905,468	0.80
	内　コロンビア	175,446,802	0.43
	内　オランダ	137,770,599	0.33
	内　アメリカ	136,863,443	0.33
	内　ハンガリー	123,503,152	0.30
	内　ギリシャ	75,682,616	0.18
	内　チェコ	68,433,168	0.17
	内　エジプト	52,241,338	0.13
	内　ペルー	29,487,420	0.07
	内　マン島	26,854,444	0.07
	内　マルタ	19,225,717	0.05
投資信託受益証券		254,743,769	0.62
	内　メキシコ	254,743,769	0.62
投資証券		95,986,141	0.23
	内　南アフリカ	45,513,574	0.11
	内　メキシコ	35,473,830	0.09
	内　トルコ	14,998,737	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,517,900,630	3.69
純資産総額		41,173,854,857	100.00

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		1,481,831,807	3.60
	内　アメリカ	1,481,831,807	3.60

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		66,608,289,056	96.50
	内　トルコ	9,860,699,834	14.29
	内　メキシコ	8,700,920,742	12.61
	内　ロシア	8,673,210,835	12.56
	内　ブラジル	6,650,846,419	9.64
	内　インドネシア	6,496,709,207	9.41
	内　コロンビア	5,428,570,836	7.86
	内　フィリピン	5,224,242,161	7.57
	内　ペルー	3,293,152,668	4.77
	内　パナマ	3,179,859,366	4.61
	内　ハンガリー	3,142,083,093	4.55
	内　南アフリカ	2,281,568,755	3.31
	内　クロアチア	2,018,520,615	2.92
	内　ルーマニア	1,657,904,525	2.40
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,418,823,162	3.50
純資産総額		69,027,112,218	100.00

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		8,296,020,000	12.02
	―	8,296,020,000	12.02

（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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	811,006	1.2805 1,038,495	1.2762 1,035,005	－ －	9.60%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	585,946	1.7721 1,038,356	1.7406 1,019,897	－ －	9.46%
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	362,468	2.2933 831,250	2.2509 815,879	－ －	7.57%
4	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	422,745	0.9814 414,884	0.9933 419,912	－ －	3.90%
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	139,051	2.9787 414,192	2.9451 409,519	－ －	3.80%
6	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	225,589	1.8387 414,792	1.8042 407,007	－ －	3.78%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	38.10%
合計	38.10%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,526,000	6,489.85 9,903,521,731	6,584.00 10,047,184,000	－ －	3.47%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,387,800	534.86 5,021,213,212	730.90 6,861,543,020	－ －	2.37%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	994,500	5,258.96 5,230,036,902	4,979.00 4,951,615,500	－ －	1.71%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	557,700	5,150.50 2,872,435,284	8,701.00 4,852,547,700	－ －	1.68%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	992,000	3,397.39 3,370,215,723	4,451.00 4,415,392,000	－ －	1.53%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,129,500	3,106.46 3,508,756,900	3,387.00 3,825,616,500	－ －	1.32%
7	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,225,600	3,195.64 3,916,582,281	3,030.00 3,713,568,000	－ －	1.28%
8	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	16,819,100	180.09 3,028,951,808	210.30 3,537,056,730	－ －	1.22%
9	ソニー 日本	株式 電気機器	886,200	2,584.05 2,289,993,116	3,423.00 3,033,462,600	－ －	1.05%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	779,500	4,635.42 3,613,310,738	3,640.00 2,837,380,000	－ －	0.98%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	127,300	16,400.39 2,087,769,849	22,165.00 2,821,604,500	－ －	0.98%
12	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	925,700	2,834.82 2,624,202,080	2,706.50 2,505,407,050	－ －	0.87%
13	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,900	29,290.65 1,666,638,251	43,870.00 2,496,203,000	－ －	0.86%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	242,800	10,712.35 2,600,958,672	10,230.00 2,483,844,000	－ －	0.86%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	501,900	3,927.25 1,971,087,004	4,731.00 2,374,488,900	－ －	0.82%
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	929,600	1,871.62 1,739,858,801	2,549.50 2,370,015,200	－ －	0.82%
17	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	518,500	5,111.75 2,650,444,845	4,509.00 2,337,916,500	－ －	0.81%
18	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	492,900	5,780.65 2,849,284,075	4,724.00 2,328,459,600	－ －	0.81%
19	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,338,900	1,146.05 1,534,447,996	1,721.50 2,304,916,350	－ －	0.80%
20	信越化学工業 日本	株式 化学	235,800	5,982.11 1,410,581,964	9,747.00 2,298,342,600	－ －	0.79%

21	キヤノン 日本	株式 電気機器	675,700	3,349.96 2,263,572,584	3,345.00 2,260,216,500	－ －	0.78%
22	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,343,100	1,658.53 2,227,577,874	1,513.50 2,032,781,850	－ －	0.70%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	131,700	13,863.72 1,825,851,938	15,255.00 2,009,083,500	－ －	0.69%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	921,000	2,236.36 2,059,692,720	2,162.50 1,991,662,500	－ －	0.69%
25	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,014,000	492.56 1,484,595,120	647.60 1,951,866,400	－ －	0.67%
26	ダイキン工業 日本	株式 機械	171,400	7,741.00 1,326,808,240	11,225.00 1,923,965,000	－ －	0.67%
27	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	104,400	22,228.54 2,320,660,228	18,270.00 1,907,388,000	－ －	0.66%
28	花王 日本	株式 化学	333,900	6,189.12 2,066,550,316	5,583.00 1,864,163,700	－ －	0.64%
29	三井物産 日本	株式 卸売業	1,120,100	1,324.01 1,483,025,891	1,656.50 1,855,445,650	－ －	0.64%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	443,600	4,104.80 1,820,889,540	4,143.00 1,837,834,800	－ －	0.64%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
株式	96.28%
合計	96.28%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.16%
輸送用機器		9.09%
銀行業		8.21%
情報・通信業		7.72%
化学		6.44%
機械		4.93%
小売業		4.47%
医薬品		4.46%
卸売業		4.32%
食料品		4.20%
陸運業		4.08%
サービス業		3.49%
建設業		2.84%
保険業		2.60%
不動産業		2.43%
電気・ガス業		1.71%
その他製品		1.68%
精密機器		1.48%
鉄鋼		1.29%
その他金融業		1.22%
証券、商品先物取引業		1.19%
ガラス・土石製品		0.94%
非鉄金属		0.91%
ゴム製品		0.86%
繊維製品		0.69%
金属製品		0.68%
空運業		0.55%
石油・石炭製品		0.54%
鉱業		0.33%
パルプ・紙		0.24%
海運業		0.24%
倉庫・運輸関連業		0.19%
水産・農林業		0.11%
合計		96.28%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	１２９回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,500,000,000	101.02 4,546,250,000	100.95 4,542,885,000	0.100000 2021/9/20	1.19%
2	１２４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.97 4,543,985,000	100.81 4,536,630,000	0.100000 2020/6/20	1.19%
3	１２２回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	100.73 4,533,165,000	0.100000 2019/12/20	1.19%
4	３４３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,500,000,000	102.99 4,634,870,000	100.32 4,514,670,000	0.100000 2026/6/20	1.18%
5	１１８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,200,000,000	101.14 4,248,216,000	100.89 4,237,590,000	0.200000 2019/6/20	1.11%
6	１１６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	100.79 4,233,264,000	0.200000 2018/12/20	1.11%
7	１２８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,000,000,000	101.62 4,065,155,000	100.92 4,036,920,000	0.100000 2021/6/20	1.06%
8	１１７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	100.83 4,033,280,000	0.200000 2019/3/20	1.06%
9	３６６回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.57 4,023,110,000	100.50 4,020,000,000	0.100000 2018/7/15	1.05%
10	３４２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,000,000,000	102.02 4,081,115,000	100.36 4,014,520,000	0.100000 2026/3/20	1.05%
11	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.79 4,031,830,000	100.28 4,011,440,000	0.100000 2026/9/20	1.05%
12	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,500,000,000	103.43 3,620,385,000	102.16 3,575,740,000	0.300000 2025/12/20	0.94%
13	１１４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	100.86 3,530,345,000	0.300000 2018/9/20	0.92%
14	１２６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,500,000,000	101.36 3,547,690,000	100.85 3,529,995,000	0.100000 2020/12/20	0.92%
15	１２３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.97 3,534,275,000	100.78 3,527,475,000	0.100000 2020/3/20	0.92%

16	３１３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	105.84 3,175,320,000	1.300000 2021/3/20	0.83%
17	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	103.19 3,095,720,000	103.00 3,090,210,000	0.400000 2025/9/20	0.81%
18	１２７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	101.57 3,047,255,000	100.89 3,026,730,000	0.100000 2021/3/20	0.79%
19	１２５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	101.06 3,031,815,000	100.83 3,025,140,000	0.100000 2020/9/20	0.79%
20	３０１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	103.99 3,015,971,000	1.500000 2019/6/20	0.79%
21	３１０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	104.10 2,914,856,000	1.000000 2020/9/20	0.76%
22	３２５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,700,000,000	105.86 2,858,285,000	104.88 2,831,949,000	0.800000 2022/9/20	0.74%
23	３３４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,600,000,000	105.21 2,735,585,000	104.34 2,713,074,000	0.600000 2024/6/20	0.71%
24	３２１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.82 2,670,535,000	105.58 2,639,650,000	1.000000 2022/3/20	0.69%
25	３０５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	104.20 2,605,200,000	1.300000 2019/12/20	0.68%
26	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.40 2,585,075,000	102.95 2,573,925,000	0.400000 2025/3/20	0.67%
27	１４９回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	2,200,000,000	114.32 2,515,180,000	116.54 2,564,034,000	1.500000 2034/6/20	0.67%
28	１４１回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	2,100,000,000	118.13 2,480,775,000	119.76 2,515,128,000	1.700000 2032/12/20	0.66%
29	３６５回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.84 2,521,025,000	100.47 2,511,975,000	0.100000 2018/6/15	0.66%
30	１４３回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	118.26 2,483,628,000	1.600000 2033/3/20	0.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.77%
地方債証券	6.26%
特殊債券	4.96%
社債券	4.47%
合計	99.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	402,214	10,704.84 4,305,640,109	13,842.71 5,567,731,880	－ －	2.06%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	553,414	5,750.03 3,182,147,273	7,412.44 4,102,151,003	－ －	1.51%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	309,835	9,277.33 2,874,441,713	9,657.91 2,992,360,589	－ －	1.10%
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,084	58,629.95 1,763,823,480	94,505.54 2,843,104,900	－ －	1.05%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	269,975	6,560.50 1,771,171,269	9,791.07 2,643,345,284	－ －	0.98%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	204,804	11,663.94 2,388,822,338	12,875.32 2,636,918,122	－ －	0.97%
7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	173,536	11,736.50 2,036,706,588	14,906.83 2,586,872,310	－ －	0.96%
8	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	358,022	5,380.11 1,926,198,174	6,382.46 2,285,062,812	－ －	0.84%
9	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	669,933	3,228.37 2,162,795,584	3,409.74 2,284,302,438	－ －	0.84%
10	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	460,498	4,171.03 1,920,754,593	4,759.53 2,191,755,980	－ －	0.81%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,139	77,786.95 1,799,912,431	91,312.03 2,112,869,275	－ －	0.78%
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	21,999	80,531.01 1,771,601,730	93,760.09 2,062,628,270	－ －	0.76%
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	761,401	1,363.34 1,038,050,818	2,611.93 1,988,733,347	－ －	0.73%
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	232,379	8,236.93 1,914,090,222	8,280.38 1,924,188,283	－ －	0.71%
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	191,488	9,233.94 1,768,190,205	9,873.01 1,890,564,375	－ －	0.70%
16	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	140,802	9,816.08 1,382,124,197	12,726.23 1,791,879,227	－ －	0.66%

17	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	305,099	5,725.50 1,746,845,000	5,618.79 1,714,290,169	— —	0.63%
18	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	91,251	14,664.67 1,338,166,172	18,755.88 1,711,493,535	— —	0.63%
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	453,602	3,366.37 1,526,993,233	3,563.39 1,616,361,329	— —	0.60%
20	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	179,552	6,493.51 1,165,924,143	8,574.44 1,539,558,820	— —	0.57%
21	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	353,216	3,282.75 1,159,520,199	4,258.77 1,504,265,774	— —	0.56%
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	92,204	13,353.09 1,231,208,626	15,759.27 1,453,067,795	— —	0.54%
23	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	206,907	5,615.68 1,161,924,610	6,991.34 1,446,558,902	— —	0.53%
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	306,559	4,912.50 1,505,973,577	4,709.45 1,443,726,673	— —	0.53%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,486,352	629.05 935,002,777	968.52 1,439,567,584	— —	0.53%
26	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	113,984	10,395.30 1,184,898,042	12,626.08 1,439,171,262	— —	0.53%
27	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	52,476	27,973.94 1,467,960,762	26,762.57 1,404,393,148	— —	0.52%
28	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	216,601	4,286.89 928,544,859	6,442.78 1,395,513,478	— —	0.52%
29	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	166,725	8,172.86 1,362,620,504	8,234.64 1,372,920,354	— —	0.51%
30	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	67,924	13,877.56 942,619,525	20,007.79 1,359,009,671	— —	0.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
株式	95.98%
投資信託受益証券	0.30%
投資証券	2.26%
合計	98.53%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.60%
石油・ガス・消耗燃料		6.59%
医薬品		5.62%
保険		4.17%
ソフトウェア		3.50%
インターネットソフトウェア・サービス		2.91%
資本市場		2.82%
メディア		2.73%
化学		2.69%
情報技術サービス		2.66%
各種電気通信サービス		2.59%
半導体・半導体製造装置		2.46%
コンピュータ・周辺機器		2.43%
バイオテクノロジー		2.26%
食品		2.17%
コングロマリット		2.13%
飲料		2.02%
食品・生活必需品小売り		1.91%
航空宇宙・防衛		1.88%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.88%
ヘルスケア機器・用品		1.85%
電力		1.81%
専門小売り		1.78%
ホテル・レストラン・レジャー		1.74%
インターネット販売・通信販売		1.59%
金属・鉱業		1.59%
タバコ		1.58%
機械		1.51%
家庭用品		1.43%
繊維・アパレル・贅沢品		1.17%
総合公益事業		1.07%
自動車		1.05%
陸運・鉄道		0.93%
各種金融サービス		0.90%
通信機器		0.80%
エネルギー設備・サービス		0.79%
電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.64%

航空貨物・物流サービス		0.60%
専門サービス		0.59%
消費者金融		0.58%
不動産管理・開発		0.51%
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.47%
自動車部品		0.45%
家庭用耐久財		0.45%
電子装置・機器・部品		0.42%
複合小売り		0.39%
建設関連製品		0.39%
建設資材		0.37%
商業サービス・用品		0.36%
無線通信サービス		0.35%
商社・流通業		0.33%
建設・土木		0.31%
容器・包装		0.31%
運送インフラ		0.23%
ガス		0.16%
旅客航空輸送業		0.15%
紙製品・林産品		0.10%
販売		0.09%
水道		0.09%
海運業		0.08%
レジャー用品		0.08%
ヘルスケア・テクノロジー		0.05%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.04%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.03%
各種消費者サービス		0.01%
合計		95.98%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	4,040,255,000	101.32 4,093,988,684	100.43 4,057,910,914	1.375000 2018/9/30	1.61%
2	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	2,390,010,000	104.25 2,491,706,063	101.00 2,414,077,400	2.125000 2021/8/15	0.96%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,934,770,000	109.69 2,122,345,951	106.32 2,057,047,464	3.625000 2020/2/15	0.82%
4	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,934,770,000	101.72 1,968,164,130	100.57 1,945,798,189	1.500000 2018/12/31	0.77%
5	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,877,865,000	106.17 1,993,748,049	103.36 1,941,092,714	2.625000 2020/8/15	0.77%
6	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,707,150,000	103.65 1,769,505,360	101.91 1,739,756,565	2.375000 2018/6/30	0.69%
7	US T N/B 1.625 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,707,150,000	102.01 1,741,574,110	100.75 1,719,953,625	1.625000 2019/3/31	0.68%
8	US T N/B 1.25 12/15/18 アメリカ	国債証券	1,707,150,000	100.22 1,711,025,230	100.12 1,709,335,152	1.250000 2018/12/15	0.68%
9	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,593,340,000	109.57 1,745,822,638	106.13 1,691,107,342	3.500000 2020/5/15	0.67%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,707,150,000	101.82 1,738,220,130	98.62 1,683,676,687	1.750000 2022/5/15	0.67%
11	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,707,150,000	100.54 1,716,423,238	97.67 1,667,527,048	1.625000 2022/8/15	0.66%
12	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,707,150,000	102.58 1,751,346,975	97.35 1,662,064,168	1.750000 2023/5/15	0.66%
13	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,479,530,000	106.89 1,581,587,979	104.07 1,539,806,052	3.125000 2019/5/15	0.61%
14	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,536,435,000	99.95 1,535,774,902	99.83 1,533,853,789	0.750000 2018/2/28	0.61%
15	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,536,435,000	100.02 1,536,813,987	99.03 1,521,608,402	1.000000 2019/8/31	0.61%
16	US T N/B 1.375 06/30/23 アメリカ	国債証券	1,593,340,000	99.72 1,589,015,220	94.96 1,513,163,131	1.375000 2023/6/30	0.60%
17	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,479,530,000	101.06 1,495,331,380	100.25 1,483,273,210	1.375000 2019/2/28	0.59%
18	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,445,387,000	101.79 1,471,323,616	100.65 1,454,868,738	1.500000 2018/8/31	0.58%
19	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,365,720,000	108.00 1,474,977,600	104.58 1,428,297,290	4.000000 2018/8/15	0.57%
20	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,365,720,000	105.27 1,437,823,187	103.00 1,406,732,571	2.750000 2019/2/15	0.56%
21	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,365,720,000	103.48 1,413,356,313	100.64 1,374,460,608	2.000000 2021/5/31	0.55%
22	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,365,720,000	100.88 1,377,751,993	99.38 1,357,279,850	1.375000 2020/4/30	0.54%
23	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,308,815,000	104.38 1,366,167,842	101.79 1,332,321,317	2.250000 2021/3/31	0.53%

24	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,365,720,000	101.92 1,392,037,424	96.62 1,319,626,950	2.000000 2025/8/15	0.53%
25	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,180,975,000	112.57 1,329,535,567	110.08 1,300,064,519	2.500000 2020/10/25	0.52%
26	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,251,910,000	102.98 1,289,216,918	100.90 1,263,252,304	1.875000 2020/6/30	0.50%
27	US T N/B 2.0 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,251,910,000	103.10 1,290,785,219	100.89 1,263,051,999	2.000000 2021/2/28	0.50%
28	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	1,251,910,000	100.53 1,258,557,642	99.56 1,246,476,710	1.125000 2019/5/31	0.50%
29	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,229,148,000	100.51 1,235,478,112	99.28 1,220,408,757	1.250000 2020/1/31	0.49%
30	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証券	1,308,815,000	99.57 1,303,188,802	92.97 1,216,883,834	1.625000 2026/5/15	0.48%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.65%
合計	96.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	8,300	128,231.99 1,064,325,518	194,313.00 1,612,797,900	－ －	3.92%
2	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	475,400	2,454.04 1,166,653,593	2,998.54 1,425,509,719	－ －	3.46%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,061,083	579.73 1,194,890,868	669.65 1,380,214,536	－ －	3.35%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	93,900	9,388.09 881,542,191	11,497.08 1,079,576,394	－ －	2.62%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	36,630	18,108.76 663,324,158	18,181.23 665,978,597	－ －	1.62%
6	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	513,500	1,314.93 675,220,768	1,288.75 661,778,003	－ －	1.61%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,032,530	74.72 525,487,548	85.08 598,369,847	－ －	1.45%
8	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	22,700	20,989.29 476,456,960	19,884.88 451,386,848	－ －	1.10%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,165,235	63.88 393,848,289	70.12 432,322,307	－ －	1.05%
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,294,532	272.58 352,865,193	302.15 391,151,905	－ －	0.95%
11	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	270,098	1,095.80 295,975,905	1,355.53 366,127,562	－ －	0.89%
12	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,641,200	47.55 315,854,806	51.93 344,889,470	－ －	0.84%
13	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	232,555	875.03 203,492,826	1,353.20 314,693,635	－ －	0.76%
14	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	125,716	1,893.45 238,037,574	2,304.79 289,749,231	－ －	0.70%
15	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	509,755	501.00 255,389,420	566.43 288,741,732	－ －	0.70%
16	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	233,315	958.72 223,683,888	1,177.90 274,822,671	－ －	0.67%

17	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	436,000	555.09 242,019,908	588.26 256,484,412	－ －	0.62%
18	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	48,682	2,752.90 134,017,055	5,191.41 252,728,708	－ －	0.61%
19	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	153,655	1,961.84 301,446,597	1,594.90 245,065,588	－ －	0.60%
20	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	394,095	689.73 271,819,654	617.70 243,435,634	－ －	0.59%
21	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	36,954	4,826.13 178,345,067	6,471.23 239,138,077	－ －	0.58%
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	1,475	105,545.81 155,680,080	157,301.00 232,018,975	－ －	0.56%
23	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,478,000	142.72 210,940,683	144.35 213,353,438	－ －	0.52%
24	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,767,278	73.20 202,575,944	72.42 200,414,021	－ －	0.49%
25	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	621,000	288.94 179,432,781	316.13 196,322,008	－ －	0.48%
26	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,129,200	78.08 166,250,433	91.10 193,971,610	－ －	0.47%
27	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	108,265	1,780.57 192,773,889	1,755.26 190,033,656	－ －	0.46%
28	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	6,600	18,408.41 121,495,566	28,508.26 188,154,561	－ －	0.46%
29	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	55,800	2,931.68 163,587,967	3,250.41 181,373,078	－ －	0.44%
30	VALE SA-PREF A ブラジル	株式 金属・鉱業	161,696	533.62 86,284,524	1,108.01 179,161,755	－ －	0.44%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
株式	95.46%
投資信託受益証券	0.62%
投資証券	0.23%
合計	96.31%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	16.15%
インターネットソフトウェア・サービス		8.31%
石油・ガス・消耗燃料		7.36%
コンピュータ・周辺機器		5.58%
半導体・半導体製造装置		5.02%
無線通信サービス		3.80%
金属・鉱業		3.41%
保険		3.31%
自動車		2.48%
電子装置・機器・部品		2.46%
化学		2.44%
メディア		2.18%
不動産管理・開発		1.99%
コングロマリット		1.88%
食品		1.79%
各種電気通信サービス		1.78%
食品・生活必需品小売り		1.74%
情報技術サービス		1.60%
医薬品		1.43%
各種金融サービス		1.35%
資本市場		1.29%
電力		1.19%
飲料		1.00%
インターネット販売・通信販売		0.95%
運送インフラ		0.93%
建設・土木		0.84%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.84%
建設資材		0.83%
パーソナル用品		0.82%
自動車部品		0.77%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.70%
家庭用耐久財		0.70%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
タバコ		0.68%
複合小売り		0.66%
機械		0.63%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.57%
繊維・アパレル・贅沢品		0.55%

ガス	0.48%
専門小売り	0.38%
各種消費者サービス	0.37%
紙製品・林産品	0.36%
家庭用品	0.36%
水道	0.27%
エクイティ不動産投資信託（ＲＥＩＴｓ）	0.25%
航空宇宙・防衛	0.24%
電気設備	0.23%
バイオテクノロジー	0.22%
旅客航空輸送業	0.21%
消費者金融	0.20%
陸運・鉄道	0.16%
ソフトウェア	0.15%
商業サービス・用品	0.13%
総合公益事業	0.09%
航空貨物・物流サービス	0.08%
エネルギー設備・サービス	0.08%
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.07%
容器・包装	0.07%
レジャー用品	0.07%
海運業	0.06%
商社・流通業	0.06%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
販売	0.05%
建設関連製品	0.04%
ヘルスケア・テクノロジー	0.04%
通信機器	0.03%
合計	95.46%

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	2,648,643,225	121.58 3,220,371,131	119.90 3,175,882,145	7.500000 2030/3/31	4.60%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	956,004,000	115.70 1,106,113,699	113.80 1,087,989,912	11.000000 2018/7/24	1.58%
3	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	717,003,000	154.98 1,111,224,906	148.38 1,063,960,751	8.750000 2033/11/21	1.54%
4	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,035,671,000	95.80 992,238,258	96.62 1,000,717,103	4.250000 2025/1/7	1.45%
5	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	796,670,000	122.00 971,943,090	115.21 917,843,507	5.625000 2050/11/18	1.33%
6	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	864,956,000	109.12 943,883,235	101.97 882,038,881	5.550000 2045/1/21	1.28%
7	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	705,622,000	131.02 924,528,706	123.10 868,691,244	6.700000 2036/1/26	1.26%
8	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	785,289,000	119.41 937,751,721	108.87 854,983,398	6.050000 2040/1/11	1.24%
9	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	933,242,000	101.55 947,798,299	91.50 853,916,430	4.750000 2044/3/8	1.24%
10	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	796,670,000	106.84 851,213,670	106.14 845,593,504	4.875000 2023/9/16	1.23%
11	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	637,336,000	134.60 857,894,089	128.68 820,187,698	7.350000 2025/7/21	1.19%
12	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	728,384,000	113.74 828,519,728	112.11 816,664,140	6.375000 2021/3/29	1.18%
13	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19 メキシコ	国債証券	751,146,000	110.47 829,794,400	108.27 813,303,331	5.950000 2019/3/19	1.18%
14	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	728,384,000	108.47 790,088,367	108.50 790,369,478	5.625000 2042/4/4	1.15%
15	TURKEY 6.75 04/03/18 トルコ	国債証券	751,146,000	105.74 794,325,514	104.11 782,070,680	6.750000 2018/4/3	1.13%
16	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	694,241,000	113.74 789,682,066	110.90 769,913,269	7.375000 2019/3/18	1.12%
17	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	762,527,000	105.26 802,679,168	100.74 768,245,952	4.000000 2023/10/2	1.11%
18	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	694,241,000	118.20 820,595,138	110.34 766,094,943	7.375000 2025/2/5	1.11%

19	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	728,384,000	103.91 756,904,786	104.20 758,976,128	4.875000 2021/1/22	1.10%
20	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	478,002,000	166.97 798,157,269	157.94 754,975,478	9.500000 2030/2/2	1.09%
21	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 メキシコ	国債証券	751,146,000	105.54 792,800,460	99.97 750,995,770	4.125000 2026/1/21	1.09%
22	BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル	国債証券	694,241,000	109.07 757,223,454	107.60 747,003,316	5.875000 2019/1/15	1.08%
23	RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 ロシア	国債証券	728,384,000	101.59 740,026,990	102.08 743,548,954	3.500000 2019/1/16	1.08%
24	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	648,717,000	118.22 766,923,025	114.35 741,814,376	6.750000 2022/2/7	1.07%
25	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	694,241,000	108.30 751,918,769	106.63 740,303,890	4.875000 2021/5/5	1.07%
26	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	864,956,000	83.95 726,187,467	85.25 737,374,990	5.000000 2045/1/27	1.07%
27	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	717,003,000	103.96 745,398,595	100.70 722,022,021	3.625000 2022/3/15	1.05%
28	INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア	国債証券	591,812,000	121.68 720,171,470	119.73 708,623,852	11.625000 2019/3/4	1.03%
29	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	637,336,000	110.00 701,126,505	110.50 704,256,280	6.125000 2041/1/18	1.02%
30	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	660,098,000	105.11 693,854,046	105.25 694,753,145	5.625000 2044/2/26	1.01%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.50%
合計	96.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成29年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　２９０３月	買建	689	10,667,538,436	10,452,130,000	3.61%

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	－	アメリカ・ドル買／円売２０１７年０２月	買建	1,820,000	208,801,684	207,116,000	0.08%
		ユーロ買／円売２０１７年０２月	買建	480,000	59,066,400	58,440,000	0.02%
		イギリス・ポンド買／円売２０１７年０２月	買建	180,000	25,997,580	25,635,600	0.01%
		カナダ・ドル買／円売２０１７年０２月	買建	170,000	14,845,964	14,752,600	0.01%
		オーストラリア・ドル買／円売２０１７年０２月	買建	160,000	13,859,840	13,774,400	0.01%
		アメリカ・ドル売／円買２０１７年０２月	売建	820,000	93,320,428	93,316,000	△0.03%
		ユーロ売／円買２０１７年０２月	売建	210,000	25,567,836	25,567,500	△0.01%
		イギリス・ポンド売／円買２０１７年０２月	売建	70,000	9,969,820	9,969,400	△0.00%
		オーストラリア・ドル売／円買２０１７年０２月	売建	70,000	6,026,580	6,026,300	△0.00%
		カナダ・ドル売／円買２０１７年０２月	売建	60,000	5,207,190	5,206,800	△0.00%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００ ＥＭＩＮＩ ＦＵＴ Ｍａｒ１７	買建	192	2,476,406,016	2,486,702,976	0.92%
	ＥＵＲＥＸ取引所	ＤＪ ＥＵＲＯ ＳＴＯＸＸ ５０ Ｍａｒ１７	買建	171	683,685,907	677,042,010	0.25%
	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ １００ ＩＮＤＥＸ ＦＵＴＵＲＥ Ｍａｒ１７	買建	28	281,550,863	280,957,418	0.10%
	シドニー先物取引所	ＳＰＩ ２００ ＦＵＴＵＲＥＳ Ｍａｒ１７	買建	13	157,205,685	156,785,947	0.06%
	モントリオール取引所	Ｓ＆Ｐ／ＴＳＥ ６０ ＩＸ ＦＵＴ Ｍａｒ１７	買建	9	142,089,116	142,115,153	0.05%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	－	アメリカ・ドル買／円売２０１７年０２月	買建	5,978,000	685,833,223	680,296,400	0.27%
		ユーロ買／円売２０１７年０２月	買建	4,465,000	549,440,575	543,613,750	0.22%
		イギリス・ポンド買／円売２０１７年０２月	買建	949,000	137,065,019	135,156,580	0.05%
		デンマーク・クローネ売／円買２０１７年０２月	売建	4,407,000	72,142,590	72,142,590	△0.03%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	ＭＩＮＩ　ＭＳＣＩ　ＥＭＧ　ＭＫＴ　Ｍａｒ１７	買建	285	1,437,888,059	1,481,831,807	3.60%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	－	アメリカ・ドル買／円売２０１７年０２月	買建	72,900,000	8,362,895,420	8,296,020,000	12.02%

（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。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（平成29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27年1月13日)	1	1	1.0475	1.0475
第2計算期間末 (平成27年7月13日)	4	4	1.0599	1.0599
第3計算期間末 (平成28年1月12日)	6	6	1.0080	1.0080
第4計算期間末 (平成28年7月11日)	7	7	0.9741	0.9741
第5計算期間末 (平成29年1月11日)	10	10	1.0281	1.0281
平成28年1月末日	7	－	1.0069	－
2月末日	7	－	0.9918	－
3月末日	7	－	0.9937	－
4月末日	8	－	0.9972	－
5月末日	8	－	0.9964	－
6月末日	7	－	0.9749	－
7月末日	8	－	0.9834	－
8月末日	9	－	0.9822	－
9月末日	9	－	0.9758	－
10月末日	9	－	0.9851	－
11月末日	10	－	1.0022	－
12月末日	10	－	1.0229	－
平成29年1月末日	10	－	1.0211	－

②【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

③【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.8
第2計算期間	1.2
第3計算期間	△4.9
第4計算期間	△3.4
第5計算期間	5.5

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	1,672,022	4,000
第2計算期間	2,911,420	174,376
第3計算期間	2,494,725	145,687
第4計算期間	2,261,885	895,972
第5計算期間	2,145,720	0

（注）　本邦外における設定及び解約はございません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日：2017年1月31日

基準価額・純資産の推移

（設定日(2014年9月12日)～2017年1月31日）

※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものとして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：2014年9月12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	(2015.01.13)	0円
第2期	(2015.07.13)	0円
第3期	(2016.01.12)	0円
第4期	(2016.07.11)	0円
第5期	(2017.01.11)	0円
設定来累計		0円

(注1)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

組入銘柄一覧 (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。

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.60%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.46%
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	7.57%
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	3.90%
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	3.80%
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	3.78%

■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		83.77
	内　日本	83.77
地方債証券		6.26
	内　日本	6.26
特殊債券		4.96
	内　日本	4.96
社債券		4.47
	内　日本	4.39
	内　オランダ	0.05
	内　イギリス	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		0.54
純資産総額		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	129回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2021/9/20	1.19%
2	124回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.19%
3	122回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.19%
4	343回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/6/20	1.18%
5	118回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.11%

■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		96.28
	内　日本	96.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3.72
純資産総額		100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.61

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.47%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.37%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.71%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.68%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.53%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.16%
2	輸送用機器	9.09%
3	銀行業	8.21%
4	情報・通信業	7.72%
5	化学	6.44%

○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：2017年1月31日

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
国債証券		96.65
	内　アメリカ	43.25
	内　フランス	9.51
	内　イタリア	9.18
	内　ドイツ	7.21
	内　イギリス	6.90
	内　その他	20.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3.35
純資産総額		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	1.61%
2	US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/8/15	0.96%
3	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.82%
4	US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	アメリカ	1.500000	2018/12/31	0.77%
5	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.77%

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）	0.54
為替予約取引（売建）	△0.03

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
株式		95.98
	内　アメリカ	59.47
	内　イギリス	6.71
	内　カナダ	4.01
	内　スイス	3.73
	内　ドイツ	3.69
	内　その他	18.37
投資信託受益証券		0.30
	内　オーストラリア	0.25
	内　シンガポール	0.05
投資証券		2.26
	内　アメリカ	1.97
	内　フランス	0.13
	内　イギリス	0.09
	内　香港	0.05
	内　カナダ	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1.47
純資産総額		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.06%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.51%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.10%
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.05%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.98%

組入上位5業種（外国株式）

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	9.60%
2	石油・ガス・消耗燃料	6.59%
3	医薬品	5.62%
4	保険	4.17%
5	ソフトウェア	3.50%

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）	0.12
為替予約取引（売建）	△0.05
株価指数先物取引（買建）	1.38

○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：2017年1月31日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
国債証券		96.50
	内 トルコ	14.29
	内 メキシコ	12.61
	内 ロシア	12.56
	内 ブラジル	9.64
	内 インドネシア	9.41
	内 その他	37.99
コールローン、その他の資産（負債控除後）		3.50
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	4.60%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	国債証券	ロシア	11.000000	2018/7/24	1.58%
3	PERU 8.75 11/21/33	国債証券	ペルー	8.750000	2033/11/21	1.54%
4	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.45%
5	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.33%

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)	12.02

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
株式		95.46
	内 韓国	14.24
	内 台湾	11.52
	内 ケイマン諸島	11.27
	内 中国	9.93
	内 インド	8.04
	内 その他	40.46
投資信託受益証券		0.62
	内 メキシコ	0.62
投資証券		0.23
	内 南アフリカ	0.11
	内 メキシコ	0.09
	内 トルコ	0.04
コールローン、その他の資産（負債控除後）		3.69
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	3.92%
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	3.46%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.35%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	2.62%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.62%

組入上位5業種（外国株式）

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	16.15%
2	インターネットソフトウェア・サービス	8.31%
3	石油・ガス・消耗燃料	7.36%
4	コンピュータ・周辺機器	5.58%
5	半導体・半導体製造装置	5.02%

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)	3.60

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して算出しております。
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2014年は設定日から年末までの収益率、および2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を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３【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報　第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

＜更新・訂正後＞

（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28年7月12日から平成29年1月11日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 平成28年7月11日現在	第5期 平成29年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,040,933	1,660,320
特殊債券	2,071,620	―
親投資信託受益証券	833,937	8,950,268
未収利息	10,094	―
流動資産合計	7,956,584	10,610,588
資産合計	7,956,584	10,610,588
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,079	2,510
未払委託者報酬	44,485	53,628
その他未払費用	180	184
流動負債合計	46,744	56,322
負債合計	46,744	56,322
純資産の部		
元本等		
元本	※1 8,120,017	※1 10,265,737
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △210,177	※2 288,529
（分配準備積立金）	67,820	134,733
元本等合計	7,909,840	10,554,266
純資産合計	7,909,840	10,554,266
負債純資産合計	7,956,584	10,610,588

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	第5期 自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
営業収益		
受取利息	26,233	13,922
有価証券売買等損益	△252,367	562,211
営業収益合計	△226,134	576,133
営業費用		
支払利息	519	797
受託者報酬	2,079	2,510
委託者報酬	44,485	53,628
その他費用	181	184
営業費用合計	47,264	57,119
営業利益又は営業損失（△）	△273,398	519,014
経常利益又は経常損失（△）	△273,398	519,014
当期純利益又は当期純損失（△）	△273,398	519,014
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（△）	△22,882	－
期首剰余金又は期首欠損金（△）	54,051	△210,177
剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,712	20,308
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,003	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,709	20,308
分配金	※1　－	※1　－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△210,177	288,529

（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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4期 平成28年7月11日現在	第5期 平成29年1月11日現在
１．　※１　期首元本額	6,754,104円	8,120,017円
期中追加設定元本額	2,261,885円	2,145,720円
期中一部解約元本額	895,972円	－円
２．　受益権の総数	8,120,017口	10,265,737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210,177円であります。	―――――――

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第4期 自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	第5期 自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（303,496円）及び分配準備積立金（67,820円）より分配対象収益は371,316円（1万口当たり457.28円）でありますが、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（66,913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（403,280円）及び分配準備積立金（67,820円）より分配対象収益は538,013円（1万口当たり524.09円）でありますが、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 自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	第5期 自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これら(親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む)は、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	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、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。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 平成28年7月11日現在	第5期 平成29年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期 平成28年7月11日現在	第5期 平成29年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
特殊債券	△11,420	－
親投資信託受益証券	△33,648	508,495
合計	△45,068	508,495

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 平成28年7月11日現在	第5期 平成29年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9741円 (9,741円)	1.0281円 (10,281円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

種　類	銘　柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	834,609	1,914,008	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,612,582	2,064,911	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	325,530	969,656	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,247,813	2,211,249	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	916,238	899,195	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	484,717	891,249	
親投資信託受益証券　合計		5,421,489	8,950,268	
合計		5,421,489	8,950,268	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,828,226,218	9,742,283,611
株式	※２	269,406,635,500	290,967,130,996
派生商品評価勘定		50,151,548	48,038,424
未収入金		―	723,088
未収配当金		377,127,537	382,674,497
前払金		31,495,000	―
流動資産合計		271,693,635,803	301,140,850,616
資産合計		271,693,635,803	301,140,850,616
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		61,296	3,123,328
前受金		―	7,256,000
未払解約金		134,055,000	230,382,000
流動負債合計		134,116,296	240,761,328
負債合計		134,116,296	240,761,328
純資産の部			
元本等			
元本	※１	147,673,783,029	131,210,790,341
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		123,885,736,478	169,689,298,947
元本等合計		271,559,519,507	300,900,089,288
純資産合計		271,559,519,507	300,900,089,288
負債純資産合計		271,693,635,803	301,140,850,616

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	137,895,802,136円	147,673,783,029円
同期中追加設定元本額	29,768,712,440円	9,639,079,750円
同期中一部解約元本額	19,990,731,547円	26,102,072,438円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	6,375,520,105円	6,264,153,363円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	1,517,074,465円	1,939,783,051円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	9,129,781円	4,829,084円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	18,120,418円	12,125,194円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	38,387,875円	25,790,682円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	19,030,231円	14,387,127円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	16,030,252円	11,695,488円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,535,935円	13,446,785円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	38,875,576,225円	37,202,520,698円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	919,699,441円	834,342,825円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,081,394,557円	2,934,010,309円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,096,646,645円	2,972,946,997円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	408,716,759円	388,762,191円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,309,764,939円	1,259,504,097円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,144,685,427円	1,110,130,669円	
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	64,694,612円	59,701,755円	
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,345,850,624円	1,326,073,224円	
マネックス資産設計ファンドエボリューション	30,643,797円	31,399,302円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	30,983,724円	34,624,546円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	64,287,197円	67,708,056円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	125,235,921円	135,592,368円	
投資のソムリエ	1,071,677,253円	1,657,754,563円	
クルーズコントロール	339,669,799円	2,114,151,120円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	24,728,210円	49,029,800円	
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	107,114,949円	111,573,577円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	78,510,194円	117,305,991円	
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	91,475円	834,609円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	3,858,249円	23,449,979円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	6,868,427円	52,178,275円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	3,612,277円	14,041,767円	
ダイナミック・ナビゲーション	433,022円	1,946,192円	
リスク抑制世界８資産バランスファンド	－円	308,417円	
ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	250,610,082円	297,550,647円	
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	124,900,758円	89,036,727円	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	295,019,238円	221,073,539円	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	479,199,961円	420,742,486円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	37,607,363円	28,397,862円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	149,336,920円	123,576,045円	

ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	39,191,992円	30,732,422円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,896,174円	34,193,002円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,943,186,781円	1,475,082,939円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,395,832,066円	565,911,402円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,986,426,285円	1,538,646,735円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,621,942,721円	1,345,964,796円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,256,723,178円	3,664,912,196円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	351,862,082円	286,143,893円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	890,989,010円	524,618,280円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,034,171,932円	833,834,770円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	4,234,272,836円	3,287,226,831円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	46,003,219円	51,147,517円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,490,614,509円	1,122,253,720円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,637,233,765円	4,941,715,812円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,802,924,565円	19,074,904,863円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	834,560,866円	705,123,751円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,618,968,856円	2,158,376,756円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,367,734,306円	12,087,103,172円	
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,463,623円	6,771,701円	

	ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,687,271円	563,380円
	ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,287,419円	5,160,286円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,955,028,403円	10,838,905,774円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	117,577,546円	97,767,082円
	ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	46,345,852円	34,287,827円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,758,274円	37,297,374円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	85,470円	73,509円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	134,219円	119,094円
	ＤＩＡＭ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）	729,123,003円	621,830,741円
	ＤＩＡＭ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）	1,971,158,603円	1,622,373,744円
	ＤＩＡＭ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）	2,597,804,800円	2,159,696,264円
	ＤＩＡＭ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）	105,546,296円	91,571,301円
	計	147,673,783,029円	131,210,790,341円
２．	受益権の総数	147,673,783,029口	131,210,790,341口
３．	※２　差入代用有価証券	株式　2,650,500,000円	株式　3,456,000,000円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△25,475,911,220	32,981,281,426
合計	△25,475,911,220	32,981,281,426

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月9日から平成28年7月11日まで及び平成28年2月9日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成28年7月11日 現在				平成29年1月11日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	3,433,095,000	－	3,483,275,000	50,180,000	8,412,448,000	－	8,457,540,000	45,092,000
合計	3,433,095,000	－	3,483,275,000	50,180,000	8,412,448,000	－	8,457,540,000	45,092,000

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8389円 (18,389円)	2.2933円 (22,933円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
（１）株式

平成29年1月11日現在

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
極洋	5,800	2,745.00	15,921,000	
日本水産	187,400	553.00	103,632,200	
マルハニチロ	27,400	3,185.00	87,269,000	
ホウスイ	12,000	134.00	1,608,000	
カネコ種苗	5,100	1,563.00	7,971,300	
サカタのタネ	21,300	3,220.00	68,586,000	
ホクト	14,700	2,109.00	31,002,300	
ホクリヨウ	1,800	754.00	1,357,200	
ショーボンドホールディングス	15,100	4,985.00	75,273,500	
ミライト・ホールディングス	44,400	1,069.00	47,463,600	
タマホーム	11,000	553.00	6,083,000	
サンヨーホームズ	3,400	659.00	2,240,600	
住石ホールディングス	40,900	97.00	3,967,300	
日鉄鉱業	4,000	5,670.00	22,680,000	
三井松島産業	8,900	1,317.00	11,721,300	
国際石油開発帝石	759,500	1,151.50	874,564,250	
日本海洋掘削	5,000	2,444.00	12,220,000	
石油資源開発	22,800	2,596.00	59,188,800	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	9,700	1,819.00	17,644,300	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	1,521.00	5,171,400	
安藤・間	103,600	785.00	81,326,000	
東急建設	51,100	949.00	48,493,900	
コムシスホールディングス	56,300	2,159.00	121,551,700	
ミサワホーム	17,000	1,102.00	18,734,000	
ビーアールホールディングス	13,200	267.00	3,524,400	
高松コンストラクショングループ	10,900	2,480.00	27,032,000	
東建コーポレーション	5,900	8,380.00	49,442,000	
ヤマウラ	7,100	578.00	4,103,800	
大成建設	733,000	846.00	620,118,000	
大林組	432,400	1,104.00	477,369,600	
清水建設	441,000	1,082.00	477,162,000	
飛島建設	139,000	185.00	25,715,000	
長谷工コーポレーション	168,200	1,263.00	212,436,600	
松井建設	15,900	1,066.00	16,949,400	
錢高組	21,000	497.00	10,437,000	
鹿島建設	634,000	825.00	523,050,000	
不動テトラ	116,700	215.00	25,090,500	
大末建設	5,100	991.00	5,054,100	
鉄建建設	88,000	350.00	30,800,000	
西松建設	166,000	592.00	98,272,000	
三井住友建設	551,900	124.00	68,435,600	
大豊建設	52,000	561.00	29,172,000	
前田建設工業	89,000	1,046.00	93,094,000	

佐田建設	10,100	450.00	4,545,000	
ナカノフドー建設	11,100	610.00	6,771,000	
奥村組	118,000	675.00	79,650,000	
東鉄工業	17,300	3,150.00	54,495,000	
イチケン	13,000	453.00	5,889,000	
淺沼組	46,000	366.00	16,836,000	
戸田建設	168,000	653.00	109,704,000	
熊谷組	226,000	306.00	69,156,000	
青木あすなろ建設	9,500	814.00	7,733,000	
北野建設	30,000	329.00	9,870,000	
植木組	18,000	265.00	4,770,000	
三井ホーム	19,000	531.00	10,089,000	
矢作建設工業	19,700	1,106.00	21,788,200	
ピーエス三菱	15,200	397.00	6,034,400	
日本ハウスホールディングス	29,400	527.00	15,493,800	
大東建託	53,000	17,700.00	938,100,000	
新日本建設	17,200	947.00	16,288,400	
ＮＩＰＰＯ	33,000	2,202.00	72,666,000	
東亜道路工業	27,000	355.00	9,585,000	
前田道路	45,000	2,001.00	90,045,000	
日本道路	43,000	461.00	19,823,000	
東亜建設工業	11,700	2,013.00	23,552,100	
若築建設	84,000	157.00	13,188,000	
東洋建設	41,500	420.00	17,430,000	
五洋建設	160,100	575.00	92,057,500	
大林道路	15,000	715.00	10,725,000	
世紀東急工業	21,000	506.00	10,626,000	
福田組	23,000	1,149.00	26,427,000	
日本ドライケミカル	1,800	2,413.00	4,343,400	
住友林業	99,200	1,580.00	156,736,000	
日本基礎技術	16,300	363.00	5,916,900	
日成ビルド工業	43,000	568.00	24,424,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	76,000	83.00	6,308,000	
巴コーポレーション	18,100	374.00	6,769,400	
パナホーム	54,000	966.00	52,164,000	
大和ハウス工業	425,900	3,292.00	1,402,062,800	
ライト工業	27,700	1,215.00	33,655,500	
積水ハウス	453,600	1,968.00	892,684,800	
日特建設	12,500	482.00	6,025,000	
北陸電気工事	7,100	921.00	6,539,100	
ユアテック	23,000	818.00	18,814,000	
西部電気工業	2,400	2,272.00	5,452,800	
四電工	6,000	445.00	2,670,000	
中電工	18,200	2,567.00	46,719,400	
関電工	57,000	1,074.00	61,218,000	
きんでん	95,900	1,480.00	141,932,000	
東京エネシス	15,000	1,045.00	15,675,000	
トーエネック	20,000	579.00	11,580,000	
住友電設	10,000	1,300.00	13,000,000	
日本電設工業	23,500	1,897.00	44,579,500	

協和エクシオ	56,500	1,716.00	96,954,000	
新日本空調	11,200	1,272.00	14,246,400	
日本工営	9,000	2,564.00	23,076,000	
ＮＤＳ	2,300	2,955.00	6,796,500	
九電工	28,000	3,175.00	88,900,000	
三機工業	32,000	1,004.00	32,128,000	
日揮	134,500	2,106.00	283,257,000	
中外炉工業	44,000	232.00	10,208,000	
ヤマト	13,200	582.00	7,682,400	
太平電業	20,000	1,147.00	22,940,000	
高砂熱学工業	39,700	1,539.00	61,098,300	
三晃金属工業	1,300	3,270.00	4,251,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	13,900	2,190.00	30,441,000	
朝日工業社	3,200	2,980.00	9,536,000	
明星工業	26,200	594.00	15,562,800	
大氣社	19,100	2,895.00	55,294,500	
ダイダン	19,000	960.00	18,240,000	
日比谷総合設備	16,100	1,694.00	27,273,400	
東芝プラントシステム	23,400	1,636.00	38,282,400	
日本製粉	42,900	1,662.00	71,299,800	
日清製粉グループ本社	158,200	1,755.00	277,641,000	
日東富士製粉	800	3,850.00	3,080,000	
昭和産業	60,000	612.00	36,720,000	
鳥越製粉	11,800	785.00	9,263,000	
中部飼料	15,900	1,029.00	16,361,100	
フィード・ワン	87,700	169.00	14,821,300	
東洋精糖	24,000	116.00	2,784,000	
日本甜菜製糖	7,400	2,393.00	17,708,200	
三井製糖	10,300	2,515.00	25,904,500	
塩水港精糖	16,300	253.00	4,123,900	
日新製糖	6,100	1,710.00	10,431,000	
ネクスト	33,400	810.00	27,054,000	
ジェイエイシーリクルートメント	8,300	1,345.00	11,163,500	
日本Ｍ＆Ａセンター	38,800	3,315.00	128,622,000	
アコーディア・ゴルフ	40,700	1,202.00	48,921,400	
中広	1,400	694.00	971,600	
タケエイ	11,900	990.00	11,781,000	
トラスト・テック	5,500	1,763.00	9,696,500	
コシダカホールディングス	4,600	2,228.00	10,248,800	
パソナグループ	11,700	830.00	9,711,000	
ＣＤＳ	3,400	1,037.00	3,525,800	
リンクアンドモチベーション	29,800	432.00	12,873,600	
ＧＣＡ	12,000	851.00	10,212,000	
エス・エム・エス	18,500	2,692.00	49,802,000	
テンプホールディングス	104,000	1,898.00	197,392,000	
リニカル	8,000	1,382.00	11,056,000	
クックパッド	30,000	1,065.00	31,950,000	
エスクリ	4,900	623.00	3,052,700	
アイ・ケイ・ケイ	6,200	697.00	4,321,400	
森永製菓	28,200	4,745.00	133,809,000	

中村屋	3,400	5,140.00	17,476,000	
江崎グリコ	36,100	5,440.00	196,384,000	
名糖産業	6,400	1,417.00	9,068,800	
不二家	83,000	220.00	18,260,000	
山崎製パン	105,700	2,241.00	236,873,700	
第一屋製パン	24,000	135.00	3,240,000	
モロゾフ	23,000	528.00	12,144,000	
亀田製菓	8,100	5,360.00	43,416,000	
寿スピリッツ	10,300	2,723.00	28,046,900	
カルビー	58,800	3,605.00	211,974,000	
森永乳業	130,000	832.00	108,160,000	
六甲バター	6,500	2,430.00	15,795,000	
ヤクルト本社	77,300	5,490.00	424,377,000	
明治ホールディングス	85,400	9,100.00	777,140,000	
雪印メグミルク	31,100	3,205.00	99,675,500	
プリマハム	91,000	424.00	38,584,000	
日本ハム	98,000	3,145.00	308,210,000	
林兼産業	4,700	874.00	4,107,800	
丸大食品	69,000	492.00	33,948,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7,800	2,982.00	23,259,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	83,300	1,058.00	88,131,400	
学情	5,500	1,240.00	6,820,000	
スタジオアリス	5,500	2,227.00	12,248,500	
シミックホールディングス	6,900	1,543.00	10,646,700	
システナ	10,200	1,796.00	18,319,200	
ＮＪＳ	3,100	1,357.00	4,206,700	
デジタルアーツ	5,700	2,686.00	15,310,200	
新日鉄住金ソリューションズ	21,200	2,158.00	45,749,600	
綜合警備保障	48,900	4,550.00	222,495,000	
キューブシステム	5,800	691.00	4,007,800	
いちご	120,700	459.00	55,401,300	
日本駐車場開発	153,400	166.00	25,464,400	
コア	5,400	1,245.00	6,723,000	
カカクコム	96,000	1,966.00	188,736,000	
アイロムグループ	3,900	1,396.00	5,444,400	
ルネサンス	7,000	1,526.00	10,682,000	
ディップ	17,400	2,465.00	42,891,000	
ＳＢＳホールディングス	12,800	821.00	10,508,800	
オプトホールディング	9,300	739.00	6,872,700	
新日本科学	13,900	616.00	8,562,400	
ツクイ	32,000	787.00	25,184,000	
キャリアデザインセンター	2,900	1,346.00	3,903,400	
エムスリー	116,500	3,150.00	366,975,000	
ツカダ・グローバルホールディング	9,900	674.00	6,672,600	
アウトソーシング	7,700	3,750.00	28,875,000	
ウェルネット	10,200	1,370.00	13,974,000	
ワールドホールディングス	3,100	2,099.00	6,506,900	
ディー・エヌ・エー	60,300	2,707.00	163,232,100	
博報堂ＤＹホールディングス	186,400	1,474.00	274,753,600	
ぐるなび	19,500	2,391.00	46,624,500	

エスアールジータカミヤ	14,700	625.00	9,187,500	
ジャパンベストレスキューシステム	17,300	247.00	4,273,100	
ファンコミュニケーションズ	34,200	752.00	25,718,400	
ライク	2,900	2,090.00	6,061,000	
ＷＤＢホールディングス	4,900	1,346.00	6,595,400	
ティア	6,800	647.00	4,399,600	
バリューコマース	12,900	338.00	4,360,200	
インフォマート	57,200	687.00	39,296,400	
サッポロホールディングス	47,300	3,035.00	143,555,500	
アサヒグループホールディングス	270,600	3,763.00	1,018,267,800	
キリンホールディングス	620,900	1,937.00	1,202,683,300	
宝ホールディングス	104,500	1,071.00	111,919,500	
オエノンホールディングス	38,000	274.00	10,412,000	
養命酒製造	4,600	1,881.00	8,652,600	
コカ・コーラウエスト	48,900	3,355.00	164,059,500	
コカ・コーライーストジャパン	56,200	2,503.00	140,668,600	
サントリー食品インターナショナル	98,800	4,860.00	480,168,000	
ダイドードリンコ	6,700	6,120.00	41,004,000	
伊藤園	42,800	3,875.00	165,850,000	
キーコーヒー	12,800	2,237.00	28,633,600	
ユニカフェ	4,200	980.00	4,116,000	
ジャパンフーズ	2,100	1,266.00	2,658,600	
日清オイリオグループ	83,000	564.00	46,812,000	
不二製油グループ本社	38,500	2,380.00	91,630,000	
Ｊ－オイルミルズ	6,700	4,020.00	26,934,000	
ローソン	44,100	8,200.00	361,620,000	
サンエー	9,600	5,500.00	52,800,000	
カワチ薬品	9,800	3,040.00	29,792,000	
エービーシー・マート	23,100	6,600.00	152,460,000	
ハードオフコーポレーション	5,700	1,209.00	6,891,300	
高千穂交易	5,200	1,021.00	5,309,200	
アスクル	15,500	3,910.00	60,605,000	
ゲオホールディングス	21,200	1,376.00	29,171,200	
アダストリア	19,500	3,165.00	61,717,500	
ジーフット	7,700	843.00	6,491,100	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,900	730.00	1,387,000	
伊藤忠食品	3,200	4,420.00	14,144,000	
くらコーポレーション	8,300	4,855.00	40,296,500	
キャンドゥ	6,700	1,735.00	11,624,500	
エレマテック	5,100	2,012.00	10,261,200	
パルグループホールディングス	6,500	3,055.00	19,857,500	
ＪＡＬＵＸ	4,100	2,099.00	8,605,900	
エディオン	49,200	1,123.00	55,251,600	
あらた	5,700	2,746.00	15,652,200	
サーラコーポレーション	16,000	647.00	10,352,000	
ワッツ	5,600	1,117.00	6,255,200	
トーメンデバイス	1,900	2,090.00	3,971,000	
ハローズ	4,200	2,388.00	10,029,600	
ＪＰホールディングス	38,800	272.00	10,553,600	
あみやき亭	2,500	3,990.00	9,975,000	

東京エレクトロン　デバイス	4,700	1,606.00	7,548,200	
ひらまつ	17,600	677.00	11,915,200	
フィールズ	9,700	1,393.00	13,512,100	
双日	749,600	296.00	221,881,600	
ゲンキー	2,500	5,900.00	14,750,000	
アルフレッサ　ホールディングス	150,300	1,946.00	292,483,800	
大黒天物産	3,000	5,120.00	15,360,000	
ハニーズ	11,200	1,155.00	12,936,000	
ファーマライズホールディングス	3,100	531.00	1,646,100	
キッコーマン	101,000	3,710.00	374,710,000	
味の素	297,100	2,327.00	691,351,700	
キユーピー	73,400	2,795.00	205,153,000	
ハウス食品グループ本社	53,400	2,433.00	129,922,200	
カゴメ	51,800	2,942.00	152,395,600	
焼津水産化学工業	7,100	1,164.00	8,264,400	
アリアケジャパン	11,800	6,140.00	72,452,000	
ピエトロ	1,700	1,645.00	2,796,500	
エバラ食品工業	3,600	2,075.00	7,470,000	
ニチレイ	71,000	2,406.00	170,826,000	
横浜冷凍	31,600	1,033.00	32,642,800	
東洋水産	70,900	4,130.00	292,817,000	
イートアンド	1,800	2,188.00	3,938,400	
日清食品ホールディングス	56,300	6,130.00	345,119,000	
永谷園ホールディングス	7,000	1,424.00	9,968,000	
一正蒲鉾	5,100	1,144.00	5,834,400	
フジッコ	14,000	2,403.00	33,642,000	
ロック・フィールド	15,100	1,552.00	23,435,200	
日本たばこ産業	799,100	3,861.00	3,085,325,100	
ケンコーマヨネーズ	5,000	3,190.00	15,950,000	
わらべや日洋ホールディングス	8,500	2,431.00	20,663,500	
なとり	7,300	1,927.00	14,067,100	
北の達人コーポレーション	3,100	515.00	1,596,500	
ユーグレナ	46,400	1,281.00	59,438,400	
片倉工業	16,900	1,373.00	23,203,700	
グンゼ	101,000	404.00	40,804,000	
ヒューリック	264,800	1,059.00	280,423,200	
神栄	18,000	185.00	3,330,000	
山下医科器械	1,100	1,782.00	1,960,200	
ラサ商事	5,800	624.00	3,619,200	
アルペン	11,300	2,080.00	23,504,000	
ラクーン	5,600	480.00	2,688,000	
クオール	14,400	1,492.00	21,484,800	
アルコニックス	7,300	1,708.00	12,468,400	
神戸物産	6,900	4,110.00	28,359,000	
ジェイアイエヌ	8,600	5,860.00	50,396,000	
ビックカメラ	72,900	1,086.00	79,169,400	
ＤＣＭホールディングス	77,000	1,061.00	81,697,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	45,000	2,609.00	117,405,000	
東京一番フーズ	2,400	561.00	1,346,400	
ダイヤモンドダイニング	2,900	1,312.00	3,804,800	

あい　ホールディングス	22,600	2,358.00	53,290,800	
ディーブイエックス	4,600	1,324.00	6,090,400	
きちり	3,900	672.00	2,620,800	
アークランドサービスホールディングス	4,000	2,922.00	11,688,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	160,700	1,714.00	275,439,800	
ドトール・日レスホールディングス	22,200	2,208.00	49,017,600	
マツモトキヨシホールディングス	24,000	5,800.00	139,200,000	
ブロンコビリー	6,600	2,917.00	19,252,200	
スタートトゥデイ	116,000	2,010.00	233,160,000	
トレジャー・ファクトリー	3,700	913.00	3,378,100	
物語コーポレーション	3,400	4,230.00	14,382,000	
ココカラファイン	13,200	4,500.00	59,400,000	
三越伊勢丹ホールディングス	252,600	1,336.00	337,473,600	
東洋紡	533,000	181.00	96,473,000	
ユニチカ	370,000	87.00	32,190,000	
富士紡ホールディングス	6,600	3,505.00	23,133,000	
日清紡ホールディングス	71,400	1,154.00	82,395,600	
倉敷紡績	136,000	240.00	32,640,000	
ダイワボウホールディングス	108,000	289.00	31,212,000	
シキボウ	73,000	153.00	11,169,000	
日東紡績	109,000	468.00	51,012,000	
トヨタ紡織	45,000	2,632.00	118,440,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	23,500	1,569.00	36,871,500	
Ｈａｍｅｅ	1,900	935.00	1,776,500	
ウエルシアホールディングス	12,600	7,170.00	90,342,000	
クリエイトＳＤホールディングス	18,700	2,576.00	48,171,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,300	1,012.00	23,579,600	
八洲電機	10,100	632.00	6,383,200	
ＵＫＣホールディングス	8,200	2,235.00	18,327,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	15,300	373.00	5,706,900	
ＯＣＨＩホールディングス	3,300	1,280.00	4,224,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	55,900	807.00	45,111,300	
ミサワ	1,800	527.00	948,600	
エー・ピーカンパニー	2,300	817.00	1,879,100	
三洋貿易	7,000	1,616.00	11,312,000	
チムニー	3,400	2,890.00	9,826,000	
シュッピン	4,900	1,437.00	7,041,300	
ビューティガレージ	1,200	1,118.00	1,341,600	
ウイン・パートナーズ	9,400	1,000.00	9,400,000	
ネクステージ	2,200	1,929.00	4,243,800	
ジョイフル本田	20,600	3,170.00	65,302,000	
鳥貴族	3,200	2,655.00	8,496,000	
キリン堂ホールディングス	4,100	870.00	3,567,000	
ホットランド	4,900	1,142.00	5,595,800	
すかいらーく	54,500	1,586.00	86,437,000	
綿半ホールディングス	5,100	1,682.00	8,578,200	
日本毛織	37,900	861.00	32,631,900	
ダイトウボウ	20,000	72.00	1,440,000	

トーア紡コーポレーション	5,800	551.00	3,195,800	
ダイドーリミテッド	15,500	419.00	6,494,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42,000	1,013.00	42,546,000	
三栄建築設計	5,100	1,759.00	8,970,900	
野村不動産ホールディングス	84,200	1,978.00	166,547,600	
三重交通グループホールディングス	22,700	398.00	9,034,600	
サムティ	10,100	1,162.00	11,736,200	
ディア・ライフ	8,800	390.00	3,432,000	
エー・ディー・ワークス	118,500	46.00	5,451,000	
日本商業開発	7,100	2,026.00	14,384,600	
プレサンスコーポレーション	19,800	1,432.00	28,353,600	
ユニゾホールディングス	10,500	3,175.00	33,337,500	
ＴＨＥグローバル社	4,900	461.00	2,258,900	
日本管理センター	9,200	1,357.00	12,484,400	
サンセイランディック	2,700	728.00	1,965,600	
エストラスト	2,400	692.00	1,660,800	
フージャースホールディングス	16,500	628.00	10,362,000	
オープンハウス	18,400	2,821.00	51,906,400	
東急不動産ホールディングス	307,100	700.00	214,970,000	
飯田グループホールディングス	105,900	2,288.00	242,299,200	
ムゲンエステート	4,000	764.00	3,056,000	
帝国繊維	14,100	1,574.00	22,193,400	
ブックオフコーポレーション	7,600	820.00	6,232,000	
日本コークス工業	109,500	108.00	11,826,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	941.00	3,669,900	
ミタチ産業	3,300	623.00	2,055,900	
ＢＥＥＮＯＳ	1,500	1,596.00	2,394,000	
あさひ	9,500	1,330.00	12,635,000	
日本調剤	4,500	4,555.00	20,497,500	
コスモス薬品	6,400	22,660.00	145,024,000	
シップヘルスケアホールディングス	24,400	3,015.00	73,566,000	
トーエル	6,200	978.00	6,063,600	
一六堂	3,600	398.00	1,432,800	
ソフトクリエイトホールディングス	6,200	1,352.00	8,382,400	
セブン＆アイ・ホールディングス	531,500	4,548.00	2,417,262,000	
薬王堂	6,400	2,265.00	14,496,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	34,100	1,054.00	35,941,400	
明治電機工業	4,300	1,219.00	5,241,700	
ツルハホールディングス	29,300	11,380.00	333,434,000	
デリカフーズ	3,000	1,004.00	3,012,000	
スターティア	2,600	534.00	1,388,400	
サンマルクホールディングス	8,200	3,545.00	29,069,000	
フェリシモ	3,700	1,008.00	3,729,600	
トリドールホールディングス	15,600	2,531.00	39,483,600	
帝人	110,100	2,436.00	268,203,600	
東レ	978,000	981.10	959,515,800	
クラレ	226,800	1,793.00	406,652,400	
旭化成	841,000	1,049.00	882,209,000	

サカイオーベックス	3,300	1,852.00	6,111,600	
稲葉製作所	7,300	1,376.00	10,044,800	
宮地エンジニアリンググループ	39,000	199.00	7,761,000	
トーカロ	8,900	2,564.00	22,819,600	
アルファ	4,600	1,122.00	5,161,200	
ＳＵＭＣＯ	140,700	1,532.00	215,552,400	
川田テクノロジーズ	2,500	8,400.00	21,000,000	
ファーストブラザーズ	1,400	1,848.00	2,587,200	
シーアールイー	1,900	1,538.00	2,922,200	
住江織物	34,000	254.00	8,636,000	
日本フエルト	7,900	512.00	4,044,800	
イチカワ	9,000	302.00	2,718,000	
エコナックホールディングス	44,000	58.00	2,552,000	
日東製網	1,500	2,192.00	3,288,000	
芦森工業	30,000	164.00	4,920,000	
アツギ	110,000	128.00	14,080,000	
コメダホールディングス	17,200	1,879.00	32,318,800	
サツドラホールディングス	1,700	2,023.00	3,439,100	
ダイユー・リックホールディングス	4,200	799.00	3,355,800	
バロックジャパンリミテッド	7,400	1,350.00	9,990,000	
クスリのアオキホールディングス	11,300	5,220.00	58,986,000	
ダイニック	27,000	188.00	5,076,000	
共和レザー	7,900	905.00	7,149,500	
セーレン	33,600	1,455.00	48,888,000	
ソトー	5,200	1,179.00	6,130,800	
東海染工	19,000	149.00	2,831,000	
小松精練	19,100	754.00	14,401,400	
ワコールホールディングス	80,000	1,378.00	110,240,000	
ホギメディカル	8,500	7,470.00	63,495,000	
レナウン	36,600	115.00	4,209,000	
クラウディア	3,600	560.00	2,016,000	
ＴＳＩホールディングス	55,300	727.00	40,203,100	
ＴＩＳ	42,100	2,516.00	105,923,600	
ネオス	4,200	446.00	1,873,200	
電算システム	4,500	1,732.00	7,794,000	
グリー	77,400	630.00	48,762,000	
コーエーテクモホールディングス	30,100	2,012.00	60,561,200	
三菱総合研究所	5,000	3,255.00	16,275,000	
ボルテージ	2,600	1,060.00	2,756,000	
電算	1,500	2,400.00	3,600,000	
ＡＧＳ	2,600	1,452.00	3,775,200	
ファインデックス	9,200	984.00	9,052,800	
ヒト・コミュニケーションズ	2,900	1,697.00	4,921,300	
ブレインパッド	2,000	1,391.00	2,782,000	
ＫＬａｂ	24,300	663.00	16,110,900	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,900	1,054.00	9,380,600	
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	907.00	1,904,700	
ネクソン	139,700	1,733.00	242,100,100	
アイスタイル	19,400	856.00	16,606,400	

エムアップ	3,700	650.00	2,405,000	
エイチーム	7,000	2,296.00	16,072,000	
テクノスジャパン	9,800	1,340.00	13,132,000	
ｅｎｉｓｈ	4,000	549.00	2,196,000	
コロプラ	35,300	1,010.00	35,653,000	
モバイルクリエイト	8,600	386.00	3,319,600	
オルトプラス	5,300	767.00	4,065,100	
ブロードリーフ	31,400	644.00	20,221,600	
ハーツユナイテッドグループ	6,700	1,717.00	11,503,900	
メディアドゥ	2,800	1,426.00	3,992,800	
ブイキューブ	7,100	678.00	4,813,800	
サイバーリンクス	2,000	1,050.00	2,100,000	
ディー・エル・イー	3,800	777.00	2,952,600	
フィックスターズ	1,800	3,720.00	6,696,000	
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	4,500	1,123.00	5,053,500	
オプティム	1,100	5,740.00	6,314,000	
特種東海製紙	7,900	3,995.00	31,560,500	
ベリサーブ	1,500	3,150.00	4,725,000	
ティーガイア	12,700	1,883.00	23,914,100	
日本アジアグループ	14,500	450.00	6,525,000	
豆蔵ホールディングス	9,500	1,011.00	9,604,500	
テクマトリックス	4,000	2,052.00	8,208,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	266,300	250.00	66,575,000	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	10,400	5,240.00	54,496,000	
ザッパラス	7,800	433.00	3,377,400	
インターネットイニシアティブ	18,700	1,795.00	33,566,500	
さくらインターネット	8,800	997.00	8,773,600	
ＧＭＯクラウド	2,900	1,367.00	3,964,300	
ＳＲＡホールディングス	6,700	2,619.00	17,547,300	
ＭＩＮＯＲＩソリューションズ	2,700	1,107.00	2,988,900	
システムインテグレータ	2,000	645.00	1,290,000	
朝日ネット	12,100	505.00	6,110,500	
アドソル日進	2,600	1,204.00	3,130,400	
フリービット	7,200	881.00	6,343,200	
コムチュア	2,200	3,465.00	7,623,000	
サイバーコム	1,600	969.00	1,550,400	
王子ホールディングス	527,000	506.00	266,662,000	
日本製紙	60,400	2,115.00	127,746,000	
三菱製紙	19,400	810.00	15,714,000	
北越紀州製紙	75,500	700.00	52,850,000	
中越パルプ工業	54,000	247.00	13,338,000	
巴川製紙所	22,000	228.00	5,016,000	
大王製紙	53,800	1,309.00	70,424,200	
メディカル・データ・ビジョン	2,100	2,593.00	5,445,300	
ｇｕｍｉ	13,200	905.00	11,946,000	
ＰＣＩホールディングス	1,500	2,649.00	3,973,500	
パイプドＨＤ	1,800	1,104.00	1,987,200	
ＬＩＮＥ	21,200	4,050.00	85,860,000	
レンゴー	130,100	666.00	86,646,600	

トーモク	43,000	337.00	14,491,000	
ザ・パック	9,600	2,766.00	26,553,600	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	10,734	849.00	9,113,166	
昭和電工	89,700	1,768.00	158,589,600	
住友化学	992,000	570.00	565,440,000	
住友精化	5,600	4,550.00	25,480,000	
日産化学工業	73,800	4,005.00	295,569,000	
ラサ工業	52,000	140.00	7,280,000	
クレハ	10,200	4,645.00	47,379,000	
多木化学	8,000	807.00	6,456,000	
テイカ	21,000	693.00	14,553,000	
石原産業	24,200	960.00	23,232,000	
片倉コープアグリ	17,000	235.00	3,995,000	
日東エフシー	8,000	937.00	7,496,000	
日本曹達	81,000	563.00	45,603,000	
東ソー	390,000	823.00	320,970,000	
トクヤマ	210,000	451.00	94,710,000	
セントラル硝子	137,000	548.00	75,076,000	
東亜合成	84,200	1,186.00	99,861,200	
大阪ソーダ	58,000	482.00	27,956,000	
関東電化工業	28,000	1,068.00	29,904,000	
デンカ	279,000	535.00	149,265,000	
イビデン	90,000	1,636.00	147,240,000	
信越化学工業	241,700	9,448.00	2,283,581,600	
日本カーバイド工業	46,000	157.00	7,222,000	
堺化学工業	50,000	403.00	20,150,000	
エア・ウォーター	111,100	2,159.00	239,864,900	
大陽日酸	103,900	1,358.00	141,096,200	
日本化学工業	50,000	244.00	12,200,000	
日本パーカライジング	68,800	1,396.00	96,044,800	
高圧ガス工業	20,000	771.00	15,420,000	
チタン工業	17,000	199.00	3,383,000	
四国化成工業	19,000	1,092.00	20,748,000	
戸田工業	27,000	289.00	7,803,000	
ステラ　ケミファ	6,400	3,290.00	21,056,000	
保土谷化学工業	4,700	2,760.00	12,972,000	
日本触媒	21,200	7,610.00	161,332,000	
大日精化工業	56,000	669.00	37,464,000	
カネカ	182,000	983.00	178,906,000	
協和発酵キリン	161,300	1,655.00	266,951,500	
三菱瓦斯化学	125,500	2,056.00	258,028,000	
三井化学	612,000	541.00	331,092,000	
ＪＳＲ	135,400	1,962.00	265,654,800	
東京応化工業	25,200	3,920.00	98,784,000	
大阪有機化学工業	8,900	1,012.00	9,006,800	
三菱ケミカルホールディングス	908,060	786.00	713,735,160	
ＫＨネオケム	16,500	1,240.00	20,460,000	
ダイセル	181,800	1,301.00	236,521,800	
住友ベークライト	119,000	665.00	79,135,000	
積水化学工業	305,900	1,894.00	579,374,600	

日本ゼオン	114,000	1,188.00	135,432,000	
アイカ工業	43,200	3,085.00	133,272,000	
宇部興産	679,000	261.00	177,219,000	
積水樹脂	20,800	1,859.00	38,667,200	
タキロン	28,000	531.00	14,868,000	
旭有機材	43,000	228.00	9,804,000	
日立化成	74,900	2,977.00	222,977,300	
ニチバン	13,000	857.00	11,141,000	
リケンテクノス	29,100	549.00	15,975,900	
大倉工業	32,000	512.00	16,384,000	
積水化成品工業	18,200	839.00	15,269,800	
群栄化学工業	3,200	3,415.00	10,928,000	
タイガースポリマー	6,700	824.00	5,520,800	
ミライアル	5,000	1,015.00	5,075,000	
ダイキアクシス	2,300	1,158.00	2,663,400	
ダイキョーニシカワ	23,700	1,435.00	34,009,500	
日本化薬	87,000	1,447.00	125,889,000	
カーリットホールディングス	12,700	563.00	7,150,100	
ＥＰＳホールディングス	16,700	1,390.00	23,213,000	
レッグス	3,000	851.00	2,553,000	
プレステージ・インターナショナル	19,200	821.00	15,763,200	
フェイス	3,500	1,292.00	4,522,000	
アミューズ	7,500	1,837.00	13,777,500	
野村総合研究所	94,930	3,610.00	342,697,300	
ドリームインキュベータ	4,100	2,044.00	8,380,400	
サイバネットシステム	10,400	674.00	7,009,600	
クイック	7,000	1,069.00	7,483,000	
ＴＡＣ	8,200	234.00	1,918,800	
ＣＥホールディングス	1,800	1,138.00	2,048,400	
ケネディクス	180,400	442.00	79,736,800	
電通	149,800	5,700.00	853,860,000	
インテージホールディングス	7,100	2,003.00	14,221,300	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,300	763.00	4,806,900	
東邦システムサイエンス	4,300	681.00	2,928,300	
ぴあ	4,100	2,966.00	12,160,600	
イオンファンタジー	4,000	3,340.00	13,360,000	
ソースネクスト	6,800	613.00	4,168,400	
シーティーエス	3,800	1,390.00	5,282,000	
ネクシィーズグループ	4,900	1,431.00	7,011,900	
メディカルシステムネットワーク	14,500	446.00	6,467,000	
日本精化	11,300	924.00	10,441,200	
扶桑化学工業	9,600	2,398.00	23,020,800	
ＡＤＥＫＡ	57,900	1,627.00	94,203,300	
日油	108,000	1,183.00	127,764,000	
ミヨシ油脂	51,000	148.00	7,548,000	
新日本理化	21,600	164.00	3,542,400	
ハリマ化成グループ	11,600	794.00	9,210,400	
花王	342,400	5,399.00	1,848,617,600	
第一工業製薬	30,000	392.00	11,760,000	
三洋化成工業	8,400	5,040.00	42,336,000	

武田薬品工業	505,300	4,970.00	2,511,341,000	
アステラス製薬	1,376,900	1,670.00	2,299,423,000	
大日本住友製薬	95,400	2,116.00	201,866,400	
塩野義製薬	182,400	5,716.00	1,042,598,400	
田辺三菱製薬	157,100	2,313.00	363,372,300	
わかもと製薬	7,000	250.00	1,750,000	
あすか製薬	14,700	1,817.00	26,709,900	
日本新薬	30,900	5,980.00	184,782,000	
ビオフェルミン製薬	2,200	3,030.00	6,666,000	
中外製薬	134,200	3,515.00	471,713,000	
科研製薬	25,200	6,320.00	159,264,000	
エーザイ	165,900	6,799.00	1,127,954,100	
理研ビタミン	4,300	4,550.00	19,565,000	
ロート製薬	66,000	1,898.00	125,268,000	
小野薬品工業	306,100	2,593.50	793,870,350	
久光製薬	38,000	6,060.00	230,280,000	
有機合成薬品工業	9,400	270.00	2,538,000	
持田製薬	9,200	8,530.00	78,476,000	
参天製薬	248,300	1,486.00	368,973,800	
扶桑薬品工業	4,600	2,886.00	13,275,600	
日本ケミファ	1,800	5,540.00	9,972,000	
ツムラ	45,300	3,285.00	148,810,500	
日医工	31,500	1,794.00	56,511,000	
テルモ	197,300	4,370.00	862,201,000	
みらかホールディングス	34,300	5,350.00	183,505,000	
キッセイ薬品工業	23,900	2,955.00	70,624,500	
生化学工業	25,000	1,768.00	44,200,000	
栄研化学	11,300	2,970.00	33,561,000	
日水製薬	5,500	1,302.00	7,161,000	
鳥居薬品	9,200	2,677.00	24,628,400	
ＪＣＲファーマ	10,400	2,964.00	30,825,600	
東和薬品	6,200	4,805.00	29,791,000	
富士製薬工業	4,400	2,826.00	12,434,400	
沢井製薬	22,900	6,520.00	149,308,000	
ゼリア新薬工業	27,600	1,823.00	50,314,800	
第一三共	396,600	2,498.00	990,706,800	
キョーリン製薬ホールディングス	32,900	2,655.00	87,349,500	
大幸薬品	6,700	1,851.00	12,401,700	
ダイト	7,500	2,290.00	17,175,000	
大塚ホールディングス	289,800	5,706.00	1,653,598,800	
大正製薬ホールディングス	28,800	9,850.00	283,680,000	
ペプチドリーム	22,900	6,190.00	141,751,000	
大日本塗料	77,000	245.00	18,865,000	
日本ペイントホールディングス	104,000	3,235.00	336,440,000	
関西ペイント	141,600	2,217.00	313,927,200	
神東塗料	11,000	222.00	2,442,000	
中国塗料	38,600	870.00	33,582,000	
日本特殊塗料	9,500	1,741.00	16,539,500	
藤倉化成	18,300	651.00	11,913,300	
太陽ホールディングス	11,000	4,725.00	51,975,000	

ＤＩＣ	53,200	3,625.00	192,850,000	
サカタインクス	27,500	1,463.00	40,232,500	
東洋インキＳＣホールディングス	133,000	553.00	73,549,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	9,800	1,060.00	10,388,000	
アルプス技研	5,400	2,597.00	14,023,800	
サニックス	22,000	200.00	4,400,000	
ダイオーズ	2,700	1,067.00	2,880,900	
日本空調サービス	12,800	627.00	8,025,600	
オリエンタルランド	145,300	6,681.00	970,749,300	
フォーカスシステムズ	5,100	514.00	2,621,400	
ダスキン	34,400	2,408.00	82,835,200	
パーク２４	64,400	3,165.00	203,826,000	
明光ネットワークジャパン	16,700	1,181.00	19,722,700	
ファルコホールディングス	6,400	1,507.00	9,644,800	
クレスコ	2,900	2,447.00	7,096,300	
フジ・メディア・ホールディングス	132,100	1,696.00	224,041,600	
秀英予備校	2,900	441.00	1,278,900	
田谷	2,800	646.00	1,808,800	
ラウンドワン	42,000	811.00	34,062,000	
リゾートトラスト	52,100	2,234.00	116,391,400	
オービック	43,800	5,190.00	227,322,000	
ジャストシステム	20,600	1,180.00	24,308,000	
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	5,700	1,177.00	6,708,900	
ヤフー	910,900	477.00	434,499,300	
ビー・エム・エル	17,600	2,814.00	49,526,400	
ワタベウェディング	2,100	428.00	898,800	
トレンドマイクロ	67,300	4,240.00	285,352,000	
りらいあコミュニケーションズ	22,200	1,163.00	25,818,600	
インフォメーション・ディベロプメント	3,750	1,198.00	4,492,500	
リソー教育	22,900	618.00	14,152,200	
日本オラクル	20,400	6,120.00	124,848,000	
早稲田アカデミー	2,000	1,042.00	2,084,000	
アルファシステムズ	4,300	2,006.00	8,625,800	
フューチャー	16,800	773.00	12,986,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,600	922.00	8,851,200	
ソフトバンク・テクノロジー	3,000	3,620.00	10,860,000	
トーセ	3,600	853.00	3,070,800	
ユー・エス・エス	162,700	1,921.00	312,546,700	
オービックビジネスコンサルタント	6,500	5,200.00	33,800,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	28,800	3,055.00	87,984,000	
アイティフォー	16,800	630.00	10,584,000	
東京個別指導学院	4,400	918.00	4,039,200	
東計電算	2,300	2,140.00	4,922,000	
サイバーエージェント	70,800	2,969.00	210,205,200	
楽天	686,800	1,216.50	835,492,200	
エックスネット	1,300	1,896.00	2,464,800	
クリーク・アンド・リバー社	4,900	901.00	4,414,900	
テー・オー・ダブリュー	10,900	668.00	7,281,200	
大塚商会	34,200	5,450.00	186,390,000	

総合メディカル	6,200	4,285.00	26,567,000	
サイボウズ	17,200	469.00	8,066,800	
ソフトブレーン	17,500	430.00	7,525,000	
セントラルスポーツ	4,600	2,960.00	13,616,000	
パラカ	3,700	2,104.00	7,784,800	
電通国際情報サービス	7,900	1,863.00	14,717,700	
デジタルガレージ	19,900	2,062.00	41,033,800	
イーエムシステムズ	4,400	1,673.00	7,361,200	
ウェザーニューズ	4,300	3,565.00	15,329,500	
ＣＩＪ	11,900	527.00	6,271,300	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,527.00	2,290,500	
日本エンタープライズ	13,400	283.00	3,792,200	
WOWOW	6,100	3,400.00	20,740,000	
スカラ	8,000	813.00	6,504,000	
フルキャストホールディングス	13,500	982.00	13,257,000	
富士フイルムホールディングス	267,300	4,480.00	1,197,504,000	
コニカミノルタ	301,200	1,195.00	359,934,000	
資生堂	255,700	3,110.00	795,227,000	
ライオン	167,000	1,901.00	317,467,000	
高砂香料工業	8,900	3,155.00	28,079,500	
マンダム	13,500	5,120.00	69,120,000	
ミルボン	7,300	4,455.00	32,521,500	
ファンケル	28,700	1,688.00	48,445,600	
コーセー	21,800	9,930.00	216,474,000	
コタ	5,000	1,304.00	6,520,000	
シーズ・ホールディングス	17,500	3,330.00	58,275,000	
シーボン	1,600	2,516.00	4,025,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	13,700	10,510.00	143,987,000	
ノエビアホールディングス	8,500	3,830.00	32,555,000	
アジュバンコスメジャパン	2,800	936.00	2,620,800	
エステー	9,300	1,623.00	15,093,900	
アグロ　カネショウ	5,300	1,209.00	6,407,700	
コニシ	21,200	1,310.00	27,772,000	
長谷川香料	17,100	1,973.00	33,738,300	
星光ＰＭＣ	7,400	1,193.00	8,828,200	
小林製薬	37,400	5,110.00	191,114,000	
荒川化学工業	11,500	1,876.00	21,574,000	
メック	10,500	983.00	10,321,500	
日本高純度化学	3,900	2,509.00	9,785,100	
タカラバイオ	28,900	1,595.00	46,095,500	
ＪＣＵ	4,200	5,650.00	23,730,000	
新田ゼラチン	8,400	764.00	6,417,600	
ＯＡＴアグリオ	1,600	1,366.00	2,185,600	
デクセリアルズ	35,300	1,164.00	41,089,200	
アース製薬	9,700	4,795.00	46,511,500	
イハラケミカル工業	18,700	1,122.00	20,981,400	
北興化学工業	13,000	438.00	5,694,000	
大成ラミック	3,900	3,200.00	12,480,000	
クミアイ化学工業	27,900	711.00	19,836,900	
日本農薬	30,800	636.00	19,588,800	

昭和シェル石油	120,400	1,120.00	134,848,000	
富士興産	4,600	460.00	2,116,000	
ニチレキ	16,600	954.00	15,836,400	
東燃ゼネラル石油	219,000	1,266.00	277,254,000	
ユシロ化学工業	7,300	1,476.00	10,774,800	
ビーピー・カストロール	5,500	1,419.00	7,804,500	
富士石油	31,400	385.00	12,089,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,500	1,665.00	7,492,500	
出光興産	63,900	3,185.00	203,521,500	
ＪＸホールディングス	1,494,900	510.30	762,847,470	
コスモエネルギーホールディングス	40,700	1,702.00	69,271,400	
横浜ゴム	81,300	2,129.00	173,087,700	
東洋ゴム工業	71,200	1,493.00	106,301,600	
ブリヂストン	454,800	4,207.00	1,913,343,600	
住友ゴム工業	126,100	1,879.00	236,941,900	
藤倉ゴム工業	11,400	666.00	7,592,400	
オカモト	41,000	1,093.00	44,813,000	
アキレス	11,000	1,674.00	18,414,000	
フコク	5,300	950.00	5,035,000	
ニッタ	12,100	3,155.00	38,175,500	
クリエートメディック	4,400	958.00	4,215,200	
住友理工	24,900	1,131.00	28,161,900	
三ツ星ベルト	33,000	1,034.00	34,122,000	
バンドー化学	24,500	1,050.00	25,725,000	
旭硝子	664,000	834.00	553,776,000	
日本板硝子	61,400	900.00	55,260,000	
石塚硝子	19,000	200.00	3,800,000	
有沢製作所	22,700	671.00	15,231,700	
日本山村硝子	53,000	208.00	11,024,000	
日本電気硝子	278,000	638.00	177,364,000	
オハラ	5,200	863.00	4,487,600	
住友大阪セメント	250,000	458.00	114,500,000	
太平洋セメント	813,000	388.00	315,444,000	
リソルホールディングス	14,000	347.00	4,858,000	
日本ヒューム	13,000	719.00	9,347,000	
日本コンクリート工業	29,500	353.00	10,413,500	
三谷セキサン	6,800	3,075.00	20,910,000	
アジアパイルホールディングス	16,700	557.00	9,301,900	
東海カーボン	126,000	386.00	48,636,000	
日本カーボン	66,000	282.00	18,612,000	
東洋炭素	7,500	1,952.00	14,640,000	
ノリタケカンパニーリミテド	7,500	2,950.00	22,125,000	
ＴＯＴＯ	99,000	4,735.00	468,765,000	
日本碍子	170,100	2,309.00	392,760,900	
日本特殊陶業	116,100	2,504.00	290,714,400	
ダントーホールディングス	12,000	195.00	2,340,000	
ＭＡＲＵＷＡ	5,000	3,690.00	18,450,000	
品川リフラクトリーズ	34,000	263.00	8,942,000	
黒崎播磨	29,000	329.00	9,541,000	
ヨータイ	8,000	357.00	2,856,000	

イソライト工業	6,800	300.00	2,040,000	
東京窯業	17,000	195.00	3,315,000	
ニッカトー	4,800	418.00	2,006,400	
フジミインコーポレーテッド	11,500	2,230.00	25,645,000	
エーアンドエーマテリアル	29,000	130.00	3,770,000	
ニチアス	70,000	1,150.00	80,500,000	
新日鐵住金	607,500	2,741.50	1,665,461,250	
神戸製鋼所	232,900	1,159.00	269,931,100	
中山製鋼所	15,100	745.00	11,249,500	
合同製鐵	7,500	2,143.00	16,072,500	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	368,200	1,877.00	691,111,400	
日新製鋼	61,400	1,544.00	94,801,600	
東京製鐵	68,100	896.00	61,017,600	
共英製鋼	14,300	2,272.00	32,489,600	
大和工業	27,000	3,325.00	89,775,000	
東京鐵鋼	28,000	477.00	13,356,000	
大阪製鐵	8,500	2,250.00	19,125,000	
淀川製鋼所	18,600	3,155.00	58,683,000	
東洋鋼鈑	32,200	384.00	12,364,800	
丸一鋼管	45,100	3,890.00	175,439,000	
モリ工業	4,200	2,010.00	8,442,000	
大同特殊鋼	226,000	501.00	113,226,000	
日本高周波鋼業	49,000	90.00	4,410,000	
日本冶金工業	111,600	193.00	21,538,800	
山陽特殊製鋼	80,000	586.00	46,880,000	
愛知製鋼	7,900	5,110.00	40,369,000	
日立金属	137,100	1,608.00	220,456,800	
日本金属	3,300	1,291.00	4,260,300	
大平洋金属	86,000	372.00	31,992,000	
新日本電工	76,300	265.00	20,219,500	
栗本鐵工所	6,400	2,386.00	15,270,400	
虹　技	19,000	260.00	4,940,000	
日本鋳鉄管	14,000	194.00	2,716,000	
日本製鋼所	44,500	2,150.00	95,675,000	
三菱製鋼	93,000	236.00	21,948,000	
日亜鋼業	18,800	276.00	5,188,800	
日本精線	9,000	594.00	5,346,000	
大紀アルミニウム工業所	22,000	512.00	11,264,000	
日本軽金属ホールディングス	304,500	262.00	79,779,000	
三井金属鉱業	366,000	301.00	110,166,000	
東邦亜鉛	76,000	477.00	36,252,000	
三菱マテリアル	84,000	3,750.00	315,000,000	
住友金属鉱山	349,000	1,594.50	556,480,500	
ＤＯＷＡホールディングス	149,000	920.00	137,080,000	
古河機械金属	210,000	220.00	46,200,000	
エス・サイエンス	65,100	38.00	2,473,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,700	1,643.00	24,152,100	
東邦チタニウム	22,800	793.00	18,080,400	
ＵＡＣＪ	171,000	329.00	56,259,000	

古河電気工業	45,200	3,510.00	158,652,000	
住友電気工業	507,500	1,656.00	840,420,000	
フジクラ	177,200	671.00	118,901,200	
昭和電線ホールディングス	162,000	91.00	14,742,000	
東京特殊電線	2,000	1,300.00	2,600,000	
タツタ電線	25,200	471.00	11,869,200	
沖電線	15,000	240.00	3,600,000	
カナレ電気	2,000	2,162.00	4,324,000	
平河ヒューテック	6,400	1,288.00	8,243,200	
リョービ	82,000	479.00	39,278,000	
アーレスティ	15,600	1,270.00	19,812,000	
アサヒホールディングス	20,300	2,127.00	43,178,100	
東洋製罐グループホールディングス	95,600	2,201.00	210,415,600	
ホッカンホールディングス	35,000	469.00	16,415,000	
コロナ	7,100	1,175.00	8,342,500	
横河ブリッジホールディングス	23,700	1,389.00	32,919,300	
ＯＳＪＢホールディングス	44,200	259.00	11,447,800	
駒井ハルテック	2,600	2,176.00	5,657,600	
高田機工	12,000	235.00	2,820,000	
三和ホールディングス	133,700	1,142.00	152,685,400	
文化シヤッター	37,500	919.00	34,462,500	
三協立山	17,600	1,725.00	30,360,000	
アルインコ	9,300	1,056.00	9,820,800	
東洋シヤッター	3,600	649.00	2,336,400	
ＬＩＸＩＬグループ	187,600	2,712.00	508,771,200	
日本フイルコン	10,100	578.00	5,837,800	
ノーリツ	26,300	2,013.00	52,941,900	
長府製作所	14,400	2,613.00	37,627,200	
リンナイ	22,900	9,650.00	220,985,000	
ユニプレス	24,800	2,342.00	58,081,600	
ダイニチ工業	7,200	748.00	5,385,600	
日東精工	19,500	430.00	8,385,000	
三洋工業	17,000	199.00	3,383,000	
岡部	28,000	964.00	26,992,000	
ジーテクト	14,100	2,162.00	30,484,200	
中国工業	2,300	707.00	1,626,100	
東プレ	25,900	2,982.00	77,233,800	
高周波熱錬	25,000	917.00	22,925,000	
東京製綱	9,100	1,952.00	17,763,200	
サンコール	7,300	560.00	4,088,000	
モリテックスチール	7,200	292.00	2,102,400	
パイオラックス	6,800	7,700.00	52,360,000	
日本発条	126,600	1,115.00	141,159,000	
中央発條	15,000	325.00	4,875,000	
アドバネクス	2,400	1,860.00	4,464,000	
三浦工業	55,100	1,775.00	97,802,500	
タクマ	43,100	1,015.00	43,746,500	
テクノプロ・ホールディングス	21,800	3,740.00	81,532,000	
インターワークス	2,600	1,141.00	2,966,600	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,500	1,831.00	2,746,500	

ファーストロジック	800	2,218.00	1,774,400	
イー・ガーディアン	4,400	1,493.00	6,569,200	
リブセンス	9,300	452.00	4,203,600	
ジャパンマテリアル	9,800	1,784.00	17,483,200	
ベクトル	11,000	1,180.00	12,980,000	
ウチヤマホールディングス	6,300	436.00	2,746,800	
サクセスホールディングス	1,100	1,245.00	1,369,500	
キャリアリンク	3,100	789.00	2,445,900	
ＩＢＪ	10,600	669.00	7,091,400	
アサンテ	5,000	1,812.00	9,060,000	
Ｎ・フィールド	6,400	1,432.00	9,164,800	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,700	3,185.00	5,414,500	
ライドオン・エクスプレス	3,100	904.00	2,802,400	
ＥＲＩホールディングス	3,900	790.00	3,081,000	
アビスト	2,100	3,755.00	7,885,500	
ウィルグループ	5,600	736.00	4,121,600	
日本ビューホテル	2,000	1,500.00	3,000,000	
リクルートホールディングス	293,700	4,700.00	1,380,390,000	
エラン	1,700	1,296.00	2,203,200	
ツガミ	36,000	687.00	24,732,000	
オークマ	88,000	1,101.00	96,888,000	
東芝機械	80,000	477.00	38,160,000	
アマダホールディングス	181,200	1,329.00	240,814,800	
アイダエンジニアリング	38,300	1,119.00	42,857,700	
滝澤鉄工所	41,000	164.00	6,724,000	
富士機械製造	41,000	1,367.00	56,047,000	
牧野フライス製作所	67,000	926.00	62,042,000	
オーエスジー	61,300	2,388.00	146,384,400	
ダイジェット工業	17,000	183.00	3,111,000	
旭ダイヤモンド工業	38,600	880.00	33,968,000	
ＤＭＧ森精機	79,700	1,443.00	115,007,100	
ソディック	34,100	979.00	33,383,900	
ディスコ	15,700	14,340.00	225,138,000	
日東工器	7,800	2,564.00	19,999,200	
パンチ工業	5,000	907.00	4,535,000	
日本郵政	350,600	1,487.00	521,342,200	
ベルシステム２４ホールディングス	20,500	1,022.00	20,951,000	
ソラスト	6,200	1,312.00	8,134,400	
豊田自動織機	117,100	5,670.00	663,957,000	
豊和工業	7,900	641.00	5,063,900	
ＯＫＫ	50,000	122.00	6,100,000	
石川製作所	3,500	705.00	2,467,500	
東洋機械金属	9,200	463.00	4,259,600	
津田駒工業	30,000	168.00	5,040,000	
エンシュウ	34,000	106.00	3,604,000	
島精機製作所	17,600	3,985.00	70,136,000	
ＮＣホールディングス	4,400	940.00	4,136,000	
フリュー	2,700	3,530.00	9,531,000	
ヤマシンフィルタ	2,700	1,285.00	3,469,500	
日阪製作所	18,000	919.00	16,542,000	

やまびこ	24,700	1,733.00	42,805,100	
ペガサスミシン製造	13,000	729.00	9,477,000	
ナブテスコ	70,000	2,800.00	196,000,000	
三井海洋開発	13,500	1,930.00	26,055,000	
レオン自動機	11,400	900.00	10,260,000	
ＳＭＣ	40,400	29,045.00	1,173,418,000	
新川	11,300	839.00	9,480,700	
ホソカワミクロン	22,000	800.00	17,600,000	
ユニオンツール	5,800	3,155.00	18,299,000	
オイレス工業	17,400	2,122.00	36,922,800	
日精エー・エス・ビー機械	4,300	2,396.00	10,302,800	
サトーホールディングス	16,800	2,414.00	40,555,200	
日本エアーテック	4,400	650.00	2,860,000	
日精樹脂工業	10,400	1,081.00	11,242,400	
オカダアイヨン	2,900	1,110.00	3,219,000	
ワイエイシイ	5,100	1,299.00	6,624,900	
小松製作所	621,300	2,653.50	1,648,619,550	
住友重機械工業	393,000	781.00	306,933,000	
日立建機	60,100	2,552.00	153,375,200	
日工	4,000	2,211.00	8,844,000	
巴工業	5,500	1,808.00	9,944,000	
井関農機	138,000	235.00	32,430,000	
ＴＯＷＡ	11,000	1,614.00	17,754,000	
丸山製作所	29,000	192.00	5,568,000	
北川鉄工所	6,200	2,459.00	15,245,800	
シンニッタン	11,200	681.00	7,627,200	
ローツェ	4,800	1,890.00	9,072,000	
タカキタ	3,600	573.00	2,062,800	
クボタ	646,600	1,700.00	1,099,220,000	
荏原実業	3,800	1,346.00	5,114,800	
東洋エンジニアリング	85,000	310.00	26,350,000	
三菱化工機	45,000	222.00	9,990,000	
月島機械	25,500	1,245.00	31,747,500	
帝国電機製作所	9,800	1,045.00	10,241,000	
東京機械製作所	52,000	81.00	4,212,000	
新東工業	30,500	1,033.00	31,506,500	
澁谷工業	11,200	2,423.00	27,137,600	
アイチコーポレーション	19,100	846.00	16,158,600	
小森コーポレーション	32,300	1,517.00	48,999,100	
鶴見製作所	10,000	1,763.00	17,630,000	
住友精密工業	22,000	368.00	8,096,000	
酒井重工業	26,000	356.00	9,256,000	
荏原製作所	59,200	3,355.00	198,616,000	
石井鐵工所	2,000	1,887.00	3,774,000	
西島製作所	13,200	1,192.00	15,734,400	
北越工業	14,600	806.00	11,767,600	
千代田化工建設	104,000	826.00	85,904,000	
ダイキン工業	175,700	11,110.00	1,952,027,000	
オルガノ	25,000	487.00	12,175,000	
トーヨーカネツ	62,000	330.00	20,460,000	

栗田工業	76,100	2,624.00	199,686,400	
椿本チエイン	76,000	952.00	72,352,000	
大同工業	27,000	264.00	7,128,000	
日機装	44,500	1,081.00	48,104,500	
木村化工機	11,800	344.00	4,059,200	
新興プランテック	29,600	847.00	25,071,200	
アネスト岩田	23,400	1,180.00	27,612,000	
ダイフク	64,200	2,450.00	157,290,000	
サムコ	3,400	1,110.00	3,774,000	
加藤製作所	7,100	3,055.00	21,690,500	
油研工業	25,000	226.00	5,650,000	
タダノ	67,300	1,469.00	98,863,700	
フジテック	37,400	1,385.00	51,799,000	
ＣＫＤ	38,500	1,468.00	56,518,000	
キトー	16,200	1,288.00	20,865,600	
平和	39,800	2,747.00	109,330,600	
理想科学工業	12,800	2,025.00	25,920,000	
ＳＡＮＫＹＯ	35,700	3,855.00	137,623,500	
日本金銭機械	11,900	1,537.00	18,290,300	
マースエンジニアリング	7,300	2,250.00	16,425,000	
福島工業	8,000	3,675.00	29,400,000	
オーイズミ	5,500	732.00	4,026,000	
ダイコク電機	5,300	1,888.00	10,006,400	
竹内製作所	23,500	2,594.00	60,959,000	
アマノ	39,800	2,202.00	87,639,600	
ＪＵＫＩ	20,300	1,106.00	22,451,800	
サンデンホールディングス	79,000	374.00	29,546,000	
蛇の目ミシン工業	12,600	858.00	10,810,800	
ブラザー工業	166,300	2,146.00	356,879,800	
マックス	20,000	1,458.00	29,160,000	
モリタホールディングス	22,600	1,635.00	36,951,000	
グローリー	41,100	3,760.00	154,536,000	
新晃工業	9,000	1,503.00	13,527,000	
大和冷機工業	20,600	962.00	19,817,200	
セガサミーホールディングス	127,600	1,813.00	231,338,800	
日本ピストンリング	5,100	2,162.00	11,026,200	
リケン	6,000	4,365.00	26,190,000	
ＴＰＲ	14,400	3,325.00	47,880,000	
ツバキ・ナカシマ	14,400	1,735.00	24,984,000	
ホシザキ	28,200	9,500.00	267,900,000	
大豊工業	10,400	1,652.00	17,180,800	
日本精工	264,300	1,352.00	357,333,600	
ＮＴＮ	298,000	481.00	143,338,000	
ジェイテクト	137,100	1,910.00	261,861,000	
不二越	129,000	538.00	69,402,000	
ミネベア	207,400	1,115.00	231,251,000	
日本トムソン	41,200	517.00	21,300,400	
ＴＨＫ	90,900	2,563.00	232,976,700	
ユーシン精機	5,700	3,015.00	17,185,500	
前澤給装工業	5,000	1,549.00	7,745,000	

イーグル工業	13,900	1,621.00	22,531,900	
前澤工業	9,600	381.00	3,657,600	
日本ピラー工業	13,100	1,275.00	16,702,500	
キッツ	61,700	671.00	41,400,700	
日立製作所	3,090,000	665.10	2,055,159,000	
東芝	2,878,000	301.10	866,565,800	
三菱電機	1,372,600	1,632.50	2,240,769,500	
富士電機	388,000	614.00	238,232,000	
東洋電機製造	5,100	1,655.00	8,440,500	
安川電機	149,100	1,883.00	280,755,300	
シンフォニア　テクノロジー	83,000	286.00	23,738,000	
明電舎	118,000	403.00	47,554,000	
オリジン電気	19,000	325.00	6,175,000	
山洋電気	34,000	867.00	29,478,000	
デンヨー	11,900	1,653.00	19,670,700	
日立工機	34,400	1,491.00	51,290,400	
三櫻工業	16,500	834.00	13,761,000	
マキタ	83,900	7,880.00	661,132,000	
東芝テック	81,000	607.00	49,167,000	
芝浦メカトロニクス	21,000	272.00	5,712,000	
マブチモーター	36,300	6,150.00	223,245,000	
日本電産	166,800	10,445.00	1,742,226,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,500	3,030.00	4,545,000	
東光高岳	6,500	2,132.00	13,858,000	
ダブル・スコープ	12,200	1,753.00	21,386,600	
宮越ホールディングス	4,500	509.00	2,290,500	
ダイヘン	70,000	731.00	51,170,000	
田淵電機	19,600	410.00	8,036,000	
ヤーマン	1,600	5,550.00	8,880,000	
ＪＶＣケンウッド	94,600	316.00	29,893,600	
ミマキエンジニアリング	11,600	685.00	7,946,000	
第一精工	5,900	1,383.00	8,159,700	
日新電機	25,900	1,320.00	34,188,000	
大崎電気工業	25,000	1,190.00	29,750,000	
オムロン	136,800	4,500.00	615,600,000	
日東工業	18,800	1,609.00	30,249,200	
ＩＤＥＣ	16,800	1,118.00	18,782,400	
不二電機工業	1,400	1,432.00	2,004,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	248,000	488.00	121,024,000	
サクサホールディングス	33,000	226.00	7,458,000	
メルコホールディングス	7,100	3,265.00	23,181,500	
テクノメディカ	2,900	2,027.00	5,878,300	
日本電気	1,769,000	328.00	580,232,000	
富士通	1,241,000	683.50	848,223,500	
沖電気工業	55,700	1,685.00	93,854,500	
岩崎通信機	58,000	90.00	5,220,000	
電気興業	37,000	590.00	21,830,000	
サンケン電気	75,000	527.00	39,525,000	
ナカヨ	13,000	405.00	5,265,000	
アイホン	7,300	1,992.00	14,541,600	

ルネサスエレクトロニクス	66,800	1,002.00	66,933,600	
セイコーエプソン	191,600	2,374.00	454,858,400	
ワコム	99,900	329.00	32,867,100	
アルバック	23,700	3,670.00	86,979,000	
アクセル	5,500	1,030.00	5,665,000	
ＥＩＺＯ	12,700	3,555.00	45,148,500	
ジャパンディスプレイ	240,300	334.00	80,260,200	
日本信号	35,500	1,007.00	35,748,500	
京三製作所	30,000	401.00	12,030,000	
能美防災	14,600	1,774.00	25,900,400	
ホーチキ	9,400	1,464.00	13,761,600	
エレコム	11,200	1,967.00	22,030,400	
日本無線	7,900	1,391.00	10,988,900	
パナソニック	1,470,200	1,211.50	1,781,147,300	
アンリツ	93,700	683.00	63,997,100	
富士通ゼネラル	44,000	2,697.00	118,668,000	
日立国際電気	33,700	2,554.00	86,069,800	
ソニー	908,500	3,510.00	3,188,835,000	
ＴＤＫ	72,500	8,110.00	587,975,000	
帝国通信工業	28,000	180.00	5,040,000	
ミツミ電機	45,500	657.00	29,893,500	
タムラ製作所	50,000	457.00	22,850,000	
アルプス電気	118,800	2,860.00	339,768,000	
池上通信機	41,000	171.00	7,011,000	
パイオニア	193,500	257.00	49,729,500	
日本電波工業	12,400	908.00	11,259,200	
鈴木	5,100	518.00	2,641,800	
日本トリム	3,100	4,715.00	14,616,500	
ローランド　ディー．ジー．	6,600	3,085.00	20,361,000	
日本コロムビア	3,900	649.00	2,531,100	
フォスター電機	15,100	2,059.00	31,090,900	
クラリオン	68,000	439.00	29,852,000	
ＳＭＫ	33,000	435.00	14,355,000	
ヨコオ	9,300	1,019.00	9,476,700	
ティアック	96,000	53.00	5,088,000	
ホシデン	39,000	959.00	37,401,000	
ヒロセ電機	20,800	14,700.00	305,760,000	
日本航空電子工業	41,000	1,755.00	71,955,000	
ＴＯＡ	15,200	1,044.00	15,868,800	
日立マクセル	19,200	2,078.00	39,897,600	
古野電気	16,200	894.00	14,482,800	
ユニデンホールディングス	38,000	175.00	6,650,000	
アルパイン	30,700	1,589.00	48,782,300	
スミダコーポレーション	10,600	1,095.00	11,607,000	
アイコム	7,100	2,290.00	16,259,000	
リオン	5,000	1,614.00	8,070,000	
本多通信工業	3,600	1,300.00	4,680,000	
船井電機	13,800	952.00	13,137,600	
横河電機	139,500	1,732.00	241,614,000	
新電元工業	50,000	440.00	22,000,000	

アズビル	39,000	3,345.00	130,455,000	
東亜ディーケーケー	6,600	552.00	3,643,200	
日本光電工業	53,800	2,684.00	144,399,200	
チノー	4,800	1,141.00	5,476,800	
共和電業	15,000	404.00	6,060,000	
日本電子材料	5,300	608.00	3,222,400	
堀場製作所	25,500	5,680.00	144,840,000	
アドバンテスト	87,700	1,962.00	172,067,400	
小野測器	6,500	881.00	5,726,500	
エスペック	11,400	1,362.00	15,526,800	
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	11,400	815.00	9,291,000	
キーエンス	29,200	83,170.00	2,428,564,000	
日置電機	6,800	2,165.00	14,722,000	
シスメックス	100,000	6,920.00	692,000,000	
日本マイクロニクス	24,100	1,148.00	27,666,800	
メガチップス	12,000	2,588.00	31,056,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,500	5,160.00	38,700,000	
イマジカ・ロボット　ホールディングス	10,700	727.00	7,778,900	
澤藤電機	8,000	217.00	1,736,000	
デンソー	317,300	5,064.00	1,606,807,200	
コーセル	17,900	1,332.00	23,842,800	
イリソ電子工業	4,100	6,870.00	28,167,000	
新日本無線	9,900	412.00	4,078,800	
オプテックスグループ	9,500	2,595.00	24,652,500	
千代田インテグレ	6,800	2,403.00	16,340,400	
アイ・オー・データ機器	4,100	1,297.00	5,317,700	
レーザーテック	15,100	2,233.00	33,718,300	
スタンレー電気	92,000	3,120.00	287,040,000	
岩崎電気	46,000	194.00	8,924,000	
ウシオ電機	78,100	1,465.00	114,416,500	
岡谷電機産業	7,500	415.00	3,112,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,800	567.00	6,690,600	
日本セラミック	10,500	2,071.00	21,745,500	
遠藤照明	6,600	922.00	6,085,200	
古河電池	9,000	766.00	6,894,000	
双信電機	6,900	298.00	2,056,200	
山一電機	11,900	1,177.00	14,006,300	
図研	8,400	1,305.00	10,962,000	
日本電子	47,000	532.00	25,004,000	
カシオ計算機	103,500	1,672.00	173,052,000	
ファナック	130,500	20,275.00	2,645,887,500	
日本シイエムケイ	27,800	709.00	19,710,200	
エンプラス	5,800	3,505.00	20,329,000	
大真空	4,700	1,448.00	6,805,600	
ローム	62,200	7,210.00	448,462,000	
浜松ホトニクス	100,400	3,205.00	321,782,000	
三井ハイテック	17,000	869.00	14,773,000	
新光電気工業	48,600	857.00	41,650,200	
京セラ	211,200	5,892.00	1,244,390,400	

協栄産業	16,000	164.00	2,624,000	
太陽誘電	62,600	1,377.00	86,200,200	
村田製作所	135,000	15,355.00	2,072,925,000	
ユーシン	17,100	768.00	13,132,800	
双葉電子工業	21,000	2,010.00	42,210,000	
日東電工	97,200	8,918.00	866,829,600	
北陸電気工業	53,000	141.00	7,473,000	
東海理化電機製作所	33,900	2,377.00	80,580,300	
ニチコン	40,400	1,060.00	42,824,000	
日本ケミコン	111,000	260.00	28,860,000	
ＫＯＡ	17,800	1,189.00	21,164,200	
三井造船	464,000	183.00	84,912,000	
日立造船	101,800	622.00	63,319,600	
三菱重工業	2,156,000	530.70	1,144,189,200	
川崎重工業	1,001,000	364.00	364,364,000	
ＩＨＩ	989,000	312.00	308,568,000	
名村造船所	38,600	789.00	30,455,400	
サノヤスホールディングス	15,700	294.00	4,615,800	
日本車輌製造	47,000	278.00	13,066,000	
ニチユ三菱フォークリフト	14,900	836.00	12,456,400	
近畿車輌	2,000	2,652.00	5,304,000	
ＦＰＧ	45,300	1,043.00	47,247,900	
島根銀行	2,800	1,398.00	3,914,400	
じもとホールディングス	91,400	198.00	18,097,200	
全国保証	35,800	4,015.00	143,737,000	
めぶきフィナンシャルグループ	612,300	443.00	271,248,900	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	18,400	4,285.00	78,844,000	
九州フィナンシャルグループ	208,200	802.00	166,976,400	
かんぽ生命保険	48,000	2,487.00	119,376,000	
ゆうちょ銀行	359,600	1,424.00	512,070,400	
富山第一銀行	32,300	540.00	17,442,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	831,400	571.10	474,812,540	
西日本フィナンシャルホールディングス	86,100	1,243.00	107,022,300	
日産自動車	1,539,900	1,172.00	1,804,762,800	
いすゞ自動車	372,900	1,511.00	563,451,900	
トヨタ自動車	1,564,400	6,912.00	10,813,132,800	＊
日野自動車	183,600	1,219.00	223,808,400	
三菱自動車工業	471,700	688.00	324,529,600	
エフテック	6,800	1,353.00	9,200,400	
レシップホールディングス	4,500	901.00	4,054,500	
ＧＭＢ	2,200	1,168.00	2,569,600	
ファルテック	2,400	1,367.00	3,280,800	
武蔵精密工業	15,000	3,310.00	49,650,000	
日産車体	56,500	1,147.00	64,805,500	
新明和工業	52,000	1,091.00	56,732,000	
極東開発工業	25,600	1,613.00	41,292,800	
日信工業	28,700	1,878.00	53,898,600	
トピー工業	10,600	3,205.00	33,973,000	

ティラド	50,000	306.00	15,300,000	
曙ブレーキ工業	59,900	319.00	19,108,100	
タチエス	21,900	1,936.00	42,398,400	
ＮＯＫ	62,300	2,365.00	147,339,500	
フタバ産業	39,300	700.00	27,510,000	
ＫＹＢ	144,000	557.00	80,208,000	
市光工業	27,000	389.00	10,503,000	
大同メタル工業	16,200	1,165.00	18,873,000	
プレス工業	68,400	529.00	36,183,600	
ミクニ	16,500	405.00	6,682,500	
カルソニックカンセイ	87,000	1,790.00	155,730,000	
太平洋工業	26,400	1,486.00	39,230,400	
ケーヒン	29,600	2,068.00	61,212,800	
河西工業	16,700	1,385.00	23,129,500	
アイシン精機	117,700	5,130.00	603,801,000	
富士機工	12,900	490.00	6,321,000	
マツダ	407,400	1,860.50	757,967,700	
今仙電機製作所	11,800	1,017.00	12,000,600	
本田技研工業	1,158,000	3,471.00	4,019,418,000	
スズキ	255,100	4,209.00	1,073,715,900	
富士重工業	399,500	4,874.00	1,947,163,000	
安永	4,300	1,790.00	7,697,000	
ヤマハ発動機	181,800	2,549.00	463,408,200	
ショーワ	33,500	815.00	27,302,500	
小糸製作所	77,100	6,170.00	475,707,000	
ＴＢＫ	16,300	517.00	8,427,100	
エクセディ	17,500	3,310.00	57,925,000	
ミツバ	23,700	2,005.00	47,518,500	
豊田合成	41,500	2,788.00	115,702,000	
愛三工業	22,500	995.00	22,387,500	
盟和産業	1,800	1,225.00	2,205,000	
ヨロズ	12,000	1,687.00	20,244,000	
エフ・シー・シー	21,100	2,114.00	44,605,400	
新家工業	29,000	165.00	4,785,000	
シマノ	51,900	19,060.00	989,214,000	
タカタ	23,300	887.00	20,667,100	
テイ・エス　テック	29,900	3,040.00	90,896,000	
ジャムコ	7,500	2,552.00	19,140,000	
小野建	11,000	1,385.00	15,235,000	
はるやまホールディングス	5,700	872.00	4,970,400	
ノジマ	14,700	1,291.00	18,977,700	
佐鳥電機	10,100	737.00	7,443,700	
カッパ・クリエイト	17,900	1,299.00	23,252,100	
エコートレーディング	3,200	693.00	2,217,600	
伯東	8,600	1,058.00	9,098,800	
コンドーテック	10,200	872.00	8,894,400	
中山福	7,700	816.00	6,283,200	
ライトオン	9,500	1,036.00	9,842,000	
ナガイレーベン	18,400	2,463.00	45,319,200	
ジーンズメイト	4,600	198.00	910,800	

三菱食品	14,000	3,425.00	47,950,000	
良品計画	16,800	22,000.00	369,600,000	
三城ホールディングス	15,900	474.00	7,536,600	
松田産業	9,300	1,549.00	14,405,700	
第一興商	20,600	4,705.00	96,923,000	
メディパルホールディングス	127,000	1,856.00	235,712,000	
アドヴァン	13,000	1,146.00	14,898,000	
ＳＰＫ	2,800	2,408.00	6,742,400	
萩原電気	4,300	2,166.00	9,313,800	
アルビス	3,400	3,845.00	13,073,000	
アズワン	9,900	5,170.00	51,183,000	
スズデン	4,400	1,034.00	4,549,600	
尾家産業	4,500	1,144.00	5,148,000	
シモジマ	7,900	1,151.00	9,092,900	
ドウシシャ	15,000	2,113.00	31,695,000	
小津産業	2,900	2,180.00	6,322,000	
コナカ	16,000	590.00	9,440,000	
高速	7,700	1,109.00	8,539,300	
ハウス　オブ　ローゼ	1,800	1,562.00	2,811,600	
Ｇ－７ホールディングス	3,800	1,794.00	6,817,200	
たけびし	4,400	1,231.00	5,416,400	
イオン北海道	12,600	598.00	7,534,800	
コジマ	19,000	294.00	5,586,000	
ヒマラヤ	4,100	878.00	3,599,800	
コーナン商事	18,000	2,259.00	40,662,000	
黒田電気	17,300	2,405.00	41,606,500	
ネットワンシステムズ	54,900	768.00	42,163,200	
エコス	5,000	1,418.00	7,090,000	
ワタミ	15,000	1,181.00	17,715,000	
マルシェ	3,300	828.00	2,732,400	
リックス	3,000	1,549.00	4,647,000	
システムソフト	22,800	169.00	3,853,200	
ドンキホーテホールディングス	82,200	4,335.00	356,337,000	
丸文	11,400	704.00	8,025,600	
西松屋チェーン	22,300	1,422.00	31,710,600	
ゼンショーホールディングス	65,800	1,963.00	129,165,400	
ハピネット	10,700	1,314.00	14,059,800	
幸楽苑ホールディングス	8,200	1,687.00	13,833,400	
ハークスレイ	3,100	1,157.00	3,586,700	
橋本総業ホールディングス	2,600	1,532.00	3,983,200	
日本ライフライン	10,900	2,286.00	24,917,400	
サイゼリヤ	20,900	2,769.00	57,872,100	
エクセル	5,500	1,580.00	8,690,000	
ＶＴホールディングス	43,000	580.00	24,940,000	
マルカキカイ	4,100	1,636.00	6,707,600	
アルゴグラフィックス	5,800	2,286.00	13,258,800	
魚力	4,000	1,281.00	5,124,000	
ＩＤＯＭ	34,300	661.00	22,672,300	
日本エム・ディ・エム	9,600	913.00	8,764,800	
ポプラ	3,500	502.00	1,757,000	

フジ・コーポレーション	2,000	2,058.00	4,116,000	
ユナイテッドアローズ	16,900	3,450.00	58,305,000	
進和	7,500	1,808.00	13,560,000	
エスケイジャパン	2,700	327.00	882,900	
ダイトロン	5,900	963.00	5,681,700	
ハイデイ日高	11,600	2,786.00	32,317,600	
シークス	9,100	4,045.00	36,809,500	
京都きもの友禅	8,400	973.00	8,173,200	
コロワイド	42,200	1,943.00	81,994,600	
ピーシーデポコーポレーション	16,900	643.00	10,866,700	
田中商事	4,100	702.00	2,878,200	
オーハシテクニカ	7,200	1,520.00	10,944,000	
壱番屋	11,500	3,800.00	43,700,000	
白銅	3,300	1,464.00	4,831,200	
トップカルチャー	5,000	484.00	2,420,000	
ＰＬＡＮＴ	2,900	1,204.00	3,491,600	
スギホールディングス	27,800	5,380.00	149,564,000	
島津製作所	166,000	1,897.00	314,902,000	
ＪＭＳ	24,000	309.00	7,416,000	
クボテック	3,000	623.00	1,869,000	
長野計器	8,500	714.00	6,069,000	
ブイ・テクノロジー	2,600	13,120.00	34,112,000	
スター精密	22,500	1,562.00	35,145,000	
東京計器	43,000	240.00	10,320,000	
愛知時計電機	1,800	3,870.00	6,966,000	
オーバル	13,000	278.00	3,614,000	
東京精密	24,800	3,570.00	88,536,000	
マニー	17,100	2,890.00	49,419,000	
ニコン	224,200	1,870.00	419,254,000	
トプコン	64,800	1,750.00	113,400,000	
オリンパス	205,400	4,095.00	841,113,000	
理研計器	11,000	1,690.00	18,590,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	26,400	7,140.00	188,496,000	
キヤノン電子	11,700	1,776.00	20,779,200	
タムロン	11,400	2,061.00	23,495,400	
ＨＯＹＡ	264,800	4,903.00	1,298,314,400	
ノーリツ鋼機	12,300	891.00	10,959,300	
エー・アンド・デイ	12,000	484.00	5,808,000	
キヤノン	692,700	3,325.00	2,303,227,500	
リコー	386,900	1,017.00	393,477,300	
シチズン時計	140,800	708.00	99,686,400	
リズム時計工業	52,000	186.00	9,672,000	
大研医器	10,800	820.00	8,856,000	
メニコン	8,900	3,485.00	31,016,500	
スノーピーク	1,600	3,080.00	4,928,000	
パラマウントベッドホールディングス	12,400	4,655.00	57,722,000	
トランザクション	2,800	1,692.00	4,737,600	
ＳＨＯ‐ＢＩ	5,000	424.00	2,120,000	
ニホンフラッシュ	5,300	1,349.00	7,149,700	
前田工繊	12,900	1,304.00	16,821,600	

永大産業	17,000	513.00	8,721,000	
アートネイチャー	13,800	723.00	9,977,400	
ダンロップスポーツ	8,200	1,089.00	8,929,800	
バンダイナムコホールディングス	141,900	3,260.00	462,594,000	
アイフィスジャパン	2,400	425.00	1,020,000	
共立印刷	22,400	329.00	7,369,600	
ＳＨＯＥＩ	5,800	2,147.00	12,452,600	
フランスベッドホールディングス	16,300	956.00	15,582,800	
マーベラス	21,400	803.00	17,184,200	
パイロットコーポレーション	22,500	4,875.00	109,687,500	
萩原工業	3,600	2,669.00	9,608,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	23,300	1,808.00	42,126,400	
トッパン・フォームズ	22,900	1,215.00	27,823,500	
フジシールインターナショナル	28,800	2,544.00	73,267,200	
タカラトミー	50,100	1,284.00	64,328,400	
廣済堂	13,000	396.00	5,148,000	
アーク	54,900	130.00	7,137,000	
レック	4,200	3,280.00	13,776,000	
タカノ	5,900	907.00	5,351,300	
プロネクサス	12,100	1,113.00	13,467,300	
ホクシン	9,700	212.00	2,056,400	
ウッドワン	22,000	275.00	6,050,000	
大建工業	9,100	2,169.00	19,737,900	
きもと	23,400	249.00	5,826,600	
凸版印刷	363,000	1,154.00	418,902,000	
大日本印刷	371,000	1,194.00	442,974,000	
図書印刷	17,000	488.00	8,296,000	
共同印刷	40,000	422.00	16,880,000	
日本写真印刷	21,600	3,020.00	65,232,000	
光村印刷	3,000	257.00	771,000	
藤森工業	10,000	2,995.00	29,950,000	
宝印刷	6,300	1,555.00	9,796,500	
前澤化成工業	8,900	1,202.00	10,697,800	
アシックス	127,900	2,357.00	301,460,300	
ツツミ	4,900	2,049.00	10,040,100	
ＪＳＰ	6,300	2,745.00	17,293,500	
ニチハ	17,900	2,944.00	52,697,600	
エフピコ	12,000	5,480.00	65,760,000	
小松ウオール工業	4,400	1,982.00	8,720,800	
ヤマハ	86,700	3,645.00	316,021,500	
河合楽器製作所	5,100	2,347.00	11,969,700	
クリナップ	15,100	947.00	14,299,700	
ピジョン	77,800	3,045.00	236,901,000	
天馬	8,900	2,049.00	18,236,100	
兼松サステック	14,000	188.00	2,632,000	
キングジム	10,900	849.00	9,254,100	
リンテック	30,600	2,581.00	78,978,600	
ＴＡＳＡＫＩ	2,700	1,593.00	4,301,100	
信越ポリマー	26,400	897.00	23,680,800	

東リ	32,300	420.00	13,566,000	
イトーキ	27,200	738.00	20,073,600	
任天堂	79,200	25,145.00	1,991,484,000	
三菱鉛筆	10,600	6,230.00	66,038,000	
松風	6,700	1,381.00	9,252,700	
タカラスタンダード	26,600	1,957.00	52,056,200	
コクヨ	66,900	1,405.00	93,994,500	
ナカバヤシ	23,000	275.00	6,325,000	
ニフコ	23,600	6,210.00	146,556,000	
立川ブラインド工業	5,700	893.00	5,090,100	
グローブライド	6,300	1,948.00	12,272,400	
岡村製作所	45,000	1,071.00	48,195,000	
日本バルカー工業	10,400	1,594.00	16,577,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	16,000	262.00	4,192,000	
伊藤忠商事	930,200	1,578.00	1,467,855,600	
丸紅	1,249,700	677.70	846,921,690	
スクロール	19,300	348.00	6,716,400	
高島	22,000	203.00	4,466,000	
ヨンドシーホールディングス	9,700	2,472.00	23,978,400	
三陽商会	71,000	182.00	12,922,000	
長瀬産業	76,100	1,546.00	117,650,600	
ナイガイ	51,000	64.00	3,264,000	
蝶理	8,100	1,787.00	14,474,700	
豊田通商	141,400	3,040.00	429,856,000	
オンワードホールディングス	87,000	903.00	78,561,000	
三共生興	19,300	422.00	8,144,600	
兼松	270,000	198.00	53,460,000	
美津濃	69,000	584.00	40,296,000	
ツカモトコーポレーション	23,000	133.00	3,059,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	55,700	7,790.00	433,903,000	
ルック	24,000	178.00	4,272,000	
三井物産	1,148,300	1,648.50	1,892,972,550	
日本紙パルプ商事	66,000	374.00	24,684,000	
東京エレクトロン	85,800	11,155.00	957,099,000	
日立ハイテクノロジーズ	44,000	4,715.00	207,460,000	
カメイ	16,500	1,240.00	20,460,000	
東都水産	2,000	1,908.00	3,816,000	
ＯＵＧホールディングス	20,000	266.00	5,320,000	
スターゼン	5,300	4,765.00	25,254,500	
セイコーホールディングス	91,000	430.00	39,130,000	
山善	48,700	988.00	48,115,600	
椿本興業	15,000	368.00	5,520,000	
住友商事	799,400	1,423.00	1,137,546,200	
日本ユニシス	35,100	1,479.00	51,912,900	
内田洋行	31,000	495.00	15,345,000	
三菱商事	953,000	2,565.50	2,444,921,500	
第一実業	29,000	696.00	20,184,000	
キヤノンマーケティングジャパン	36,200	2,004.00	72,544,800	
西華産業	41,000	348.00	14,268,000	

佐藤商事	11,400	868.00	9,895,200	
菱洋エレクトロ	12,200	1,487.00	18,141,400	
東京産業	12,900	493.00	6,359,700	
ユアサ商事	12,000	3,010.00	36,120,000	
神鋼商事	3,100	2,467.00	7,647,700	
小林産業	9,400	260.00	2,444,000	
阪和興業	127,000	772.00	98,044,000	
カナデン	12,200	1,090.00	13,298,000	
菱電商事	20,000	756.00	15,120,000	
ニプロ	89,000	1,323.00	117,747,000	
フルサト工業	7,000	1,733.00	12,131,000	
岩谷産業	141,000	624.00	87,984,000	
すてきナイスグループ	54,000	157.00	8,478,000	
昭光通商	47,000	103.00	4,841,000	
ニチモウ	19,000	179.00	3,401,000	
極東貿易	19,000	247.00	4,693,000	
イワキ	20,000	227.00	4,540,000	
兼松エレクトロニクス	8,000	2,668.00	21,344,000	
三愛石油	34,100	839.00	28,609,900	
稲畑産業	30,400	1,330.00	40,432,000	
ＧＳＩクレオス	31,000	137.00	4,247,000	
明和産業	11,900	395.00	4,700,500	
キムラタン	588,000	8.00	4,704,000	
ゴールドウイン	5,700	5,350.00	30,495,000	
ユニ・チャーム	272,900	2,562.00	699,169,800	
デサント	30,800	1,342.00	41,333,600	
キング	6,900	415.00	2,863,500	
ワキタ	27,000	1,027.00	27,729,000	
ヤマトインターナショナル	8,700	409.00	3,558,300	
東邦ホールディングス	40,700	2,385.00	97,069,500	
サンゲツ	43,500	2,100.00	91,350,000	
ミツウロコグループホールディングス	20,500	726.00	14,883,000	
シナネンホールディングス	5,400	2,219.00	11,982,600	
伊藤忠エネクス	28,000	931.00	26,068,000	
サンリオ	39,100	2,301.00	89,969,100	
サンワ　テクノス	7,600	954.00	7,250,400	
リョーサン	18,900	3,550.00	67,095,000	
新光商事	13,900	1,278.00	17,764,200	
トーホー	5,800	2,607.00	15,120,600	
三信電気	14,100	1,183.00	16,680,300	
東陽テクニカ	16,900	1,046.00	17,677,400	
モスフードサービス	16,600	3,455.00	57,353,000	
加賀電子	11,500	2,032.00	23,368,000	
三益半導体工業	10,000	1,677.00	16,770,000	
ソーダニッカ	13,600	510.00	6,936,000	
立花エレテック	8,600	1,374.00	11,816,400	
木曽路	15,600	2,340.00	36,504,000	
サトレストランシステムズ	15,300	824.00	12,607,200	
千趣会	23,000	728.00	16,744,000	
タカキュー	10,700	204.00	2,182,800	

ケーヨー	21,500	570.00	12,255,000	
上新電機	30,000	1,080.00	32,400,000	
日本瓦斯	23,300	3,285.00	76,540,500	
ベスト電器	41,400	159.00	6,582,600	
ロイヤルホールディングス	21,000	1,937.00	40,677,000	
東天紅	10,000	156.00	1,560,000	
いなげや	14,100	1,533.00	21,615,300	
島忠	32,800	2,826.00	92,692,800	
チヨダ	15,000	2,827.00	42,405,000	
ライフコーポレーション	9,600	3,275.00	31,440,000	
リンガーハット	13,100	2,324.00	30,444,400	
さが美	11,000	128.00	1,408,000	
ＭＲ　ＭＡＸ	16,000	416.00	6,656,000	
テンアライド	13,100	384.00	5,030,400	
ＡＯＫＩホールディングス	25,300	1,452.00	36,735,600	
オークワ	18,000	1,158.00	20,844,000	
コメリ	19,600	2,770.00	54,292,000	
青山商事	26,500	4,070.00	107,855,000	
しまむら	14,700	15,400.00	226,380,000	
はせがわ	4,800	450.00	2,160,000	
高島屋	213,000	1,003.00	213,639,000	
松屋	27,700	1,055.00	29,223,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	65,000	1,864.00	121,160,000	
近鉄百貨店	49,000	364.00	17,836,000	
丸栄	28,000	90.00	2,520,000	
パルコ	12,000	1,065.00	12,780,000	
丸井グループ	133,600	1,749.00	233,666,400	
クレディセゾン	96,300	2,117.00	203,867,100	
アクシアル　リテイリング	9,800	4,050.00	39,690,000	
井筒屋	7,000	407.00	2,849,000	
イオン	522,500	1,699.00	887,727,500	
イズミ	25,200	5,060.00	127,512,000	
東武ストア	1,500	2,926.00	4,389,000	
フォーバル	5,700	742.00	4,229,400	
平和堂	25,700	2,808.00	72,165,600	
フジ	14,100	2,333.00	32,895,300	
ヤオコー	14,400	4,735.00	68,184,000	
ゼビオホールディングス	17,200	1,814.00	31,200,800	
ケーズホールディングス	58,500	2,128.00	124,488,000	
ＰＡＬＴＡＣ	20,300	2,874.00	58,342,200	
三谷産業	13,700	366.00	5,014,200	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,600	636.00	4,833,600	
日産東京販売ホールディングス	18,700	348.00	6,507,600	
新生銀行	1,209,000	203.00	245,427,000	
あおぞら銀行	803,000	418.00	335,654,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,624,200	737.70	7,099,772,340	
りそなホールディングス	1,485,900	626.30	930,619,170	
三井住友トラスト・ホールディングス	265,100	4,334.00	1,148,943,400	
三井住友フィナンシャルグループ	1,016,900	4,571.00	4,648,249,900	
第四銀行	156,000	530.00	82,680,000	

北越銀行	13,700	2,735.00	37,469,500	
千葉銀行	490,000	732.00	358,680,000	
群馬銀行	282,100	649.00	183,082,900	
武蔵野銀行	20,200	3,520.00	71,104,000	
千葉興業銀行	34,900	597.00	20,835,300	
筑波銀行	52,900	356.00	18,832,400	
七十七銀行	199,000	574.00	114,226,000	
青森銀行	99,000	396.00	39,204,000	
秋田銀行	83,000	381.00	31,623,000	
山形銀行	71,000	490.00	34,790,000	
岩手銀行	8,300	4,755.00	39,466,500	
東邦銀行	113,000	443.00	50,059,000	
東北銀行	66,000	158.00	10,428,000	
みちのく銀行	63,000	198.00	12,474,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	515,000	534.00	275,010,000	
静岡銀行	345,000	1,009.00	348,105,000	
十六銀行	170,000	423.00	71,910,000	
スルガ銀行	129,900	2,575.00	334,492,500	
八十二銀行	244,800	689.00	168,667,200	
山梨中央銀行	79,000	554.00	43,766,000	
大垣共立銀行	169,000	463.00	78,247,000	
福井銀行	109,000	299.00	32,591,000	
北國銀行	135,000	433.00	58,455,000	
清水銀行	4,300	3,810.00	16,383,000	
富山銀行	2,500	4,485.00	11,212,500	
滋賀銀行	119,000	649.00	77,231,000	
南都銀行	12,300	4,580.00	56,334,000	
百五銀行	114,000	487.00	55,518,000	
京都銀行	227,000	885.00	200,895,000	
紀陽銀行	47,700	1,880.00	89,676,000	
三重銀行	5,700	2,460.00	14,022,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	84,400	2,034.00	171,669,600	
広島銀行	375,000	555.00	208,125,000	
山陰合同銀行	76,300	1,002.00	76,452,600	
中国銀行	90,000	1,701.00	153,090,000	
鳥取銀行	4,100	1,933.00	7,925,300	
伊予銀行	135,700	822.00	111,545,400	
百十四銀行	139,000	400.00	55,600,000	
四国銀行	98,000	291.00	28,518,000	
阿波銀行	108,000	710.00	76,680,000	
大分銀行	73,000	440.00	32,120,000	
宮崎銀行	85,000	382.00	32,470,000	
佐賀銀行	77,000	306.00	23,562,000	
十八銀行	78,000	358.00	27,924,000	
沖縄銀行	12,300	4,255.00	52,336,500	
琉球銀行	26,200	1,540.00	40,348,000	
セブン銀行	476,100	336.00	159,969,600	
みずほフィナンシャルグループ	17,242,700	215.60	3,717,526,120	
高知銀行	48,000	136.00	6,528,000	
山口フィナンシャルグループ	119,000	1,275.00	151,725,000	

アクリーティブ	10,600	496.00	5,257,600	
芙蓉総合リース	14,500	5,650.00	81,925,000	
興銀リース	23,800	2,614.00	62,213,200	
東京センチュリー	25,500	4,040.00	103,020,000	
ＳＢＩホールディングス	143,400	1,554.00	222,843,600	
日本証券金融	55,700	633.00	35,258,100	
アイフル	212,900	351.00	74,727,900	
日本アジア投資	12,200	516.00	6,295,200	
ポケットカード	9,600	580.00	5,568,000	
長野銀行	4,200	2,037.00	8,555,400	
名古屋銀行	10,600	4,260.00	45,156,000	
北洋銀行	207,000	489.00	101,223,000	
愛知銀行	4,300	6,760.00	29,068,000	
第三銀行	7,200	1,874.00	13,492,800	
中京銀行	5,200	2,344.00	12,188,800	
大光銀行	45,000	266.00	11,970,000	
愛媛銀行	15,000	1,389.00	20,835,000	
トマト銀行	5,000	1,614.00	8,070,000	
みなと銀行	11,500	2,153.00	24,759,500	
京葉銀行	103,000	544.00	56,032,000	
関西アーバン銀行	17,800	1,445.00	25,721,000	
栃木銀行	70,000	591.00	41,370,000	
北日本銀行	4,000	3,110.00	12,440,000	
東和銀行	238,000	116.00	27,608,000	
福島銀行	139,000	101.00	14,039,000	
大東銀行	67,000	170.00	11,390,000	
リコーリース	10,000	3,600.00	36,000,000	
イオンフィナンシャルサービス	81,100	2,098.00	170,147,800	
アコム	255,300	503.00	128,415,900	
ジャックス	70,000	523.00	36,610,000	
オリエントコーポレーション	274,400	215.00	58,996,000	
日立キャピタル	29,900	2,961.00	88,533,900	
アプラスフィナンシャル	61,400	119.00	7,306,600	
オリックス	899,300	1,845.00	1,659,208,500	
三菱ＵＦＪリース	322,100	609.00	196,158,900	
ジャフコ	21,200	3,900.00	82,680,000	
トモニホールディングス	104,700	631.00	66,065,700	
大和証券グループ本社	1,188,000	738.90	877,813,200	
野村ホールディングス	2,596,600	699.40	1,816,062,040	
岡三証券グループ	108,000	750.00	81,000,000	
丸三証券	40,400	996.00	40,238,400	
東洋証券	46,000	292.00	13,432,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	145,700	639.00	93,102,300	
光世証券	31,000	204.00	6,324,000	
水戸証券	39,600	327.00	12,949,200	
いちよし証券	28,400	912.00	25,900,800	
松井証券	72,500	1,020.00	73,950,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	265,500	3,993.00	1,060,141,500	
だいこう証券ビジネス	6,400	629.00	4,025,600	

日本取引所グループ	394,900	1,687.00	666,196,300	
マネックスグループ	136,500	328.00	44,772,000	
カブドットコム証券	94,900	408.00	38,719,200	
極東証券	17,000	1,793.00	30,481,000	
岩井コスモホールディングス	12,000	1,110.00	13,320,000	
藍澤證券	23,800	672.00	15,993,600	
フィデアホールディングス	123,300	213.00	26,262,900	
池田泉州ホールディングス	134,600	550.00	74,030,000	
アニコム　ホールディングス	8,600	2,341.00	20,132,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	379,500	3,713.00	1,409,083,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	121,700	1,850.00	225,145,000	
マネーパートナーズグループ	16,300	553.00	9,013,900	
小林洋行	4,300	293.00	1,259,900	
第一生命ホールディングス	765,900	1,989.00	1,523,375,100	
東京海上ホールディングス	514,500	4,811.00	2,475,259,500	
イー・ギャランティ	3,800	2,523.00	9,587,400	
アサックス	2,300	1,625.00	3,737,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,100	1,821.00	9,287,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	462,900	1,589.00	735,548,100	
アドバンスクリエイト	3,100	1,851.00	5,738,100	
三井不動産	673,000	2,699.50	1,816,763,500	
三菱地所	945,000	2,317.00	2,189,565,000	
平和不動産	24,000	1,612.00	38,688,000	
東京建物	147,400	1,563.00	230,386,200	
ダイビル	32,700	1,013.00	33,125,100	
京阪神ビルディング	21,100	620.00	13,082,000	
住友不動産	304,000	3,104.00	943,616,000	
太平洋興発	54,000	102.00	5,508,000	
大京	236,000	243.00	57,348,000	
テーオーシー	49,300	948.00	46,736,400	
東京楽天地	21,000	542.00	11,382,000	
レオパレス２１	160,100	675.00	108,067,500	
スターツコーポレーション	13,000	2,035.00	26,455,000	
フジ住宅	16,200	770.00	12,474,000	
空港施設	15,400	588.00	9,055,200	
明和地所	7,000	751.00	5,257,000	
住友不動産販売	11,400	2,768.00	31,555,200	
ゴールドクレスト	11,400	2,229.00	25,410,600	
リログループ	5,100	16,920.00	86,292,000	
日本エスリード	5,000	1,362.00	6,810,000	
日神不動産	15,100	546.00	8,244,600	
日本エスコン	17,100	452.00	7,729,200	
タカラレーベン	55,400	732.00	40,552,800	
サンヨーハウジング名古屋	6,600	1,110.00	7,326,000	
イオンモール	81,800	1,695.00	138,651,000	
ファースト住建	4,800	1,504.00	7,219,200	
ランド	64,400	18.00	1,159,200	
東祥	2,900	5,400.00	15,660,000	

トーセイ	17,400	875.00	15,225,000	
穴吹興産	1,400	2,640.00	3,696,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	78,900	1,059.00	83,555,100	
サンフロンティア不動産	13,600	1,064.00	14,470,400	
エフ・ジェー・ネクスト	11,200	749.00	8,388,800	
ランドビジネス	8,000	283.00	2,264,000	
グランディハウス	11,400	431.00	4,913,400	
東武鉄道	687,000	594.00	408,078,000	
相鉄ホールディングス	206,000	593.00	122,158,000	
東京急行電鉄	699,000	886.00	619,314,000	
京浜急行電鉄	353,000	1,384.00	488,552,000	
小田急電鉄	206,100	2,361.00	486,602,100	
京王電鉄	360,000	989.00	356,040,000	
京成電鉄	96,400	2,909.00	280,427,600	
富士急行	35,000	1,154.00	40,390,000	
新京成電鉄	17,000	421.00	7,157,000	
東日本旅客鉄道	248,900	10,495.00	2,612,205,500	
西日本旅客鉄道	123,900	7,368.00	912,895,200	
東海旅客鉄道	107,000	19,585.00	2,095,595,000	
西武ホールディングス	177,700	2,084.00	370,326,800	
鴻池運輸	18,200	1,558.00	28,355,600	
西日本鉄道	155,000	557.00	86,335,000	
ハマキョウレックス	8,400	2,207.00	18,538,800	
サカイ引越センター	4,500	2,708.00	12,186,000	
近鉄グループホールディングス	1,295,000	458.00	593,110,000	
阪急阪神ホールディングス	162,500	3,945.00	641,062,500	
南海電気鉄道	272,000	598.00	162,656,000	
京阪ホールディングス	288,000	787.00	226,656,000	
神戸電鉄	32,000	380.00	12,160,000	
名古屋鉄道	469,000	569.00	266,861,000	
山陽電気鉄道	47,000	610.00	28,670,000	
トランコム	3,700	5,870.00	21,719,000	
日本通運	498,000	636.00	316,728,000	
ヤマトホールディングス	230,100	2,401.50	552,585,150	
山九	169,000	720.00	121,680,000	
日新	53,000	374.00	19,822,000	
丸運	7,500	253.00	1,897,500	
丸全昭和運輸	43,000	458.00	19,694,000	
センコー	57,900	813.00	47,072,700	
トナミホールディングス	26,000	369.00	9,594,000	
ニッコンホールディングス	43,600	2,485.00	108,346,000	
日本石油輸送	1,500	2,475.00	3,712,500	
福山通運	78,000	653.00	50,934,000	
セイノーホールディングス	91,200	1,353.00	123,393,600	
神奈川中央交通	15,000	731.00	10,965,000	
日立物流	26,800	2,395.00	64,186,000	
丸和運輸機関	3,200	2,901.00	9,283,200	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	13,100	1,330.00	17,423,000	
日本郵船	1,087,000	229.00	248,923,000	
商船三井	675,000	348.00	234,900,000	

川崎汽船	488,000	278.00	135,664,000	
ＮＳユナイテッド海運	58,000	206.00	11,948,000	
明治海運	11,700	434.00	5,077,800	
飯野海運	66,600	474.00	31,568,400	
共栄タンカー	11,000	225.00	2,475,000	
九州旅客鉄道	95,800	3,085.00	295,543,000	
日本航空	231,800	3,592.00	832,625,600	
ＡＮＡホールディングス	2,388,000	323.40	772,279,200	
パスコ	12,000	426.00	5,112,000	
三菱倉庫	84,000	1,693.00	142,212,000	
三井倉庫ホールディングス	74,000	346.00	25,604,000	
住友倉庫	94,000	627.00	58,938,000	
澁澤倉庫	33,000	360.00	11,880,000	
ヤマタネ	6,400	1,641.00	10,502,400	
東陽倉庫	22,800	298.00	6,794,400	
乾汽船	9,500	979.00	9,300,500	
日本トランスシティ	30,000	436.00	13,080,000	
ケイヒン	24,000	156.00	3,744,000	
中央倉庫	7,600	1,087.00	8,261,200	
安田倉庫	9,900	769.00	7,613,100	
東洋埠頭	38,000	192.00	7,296,000	
宇徳	10,700	421.00	4,504,700	
上組	153,000	1,134.00	173,502,000	
サンリツ	1,700	531.00	902,700	
キムラユニティー	3,400	1,221.00	4,151,400	
キユーソー流通システム	3,900	2,433.00	9,488,700	
郵船ロジスティクス	11,800	1,188.00	14,018,400	
近鉄エクスプレス	23,000	1,642.00	37,766,000	
東海運	7,200	459.00	3,304,800	
エーアイテイー	8,000	1,137.00	9,096,000	
内外トランスライン	4,000	1,078.00	4,312,000	
東京放送ホールディングス	83,700	1,993.00	166,814,100	
日本テレビホールディングス	115,900	2,170.00	251,503,000	
朝日放送	12,400	729.00	9,039,600	
テレビ朝日ホールディングス	34,700	2,383.00	82,690,100	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	82,500	539.00	44,467,500	
テレビ東京ホールディングス	10,300	2,331.00	24,009,300	
日本ＢＳ放送	2,900	1,066.00	3,091,400	
Ｕ－ＮＥＸＴ	3,400	693.00	2,356,200	
ワイヤレスゲート	4,100	1,747.00	7,162,700	
コネクシオ	11,200	1,510.00	16,912,000	
日本通信	106,800	171.00	18,262,800	
クロップス	1,400	575.00	805,000	
日本電信電話	1,019,500	5,047.00	5,145,416,500	
ＫＤＤＩ	1,256,500	3,054.00	3,837,351,000	
光通信	15,300	11,050.00	169,065,000	
ＮＴＴドコモ	949,000	2,761.00	2,620,189,000	
エムティーアイ	19,500	734.00	14,313,000	
GMOインターネット	46,400	1,569.00	72,801,600	
カドカワ	36,800	1,755.00	64,584,000	

学研ホールディングス	42,000	334.00	14,028,000	
ゼンリン	16,800	2,388.00	40,118,400	
昭文社	7,100	699.00	4,962,900	
インプレスホールディングス	11,100	144.00	1,598,400	
東京電力ホールディングス	1,091,600	477.00	520,693,200	
中部電力	424,000	1,600.50	678,612,000	
関西電力	525,200	1,298.00	681,709,600	
中国電力	177,800	1,358.00	241,452,400	
北陸電力	126,000	1,320.00	166,320,000	
東北電力	321,400	1,442.00	463,458,800	
四国電力	115,900	1,187.00	137,573,300	
九州電力	284,200	1,296.00	368,323,200	
北海道電力	120,500	920.00	110,860,000	
沖縄電力	18,900	2,700.00	51,030,000	
電源開発	102,400	2,756.00	282,214,400	
エフオン	5,400	1,033.00	5,578,200	
イーレックス	5,400	3,350.00	18,090,000	
東京瓦斯	1,380,000	529.70	730,986,000	
大阪瓦斯	1,248,000	448.60	559,852,800	
東邦瓦斯	324,000	945.00	306,180,000	
北海道瓦斯	32,000	278.00	8,896,000	
広島ガス	26,700	378.00	10,092,600	
西部瓦斯	145,000	256.00	37,120,000	
静岡ガス	39,600	813.00	32,194,800	
メタウォーター	7,300	2,832.00	20,673,600	
アイネット	7,400	1,139.00	8,428,600	
松竹	84,000	1,360.00	114,240,000	
東宝	83,000	3,325.00	275,975,000	
エイチ・アイ・エス	21,900	3,060.00	67,014,000	
東映	47,000	1,024.00	48,128,000	
ラックランド	2,200	1,907.00	4,195,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	78,500	5,700.00	447,450,000	
共立メンテナンス	10,900	7,220.00	78,698,000	
イチネンホールディングス	14,300	1,186.00	16,959,800	
建設技術研究所	8,600	1,038.00	8,926,800	
スペース	7,300	1,254.00	9,154,200	
アインホールディングス	15,300	8,020.00	122,706,000	
燦ホールディングス	2,700	1,573.00	4,247,100	
ピー・シー・エー	1,800	1,458.00	2,624,400	
スバル興業	10,000	558.00	5,580,000	
東京テアトル	53,000	160.00	8,480,000	
タナベ経営	2,800	1,295.00	3,626,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,029.00	1,749,300	
ナガワ	2,500	4,535.00	11,337,500	
よみうりランド	27,000	496.00	13,392,000	
東京都競馬	92,000	276.00	25,392,000	
常磐興産	5,100	1,593.00	8,124,300	
カナモト	18,800	3,170.00	59,596,000	
東京ドーム	53,600	1,149.00	61,586,400	
ＤＴＳ	13,100	2,602.00	34,086,200	

スクウェア・エニックス・ホールディングス	48,900	3,105.00	151,834,500	
シーイーシー	7,600	1,855.00	14,098,000	
カプコン	29,800	2,742.00	81,711,600	
西尾レントオール	10,800	3,565.00	38,502,000	
アイ・エス・ビー	2,300	947.00	2,178,100	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	72,000	38.00	2,736,000	
日本空港ビルデング	40,500	4,255.00	172,327,500	
トランス・コスモス	15,600	2,858.00	44,584,800	
乃村工藝社	28,800	1,733.00	49,910,400	
ジャステック	8,100	1,083.00	8,772,300	
ＳＣＳＫ	34,500	4,235.00	146,107,500	
藤田観光	44,000	366.00	16,104,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	72,000	151.00	10,872,000	
日本管財	11,600	1,820.00	21,112,000	
トーカイ	6,000	4,055.00	24,330,000	
白洋舎	500	2,727.00	1,363,500	
セコム	139,800	8,642.00	1,208,151,600	
日本システムウエア	4,200	1,518.00	6,375,600	
セントラル警備保障	6,000	2,073.00	12,438,000	
アイネス	16,100	1,257.00	20,237,700	
丹青社	23,300	815.00	18,989,500	
メイテック	16,300	4,435.00	72,290,500	
ＴＫＣ	11,800	3,360.00	39,648,000	
アサツー　ディ・ケイ	21,900	2,990.00	65,481,000	
富士ソフト	18,900	2,830.00	53,487,000	
応用地質	12,700	1,405.00	17,843,500	
船井総研ホールディングス	17,300	1,798.00	31,105,400	
ＮＳＤ	27,000	1,869.00	50,463,000	
進学会	5,700	575.00	3,277,500	
丸紅建材リース	12,000	232.00	2,784,000	
オオバ	10,100	466.00	4,706,600	
コナミホールディングス	57,300	4,735.00	271,315,500	
学究社	3,700	1,495.00	5,531,500	
ベネッセホールディングス	45,000	3,315.00	149,175,000	
イオンディライト	15,200	3,425.00	52,060,000	
ナック	8,300	994.00	8,250,200	
福井コンピュータホールディングス	3,700	3,160.00	11,692,000	
ニチイ学館	23,400	869.00	20,334,600	
ダイセキ	23,500	2,248.00	52,828,000	
ステップ	4,600	1,388.00	6,384,800	
日鉄住金物産	11,100	4,630.00	51,393,000	
元気寿司	3,300	2,158.00	7,121,400	
トラスコ中山	29,000	2,554.00	74,066,000	
ヤマダ電機	424,700	637.00	270,533,900	
オートバックスセブン	47,000	1,787.00	83,989,000	
アークランドサカモト	21,500	1,414.00	30,401,000	
ニトリホールディングス	54,900	13,100.00	719,190,000	
グルメ杵屋	9,000	1,028.00	9,252,000	

愛眼	10,800	198.00	2,138,400	
ケーユーホールディングス	6,700	838.00	5,614,600	
吉野家ホールディングス	44,200	1,633.00	72,178,600	
加藤産業	19,900	2,778.00	55,282,200	
イノテック	11,000	602.00	6,622,000	
イエローハット	12,000	2,566.00	30,792,000	
松屋フーズ	6,100	3,975.00	24,247,500	
ＪＢＣＣホールディングス	10,700	812.00	8,688,400	
ＪＫホールディングス	12,800	605.00	7,744,000	
サガミチェーン	16,000	1,313.00	21,008,000	
日伝	5,300	3,195.00	16,933,500	
関西スーパーマーケット	10,400	1,546.00	16,078,400	
ミロク情報サービス	9,500	1,778.00	16,891,000	
北沢産業	11,000	211.00	2,321,000	
杉本商事	7,400	1,537.00	11,373,800	
因幡電機産業	17,800	4,015.00	71,467,000	
王将フードサービス	9,300	4,450.00	41,385,000	
プレナス	14,200	2,354.00	33,426,800	
ミニストップ	9,400	2,060.00	19,364,000	
アークス	23,700	2,611.00	61,880,700	
バローホールディングス	27,300	3,080.00	84,084,000	
バイテックホールディングス	5,200	1,282.00	6,666,400	
ミスミグループ本社	142,700	1,945.00	277,551,500	
アルテック	11,200	224.00	2,508,800	
ベルク	5,600	4,320.00	24,192,000	
大　庄	6,900	1,619.00	11,171,100	
タキヒヨー	19,000	471.00	8,949,000	
ファーストリテイリング	21,200	38,560.00	817,472,000	
ソフトバンクグループ	571,700	8,495.00	4,856,591,500	
蔵王産業	2,100	1,434.00	3,011,400	
スズケン	57,800	3,885.00	224,553,000	
サンドラッグ	24,200	8,590.00	207,878,000	
サックスバー　ホールディングス	12,000	1,200.00	14,400,000	
ジェコス	8,800	1,152.00	10,137,600	
ヤマザワ	2,700	1,838.00	4,962,600	
やまや	2,600	1,750.00	4,550,000	
ルネサスイーストン	11,200	541.00	6,059,200	
ベルーナ	31,700	799.00	25,328,300	
合計	194,680,274		290,967,130,996	

＊担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘　柄	株　式　数
トヨタ自動車	500,000

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,669,800,351	1,810,993,822
国債証券		322,571,545,900	322,898,743,100
地方債証券		24,847,419,058	23,972,716,425
特殊債券		21,383,050,814	18,970,399,799
社債券		18,810,793,240	17,116,038,660
未収入金		－	1,722,720,000
未収利息		871,382,620	853,274,556
前払費用		7,312,311	16,404,130
流動資産合計		391,161,304,294	387,361,290,492
資産合計		391,161,304,294	387,361,290,492
負債の部			
流動負債			
未払金		2,553,334,000	－
未払解約金		203,965,000	187,691,000
流動負債合計		2,757,299,000	187,691,000
負債合計		2,757,299,000	187,691,000
純資産の部			
元本等			
元本	※１	292,253,585,690	302,351,149,022
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		96,150,419,604	84,822,450,470
元本等合計		388,404,005,294	387,173,599,492
純資産合計		388,404,005,294	387,173,599,492
負債純資産合計		391,161,304,294	387,361,290,492

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	332,334,674,604円	292,253,585,690円
同期中追加設定元本額	28,402,466,785円	37,966,858,814円
同期中一部解約元本額	68,483,555,699円	27,869,295,482円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	9,941,134,725円	10,854,182,784円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	172,180,702円	136,287,516円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	123,653,996円	123,830,945円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	36,694,771円	46,215,676円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	358,912,607円	406,021,206円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	109,095,285円	119,424,698円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	14,849,516円	24,093,768円
たわらノーロード　国内債券	843,892,595円	901,143,539円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ向け＞	755,274円	755,274円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,136,230,303円	12,171,985,997円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	4,455,584,454円	4,811,241,049円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	6,480,666,778円	6,822,072,744円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,577,558,464円	2,649,526,618円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,635,560,673円	1,641,032,476円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,752,431,130円	1,722,626,088円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	244,957,185円	244,923,243円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	107,376,967円	98,797,552円

マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,232,067,996円	2,195,866,560円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	8,622,472円	4,978,002円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	241,882,463円	353,017,386円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	180,929,656円	250,995,189円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	42,599,566円	60,859,020円
投資のソムリエ	8,397,162,509円	8,918,982,259円
クルーズコントロール	603,930,416円	4,082,782,511円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	193,382,273円	263,430,477円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	830,691,516円	1,121,552,998円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	60,028,288円	114,156,112円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	162,357円	1,612,582円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,845,659円	12,066,843円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	3,267,039円	26,868,545円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	42,386,066円	113,106,192円
ダイナミック・ナビゲーション	1,164,445円	462,426円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	－円	2,413,062円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
ＤＩＡＭ高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	31,069,835,454円	31,050,583,696円
ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	1,017,679,760円	720,300,635円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	565,187,887円	512,582,948円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	487,442,086円	464,509,485円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	263,811,800円	294,451,872円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	120,775,930円	116,088,208円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	308,201,994円	324,560,165円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	134,933,432円	134,546,633円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	100,766,131円	79,812,989円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,142,086,582円	3,873,885,819円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,882,754,786円	1,486,248,373円

ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,291,850,962円	7,186,488,246円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,347,753,977円	3,535,321,999円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,855,728,654円	6,415,378,240円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	726,773,720円	751,554,552円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	3,065,894,724円	2,297,736,149円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,268,643,026円	4,381,704,478円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	5,825,783,266円	5,754,159,456円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	839,267,900円	812,385,968円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,155,191,528円	5,909,722,696円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,389,387,464円	6,745,903,203円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	83,661,791,662円	89,058,950,692円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,148,667,373円	1,234,322,032円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,204,561,225円	7,560,187,206円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,346,101,006円	28,217,510,574円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	93,379,444円	94,990,409円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,695,134円	2,469,333円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,771,365円	9,097,607円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,694,944,222円	31,637,535,869円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	532,331,561円	562,537,512円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	149,060,577円	140,361,156円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	686,289,506円	657,286,245円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	414,302円	453,278円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	308,265円	349,123円
計	292,253,585,690円	302,351,149,022円
２．　受益権の総数	292,253,585,690口	302,351,149,022口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	平成29年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	17,818,346,000	1,960,142,200
地方債証券	17,098,491	△126,766,942
特殊債券	△22,523,087	△131,484,282
社債券	76,252,550	△123,096,030
合計	17,889,173,954	1,578,794,946

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月16日から平成28年7月11日まで及び平成28年2月16日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3290円 (13,290円)	1.2805円 (12,805円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

種　類	銘　柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	３６１回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,004,650,000	
	３６３回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,005,020,000	
	３６４回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,507,830,000	
	３６５回　利付国庫債券（２年）	2,500,000,000	2,513,350,000	
	３６６回　利付国庫債券（２年）	4,000,000,000	4,022,280,000	
	３６７回　利付国庫債券（２年）	500,000,000	502,945,000	
	３６９回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,006,340,000	
	３７０回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,006,640,000	
	１０９回　利付国庫債券（５年）	2,000,000,000	2,009,820,000	
	１１０回　利付国庫債券（５年）	2,000,000,000	2,014,560,000	
	１１２回　利付国庫債券（５年）	1,500,000,000	1,514,670,000	
	１１３回　利付国庫債券（５年）	2,000,000,000	2,016,680,000	
	１１４回　利付国庫債券（５年）	3,500,000,000	3,533,145,000	
	１１６回　利付国庫債券（５年）	4,200,000,000	4,236,708,000	
	１１７回　利付国庫債券（５年）	4,000,000,000	4,038,120,000	
	１１８回　利付国庫債券（５年）	4,200,000,000	4,243,638,000	
	１２０回　利付国庫債券（５年）	1,500,000,000	1,516,605,000	
	１２１回　利付国庫債券（５年）	2,000,000,000	2,016,740,000	
	１２２回　利付国庫債券（５年）	4,500,000,000	4,539,150,000	
	１２３回　利付国庫債券（５年）	4,000,000,000	4,035,800,000	
	１２４回　利付国庫債券（５年）	4,500,000,000	4,541,940,000	
	１２５回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,029,460,000	
	１２６回　利付国庫債券（５年）	4,200,000,000	4,242,378,000	
	１２７回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,031,530,000	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	4,000,000,000	4,043,720,000	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	4,500,000,000	4,550,895,000	
	２回　利付国庫債券（４０年）	600,000,000	843,018,000	
	３回　利付国庫債券（４０年）	700,000,000	989,387,000	
	４回　利付国庫債券（４０年）	800,000,000	1,137,248,000	
	５回　利付国庫債券（４０年）	800,000,000	1,093,576,000	
	６回　利付国庫債券（４０年）	700,000,000	939,785,000	
	７回　利付国庫債券（４０年）	800,000,000	1,026,928,000	
	８回　利付国庫債券（４０年）	1,000,000,000	1,187,640,000	
	９回　利付国庫債券（４０年）	800,000,000	684,128,000	
	２９０回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,020,260,000	
	２９３回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,235,904,000	
	２９６回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,059,380,000	
	２９７回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,373,508,000	
	２９９回　利付国庫債券（１０年）	900,000,000	930,177,000	
	３０１回　利付国庫債券（１０年）	2,900,000,000	3,021,249,000	

３０３回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,356,329,000	
３０５回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,610,275,000	
３０６回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,575,810,000	
３０８回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	840,456,000	
３０９回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,043,670,000	
３１０回　利付国庫債券（１０年）	2,800,000,000	2,920,372,000	
３１２回　利付国庫債券（１０年）	2,200,000,000	2,317,986,000	
３１３回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,182,340,000	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,589,295,000	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,058,220,000	
３１８回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,053,510,000	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,591,215,000	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,583,775,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,645,275,000	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,099,460,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	2,700,000,000	2,839,725,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	1,700,000,000	1,781,175,000	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,564,320,000	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,268,280,000	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	1,700,000,000	1,799,331,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,614,875,000	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,092,920,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	2,600,000,000	2,722,018,000	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,080,040,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,560,735,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,331,993,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,582,850,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,376,567,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,101,520,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	3,500,000,000	3,588,970,000	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	4,000,000,000	4,029,320,000	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,529,610,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	5,000,000,000	5,026,500,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	502,220,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	132,657,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	128,256,000	
３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	254,602,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	272,234,000	
５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	254,018,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	260,644,000	
７回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	387,747,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	365,901,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	482,412,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	380,961,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	376,425,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	660,760,000	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	267,790,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	536,520,000	
１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	265,160,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	820,000,000	1,073,134,000	

１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	262,084,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	403,911,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	656,235,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	470,000,000	633,964,200	
２３回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	810,384,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	405,345,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	526,224,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	935,228,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,224,801,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	1,092,832,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,487,057,000	
３０回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,336,710,000	
３１回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,454,321,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,616,784,000	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,673,945,000	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,603,752,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,945,230,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,820,798,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,793,064,000	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,260,110,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	1,027,888,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	884,065,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	991,400,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,239,680,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	993,248,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	993,584,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,192,490,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,432,704,000	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,464,780,000	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,287,011,000	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,171,240,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,218,732,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,149,252,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,216,657,000	
３９回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	413,792,000	
４０回　利付国庫債券（２０年）	720,000,000	751,060,800	
４２回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	849,528,000	
４３回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	931,964,800	
４５回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	973,971,000	
４６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	540,890,000	
４７回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,033,163,000	
４８回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	552,365,000	
５０回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	847,181,400	
５１回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	657,162,000	
５２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	607,843,500	
５４回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	780,997,000	
５５回　利付国庫債券（２０年）	810,000,000	899,326,800	
５７回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,254,130,500	
５８回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	668,988,000	
６０回　利付国庫債券（２０年）	990,000,000	1,078,644,600	

６１回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	854,456,000	
６２回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	845,520,000	
６４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	679,386,000	
６５回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,250,557,000	
６７回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	2,166,209,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	1,250,000,000	1,476,275,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	1,250,000,000	1,453,400,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	1,190,000,000	1,379,924,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,641,178,000	
７８回　利付国庫債券（２０年）	1,450,000,000	1,681,608,500	
８１回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,642,452,000	
８３回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,660,428,000	
８５回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,666,854,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,455,540,000	
９０回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,450,056,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,563,432,000	
９３回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	836,990,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	964,648,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,476,384,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,713,530,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,703,758,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,600,976,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,760,990,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,594,762,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	2,089,878,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,933,776,000	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,996,672,000	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,858,320,000	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,862,850,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	2,263,770,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	1,000,000,000	1,233,850,000	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,086,948,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	2,324,042,000	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	2,379,693,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	2,283,822,000	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	859,691,000	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,092,798,000	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,822,875,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	2,163,294,000	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,095,219,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	961,920,000	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	2,045,015,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,925,456,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	2,100,000,000	2,529,765,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	2,100,000,000	2,498,139,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,687,126,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,928,336,000	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	2,021,929,000	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,759,590,000	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,200,000,000	2,579,654,000	

	１５０回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,964,554,000	
	１５１回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	2,017,332,000	
	１５２回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,791,120,000	
	１５３回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	2,158,343,000	
	１５４回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,675,125,000	
	１５５回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,726,416,000	
	１５６回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,453,395,000	
	１５７回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	1,673,226,000	
	１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,000,000,000	1,963,060,000	
	１５９回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	398,932,000	
国債証券　合計		292,420,000,000	322,898,743,100	
地方債証券	６５９回　東京都公募公債	203,500,000	208,241,550	
	６６７回　東京都公募公債	300,000,000	310,314,000	
	６８０回　東京都公募公債	200,000,000	209,086,000	
	６８５回　東京都公募公債	500,000,000	519,410,000	
	６８８回　東京都公募公債	200,000,000	206,926,000	
	６９７回　東京都公募公債	500,000,000	524,585,000	
	７０１回　東京都公募公債	700,000,000	732,284,000	
	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	524,375,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	316,311,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	418,952,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	116,418,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	243,178,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	362,796,000	
	２１年度６回　北海道公募公債	200,000,000	208,406,000	
	２２年度１２回　北海道公募公債	200,000,000	210,550,000	
	１６６回　神奈川県公募公債	300,000,000	311,097,000	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	313,635,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	310,104,000	
	３１９回　大阪府公募公債	200,000,000	206,394,000	
	３３６回　大阪府公募公債	200,000,000	209,382,000	
	３４５回　大阪府公募公債	300,000,000	315,033,000	
	３５６回　大阪府公募公債	200,000,000	210,630,000	
	３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	312,993,000	
	３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	317,277,000	
	２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	360,080,000	
	２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	205,402,000	
	１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	322,086,000	
	２１年度５回　静岡県公募公債	197,000,000	204,554,950	
	２２年度８回　静岡県公募公債	200,000,000	207,664,000	
	２３年度９回　静岡県公募公債	200,000,000	210,180,000	
	１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	117,661,000	
	２０年度４回　愛知県公募公債	100,000,000	102,726,000	
	２２年度６回　愛知県公募公債	200,000,000	208,490,000	
	２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	527,910,000	
	２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	315,591,000	
	２２年度１回　広島県公募公債	200,000,000	209,248,000	
	２１年度４回　埼玉県公募公債	200,000,000	207,328,000	
	２３年度２回　埼玉県公募公債	200,000,000	210,384,000	
	２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	415,368,000	

	２１年度３回　福岡県公募公債	200,000,000	208,136,000	
	２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	208,756,000	
	２１年度６回　千葉県公募公債	200,000,000	207,624,000	
	２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	312,741,000	
	２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	210,426,000	
	６５回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,618,000	
	８０回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,842,000	
	９４回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	525,330,000	
	９９回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	736,456,000	
	１０６回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,583,000	
	１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	527,465,000	
	１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	733,341,000	
	１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,360,000	
	１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,620,000	
	１２６回　共同発行市場公募地方債	793,900,000	834,190,425	
	１２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,055,000	
	１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,342,000	
	１３７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,740,000	
	１３９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,870,000	
	１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,170,000	
	１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,564,000	
	１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	414,348,000	
	１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,070,000	
	４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	467,100,000	
	４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	122,418,000	
	２２年度３回　横浜市公募公債	200,000,000	208,606,000	
	２２年度５回　横浜市公募公債	200,000,000	209,960,000	
	２３年度４回　横浜市公募公債	450,000,000	472,738,500	
	２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	421,884,000	
	２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	209,704,000	
	２回　川崎市公募公債　１５年	100,000,000	105,682,000	
	２１年度２回　北九州市公募公債	200,000,000	208,216,000	
	２３年度１回　千葉市公募公債	200,000,000	211,710,000	
地方債証券　合計		22,844,400,000	23,972,716,425	
特殊債券	４６回　日本政策投資銀行債券	200,000,000	204,008,000	
	４８回　高速道路機構債	700,000,000	726,159,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	730,247,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	104,515,000	
	９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,028,000	
	１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	330,726,000	
	５６回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,584,000	
	６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	725,714,290	
	６６回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	166,187,700	
	６７回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	412,637,020	

７１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	616,524,000	
７８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	722,687,000	
８２回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,715,000	
８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,680,000	
１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	419,740,000	
１８０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,044,390,000	
１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	516,970,000	
１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	528,515,000	
１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	349,648,200	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	516,190,000	
８回　政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	674,234,190	
３回　政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,957,180	
５回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	519,490,000	
８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,886,000	
１０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,745,000	
１５回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,250,000	
２０回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,613,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,651,000	
３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,634,000	
４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	420,096,000	
５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	529,590,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,670,000	
１９回　都市再生機構債券	200,000,000	204,840,000	
３７回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	311,472,000	
６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	56,085,000	59,894,854	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	39,518,000	42,190,997	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	58,521,000	62,518,569	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	62,727,000	67,532,515	
１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	26,464,000	27,667,847	
１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	134,930,000	140,139,647	
４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,710,000	38,674,244	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,756,000	23,331,134	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,528,000	88,509,629	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,899,000	66,098,228	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,485,000	117,349,433	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	204,225,000	219,253,917	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	378,568,000	403,152,205	
７５５号　利付商工債	260,000,000	260,988,000	

	い第７６９号　利付商工債	200,000,000	201,180,000	
	い第７７９号　利付商工債	200,000,000	201,248,000	
	７６０号　利附農林債	300,000,000	301,998,000	
	７６４号　利附農林債	500,000,000	503,410,000	
	２８２回　利附信金中金債	300,000,000	301,209,000	
	２９３回　利附信金中金債	400,000,000	402,192,000	
	３０２回　利附信金中金債	300,000,000	301,686,000	
	１８６号　利附商工債（３年）	200,000,000	200,476,000	
	２１回　政保中日本高速道路債券	300,000,000	306,951,000	
	５回　中日本高速道路債券	200,000,000	206,500,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	524,255,000	
特殊債券　合計		18,287,416,000	18,970,399,799	
社債券	１回　スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,869,000	
	３３７回　東京交通債	200,000,000	217,654,000	
	２７回　ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,198,000	
	２２回　中日本高速道路債券	300,000,000	311,280,000	
	７回　キリンホールディングス社債	100,000,000	104,391,000	
	９回　日本たばこ産業社債	200,000,000	200,992,000	
	３回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,777,000	
	４１回　住友化学社債	100,000,000	104,216,000	
	３７回　三菱化学社債	100,000,000	103,124,000	
	８回　ブリヂストン社債	200,000,000	200,794,000	
	６４回　新日本製鐵社債	100,000,000	104,433,000	
	１１回　パナソニック社債	100,000,000	101,253,000	
	１２回　パナソニック社債	200,000,000	201,588,000	
	５６回　日産自動車社債	100,000,000	101,355,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	210,094,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	100,000,000	103,260,000	
	４９回　伊藤忠商事社債	100,000,000	103,237,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	103,964,000	
	４５回　住友商事社債	100,000,000	103,476,000	
	４７回　住友商事社債	100,000,000	102,362,000	
	６９回　三菱商事社債	300,000,000	308,037,000	
	４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	103,369,000	
	７回　みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	105,557,000	
	７回　東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	211,440,000	
	２５回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	208,448,000	
	２８回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	210,816,000	
	３２回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	300,000,000	318,270,000	
	４回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,246,000	
	６回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	105,763,000	
	７回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	200,000,000	209,318,000	
	９回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	106,152,000	
	１２回　住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,292,000	
	１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	206,416,000	
	１０回　セブン銀行社債	100,000,000	104,305,000	
	２０回　三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,406,000	

２２回　三井住友銀行劣後社債	200,000,000	209,084,000	
２３回　三井住友銀行劣後社債	400,000,000	421,868,000	
１４回　みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	210,560,000	
２３回　ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,372,000	
１５回　トヨタファイナンス社債	200,000,000	211,576,000	
４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	206,500,000	
１６４回　オリックス社債	100,000,000	102,426,000	
１６７回　オリックス社債	200,000,000	200,986,000	
１４回　大和証券グループ本社社債	100,000,000	103,552,000	
２６回　野村ホールディングス社債	100,000,000	105,191,000	
４６回　野村ホールディングス社債	200,000,000	201,382,000	
３８回　三井不動産社債	200,000,000	208,262,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	114,128,000	
９０回　三菱地所社債	100,000,000	102,105,000	
９６回　三菱地所社債	200,000,000	207,628,000	
８７回　住友不動産社債	100,000,000	102,040,000	
８回　エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	102,380,000	
１５回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	328,116,000	
１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,546,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	346,341,000	
５２回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	306,294,000	
５６回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	310,011,000	
９回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	222,552,000	
１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	337,998,000	
５回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,806,000	
６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,637,000	
１１回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,108,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,526,000	
１５回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	209,638,000	
２３回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,795,000	
６０回　日本電信電話社債	300,000,000	313,914,000	
１５回　ＮＴＴドコモ社債	200,000,000	205,652,000	
４５５回　東京電力社債	200,000,000	206,598,000	
５４２回　東京電力社債	500,000,000	509,145,000	
４７６回　中部電力社債	100,000,000	103,041,000	
４９６回　中部電力社債	500,000,000	519,005,000	
４１０回　関西電力社債	300,000,000	310,626,000	
４９２回　関西電力社債	200,000,000	202,174,000	
４９３回　関西電力社債	200,000,000	202,164,000	
３７７回　中国電力社債	200,000,000	211,344,000	
２６０回　北陸電力社債	100,000,000	107,374,000	
２８１回　北陸電力社債	200,000,000	205,052,000	
４７１回　東北電力社債	200,000,000	211,900,000	
４７３回　東北電力社債	300,000,000	304,989,000	
２３７回　四国電力社債	100,000,000	103,712,000	
２５３回　四国電力社債	200,000,000	209,860,000	
４２３回　九州電力社債	200,000,000	204,412,000	
４２４回　九州電力社債	200,000,000	212,148,000	
４２６回　九州電力社債	400,000,000	419,644,000	
３２０回　北海道電力社債	200,000,000	203,524,000	

	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	167,288,660	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	228,114,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	314,406,000	
	１７回　東京ガス社債	100,000,000	103,761,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	107,868,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	103,763,000	
社債券　合計		16,361,000,000	17,116,038,660	
合計		349,912,816,000	382,957,897,984	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,149,484,159	4,450,881,435
コール・ローン		555,810,350	136,302,820
株式		234,745,691,060	263,044,401,726
投資信託受益証券		849,632,766	833,914,594
投資証券		6,182,483,947	6,182,633,954
派生商品評価勘定		157,290,864	29,766,443
未収入金		12,533,139	2,788,032
未収配当金		327,009,097	330,630,621
差入委託証拠金		1,743,893,635	1,428,687,077
流動資産合計		246,723,829,017	276,440,006,702
資産合計		246,723,829,017	276,440,006,702
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,775,706	880,817
未払金		136,523,753	－
未払解約金		138,690,000	229,401,000
流動負債合計		277,989,459	230,281,817
負債合計		277,989,459	230,281,817
純資産の部			
元本等			
元本	※１	102,470,324,899	92,727,414,724
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		143,975,514,659	183,482,310,161
元本等合計		246,445,839,558	276,209,724,885
純資産合計		246,445,839,558	276,209,724,885
負債純資産合計		246,723,829,017	276,440,006,702

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。 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。 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．　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。 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．　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。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	97,735,137,391円	102,470,324,899円
同期中追加設定元本額	15,253,856,269円	5,887,330,395円
同期中一部解約元本額	10,518,668,761円	15,630,240,570円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	1,860,301,307円	1,946,959,402円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	7,070,818円	4,434,740円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	16,314,685円	12,888,567円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	37,700,196円	29,749,544円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	14,738,824円	13,210,663円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,433,689円	12,430,317円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,258,200円	15,508,554円
たわらノーロード　先進国株式	1,621,487,264円	2,079,682,896円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	426,031円	425,695円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	－円	61,132,652円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	35,148,925,218円	35,568,884,895円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	175,410,587円	179,962,215円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	919,847,850円	953,771,814円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,122,290,696円	1,115,778,433円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	145,919,659円	153,484,704円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	406,699,674円	427,386,666円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	343,433,795円	346,239,329円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	45,778,536円	42,363,606円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	951,244,965円	938,046,218円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	231,426,141円	228,756,848円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	23,489,567円	26,508,121円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	49,505,505円	51,983,023円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	95,169,676円	104,518,603円	
投資のソムリエ	401,696,368円	826,420,611円	
クルーズコントロール	126,776,777円	827,877,963円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	9,319,256円	24,426,190円	
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	83,698,246円	87,168,309円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	28,675,864円	42,666,319円	
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	34,150円	325,530円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	943,122円	6,117,616円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	1,679,841円	13,598,018円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	2,039,677円	2,348,013円	
ダイナミック・ナビゲーション	575,059円	1,595,132円	
リスク抑制世界８資産バランスファンド	－円	49,988円	
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	208,719,047円	173,737,690円	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	3,250,698,975円	3,216,630,874円	
ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	145,609,101円	172,145,175円	
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	392,381円	392,000円	
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,539,307円	29,023,964円	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	223,630,974円	168,073,193円	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	363,341,022円	320,310,030円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,499,478円	21,588,870円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	169,736,421円	140,963,619円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,847,320円	11,674,565円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,732,262円	17,327,751円	

ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,989,076,156円	1,121,411,686円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,587,774,045円	645,440,187円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,003,393,476円	779,496,270円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,075,482,053円	895,242,912円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,225,603,207円	2,786,274,684円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	1,334,768,278円	1,077,755,283円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	2,026,788,286円	1,185,802,464円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,567,593,129円	1,269,093,076円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	1,067,314,685円	831,466,203円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	12,333,699円	13,494,600円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,086,524,668円	3,822,906,387円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,739,502,696円	1,523,731,124円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,521,229,462円	9,666,114,191円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	632,413,399円	536,552,271円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,984,726,533円	1,642,532,401円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,261,622,463円	6,133,183,873円	
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,096,738円	25,699,340円	
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,009,666円	1,714,626円	
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,528,117円	14,483,642円	

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,817,602,164円	8,250,573,365円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	113,400,844円	85,433,865円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	187,990円	169,337円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	295,614円	274,012円
計	102,470,324,899円	92,727,414,724円
２．　受益権の総数	102,470,324,899口	92,727,414,724口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	平成29年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	24,559,598,481	45,803,894,661
投資信託受益証券	98,471,569	57,863,895
投資証券	1,013,874,167	572,776,282
合計	25,671,944,217	46,434,534,838

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月16日から平成28年7月11日まで及び平成28年2月16日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年7月11日 現在				平成29年1月11日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	－	－	－	－	968,141,605	－	968,068,200	73,405
アメリカ・ドル	－	－	－	－	643,540,875	－	643,522,500	18,375
イギリス・ポンド	－	－	－	－	74,870,980	－	74,867,800	3,180
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	40,968,420	－	40,978,200	△9,780
カナダ・ドル	－	－	－	－	38,533,800	－	38,522,000	11,800
ユーロ	－	－	－	－	170,227,530	－	170,177,700	49,830
買　建	1,051,156,245	－	1,050,283,100	△873,145	－	－	－	－
アメリカ・ドル	733,254,870	－	732,816,000	△438,870	－	－	－	－
イギリス・ポンド	78,270,828	－	78,228,000	△42,828	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	26,649,000	－	26,645,500	△3,500	－	－	－	－
カナダ・ドル	42,537,180	－	42,427,000	△110,180	－	－	－	－
ユーロ	170,444,367	－	170,166,600	△277,767	－	－	－	－
合計	1,051,156,245	－	1,050,283,100	△873,145	968,141,605	－	968,068,200	73,405

（注）時価の算定方法

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

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成28年7月11日 現在				平成29年1月11日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	5,077,497,639	－	5,232,885,942	155,388,303	5,114,184,278	－	5,142,996,499	28,812,221
合計	5,077,497,639	－	5,232,885,942	155,388,303	5,114,184,278	－	5,142,996,499	28,812,221

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4050円 (24,050円)	2.9787円 (29,787円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
（１）株式

平成29年1月11日現在

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,084	795.900	23,943,855.600	
	ABBOTT LABORATORIES	127,914	41.290	5,281,569.060	
	AES CORP	45,579	11.330	516,410.070	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,924	165.520	11,242,780.480	
	ADOBE SYSTEMS INC	37,684	108.260	4,079,669.840	
	CHUBB LTD	34,845	130.460	4,545,878.700	
	AGCO CORP	5,610	60.340	338,507.400	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,671	145.260	2,276,369.460	
	ALLEGHANY CORP	1,054	599.500	631,873.000	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	65,207	73.560	4,796,626.920	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	87.940	413,581.820	
	ALLSTATE CORP	27,316	73.750	2,014,555.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	53,883	117.850	6,350,111.550	
	AMGEN INC	55,670	158.760	8,838,169.200	
	HESS CORP	20,421	61.450	1,254,870.450	
	AMERICAN EXPRESS CO	58,349	76.650	4,472,450.850	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,960	62.120	2,295,955.200	
	AFLAC INC	30,673	69.430	2,129,626.390	
	AMERICAN INTL GROUP	79,535	67.200	5,344,752.000	
	AMERCO	551	369.080	203,363.080	
	ANALOG DEVICES	23,069	72.350	1,669,042.150	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	69.580	2,852,988.740	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,266	143.670	2,480,606.220	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	68,862	43.610	3,003,071.820	
	TIME WARNER	57,964	93.400	5,413,837.600	
	JONES LANG LASALLE INC	3,815	106.850	407,632.750	
	VALERO ENERGY CORP	35,405	66.530	2,355,494.650	
	APACHE CORP	28,309	62.870	1,779,786.830	
	ANSYS INC	5,619	94.190	529,253.610	
	APPLE INC	402,214	119.110	47,907,709.540	
	APPLIED MATERIALS INC	82,900	33.130	2,746,477.000	
	ALBEMARLE CORP	7,904	89.880	710,411.520	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,421	44.460	1,974,957.660	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	77.130	604,005.030	
	AMEREN CORP	17,312	51.970	899,704.640	

ARROW ELECTRONICS INC	7,403	73.100	541,159.300	
AUTOLIV INC	6,197	113.130	701,066.610	
AUTODESK INC	14,259	79.980	1,140,434.820	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,227	102.200	3,497,999.400	
AUTOZONE INC	2,229	793.680	1,769,112.720	
AVERY DENNISON CORP	7,368	72.730	535,874.640	
AVNET INC	10,288	46.970	483,227.360	
BAKER HUGHES INC	30,916	62.380	1,928,540.080	
BALL CORP	12,162	75.620	919,690.440	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	91,251	161.470	14,734,298.970	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,107	47.720	3,774,986.040	
CR BARD INC	5,309	232.660	1,235,191.940	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,687	46.510	1,752,822.370	
BED BATH &BEYOND INC	10,744	40.750	437,818.000	
BECTON DICKINSON & CO	15,808	170.940	2,702,219.520	
AMETEK INC	16,775	49.870	836,569.250	
BE AEROSPACE INC	8,229	61.360	504,931.440	
VERIZON COMM INC	305,099	52.760	16,097,023.240	
WR BERKLEY CORP	8,134	66.910	544,245.940	
BEST BUY CO INC	21,033	43.860	922,507.380	
YUM! BRANDS INC	28,494	64.980	1,851,540.120	
FIRSTENERGY CORP	30,796	30.370	935,274.520	
H&R BLOCK INC	16,114	23.650	381,096.100	
BOEING CO	44,146	159.070	7,022,304.220	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	49.020	531,670.920	
BORGWARNER INC	14,648	40.770	597,198.960	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,578	23.610	2,374,646.580	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	73.140	723,647.160	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	429.940	790,229.720	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	124,492	59.980	7,467,030.160	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	143.270	542,706.760	
INGREDION INC	5,305	124.080	658,244.400	
ONEOK INC	16,401	56.070	919,604.070	
UNITED RENTALS INC	6,332	108.900	689,554.800	
SEMPRA ENERGY	18,176	101.060	1,836,866.560	
FEDEX CORP	18,672	188.420	3,518,178.240	
VERISIGN INC	6,321	79.250	500,939.250	
AMPHENOL CORP	23,304	67.790	1,579,778.160	
BROWN-FORMAN CORP	16,642	44.570	741,733.940	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,337	58.450	1,305,597.650	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	4.630	588,435.960	
CSX CORP	69,449	37.420	2,598,781.580	

CABOT OIL & GAS CORP	38,049	22.170	843,546.330	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	60.010	843,140.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	37.630	874,483.570	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,081	149.240	1,952,208.440	
CARDINAL HEALTH INC	24,212	75.220	1,821,226.640	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	27,339	54.250	1,483,140.750	
CATERPILLAR INC	44,065	93.830	4,134,618.950	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	88.210	867,280.720	
CELGENE CORP	57,620	119.980	6,913,247.600	
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	121.430	438,605.160	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	90.650	987,722.400	
CENTURYLINK INC	39,384	25.200	992,476.800	
CERNER CORP	23,765	49.270	1,170,901.550	
JPMORGAN CHASE & CO	269,975	86.430	23,333,939.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	43.580	820,262.760	
CIGNA CORP	19,066	140.230	2,673,625.180	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	74.520	818,378.640	
CINTAS CORP	6,282	114.780	721,047.960	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	96,233	3.630	349,325.790	
CISCO SYSTEMS INC	375,461	30.380	11,406,505.180	
CLOROX COMPANY	9,331	119.380	1,113,934.780	
COCA-COLA CO/THE	306,559	41.040	12,581,181.360	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,128	65.390	4,127,939.920	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	25,301	81.930	2,072,910.930	
COMERICA INC	12,068	69.610	840,053.480	
COMCAST CORP-CL A	179,552	70.920	12,733,827.840	
CA INC	22,732	33.010	750,383.320	
COMPUTER SCIENCES CORP	10,556	60.550	639,165.800	
CONAGRA BRANDS INC	31,942	38.290	1,223,059.180	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,660	72.640	1,718,662.400	
CMS ENERGY CORP	22,372	41.510	928,661.720	
COOPER COS INC	3,794	181.800	689,749.200	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	96.410	1,335,760.550	
CORNING INC	79,197	24.490	1,939,534.530	
WR GRACE & CO	5,923	68.870	407,917.010	
SEALED AIR CORP	16,041	47.800	766,759.800	
CUMMINS INC	12,194	139.560	1,701,794.640	
DR HORTON INC	24,498	28.150	689,618.700	
DANAHER CORP	46,324	81.100	3,756,876.400	
MOODY'S CORP	12,924	94.670	1,223,515.080	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,469	56.660	2,576,273.540	
TARGET CORP	40,245	71.430	2,874,700.350	
DEERE & CO	20,474	104.890	2,147,517.860	

MORGAN STANLEY	106,341	43.060	4,579,043.460	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	56.690	984,988.750	
COSTAR GROUP INC	2,278	194.200	442,387.600	
THE WALT DISNEY CO	113,984	108.380	12,353,585.920	
DOLLAR TREE INC	17,493	77.960	1,363,754.280	
DOVER CORP	10,736	77.020	826,886.720	
DOW CHEMICAL	83,895	57.670	4,838,224.650	
OMNICOM GROUP	16,993	85.240	1,448,483.320	
DTE ENERGY CO	13,122	97.430	1,278,476.460	
DUKE ENERGY CORP	51,765	76.500	3,960,022.500	
FLOWSERVE CORP	8,406	49.010	411,978.060	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	72.250	681,751.000	
EBAY INC	82,914	30.250	2,508,148.500	
BANK OF AMERICA CORP	761,401	22.940	17,466,538.940	
CITIGROUP INC	216,601	60.230	13,045,878.230	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	77.330	788,224.690	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	36.790	689,444.600	
EATON CORP PLC	34,800	67.210	2,338,908.000	
EATON VANCE CORP	9,184	43.210	396,840.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	25.770	538,000.290	
DISH NETWORK CORP	16,150	61.740	997,101.000	
ECOLAB INC	20,098	117.860	2,368,750.280	
ELECTRONIC ARTS INC	23,105	78.850	1,821,829.250	
SALESFORCE.COM INC	49,119	73.980	3,633,823.620	
EMERSON ELECTRIC CO	48,079	56.690	2,725,598.510	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	73.290	602,517.090	
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	5.680	400,099.200	
ENTERGY CORP	13,984	71.240	996,220.160	
EOG RESOURCES INC	42,707	103.400	4,415,903.800	
EQUIFAX INC	8,495	120.040	1,019,739.800	
EQT CORP	13,874	63.340	878,779.160	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	77.350	1,247,964.900	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	52.870	754,930.730	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	47,994	72.500	3,479,565.000	
EXXON MOBIL CORP	309,835	85.930	26,624,121.550	
FMC CORP	10,694	57.700	617,043.800	
NEXTERA ENERGY INC	34,612	118.580	4,104,290.960	
ASSURANT INC	4,960	94.200	467,232.000	
FASTENAL CO	21,654	46.510	1,007,127.540	
FIFTH THIRD BANCORP	57,732	27.070	1,562,805.240	
M&T BANK CORP	10,664	156.700	1,671,048.800	
FISERV INC	15,880	108.230	1,718,692.400	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	35.770	415,754.710	
MACY'S INC	24,512	30.300	742,713.600	
FORD MOTOR CO	279,141	12.850	3,586,961.850	
FRANKLIN RESOURCES INC	27,510	40.400	1,111,404.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	96,812	15.550	1,505,426.600	
FLEX LTD	44,363	14.620	648,587.060	

ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	52.420	638,265.920	
TEGNA INC	16,963	21.490	364,534.870	
GAP INC/THE	18,295	23.910	437,433.450	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	58.170	1,016,637.090	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,255	176.360	3,395,811.800	
GENERAL MILLS INC	43,879	60.450	2,652,485.550	
GENUINE PARTS CO	11,094	97.280	1,079,224.320	
GILEAD SCIENCES INC	98,271	75.010	7,371,307.710	
GARTNER INC	6,829	97.620	666,646.980	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	32.070	580,370.790	
MCKESSON CORP	16,986	146.820	2,493,884.520	
NVIDIA CORP	39,760	106.470	4,233,247.200	
GENERAL ELECTRIC CO	669,933	31.370	21,015,798.210	
WW GRAINGER INC	4,486	230.720	1,035,009.920	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	15.450	343,546.200	
HALLIBURTON CO	64,633	54.640	3,531,547.120	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	43.500	1,284,207.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,115	242.570	6,577,285.550	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	58.500	754,708.500	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,679	110.650	628,381.350	
HARRIS CORP	8,954	101.710	910,711.340	
HASBRO INC	8,909	82.860	738,199.740	
HENRY SCHEIN INC	5,713	158.090	903,168.170	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	78.840	568,672.920	
HERSHEY FOODS CORP	11,306	104.830	1,185,207.980	
HP INC	131,066	14.690	1,925,359.540	
F5 NETWORKS INC	4,874	144.240	703,025.760	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,481	53.170	610,444.770	
REYNOLDS AMERICAN INC	63,698	55.810	3,554,985.380	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,156	102.600	939,405.600	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	152.460	525,529.620	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.400	787,816.000	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	30.710	426,500.480	
HOLOGIC INC	17,500	40.435	707,612.500	
UNUM GROUP	16,000	44.600	713,600.000	
HOME DEPOT INC	92,204	136.100	12,548,964.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	90.400	1,164,984.800	
HORMEL FOODS CORP	23,322	34.920	814,404.240	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	24.950	797,202.400	
HUMANA INC	11,580	200.950	2,327,001.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	97.720	579,186.440	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	13.330	1,001,896.130	

RED HAT INC	13,472	71.660	965,403.520	
BIOGEN INC	16,273	297.790	4,845,936.670	
ILLINOIS TOOL WORKS	23,599	122.570	2,892,529.430	
INTUIT INC	17,739	116.110	2,059,675.290	
IDEXX LABORATORIES INC	7,050	120.710	851,005.500	
INGERSOLL-RAND PLC	19,490	76.010	1,481,434.900	
INTEL CORP	353,216	36.540	12,906,512.640	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	115.480	644,147.440	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	53.780	1,526,007.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	23.310	679,649.670	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	57.290	454,366.990	
INCYTE CORP	12,360	119.300	1,474,548.000	
JOHNSON & JOHNSON	204,804	116.160	23,790,032.640	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,304	48.430	1,419,192.720	
KLA-TENCOR CORP	11,724	79.330	930,064.920	
DEVON ENERGY CORP	34,184	46.700	1,596,392.800	
WESTAR ENERGY INC	9,911	54.580	540,942.380	
KELLOGG CO	18,922	71.660	1,355,950.520	
KEYCORP	81,264	18.480	1,501,758.720	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,663	114.360	3,049,180.680	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,030	380.310	3,434,199.300	
KOHLS CORP	14,862	41.210	612,463.020	
KROGER CO	69,381	33.190	2,302,755.390	
LAM RESEARCH CORP	11,522	108.470	1,249,791.340	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,455	87.980	655,890.900	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	70.280	887,074.160	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	48.010	460,319.880	
LENNAR CORP	14,850	43.730	649,390.500	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	23.610	506,717.820	
ELI LILLY & CO	74,120	76.270	5,653,132.400	
L BRANDS INC	18,583	61.350	1,140,067.050	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,276	67.160	1,160,256.160	
LINEAR TECH CORP	17,456	62.330	1,088,032.480	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,738	113.920	5,893,992.960	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	48.100	1,167,194.600	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,723	256.170	5,052,440.910	
LOEWS CORP	21,346	46.470	991,948.620	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	33.360	456,931.920	
LOWE'S COS INC	65,195	71.210	4,642,535.950	
DOMINION RESOURCES INC/VA	47,031	75.430	3,547,548.330	
SCANA CORP	10,902	71.020	774,260.040	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	29.620	953,704.760	
MCCORMICK & CO INC	9,163	89.790	822,745.770	
MCDONALD'S CORPORATION	63,662	120.250	7,655,355.500	
S&P GLOBAL INC	20,295	111.350	2,259,848.250	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	219.420	717,942.240	
MANPOWERGROUP INC	5,703	90.270	514,809.810	
MARKEL CORPORATION	989	896.670	886,806.630	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	99.140	1,564,032.640	
MARSH & MCLENNAN COS	38,323	67.510	2,587,185.730	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,056	75.330	305,538.480	
MASCO CORP	23,043	32.210	742,215.030	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	220.560	967,596.720	
MATTEL INC	24,003	29.910	717,929.730	
METLIFE INC	70,719	53.930	3,813,875.670	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	40.890	831,784.380	
MEDTRONIC PLC	104,227	74.900	7,806,602.300	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,373	38.380	1,664,655.740	
CVS HEALTH CORP	79,353	82.670	6,560,112.510	
MERCK & CO.INC.	206,907	59.920	12,397,867.440	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	132.060	947,662.560	
MICROSOFT CORP	553,414	62.620	34,654,784.680	
MICRON TECH INC	76,146	22.480	1,711,762.080	
MIDDLEBY CORP	4,100	132.410	542,881.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,176	64.850	984,163.600	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,922	14.560	508,464.320	
3M CO	45,218	176.580	7,984,594.440	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,759	203.180	966,933.620	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,150	82.630	921,324.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,789	81.280	714,369.920	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	30.800	383,244.400	
ENDO INTERNATIONAL PLC	16,587	15.310	253,946.970	
MYLAN NV	34,754	38.950	1,353,668.300	
ILLUMINA INC	11,255	165.040	1,857,525.200	
XCEL ENERGY INC	37,554	40.290	1,513,050.660	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	37.760	1,017,178.880	
NETAPP INC	20,641	35.250	727,595.250	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	41.610	571,721.400	
NEWELL BRANDS INC	32,324	46.970	1,518,258.280	
DUN & BRADSTREET CORP	3,012	121.970	367,373.640	
NEWMONT MINING CORP	38,093	35.080	1,336,302.440	
NIKE INC-CL B	99,876	53.110	5,304,414.360	

NOBLE ENERGY INC	31,005	36.990	1,146,874.950	
NORDSTROM INC	9,487	45.670	433,271.290	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,604	109.260	2,469,713.040	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	54.280	1,253,053.800	
NISOURCE INC	22,198	21.940	487,024.120	
COACH INC	19,175	35.480	680,329.000	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	89.270	1,436,354.300	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,620	233.110	2,941,848.200	
WELLS FARGO & CO	358,022	54.620	19,555,161.640	
NUCOR CORP	23,780	61.220	1,455,811.600	
MONSANTO CO	33,243	108.440	3,604,870.920	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	43.350	690,435.450	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,294	88.980	3,318,420.120	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,546	69.350	3,921,465.100	
OGE ENERGY CORP	16,028	33.060	529,885.680	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,017	281.300	1,973,882.100	
ORACLE CORP	231,390	38.660	8,945,537.400	
PACCAR INC	26,578	66.250	1,760,792.500	
EXELON CORP	69,607	35.060	2,440,421.420	
PARKER HANNIFIN CORP	9,981	141.830	1,415,605.230	
PATTERSON COS INC	7,169	41.790	299,592.510	
PAYCHEX INC	23,141	60.810	1,407,204.210	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	64.890	423,472.140	
MEDNAX INC	7,824	68.870	538,838.880	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	96.130	505,163.150	
PPL CORPORATION	49,957	33.940	1,695,540.580	
PEPSICO INC	107,608	101.970	10,972,787.760	
PENTAIR PLC	11,775	56.930	670,350.750	
PFIZER INC	453,602	33.440	15,168,450.880	
CONOCOPHILLIPS	91,766	49.660	4,557,099.560	
PVH CORP	6,682	93.850	627,105.700	
PG&E CORP	37,651	60.070	2,261,695.570	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,977	181.270	2,352,340.790	
ALTRIA GROUP INC	146,055	67.720	9,890,844.600	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,446	118.670	4,325,046.820	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	83.740	419,537.400	
GARMIN LTD	7,795	47.930	373,614.350	
AETNA INC	26,111	122.670	3,203,036.370	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	53.080	521,298.680	
PPG INDUSTRIES INC	19,289	96.390	1,859,266.710	
PRAXAIR INC	21,868	115.850	2,533,407.800	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,574	161.660	5,265,912.840	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,304	73.480	1,344,977.920	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	93.000	965,154.000	

PROCTER & GAMBLE CO	191,488	83.490	15,987,333.120	
PROGRESSIVE CORP	44,358	36.320	1,611,082.560	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	43.460	1,613,017.900	
PULTE GROUP INC	25,477	18.690	476,165.130	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	39,870	15.850	631,939.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	77.880	838,689.720	
QUALCOMM INC	109,993	65.630	7,218,840.590	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	74.430	758,218.410	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	137.320	485,426.200	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	373.000	2,110,807.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	123.580	573,658.360	
AUTONATION INC	5,772	51.130	295,122.360	
RESMED INC	11,376	64.250	730,908.000	
US BANCORP	127,815	51.220	6,546,684.300	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	59.010	431,776.170	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	86.310	748,652.940	
RITE AID CORP	85,598	8.320	712,175.360	
ROSS STORES INC	30,542	66.770	2,039,289.340	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,820	186.000	1,454,520.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,667	139.530	1,348,836.510	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,567	85.930	1,165,812.310	
RAYTHEON COMPANY	21,940	146.610	3,216,623.400	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,399	235.260	1,034,908.740	
FMC TECHNOLOGIES INC	14,816	35.790	530,264.640	
ACCENTURE PLC-CL A	46,433	115.060	5,342,580.980	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	115,309	44.170	5,093,198.530	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,919	126.220	1,251,976.180	
ROCKWELL COLLINS INC	9,535	91.000	867,685.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,229	117.180	2,487,614.220	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	23,052	77.650	1,789,987.800	
PRICELINE GROUP INC	3,670	1,535.250	5,634,367.500	
SCHLUMBERGER LTD	103,570	84.600	8,762,022.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	88,020	41.190	3,625,543.800	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,255	113.670	1,734,035.850	
BUNGE LTD	11,367	70.400	800,236.800	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	51.380	570,677.660	
ANTHEM INC	19,543	146.340	2,859,922.620	

AMERISOURCEBERGEN CORP	14,348	84.830	1,217,140.840	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	58.650	1,257,573.300	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	278.880	1,661,567.040	
CENTENE CORP	13,899	62.120	863,405.880	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	47.760	456,824.400	
ACUITY BRANDS INC	3,087	208.940	644,997.780	
SNAP-ON INC	3,932	176.270	693,093.640	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,142	105.570	3,393,230.940	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	169.920	895,988.160	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,997	9.970	388,800.090	
EDISON INTERNATIONAL	24,139	71.110	1,716,524.290	
SOUTHERN CO	73,354	48.380	3,548,866.520	
BB&T CORP	59,828	46.660	2,791,574.480	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	51.340	582,811.680	
AT&T INC	460,498	40.810	18,792,923.380	
CHEVRON CORP	140,802	114.960	16,186,597.920	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,590	117.750	1,364,722.500	
STAPLES INC	52,662	9.340	491,863.080	
STATE STREET CORP	29,122	81.300	2,367,618.600	
STARBUCKS CORP	108,982	57.880	6,307,878.160	
STRYKER CORP	25,117	121.900	3,061,762.300	
NETFLIX INC	31,878	129.890	4,140,633.420	
STERICYCLE INC	6,853	78.040	534,808.120	
SUNTRUST BANKS INC	37,716	55.700	2,100,781.200	
SYMANTEC CORP	46,581	25.130	1,170,580.530	
SYNOPSYS INC	10,656	60.690	646,712.640	
SYSCO CORP	40,782	55.330	2,256,468.060	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,837	662.200	1,878,661.400	
TELEFLEX INC	3,203	167.880	537,719.640	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	67,717	35.200	2,383,638.400	
TESORO CORP	9,395	81.590	766,538.050	
TEXAS INSTRUMENTS INC	74,880	74.600	5,586,048.000	
TEXTRON INC	19,076	49.940	952,655.440	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,340	147.780	4,335,865.200	
TIFFANY & CO	8,733	77.140	673,663.620	
TOLL BROTHERS INC	13,356	31.120	415,638.720	
TORCHMARK CORP	7,699	74.010	569,802.990	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	53.080	598,689.320	
DAVITA INC	12,245	63.630	779,149.350	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	76.350	708,222.600	
TRIMBLE INC	20,073	30.310	608,412.630	
TYSON FOODS INC	21,621	61.210	1,323,421.410	
UGI CORP	12,068	45.310	546,801.080	
MARATHON OIL CORP	66,702	17.480	1,165,950.960	

UNION PACIFIC CORP	62,006	103.420	6,412,660.520	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	59,230	111.260	6,589,929.800	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,272	161.580	11,516,129.760	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	112.340	713,471.340	
VALSPAR CORP	6,122	105.110	643,483.420	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	89.990	616,251.520	
VF CORP	24,309	53.240	1,294,211.160	
CBS CORP	31,152	62.690	1,952,918.880	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,957	82.930	1,572,104.010	
VULCAN MATERIALS CO	9,977	123.610	1,233,256.970	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,696	82.670	5,679,098.320	
WAL-MART STORES INC	116,011	68.230	7,915,430.530	
WASTE MANAGEMENT INC	34,095	69.490	2,369,261.550	
WATERS CORP	5,963	137.560	820,270.280	
ALLERGAN PLC	29,478	221.250	6,522,007.500	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	128.740	1,127,118.700	
WESTERN DIGITAL CORP	22,106	70.840	1,565,989.040	
WABTEC CORP	7,363	85.310	628,137.530	
WHIRLPOOL CORP	5,553	183.820	1,020,752.460	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	77.310	1,045,926.990	
WYNN RESORTS LTD	6,279	94.830	595,437.570	
WHOLE FOODS MARKET INC	22,675	30.730	696,802.750	
NASDAQ INC	9,132	67.200	613,670.400	
CME GROUP INC	25,149	116.300	2,924,828.700	
WILLIAMS COS INC	54,722	28.500	1,559,577.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	54.620	409,049.180	
LKQ CORP	22,948	31.260	717,354.480	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	37.240	610,102.920	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	58.100	1,343,097.700	
FOOT LOCKER INC	9,476	70.940	672,227.440	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	46.840	872,676.040	
CARMAX INC	13,513	65.680	887,533.840	
XEROX CORP	69,821	7.030	490,841.630	
XILINX INC	18,777	58.530	1,099,017.810	
YAHOO! INC	66,277	42.300	2,803,517.100	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	141.340	989,804.020	
TJX COMPANIES INC	48,566	76.690	3,724,526.540	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	6.920	655,324.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,000	60.000	1,200,000.000	
SIGNATURE BANK	4,171	151.190	630,613.490	
CBRE GROUP INC	20,976	30.960	649,416.960	

LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	34.010	546,642.730	
REGIONS FINANCIAL CORP	94,000	14.560	1,368,640.000	
DOMINO'S PIZZA INC	3,935	166.360	654,626.600	
T-MOBILE US INC	21,188	58.740	1,244,583.120	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,734	56.610	1,909,681.740	
MOSAIC CO/THE	26,525	30.720	814,848.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	30,914	28.920	894,032.880	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	79,925	29.670	2,371,374.750	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	82.640	452,288.720	
CELANESE CORP	10,766	81.330	875,598.780	
DEXCOM INC	6,161	67.040	413,033.440	
DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	10,423	26.340	274,541.820	
EXPEDIA INC	9,786	117.620	1,151,029.320	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	32.730	604,686.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,627	114.730	1,333,965.710	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	50,537	32.710	1,653,065.270	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,298	56.770	2,628,337.460	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	30.710	451,314.160	
VIACOM INC-CLASS B	27,527	38.400	1,057,036.800	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,089	414.480	865,848.720	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	73.660	456,029.060	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	253.270	965,465.240	
MASTERCARD INC	72,464	107.320	7,776,836.480	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	19.460	574,673.260	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	76.930	572,051.480	
HANESBRANDS INC	27,619	22.430	619,494.170	
WESTERN UNION CO	35,222	22.230	782,985.060	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	43.490	503,875.140	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,099	16.980	307,321.020	
SPECTRA ENERGY CORP	51,646	41.730	2,155,187.580	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	66.020	549,946.600	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,440	19.500	359,580.000	
DELTA AIR LINES INC	14,611	50.930	744,138.230	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	49.880	316,937.520	
DISCOVER FINANCIAL	30,804	72.110	2,221,276.440	

TE CONNECTIVITY LTD	27,026	67.600	1,826,957.600	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	133.690	1,410,696.880	
WABCO HOLDING INC	4,379	106.550	466,582.450	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,052	69.900	632,734.800	
VMWARE INC	5,491	81.480	447,406.680	
MERCADOLIBRE INC	2,861	177.790	508,657.190	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,332	262.500	1,137,150.000	
INVESCO LTD	29,824	30.670	914,702.080	
MSCI INC	6,462	81.520	526,782.240	
CALPINE CORP NPR	27,876	11.850	330,330.600	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,885	90.520	10,489,910.200	
VISA INC	141,188	81.310	11,479,996.280	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,377	90.080	1,295,080.160	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,301	70.720	1,011,366.720	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	74.290	489,199.650	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	87.460	533,068.700	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,085	25.760	414,349.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	39,747	48.970	1,946,410.590	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	54.170	629,672.080	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	119.810	218,773.060	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	140,475	21.570	3,030,045.750	
XYLEM INC	11,630	49.140	571,498.200	
ALKERMES PLC	12,053	58.490	704,979.970	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,049	86.880	2,350,017.120	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	191.300	665,532.700	
SPLUNK INC	10,674	56.180	599,665.320	
HCA HOLDINGS INC	23,320	78.270	1,825,256.400	
VERISK ANALYTICS INC	12,227	82.260	1,005,793.020	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,846	116.120	562,717.520	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	147.970	968,315.680	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,697	71.160	974,678.520	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,555	92.300	974,226.500	
CIT GROUP INC	16,266	42.990	699,275.340	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	98.630	2,234,166.760	
TARGA RESOURCES CORP	12,532	57.020	714,574.640	

LEAR CORP	5,132	142.770	732,695.640	
DOLLAR GENERAL CORP	21,500	74.250	1,596,375.000	
FORTINET INC	11,399	31.960	364,312.040	
AON PLC	20,606	112.630	2,320,853.780	
TESLA MOTORS INC	9,875	229.870	2,269,966.250	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	41.430	471,970.560	
GENERAL MOTORS CO	105,443	37.350	3,938,296.050	
VANTIV INC	12,141	61.710	749,221.110	
TRIPADVISOR INC	9,263	51.310	475,284.530	
ALLY FINANCIAL INC	35,251	20.040	706,430.040	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	43.380	517,219.740	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	40.360	545,869.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,532	70.470	1,446,890.040	
PHILLIPS 66	34,686	83.760	2,905,299.360	
FACEBOOK INC	173,536	124.350	21,579,201.600	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	11,968	77.880	932,067.840	
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,616	102.710	576,819.360	
SERVICENOW INC	12,640	81.670	1,032,308.800	
WHITEWAVE FOODS CO	14,444	55.380	799,908.720	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	134.680	949,224.640	
WORKDAY INC	8,710	74.350	647,588.500	
ABBVIE INC	121,323	64.070	7,773,164.610	
ZOETIS INC	34,481	53.930	1,859,560.330	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	45.220	552,769.280	
COTY INC	38,871	18.960	736,994.160	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.000	363,156.000	
MALLINCKRODT PLC	9,419	53.750	506,271.250	
CDW CORP	9,877	52.240	515,974.480	
SPRINT CORP	63,882	8.760	559,606.320	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	48.480	494,447.520	
ARCONIC INC	34,259	20.710	709,503.890	
ENVISION HEALTHCARE CORP	4,730	65.220	308,490.600	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	35.600	178,213.600	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	18,330	35.080	643,016.400	
XL GROUP LTD	20,259	36.940	748,367.460	
BROADCOM LTD	29,475	180.570	5,322,300.750	
DELL TECHNOLOGIES INC	17,283	56.990	984,958.170	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	27.320	421,001.200	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	24.220	318,807.860	
TWITTER INC	43,692	17.370	758,930.040	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	33.260	260,658.620	
PERRIGO CO PLC	10,322	83.650	863,435.300	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	56.020	828,871.920	

	ARAMARK	17,307	34.020	588,784.140	
	SABRE CORP	17,624	24.940	439,542.560	
	NAVIENT CORP	22,636	16.820	380,737.520	
	PARSLEY ENERGY INC	10,949	36.670	401,499.830	
	IHS MARKIT LTD	26,741	36.610	978,988.010	
	FNF GROUP	20,571	34.040	700,236.840	
	SYNCHRONY FINANCIAL	62,691	36.960	2,317,059.360	
	MOBILEYE NV	14,001	40.370	565,220.370	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	39,020	36.280	1,415,645.600	
	CDK GLOBAL INC	8,309	59.700	496,047.300	
	QORVO INC	10,599	56.400	597,783.600	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	31.460	358,297.940	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	75.540	590,571.720	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	27.280	401,288.800	
	LIBERTY LILAC GROUP-C	6,305	21.720	136,944.600	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	41.750	1,120,570.000	
	ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,128	110.920	568,797.760	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	31.500	506,835.000	
	WESTROCK CO	17,744	52.080	924,107.520	
	KRAFT HEINZ CO	45,382	85.910	3,898,767.620	
	HILTON GRAND VACATIONS INC	4,438	25.790	114,456.020	
	FORTIVE CORP	23,758	53.800	1,278,180.400	
	WASTE CONNECTIONS INC	10,157	81.200	824,748.400	
	ALPHABET INC-CL A	21,999	826.010	18,171,393.990	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	22.950	2,790,490.500	
	PAYPAL HOLDINGS INC	80,567	41.080	3,309,692.360	
	CONDUENT INC	13,964	13.420	187,396.880	
	FIRST DATA CORP	22,035	15.510	341,762.850	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	36.650	298,111.100	
	ALPHABET INC-CL C	23,139	804.790	18,622,035.810	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	150.960	889,456.320	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	16,119	298.200	4,806,685.800	
アメリカ・ドル　小計		23,283,810		1,495,735,077.520 (173,445,439,589)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.711	193,405.450	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.230	187,293.150	
	ASHTEAD GROUP	35,233	16.010	564,080.330	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	21.960	327,138.120	
	BHP BILLITON PLC	153,323	14.000	2,146,522.000	
	BARCLAYS PLC	1,247,081	2.362	2,945,605.320	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,682	5.070	419,197.740	

BT GROUP PLC	621,220	3.877	2,408,469.940	
SKY PLC	72,210	9.880	713,434.800	
BUNZL PLC	26,929	21.080	567,663.320	
EASYJET PLC	13,628	10.790	147,046.120	
CAPITA PLC	54,894	5.185	284,625.390	
AVIVA PLC	306,804	4.868	1,493,521.870	
CRODA INTERNATIONAL	10,965	32.680	358,336.200	
DIAGEO PLC	186,418	21.655	4,036,881.790	
SCHRODERS PLC	7,188	30.370	218,299.560	
DCC PLC	7,281	60.950	443,776.950	
NATIONAL GRID PLC	280,203	9.346	2,618,777.230	
GKN PLC	134,180	3.348	449,234.640	
KINGFISHER PLC	165,680	3.452	571,927.360	
BAE SYSTEMS PLC	241,905	6.100	1,475,620.500	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	28.870	346,064.690	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	138,548	46.720	6,472,962.560	
COBHAM PLC	142,739	1.646	234,948.390	
NEXT PLC	9,731	41.520	404,031.120	
IMPERIAL BRANDS PLC	70,388	35.925	2,528,688.900	
IMI PLC	21,218	10.680	226,608.240	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	31.930	399,987.110	
ANGLO AMERICAN PLC	105,010	12.375	1,299,498.750	
COMPASS GROUP PLC	119,716	14.640	1,752,642.240	
HSBC HOLDINGS PLC	1,486,352	6.714	9,979,367.320	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.484	1,052,344.110	
CENTRICA PLC	392,766	2.268	890,793.280	
UNILEVER PLC	97,369	33.350	3,247,256.150	
MEGGITT PLC	62,181	4.528	281,555.560	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.460	382,977.720	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	8.905	495,109.090	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.690	460,116.160	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	26.640	674,205.120	
PEARSON PLC	65,009	8.185	532,098.660	
PERSIMMON PLC	23,150	19.890	460,453.500	
PRUDENTIAL PLC	194,275	15.800	3,069,545.000	
RIO TINTO PLC	90,216	32.935	2,971,263.960	
VODAFONE GROUP PLC	1,974,479	2.102	4,150,354.850	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	46,978	67.830	3,186,517.740	
RELX PLC	80,689	14.510	1,170,797.390	
OLD MUTUAL PLC	389,986	2.091	815,460.720	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	146,260	6.675	976,285.500	

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.266	633,215.570	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.640	435,005.760	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.510	295,380.070	
SSE PLC	73,043	15.270	1,115,366.610	
BP PLC	1,397,956	5.117	7,153,340.850	
SHIRE PLC	68,023	48.345	3,288,571.930	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.615	564,067.660	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.830	470,407.600	
STANDARD CHARTERED PLC	251,434	7.007	1,761,798.030	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,885,554	0.665	3,248,893.410	
TATE & LYLE PLC	39,915	6.885	274,814.770	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.749	442,535.470	
TESCO PLC	624,703	2.130	1,330,617.390	
3I GROUP PLC	78,491	7.160	561,995.560	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.260	811,060.300	
GLAXOSMITHKLINE PLC	363,678	15.940	5,797,027.320	
WEIR GROUP	18,336	19.950	365,803.200	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,907	29.530	735,503.710	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	9.525	202,901.550	
WPP PLC	97,555	18.780	1,832,082.900	
WOLSELEY PLC	18,238	50.250	916,459.500	
ASTRAZENECA PLC	94,192	46.600	4,389,347.200	
WHITBREAD PLC	12,159	40.510	492,561.090	
CARNIVAL PLC	13,153	42.980	565,315.940	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.397	408,625.130	
INTERTEK GROUP PLC	10,500	34.670	364,035.000	
WILLIAM HILL PLC	72,474	2.926	212,058.920	
BURBERRY GROUP PLC	35,774	15.330	548,415.420	
INVESTEC PLC	50,655	5.465	276,829.570	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,187	37.590	570,879.330	
ITV PLC	247,210	2.072	512,219.120	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.588	283,153.080	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	67.100	469,565.800	
G4S PLC	122,250	2.411	294,744.750	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	17.800	282,895.400	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	29.490	316,309.740	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	324,139	22.490	7,289,886.110	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	277,839	23.385	6,497,265.010	
INMARSAT PLC	34,127	7.670	261,754.090	
PETROFAC LTD	21,809	9.285	202,496.560	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	19.270	220,776.390	

	TUI AG-DI	19,394	11.910	230,982.540	
	STANDARD LIFE PLC	155,609	3.615	562,526.530	
	EXPERIAN PLC	71,516	15.790	1,129,237.640	
	MONDI PLC	30,200	16.640	502,528.000	
	TP ICAP PLC	20,904	4.563	95,384.950	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	12.920	275,066.800	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	14.320	223,950.480	
	GLENCORE PLC	899,043	3.072	2,761,860.090	
	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	3.446	291,665.990	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.570	402,317.580	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	7.865	240,794.840	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	17.830	239,028.980	
	NEX GROUP PLC	25,581	5.035	128,800.330	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	4.503	247,935.180	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.695	234,923.710	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.043	308,674.960	
	WORLDPAY GROUP PLC	112,202	2.842	318,878.080	
イギリス・ポンド　小計		22,323,049		135,923,331.100 (19,201,888,984)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	23.420	1,836,783.760	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	15.730	1,954,767.100	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	7.050	1,327,021.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	393.700	692,912.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	203.900	530,140.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	17.220	850,857.420	
	NICE LTD	5,638	266.500	1,502,527.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	57.300	598,441.200	
イスラエル・シュケル　小計		460,781		9,293,449.980 (280,104,583)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	71.540	795,167.100	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	221,660	31.280	6,933,524.800	
	AMCOR LTD	80,741	15.060	1,215,959.460	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	248,237	33.700	8,365,586.900	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	12.230	373,858.870	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	5.960	680,185.000	
	TELSTRA CORP LTD	314,574	5.230	1,645,222.020	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	12.920	504,060.880	
	AMP LTD	200,498	5.230	1,048,604.540	
	ASX LTD	16,354	50.820	831,110.280	

BHP BILLITON LTD	241,614	25.360	6,127,331.040	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	30.110	630,684.060	
COMPUTERSHARE LT	38,040	12.400	471,696.000	
CSL LIMITED	33,499	104.000	3,483,896.000	
REA GROUP LTD	4,119	57.260	235,853.940	
TRANSURBAN GROUP	149,591	10.500	1,570,705.500	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.090	490,384.090	
COCHLEAR LTD	3,992	128.270	512,053.840	
ORIGIN ENERGY LTD	143,330	6.750	967,477.500	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	127,579	84.820	10,821,250.780	
BORAL LIMITED	60,188	5.360	322,607.680	
RIO TINTO LIMITED	31,897	59.950	1,912,225.150	
APA GROUP	73,253	8.890	651,219.170	
ARISTOCRAT LEISU	44,406	15.600	692,733.600	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.160	1,056,261.360	
TPG TELECOM LTD	28,719	7.280	209,074.320	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,706	31.800	149,650.800	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	21.320	763,042.800	
ORICA LTD	25,308	17.980	455,037.840	
CIMIC GROUP LTD	8,709	36.080	314,220.720	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.020	512,482.600	
MACQUARIE GROUP LTD	21,869	87.740	1,918,786.060	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.720	1,278,443.320	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	200,714	31.670	6,356,612.380	
NEWCREST MINING LTD	61,110	20.850	1,274,143.500	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.350	688,805.250	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.670	500,683.420	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	12.430	1,185,697.700	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	11.390	520,602.730	
SANTOS LTD	133,862	4.160	556,865.920	
SONIC HEALTHCARE	26,192	21.800	570,985.600	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.830	341,848.080	
WESFARMERS LTD	86,331	42.280	3,650,074.680	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.780	328,611.140	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	31.840	1,844,268.320	
WOOLWORTHS LTD	92,344	24.210	2,235,648.240	
DUET GROUP	207,776	2.750	571,384.000	
SEEK LTD	25,899	15.190	393,405.810	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	65.700	300,971.700	
TATTS GROUP LTD	109,937	4.350	478,225.950	
AUSNET SERVICES	165,066	1.590	262,454.940	

	AGL ENERGY LTD	46,315	22.160	1,026,340.400	
	BRAMBLES LTD	115,255	12.580	1,449,907.900	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.580	380,530.380	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	43,023	4.300	184,998.900	
	AURIZON HOLDINGS LTD	171,522	5.170	886,768.740	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	10.510	671,820.220	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.400	357,712.800	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.800	657,577.200	
	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	2.820	1,218,316.140	
オーストラリア・ドル　小計		5,860,008		86,835,660.060 (7,414,897,012)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	58.680	947,153.880	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	60.730	1,866,111.440	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	22.220	1,858,658.560	
	ATCO LTD	7,193	44.720	321,670.960	
	BANK OF MONTREAL	47,743	97.680	4,663,536.240	
	BANK OF NOVA SCOTIA	89,436	76.960	6,882,994.560	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	54.760	1,300,878.560	
	BCE INC	11,568	57.990	670,828.320	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,043	43.800	2,848,883.400	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	21.820	563,370.580	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.470	374,489.050	
	SAPUTO INC	20,680	46.900	969,892.000	
	BLACKBERRY LTD	39,652	9.410	373,125.320	
	CGI GROUP INC	15,228	64.310	979,312.680	
	CCL INDUSTRIES INC	2,268	256.900	582,649.200	
	CAE INC	23,000	18.610	428,030.000	
	CAMECO CORP	32,627	15.650	510,612.550	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	51.200	1,329,510.400	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,159	110.690	3,338,299.710	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	84,339	41.180	3,473,080.020	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	141.510	688,021.620	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	36.190	330,016.610	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,306	91.690	5,254,387.140	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.900	238,615.300	
	AGRIUM INC	9,382	135.940	1,275,389.080	
	YAMANA GOLD INC	67,520	4.220	284,934.400	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	33.940	472,784.200	
	OPEN TEXT CORP	9,878	83.480	824,615.440	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.470	209,151.300	
	EMPIRE CO LTD	15,093	15.750	237,714.750	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.480	446,839.680	

FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	25.950	256,697.400	
FORTIS INC	29,002	40.910	1,186,471.820	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	15.870	877,547.520	
TELUS CORP	18,945	43.940	832,443.300	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	35.610	884,445.570	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	45.600	982,315.200	
ENBRIDGE INC	68,827	56.660	3,899,737.820	
IGM FINANCIAL INC	8,426	40.520	341,421.520	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	4.710	414,456.450	
MANULIFE FINANCIAL CORP	144,196	24.550	3,540,011.800	
LINAMAR CORP	3,827	58.670	224,530.090	
LOBLAW CO LTD	17,936	70.040	1,256,237.440	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	54.500	355,558.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	29,208	60.120	1,755,984.960	
SUN LIFE FINANCIAL INC	46,405	51.640	2,396,354.200	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,805	633.160	1,142,853.800	
METRO INC	19,350	39.840	770,904.000	
HUSKY ENERGY INC	28,749	16.030	460,846.470	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	16.950	677,864.400	
METHANEX CORP	7,381	61.500	453,931.500	
ONEX CORP	6,646	88.930	591,028.780	
GOLDCORP INC	67,652	19.110	1,292,829.720	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	24.610	1,503,080.360	
POWER CORP OF CANADA	25,052	30.480	763,584.960	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	33.990	594,281.160	
ROYAL BANK OF CANADA	110,868	92.970	10,307,397.960	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,459	57.910	721,500.690	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	193.360	2,050,969.520	
SHAW COMM INC-B	34,029	27.940	950,770.260	
SUNCOR ENERGY INC	126,273	43.010	5,431,001.730	
ENCANA CORP	69,257	16.920	1,171,828.440	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	29.630	1,215,304.080	
THOMSON REUTERS CORP	25,128	59.010	1,482,803.280	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	138,562	67.100	9,297,510.200	
TRANSCANADA CORP	62,895	60.560	3,808,921.200	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	46.310	263,781.760	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	112.430	349,095.150	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	94.360	1,011,350.480	

	SILVER WHEATON CORP	33,943	26.990	916,121.570	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	599.800	896,101.200	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	13,919	81.710	1,137,321.490	
	WASTE CONNECTIONS INC	2,429	107.370	260,801.730	
	CI FINANCIAL CORP	20,695	28.520	590,221.400	
	VERESEN INC	24,982	12.900	322,267.800	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	31.690	500,036.510	
	KEYERA CORP	13,728	39.660	544,452.480	
	ALTAGAS LTD	12,538	34.200	428,799.600	
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,719	41.680	1,280,367.920	
	DOLLARAMA INC	9,286	98.120	911,142.320	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	59,124	19.540	1,155,282.960	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	56.330	467,032.030	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	21.790	501,104.630	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	30.040	435,369.720	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	12.540	384,112.740	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	28.950	697,202.850	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	32.780	490,421.580	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	27.000	465,237.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,390	65.630	1,141,305.700	
	HYDRO ONE LTD	16,612	23.650	392,873.800	
カナダ・ドル　小計		3,075,631		123,980,786.970 (10,855,757,707)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.360	420,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	3.060	249,084.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.660	452,742.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.425	294,159.500	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	133,100	17.990	2,394,469.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.640	250,560.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	41.560	425,740.640	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.940	208,962.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.240	498,836.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.140	604,183.100	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	0.945	393,498.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	6.100	727,730.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.540	451,866.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	249,053	9.350	2,328,645.550	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.770	2,231,545.940	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.860	468,350.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	20.990	1,983,555.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	151,000	3.670	554,170.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	145,700	0.845	123,116.500	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	2.550	438,855.000	
シンガポール・ドル　小計		3,663,574		15,500,068.230 (1,250,855,506)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	145,106	15.890	2,305,734.340	
	SYNGENTA AG	6,872	413.400	2,840,884.800	
	NESTLE SA-REGISTERED	232,379	74.300	17,265,759.700	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,674	70.900	2,812,886.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,476	243.400	12,772,658.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	180.600	512,001.000	
	SIKA INHABER	151	4,801.000	724,951.000	
	SGS SA-REG	405	2,098.000	849,690.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	166,725	75.400	12,571,065.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	129.300	533,621.100	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,265.000	182,160.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	461.900	829,110.500	
	ABB LTD	137,622	22.120	3,044,198.640	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,926	69.850	763,181.100	
	GEBERIT AG	2,801	410.200	1,148,970.200	
	LONZA GROUP AG-REG	4,373	184.200	805,506.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,540.000	415,500.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	6	64,320.000	385,920.000	
	GIVAUDAN-REG	692	1,845.000	1,276,740.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,053	284.100	3,140,157.300	
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,941	53.900	1,128,719.900	
	ACTELION	7,435	231.400	1,720,459.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	125.200	565,778.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	134.500	598,928.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	330.200	645,541.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	64.900	298,020.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	178.000	296,014.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,618	294.300	770,477.400	
	GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,160.000	353,800.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	522.000	288,666.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	84.350	505,256.500	
	DUFRY GROUP	3,566	129.800	462,866.800	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,474	484.750	714,521.500	
	ARYZTA AG	7,191	44.780	322,012.980	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	47.460	722,673.420	
	SWISS RE LTD	23,838	95.850	2,284,872.300	

	UBS GROUP AG	277,078	16.780	4,649,368.840	
スイス・フラン　小計		1,203,635		81,508,674.020 (9,298,509,533)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	286.600	13,864,848.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	257.000	7,493,349.000	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	53.700	11,907,867.600	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	147.900	1,945,328.700	
	LUNDBERGS B	2,606	552.000	1,438,512.000	
	SKF AB-B SHS	32,306	166.800	5,388,640.800	
	SANDVIK AB	75,199	116.100	8,730,603.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	121,939	94.650	11,541,526.350	
	SKANSKA AB-B SHS	27,150	215.000	5,837,250.000	
	SWEDBANK AB	66,507	215.000	14,299,005.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,024	253.600	11,671,686.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	122.700	14,590,134.300	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	109.300	12,424,349.600	
	SWEDISH MATCH AB	15,807	282.700	4,468,638.900	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	73.500	1,982,736.000	
	NORDEA AB	229,457	98.900	22,693,297.300	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	221.500	4,250,806.500	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	143.800	3,465,292.400	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	339.700	11,350,056.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	72,617	243.700	17,696,762.900	
	ASSA ABLOY AB-B	75,670	165.900	12,553,653.000	
	TELIA CO AB	184,927	37.150	6,870,038.050	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	193.300	3,245,507.000	
	BOLIDEN AB	21,855	248.800	5,437,524.000	
	ALFA LAVAL AB	24,553	154.900	3,803,259.700	
	KINNEVIK AB-B	18,310	220.400	4,035,524.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	426.800	2,275,697.600	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	276.900	1,639,248.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	70.300	2,368,547.600	
	HEXAGON AB	16,702	343.000	5,728,786.000	
スウェーデン・クローナ　小計		1,742,056		234,998,477.200 (3,000,930,554)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,601	610.500	5,250,910.500	
	A P MOLLER A/S	481	11,640.000	5,598,840.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	11,090.000	3,027,570.000	
	DANSKE BANK A/S	52,545	218.600	11,486,337.000	
	GENMAB A/S	4,633	1,287.000	5,962,671.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	249.400	3,966,457.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,139	254.000	36,103,306.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	472.000	7,461,376.000	

	TDC A/S	68,939	36.600	2,523,167.400	
	COLOPLAST-B	8,286	486.000	4,026,996.000	
	DSV A/S	15,601	321.100	5,009,481.100	
	WILLIAM DEMANT	6,537	124.600	814,510.200	
	TRYG A/S	11,107	130.000	1,443,910.000	
	PANDORA A/S	8,251	866.000	7,145,366.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	388.600	2,995,328.800	
	ISS A/S	11,125	236.400	2,629,950.000	
	DONG ENERGY A/S	6,575	256.000	1,683,200.000	
デンマーク・クローネ　小計		384,513		107,129,377.600 (1,764,420,849)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.610	647,727.120	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	10.290	774,641.490	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.630	762,884.430	
ニュージーランド・ドル　小計		383,434		2,185,253.040 (176,743,266)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	31,839	147.000	4,680,333.000	
	DNB ASA	70,426	133.900	9,430,041.400	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	42.380	3,893,832.020	
	TELENOR ASA	53,178	132.500	7,046,085.000	
	SCHIBSTED ASA	9,131	203.700	1,859,984.700	
	ORKLA ASA	61,421	77.000	4,729,417.000	
	STATOIL ASA	81,414	159.700	13,001,815.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,576	356.300	5,193,428.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	136.500	2,277,229.500	
ノルウェー・クローネ　小計		430,547		52,112,167.220 (702,993,136)	
ユーロ	CRH PLC	62,222	32.295	2,009,459.490	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	101.150	631,782.900	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	69.440	803,837.440	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.243	534,268.790	
	UMICORE	7,660	55.260	423,291.600	
	AIR LIQUIDE	28,615	104.450	2,988,836.750	
	AIRBUS SE	42,705	65.200	2,784,366.000	
	AXA	146,095	24.285	3,547,917.070	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	15.190	525,908.180	
	ADIDAS AG	14,302	144.800	2,070,929.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	14.170	1,218,549.150	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	41,829	13.600	568,874.400	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,089.650	171,075.050	
	DANONE	43,220	61.200	2,645,064.000	
	SAFRAN SA	23,731	67.330	1,597,808.230	
	INTESA SANPAOLO	934,915	2.468	2,307,370.220	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	2.260	254,170.900	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,055	89.910	2,162,785.050	
ACCOR SA	10,385	38.315	397,901.270	
BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	33.030	249,805.890	
BOUYGUES	13,996	33.870	474,044.520	
BNP PARIBAS	78,591	60.850	4,782,262.350	
RELX NV	70,826	15.740	1,114,801.240	
THALES SA	8,128	90.030	731,763.840	
CAP GEMINI SA	11,481	81.380	934,323.780	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	49.100	209,362.400	
CHRISTIAN DIOR SE	3,940	199.200	784,848.000	
INGENICO GROUP	4,334	77.800	337,185.200	
UNICREDIT SPA	378,245	2.680	1,013,696.600	
NATIXIS	70,166	5.485	384,860.510	
KONINKLIJKE DSM NV	12,285	58.300	716,215.500	
COMMERZBANK AG	72,573	7.607	552,062.810	
EIFFAGE	4,777	68.240	325,982.480	
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	73.120	2,205,006.720	
UNITED INTERNET	9,882	38.340	378,875.880	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	39.320	218,068.720	
PUBLICIS GROUPE	15,068	66.140	996,597.520	
MAN SE	3,396	95.400	323,978.400	
IBERDROLA SA	415,050	5.968	2,477,018.400	
ENI SPA	188,983	15.550	2,938,685.650	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.955	311,393.730	
KBC GROUPE	18,378	60.500	1,111,869.000	
HANNOVER RUECK SE	5,050	101.250	511,312.500	
WARTSILA OYJ	11,645	42.650	496,659.250	
L'OREAL	18,815	171.050	3,218,305.750	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,036	181.100	3,809,619.600	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	25.510	244,896.000	
GEA GROUP AG	14,635	37.850	553,934.750	
BOLLORE	71,347	3.560	253,995.320	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.905	335,203.620	
MICHELIN(CGDE)-B	13,125	104.500	1,371,562.500	
CONTINENTAL AG	8,310	191.900	1,594,689.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	74,274	31.430	2,334,431.820	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	36.080	339,115.920	
AXEL SPRINGER SE	3,067	46.715	143,274.900	
OMV AG	9,766	33.775	329,846.650	
PERNOD-RICARD	16,110	104.800	1,688,328.000	
PEUGEOT SA	32,906	16.705	549,694.730	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,066	55.140	665,319.240	
RENAULT SA	14,360	88.070	1,264,685.200	
REPSOL SA	78,098	13.720	1,071,504.560	
REMY COINTREAU	1,860	79.680	148,204.800	

MERCK KGAA	8,752	101.950	892,266.400	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	44.990	1,606,412.940	
SAIPEM	465,751	0.508	236,601.500	
RWE AG	39,183	11.810	462,751.230	
SEB SA	1,405	126.900	178,294.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	47.960	556,431.920	
SOCIETE GENERALE-A	56,243	46.390	2,609,112.770	
VINCI S.A.	37,818	65.910	2,492,584.380	
SODEXO	7,368	109.000	803,112.000	
SOLVAY SA	5,991	109.350	655,115.850	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,136	67.310	2,768,864.160	
VIVENDI SA	78,086	18.140	1,416,480.040	
SAP SE	73,292	84.000	6,156,528.000	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	8,870	68.020	603,337.400	
TELEFONICA S.A	347,856	9.188	3,196,100.920	
TOTAL SA	167,398	48.230	8,073,605.540	
VALEO	17,731	55.100	976,978.100	
E.ON SE	142,688	6.679	953,013.150	
VOEST-ALPINE AG	9,875	36.800	363,400.000	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	22.845	349,117.290	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	98.180	845,722.520	
METRO AG	10,774	31.250	336,687.500	
SIEMENS AG-REG	56,800	117.750	6,688,200.000	
UPM-KYMMENE OYJ	41,826	23.180	969,526.680	
ING GROEP NV-CVA	286,593	13.640	3,909,128.520	
BAYER AG	61,471	100.850	6,199,350.350	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	10.090	426,837.270	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,253	114.200	1,513,492.600	
DAIMLER AG	71,139	72.230	5,138,369.970	
BASF SE	67,970	88.100	5,988,157.000	
BEIERSDORF AG	6,780	80.990	549,112.200	
HOCHTIEF AG	1,707	135.400	231,127.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	85.900	945,673.100	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,452	76.950	1,265,981.400	
ORANGE	152,528	14.610	2,228,434.080	
SAMPO OYJ-A SHS	33,059	43.050	1,423,189.950	
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	54.390	423,915.660	
ALLIANZ SE	33,800	160.050	5,409,690.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.740	523,597.560	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	98,527	19.785	1,949,356.690	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	38.095	670,548.190	
HERMES INTL	1,875	396.200	742,875.000	
ENDESA S.A.	21,037	19.685	414,113.340	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	11.660	230,261.680	
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	28.910	674,296.840	

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,354	177.650	2,194,688.100	
ARCELOR MITTAL (NL)	130,747	7.554	987,662.830	
SOCIETE BIC SA	2,478	127.800	316,688.400	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,673	72.900	778,061.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,555	30.085	347,632.170	
HEINEKEN NV	17,373	70.980	1,233,135.540	
AKZO NOBEL	18,209	59.110	1,076,333.990	
ASML HOLDING NV	27,566	106.700	2,941,292.200	
AEGON NV	144,321	5.151	743,397.470	
BANKINTER S.A.	57,960	7.500	434,700.000	
VOLKSWAGEN AG	2,794	148.100	413,791.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,131	146.050	2,063,832.550	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	481,507	6.357	3,060,939.990	
KERING	5,479	216.650	1,187,025.350	
CNP ASSURANCES	13,987	17.605	246,241.130	
FORTUM OYJ	37,132	14.850	551,410.200	
AGEAS	12,993	38.345	498,216.580	
UCB SA	10,367	65.410	678,105.470	
THYSSENKRUPP AG	29,215	22.925	669,753.870	
UNILEVER NV-CVA	121,112	38.850	4,705,201.200	
CARREFOUR SA	43,732	22.970	1,004,524.040	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	17.305	502,018.050	
ATOS SE	7,050	102.950	725,797.500	
NOKIA OYJ	442,720	4.568	2,022,344.960	
TUI AG	19,196	13.690	262,793.240	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,794	28.865	2,072,333.810	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	34.655	712,437.490	
SANOFI	86,452	78.310	6,770,056.120	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	10.715	491,454.190	
ELISA OYJ	9,517	31.280	297,691.760	
BANCO SANTANDER SA	1,078,026	5.115	5,514,102.990	
METSO OYJ	8,585	27.600	236,946.000	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.215	595,570.140	
QIAGEN N.V.	14,167	27.045	383,146.510	
LINDE AG	14,183	155.300	2,202,619.900	
DEUTSCHE BANK AG-REG	104,836	17.660	1,851,403.760	
BMW VORZUG	4,116	73.430	302,237.880	
K & S	14,982	22.765	341,065.230	
ENEL SPA	581,747	4.122	2,397,961.130	
COLRUYT NV	4,673	46.480	217,201.040	
VOPAK (KON.)	5,364	44.170	236,927.880	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	242,088	16.245	3,932,719.560	
BANCO POPULAR ESPANOL	277,768	0.973	270,268.260	
LEONARDO SPA	34,431	13.480	464,129.880	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	16.450	1,345,182.300	

KONINKLIJKE KPN NV	276,563	2.861	791,246.740	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	413.350	328,199.900	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.076	190,975.390	
EURAZEO	4,063	56.090	227,893.670	
BANCO SABADELL	428,014	1.373	587,663.220	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	78.660	457,329.240	
FRAPORT AG	3,149	56.120	176,721.880	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	66.420	532,289.880	
INDITEX	83,755	31.630	2,649,170.650	
JC DECAUX SA	6,058	28.120	170,350.960	
ANDRITZ AG	6,265	48.675	304,948.870	
MAPFRE SA	84,474	2.903	245,228.020	
ESSILOR INTL	16,004	105.050	1,681,220.200	
SNAM SPA	186,129	3.806	708,406.970	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	12.085	1,034,294.720	
ENAGAS	18,095	24.055	435,275.220	
WENDEL	2,220	113.550	252,081.000	
TENARIS SA	38,237	16.790	641,999.230	
TELECOM ITALIA SPA	672,896	0.828	557,157.880	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.681	338,862.870	
ATLANTIA SPA	27,920	22.370	624,570.400	
ILIAD SA	2,102	182.900	384,455.800	
PROXIMUS	13,498	27.090	365,660.820	
SES FDR	30,439	20.785	632,674.610	
TERNA SPA	117,108	4.328	506,843.420	
GRIFOLS SA	25,309	19.350	489,729.150	
FERROVIAL SA	35,610	17.970	639,911.700	
LANXESS AG	6,856	63.600	436,041.600	
NESTE OYJ	10,692	32.990	352,729.080	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	19.020	183,371.820	
KONE OYJ	23,717	43.060	1,021,254.020	
ENGIE	110,924	11.930	1,323,323.320	
ALSTOM	12,046	26.700	321,628.200	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.095	226,947.490	
ELECTRICITE DE FRANCE	20,751	9.020	187,174.020	
DEUTSCHE WOHNEN AG	26,714	30.600	817,448.400	
ARKEMA SA	4,241	90.040	381,859.640	
LEGRAND SA	19,920	53.410	1,063,927.200	
ADP	2,313	100.750	233,034.750	
ORION OYJ	8,051	43.440	349,735.440	
RTL GROUP SA	3,446	69.340	238,945.640	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.070	533,548.470	
SYMRISE AG	7,926	56.400	447,026.400	
SCOR SE	13,875	32.235	447,260.620	
REXEL SA	23,245	16.505	383,658.720	
PRYSMIAN SPA	14,925	24.480	365,364.000	

	CAIXABANK	229,231	3.296	755,545.370	
	BUREAU VERITAS SA	21,480	19.000	408,120.000	
	GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	9.160	344,837.360	
	SUEZ SA	25,406	13.750	349,332.500	
	ENGIE	3,318	0.001	3.310	
	AMADEUS IT GROUP SA	33,099	43.805	1,449,901.690	
	BRENNTAG AG	12,331	51.450	634,429.950	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	68,448	5.513	377,353.820	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	4.692	226,647.060	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	27.230	315,187.250	
	EDENRED	18,682	19.755	369,062.910	
	BANKIA SA	370,638	1.007	373,232.460	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.090	251,702.690	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	57.290	298,939.220	
	OSRAM LICHT AG	7,017	51.210	359,340.570	
	GEMALTO	6,103	55.440	338,350.320	
	VONOVIA SE	35,271	31.475	1,110,154.720	
	FERRARI NV	8,338	55.750	464,843.500	
	DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	78.300	1,083,985.200	
	INNOGY SE	9,769	31.500	307,723.500	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	8.470	666,123.150	
	SFR GROUP SA	8,774	26.900	236,020.600	
	NN GROUP NV	21,965	32.520	714,301.800	
	ZALANDO SE	6,674	37.240	248,539.760	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	10.150	711,616.500	
	AENA SA	5,256	132.800	697,996.800	
	ABN AMRO GROUP NV	19,363	22.080	427,535.040	
	EXOR NV	9,441	43.960	415,026.360	
	ALTICE NV-A	38,525	18.990	731,589.750	
	COVESTRO AG	5,966	64.090	382,360.940	
	IBERDROLA SA-RTS	415,050	0.134	55,616.700	
	REPSOL SA-RTS	78,090	0.363	28,346.670	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,644	100.200	5,675,728.800	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.135	245,492.020	
	SCHAEFFLER AG	12,644	13.755	173,918.220	
	LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	50.080	706,378.400	
	UNIPER SE	16,058	13.380	214,856.040	
ユーロ　小計		18,114,780		264,889,869.280 (32,430,466,696)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	84.800	1,407,680.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.460	2,863,440.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	31.750	2,421,255.000	

	CLP HOLDINGS LTD	130,500	75.500	9,852,750.000	
	PCCW LTD	331,000	4.440	1,469,640.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	92,000	10.560	971,520.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	3.550	1,890,020.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	61.850	3,030,650.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	89,540	187.500	16,788,750.000	
	MTR CORP	118,500	38.800	4,597,800.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	27.400	1,726,200.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	148.700	8,327,200.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	94,222	42.900	4,042,123.800	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	112,500	71.050	7,993,125.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	57.800	5,534,350.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	616,588	14.460	8,915,862.480	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	35.850	6,775,650.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	43,000	21.850	939,550.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	287,000	29.000	8,323,000.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	27.550	1,391,275.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	8.690	3,834,601.540	
	SINO LAND CO	255,400	12.400	3,166,960.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	113,000	104.700	11,831,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	77.500	3,293,750.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	28.150	3,195,025.000	
	WHEELOCK & CO LTD	56,000	46.700	2,615,200.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	13.000	1,617,200.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	16.080	1,041,984.000	
	AIA GROUP LTD	892,627	46.200	41,239,367.400	
	HKT TRUST / HKT LTD	214,000	9.450	2,022,300.000	
	SANDS CHINA LTD	198,000	35.300	6,989,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	22.700	2,365,340.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	6.470	1,488,100.000	
	WH GROUP LTD	530,500	6.250	3,315,625.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	90.950	18,129,245.400	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	198,832	50.650	10,070,840.800	
香港・ドル　小計		6,985,717		215,477,880.420 (3,221,394,311)	
合計		87,911,535		263,044,401,726 (263,044,401,726)	

（２）株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	63,819.000	601,174.980	
		GOODMAN GROUP	143,627.000	1,024,060.510	
		GPT GROUP	144,955.000	732,022.750	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	534,664.530	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	618,186.470	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,772,638.560	
		STOCKLAND	193,279.000	879,419.450	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	808,624.570	
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,334,533.550	
	オーストラリア・ドル　小計		1,672,992.000	8,305,325.370 (709,191,734)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	485,950.520	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	329,160.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	399,990.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	330,412.000	
	シンガポール・ドル　小計		802,906.000	1,545,512.520 (124,722,860)	
投資信託受益証券　合計			2,475,898	833,914,594 (833,914,594)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	482,643.750	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,587.000	619,318.950	
		AMERICAN TOWER CORP	31,665.000	3,277,327.500	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	788,459.760	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,191.000	1,801,972.620	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,438,326.720	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	537,069.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	519,706.650	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	25,117.000	2,118,870.120	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,787.000	1,206,517.320	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	654,083.100	
		EQUINIX INC	5,241.000	1,939,327.230	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,729,231.600	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,283.000	1,215,618.300	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,980.000	764,767.400	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	810,571.790	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	43,463.000	1,088,313.520	
		HCP INC	34,130.000	1,025,606.500	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	1,048,372.380	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	641,524.500	
	KIMCO REALTY	32,980.000	829,117.200	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	465,727.020	
	MID AMERICA	8,123.000	791,992.500	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	472,898.400	
	PARK HOTELS & RESORTS INC	8,877.000	259,385.940	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,044,546.020	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,512,320.300	
	REALTY INCOME CORP	20,047.000	1,176,558.430	
	REGENCY CENTERS CORP	7,365.000	505,975.500	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,516.000	4,331,412.040	
	SL GREEN	7,722.000	818,918.100	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	631,791.260	
	UDR INC	21,797.000	778,806.810	
	VENTAS INC	27,031.000	1,653,215.960	
	VEREIT INC	59,654.000	523,762.120	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	1,282,155.000	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,758,541.120	
	WEYERHAEUSER CO	57,008.000	1,751,855.840	
アメリカ・ドル　小計		854,004.000	46,296,608.270 (5,368,554,694)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	451,349.880	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	334,404.280	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	209,118.880	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	656,970.090	
	SEGRO PLC	50,928.000	240,482.010	
イギリス・ポンド　小計		319,358.000	1,892,325.140 (267,328,773)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	243,764.640	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	259,386.750	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,582.000	82,908.020	
カナダ・ドル　小計		23,005.000	586,059.410 (51,315,362)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	189,876.720	
	GECINA SA	3,212.000	410,654.200	
	ICADE	2,234.000	151,666.260	
	KLEPIERRE	17,042.000	623,311.150	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,607,033.550	
ユーロ　小計		32,052.000	2,982,541.880 (365,152,602)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	8,714,550.000	
香港・ドル　小計		163,500.000	8,714,550.000	

			(130,282,523)	
投資証券　合計		1,391,919	6,182,633,954 (6,182,633,954)	
合計			7,016,548,548 (7,016,548,548)	

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	603銘柄	62.79%	-%	-%	66.21%
	投資証券	38銘柄	-%	-%	1.94%	
イギリス・ポンド	株式	106銘柄	6.95%	-%	-%	7.21%
	投資証券	5銘柄	-%	-%	0.10%	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式	60銘柄	2.68%	-%	-%	3.01%
	投資信託受益証券	9銘柄	-%	0.26%	-%	
カナダ・ドル	株式	90銘柄	3.93%	-%	-%	4.04%
	投資証券	3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式	20銘柄	0.45%	-%	-%	0.51%
	投資信託受益証券	4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式	37銘柄	3.37%	-%	-%	3.44%
スウェーデン・クローナ	株式	30銘柄	1.09%	-%	-%	1.11%
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.64%	-%	-%	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式	3銘柄	0.06%	-%	-%	0.07%
ノルウェー・クローネ	株式	9銘柄	0.25%	-%	-%	0.26%
ユーロ	株式	235銘柄	11.74%	-%	-%	12.14%
	投資証券	5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式	36銘柄	1.17%	-%	-%	1.24%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,327,859,938	4,688,604,432
コール・ローン		257,557,361	446,562,725
国債証券		246,435,012,067	252,171,615,963
派生商品評価勘定		383,796	30,346
未収利息		2,099,442,256	2,328,790,839
前払費用		116,757,577	39,280,294
流動資産合計		253,237,012,995	259,674,884,599
資産合計		253,237,012,995	259,674,884,599
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		69,393	－
未払解約金		128,380,000	292,699,000
流動負債合計		128,449,393	292,699,000
負債合計		128,449,393	292,699,000
純資産の部			
元本等			
元本	※１	153,756,172,524	146,373,971,356
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		99,352,391,078	113,008,214,243
元本等合計		253,108,563,602	259,382,185,599
純資産合計		253,108,563,602	259,382,185,599
負債純資産合計		253,237,012,995	259,674,884,599

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 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。
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	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目			平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．	※１	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	157,146,877,456円	153,756,172,524円
		同期中追加設定元本額	19,538,780,375円	9,883,848,569円
		同期中一部解約元本額	22,929,485,307円	17,266,049,737円
		元本の内訳		
	ファンド名			
		ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	4,657,576,294円	5,040,953,548円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	18,453,626円	13,192,943円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	49,958,425円	44,974,467円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	76,117,034円	68,941,452円
		グローバル８資産ラップファンド（安定型）	38,466,174円	39,306,534円
		グローバル８資産ラップファンド（中立型）	44,194,140円	43,503,107円
		グローバル８資産ラップファンド（積極型）	30,803,761円	35,942,474円
		たわらノーロード　先進国債券	335,095,097円	471,375,852円
		たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	606,412円	606,412円
		ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	4,669,154,605円	4,806,701,175円
		ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	409,560,484円	447,249,853円

	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,342,108,909円	1,429,659,466円
	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,396,294,182円	1,468,558,554円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	329,414,218円	361,249,152円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	702,091,373円	744,657,416円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	508,486,226円	543,187,678円
	マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	27,854,849円	25,724,429円
	マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	575,214,392円	566,630,602円
	マネックス資産設計ファンドエボリューション	22,038,818円	12,108,735円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	10,139,432円	13,202,419円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	18,447,725円	23,247,466円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	34,021,297円	43,834,058円
	クルーズコントロール	454,750,989円	3,171,032,527円
	ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	34,924,753円	41,442,826円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	34,167,706円	59,799,525円
	クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	122,277円	1,247,813円
	ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,788,106円	18,741,599円
	ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	4,869,065円	41,611,504円
	ダイナミック・ナビゲーション	1,169,942円	333,384円
	ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,681,199,585円	1,588,029,486円
	ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	7,844,833,698円	7,019,389,220円
	ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	4,309,315,918円	4,329,960,127円
	外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	4,584,579,483円	4,774,687,969円
	ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	246,920,518円	345,326,925円
	ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	135,908,048円	112,336,075円
	ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,541,804,314円	1,338,912,580円

ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	834,638,389円	849,585,326円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,495,469円	83,610,208円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	162,405,252円	155,742,527円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,645,519円	38,716,013円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,888,235円	14,338,581円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,436,925,429円	2,785,838,183円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,519,112,343円	712,401,380円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,044,396,602円	4,524,007,417円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,867,773,547円	2,758,132,476円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,629,882,412円	4,613,589,990円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	957,544,555円	902,807,235円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	3,393,963,726円	2,314,812,702円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,498,153,103円	4,189,811,725円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	16,927,285,923円	15,122,406,437円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	56,954,254円	64,131,288円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,432,893,808円	2,126,670,676円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,168,532,699円	11,186,558,463円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,537,657,599円	16,005,578,546円	

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,838,484,079円	20,316,219,428円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,666,037円	25,650,753円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,037,825円	1,779,956円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,401,032円	6,543,483円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,787,964,059円	18,222,174,819円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	127,936,598円	123,265,543円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	162,702,241円	141,553,653円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	234,554円	234,433円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	145,360円	150,763円
計	153,756,172,524円	146,373,971,356円
２．　受益権の総数	153,756,172,524口	146,373,971,356口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	平成29年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	6,911,518,000	△6,836,814,082
合計	6,911,518,000	△6,836,814,082

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月23日から平成28年7月11日まで及び平成28年2月23日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年7月11日 現在				平成29年1月11日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	93,808,596	－	93,424,800	383,796	1,355,543,776	－	1,355,513,430	30,346
アメリカ・ドル	－	－	－	－	705,228,471	－	705,207,900	20,571
イギリス・ポンド	－	－	－	－	130,105,986	－	130,100,460	5,526
ユーロ	93,808,596	－	93,424,800	383,796	520,209,319	－	520,205,070	4,249
買　建	1,674,302,693	－	1,674,233,300	△69,393	－	－	－	－
アメリカ・ドル	670,247,125	－	670,219,200	△27,925	－	－	－	－
イギリス・ポンド	83,706,014	－	83,703,960	△2,054	－	－	－	－
カナダ・ドル	167,252,528	－	167,239,520	△13,008	－	－	－	－
ユーロ	753,097,026	－	753,070,620	△26,406	－	－	－	－
合計	1,768,111,289	－	1,767,658,100	314,403	1,355,543,776	－	1,355,513,430	30,346

（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。

①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。

②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28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6462円 (16,462円)	1.7721円 (17,721円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.75 02/28/18	13,500,000.000	13,474,080.000	
		US T N/B 0.75 04/15/18	3,000,000.000	2,991,900.000	
		US T N/B 0.875 07/15/18	10,000,000.000	9,972,200.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	6,917,400.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	10,000,000.000	9,997,600.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,368,645.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	4,946,650.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,421,025.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,955,670.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,722,348.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	6,967,730.000	
		US T N/B 1.25 12/15/18	15,000,000.000	15,018,150.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	2,000,000.000	1,993,120.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	13,037,050.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,267,492.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,927,760.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	13,500,000.000	13,412,385.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	14,000,000.000	13,355,720.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	35,500,000.000	35,649,455.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,473,320.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	12,700,000.000	12,780,264.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,098,260.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	10,500,000.000	9,864,225.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	15,113,550.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	11,500,000.000	10,782,055.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	15,000,000.000	14,691,150.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,328,850.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	4,904,650.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	3,000,000.000	2,969,760.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	15,000,000.000	14,840,550.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	15,000,000.000	14,663,550.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	4,921,850.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,015,420.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,008,370.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,108,240.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	7,000,000.000	6,943,090.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	2,500,000.000	2,509,950.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,452,500.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,286,915.000	
		US T N/B 2.0 02/28/21	11,000,000.000	11,103,070.000	

US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,093,240.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	12,000,000.000	11,678,400.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,072,180.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,452,728.000	
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,618,125.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,116,800.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	10,340,820.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,564,505.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	21,000,000.000	21,244,440.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,051,090.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,110,100.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	8,700,000.000	8,792,394.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,022,480.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,721,835.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	7,500,000.000	6,417,750.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,500,000.000	10,480,260.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,000,000.000	9,916,400.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	15,000,000.000	15,289,950.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,979,922.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,511,982.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	6,000,000.000	5,445,420.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	7,000,000.000	6,333,880.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,172,260.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	5,000,000.000	4,523,800.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,171,200.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,067,765.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,209,520.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	12,000,000.000	12,366,000.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	7,000,000.000	7,257,530.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,890,000.000	3,746,848.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,370,300.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,271,684.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,231,200.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	6,070,000.000	5,974,154.700	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,400,000.000	6,268,480.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	500,000.000	490,660.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,292,427.600	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,500,000.000	6,528,405.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,800,000.000	6,837,672.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	6,000,000.000	6,021,540.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,859,616.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	5,600,000.000	5,777,184.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,542,750.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,441,200.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,100,000.000	6,287,270.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,860,030.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,690,000.000	7,220,985.300	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,218,720.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	14,387,660.000	

		US T N/B 3.5 02/15/39	2,000,000.000	2,219,840.000	
		US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,876,540.000	
		US T N/B 3.625 02/15/20	17,000,000.000	18,091,570.000	
		US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,909,475.000	
		US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,636,300.000	
		US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,288,450.000	
		US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	5,861,336.000	
		US T N/B 3.75 08/15/41	2,980,000.000	3,415,109.800	
		US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	6,567,882.000	
		US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,305,920.000	
		US T N/B 3.875 08/15/40	2,570,000.000	2,999,447.000	
		US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	12,553,560.000	
		US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,007,442.800	
		US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,466,080.000	
		US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	944,880.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,499,915.500	
		US T N/B 4.375 05/15/41	2,450,000.000	3,080,287.000	
		US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,078,486.000	
		US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,559,840.000	
		US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,830,171.200	
		US T N/B 4.5 08/15/39	2,200,000.000	2,803,790.000	
		US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	4,800,158.000	
		US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	3,973,110.000	
		US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	1,942,554.900	
		US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,924,560.000	
		US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,434,474.000	
		US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,346,534.000	
		US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,158,112.000	
		US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,890,098.000	
		US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,995,980.000	
		US T N/B 6.25 08/15/23	6,000,000.000	7,528,080.000	
		US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,699,200.000	
		US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,689,840.000	
		US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,643,560.000	
	アメリカ・ドル　小計		956,510,000.000 (110,916,899,600)	977,930,114.800 (113,400,776,112)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.25 07/22/18	3,000,000.000	3,048,600.000	
		UK TREASURY 1.5 01/22/21	3,200,000.000	3,321,600.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,200,000.000	1,215,600.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,700,000.000	4,877,613.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,475,230.000	
		UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,500,000.000	1,581,435.000	

UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,900,000.000	3,084,498.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,500,000.000	3,798,550.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,700,000.000	2,076,261.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,800,000.000	3,143,476.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,300,000.000	4,160,970.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	3,450,000.000	4,556,760.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,630,000.000	4,110,427.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,600,000.000	3,845,400.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,404,820.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,251,190.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,200,000.000	3,662,752.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,200,000.000	3,636,160.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,687,320.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,350,000.000	4,615,965.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,450,000.000	3,279,080.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,850,000.000	2,620,895.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,160,000.000	2,768,688.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,500,000.000	3,583,000.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,400,000.000	3,627,600.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,241,413.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,490,000.000	4,148,091.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,400,000.000	2,623,920.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,300,000.000	4,624,290.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,800,000.000	4,238,360.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,000,000.000	6,833,400.000	

		UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,200,000.000	3,048,320.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,400,000.000	3,605,040.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/18	900,000.000	949,770.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,880,000.000	3,746,592.000	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,164,995.000	
		UK TREASURY 8.0 06/07/21	2,000,000.000	2,651,800.000	
	イギリス・ポンド　小計		98,180,000.000 (13,869,888,600)	124,309,881.000 (17,561,256,889)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,747,776.000	
		AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,500,000.000	4,823,415.000	
		AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,254,186.000	
		AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,370,792.000	
		AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,000,000.000	942,800.000	
		AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	3,960,177.000	
		AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	827,037.000	
		AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,533,660.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,200,000.000	3,181,120.000	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,000,000.000	4,188,920.000	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	1,964,011.000	
		AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,700,000.000	1,625,829.000	
		AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	1,500,000.000	1,537,815.000	
		AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	1,728,754.500	
		AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,100,000.000	5,764,122.000	
		AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,107,296.000	
		AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,900,000.000	4,607,304.000	
		AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,700,000.000	3,841,895.000	
		AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,542,550.000	

	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,000,000.000	4,717,160.000	
オーストラリア・ドル　小計		57,750,000.000 (4,931,272,500)	62,266,619.500 (5,316,946,639)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,587,710.000	
	CANADA 0.5 11/01/18	4,600,000.000	4,579,392.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,379,960.000	
	CANADA 1.25 02/01/18	1,000,000.000	1,006,490.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,600,000.000	1,610,848.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,450,000.000	2,470,188.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,814,112.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,672,375.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,000,000.000	1,020,610.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,891,746.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,500,000.000	2,676,325.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,208,451.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	800,000.000	884,080.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	900,000.000	1,026,981.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	5,138,275.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,300,000.000	4,664,382.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,550,000.000	3,185,995.500	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,957,039.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,350,000.000	3,084,657.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	5,500,000.000	5,768,290.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	2,060,000.000	2,973,589.400	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,800,000.000	2,546,640.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,800,000.000	2,685,546.000	
カナダ・ドル　小計		56,210,000.000 (4,921,747,600)	62,833,681.900 (5,501,717,187)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	880,000.000	873,752.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	809,440.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	310,000.000	314,367.900	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	610,000.000	617,625.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	410,800.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	469,655.400	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	847,665.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,690,400.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,413,834.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	521,760.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,091,500.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,550,000.000	1,619,858.500	
シンガポール・ドル　小計		10,240,000.000 (826,368,000)	10,680,657.800 (861,929,084)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	5,000,000.000	5,196,200.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,589,878.000	

	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,800,000.000	13,875,148.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,400,000.000	8,740,864.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	11,870,000.000	14,177,884.100	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	12,300,000.000	13,612,779.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	13,811,805.000	
スウェーデン・クローナ　小計		68,480,000.000 (874,489,600)	80,004,558.100 (1,021,658,207)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	4,000,000.000	4,064,160.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,500,000.000	9,368,700.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	13,470,000.000	15,102,159.900	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,990,950.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	13,900,000.000	15,702,691.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	17,000,000.000	28,923,630.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	3,700,000.000	5,703,217.000	
デンマーク・クローネ　小計		73,570,000.000 (1,211,697,900)	93,855,507.900 (1,545,800,215)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	2,000,000.000	1,993,600.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,887,438.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,946,940.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,400,000.000	8,232,648.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	9,100,000.000	10,180,625.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	7,149,744.000	
ノルウェー・クローネ　小計		36,460,000.000 (491,845,400)	39,390,995.000 (531,384,523)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,908,500.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,101,440.000	
	POLAND 10/25/18	2,000,000.000	1,930,500.000	
	POLAND 2.5 07/25/18	1,500,000.000	1,513,950.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	3,846,990.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,141,838.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,216,207.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	5,000,000.000	5,127,500.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,237,175.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,527,325.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,921,340.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,208,478.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,547,600.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,153,616.000	
ポーランド・ズロチ　小計		48,470,000.000 (1,357,644,700)	50,382,459.400 (1,411,212,688)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,906,040.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,174,274.400	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,195,600.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,341,424.200	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	3,700,000.000	3,713,690.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,065,501.800	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	765,856.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,699,040.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,586,900.000	

	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,418,917.500	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	2,300,000.000	2,322,494.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,777,593.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,056,123.600	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,751,310.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,509,750.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,687,152.000	
マレーシア・リンギット　小計		37,430,000.000 (969,811,300)	36,971,667.100 (957,935,895)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	16,500,000.000	19,677,405.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	41,000,000.000	46,802,320.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	41,500,000.000	40,226,365.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	21,000,000.000	19,780,950.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,361,400.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	10,000,000.000	9,549,500.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,643,780.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,789,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,785,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	19,366,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,809,950.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,587,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,324,100.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	32,408,330.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	15,681,450.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	15,000,000.000	15,382,950.000	
メキシコ・ペソ　小計		325,000,000.000 (1,729,000,000)	331,176,400.000 (1,761,858,448)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	200,000.000	204,716.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	800,000.000	816,800.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,700,000.000	1,825,545.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,392,250.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,569,820.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,488,424.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,099,332.000	

		AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,220,000.000	1,724,848.200	
		AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,811,655.000	
		AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,600,000.000	3,066,700.000	
		AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,444,800.000	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	570,000.000	969,467.400	
		AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,250,000.000	2,596,500.000	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,800,000.000	2,778,300.000	
		AUSTRIA 4.35 03/15/19	2,300,000.000	2,550,033.000	
		AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,700,000.000	1,790,950.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,500,000.000	2,109,000.000	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,830,006.500	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	2,700,000.000	2,765,583.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,400,000.000	1,440,418.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,271,218.000	
		BELGIUM 1.25 06/22/18	2,000,000.000	2,054,940.000	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	862,236.000	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	700,000.000	756,721.000	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	400,000.000	403,800.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	2,000,000.000	2,289,760.000	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,043,794.000	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,078,063.500	
		BELGIUM 3.0 09/28/19	2,100,000.000	2,305,569.000	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	1,400,000.000	2,055,942.000	
		BELGIUM 3.75 09/28/20	3,000,000.000	3,475,620.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/18	500,000.000	528,240.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/19	1,950,000.000	2,152,059.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	2,300,000.000	2,812,049.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	1,200,000.000	1,675,464.000	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	2,400,000.000	3,724,824.000	
		BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,616,937.000	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,875,736.000	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,170,240.000	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	3,000,000.000	4,830,690.000	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	2,750,000.000	4,139,135.000	
		BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,032,470.000	
		BUNDESOBL 0.5 02/23/18	3,300,000.000	3,345,771.000	
		BUNDESOBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,188,164.000	
		BUNDESOBL 04/09/21	3,200,000.000	3,273,600.000	
		BUNDESOBL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,855,152.000	
		BUNDESSCHAT 06/15/18	2,300,000.000	2,324,380.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,900,000.000	4,046,094.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,200,000.000	4,316,550.000	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	2,000,000.000	1,946,640.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,804,958.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,445,120.000	

		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,000,000.000	1,109,350.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,223,890.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	3,800,000.000	4,242,434.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,200,000.000	2,431,968.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,700,010.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,500,000.000	3,911,845.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	3,300,000.000	3,707,088.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,100,000.000	3,554,832.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	2,700,000.000	2,988,468.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,500,000.000	3,955,525.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,700,000.000	3,037,635.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,800,000.000	3,782,408.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,780,000.000	3,796,090.000	
		DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	4,500,000.000	5,079,600.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	7,700,000.000	8,618,995.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,800,000.000	4,455,310.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,350,000.000	3,540,580.500	
		DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	5,900,000.000	6,527,170.000	
		DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	4,900,000.000	5,341,392.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,900,000.000	4,082,715.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,500,000.000	5,560,730.000	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	5,200,000.000	5,585,320.000	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,200,000.000	3,704,580.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,600,000.000	2,379,328.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,100,000.000	5,164,507.000	

DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,200,000.000	3,982,066.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,200,000.000	3,670,326.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,360,000.000	3,696,184.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,400,000.000	2,026,360.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,500,000.000	2,592,555.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,750,000.000	2,866,465.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	515,550.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	700,000.000	702,702.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	443,974.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	313,368.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	400,000.000	412,060.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,270,000.000	1,393,952.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	441,512.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	800,000.000	909,288.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	872,275.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	780,000.000	966,856.800	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,130,000.000	1,274,967.700	
FINLAND 3.5 04/15/21	800,000.000	933,552.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,010,000.000	1,328,190.400	
FINLAND 4.375 07/04/19	810,000.000	911,225.700	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	2,200,000.000	3,363,712.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,300,000.000	4,291,873.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,154,812.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	4,300,000.000	4,397,954.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,765,756.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	1,200,000.000	1,236,900.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	4,700,000.000	4,853,079.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,800,000.000	1,724,040.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,700,000.000	3,844,966.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,854,608.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	150,000.000	137,275.500	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	6,460,000.000	7,136,232.800	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,200,000.000	3,655,968.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	5,307,804.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,800,000.000	5,632,128.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,700,000.000	10,770,104.000	

FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,940,000.000	7,074,718.200	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,167,822.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,450,000.000	4,590,190.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,800,000.000	9,088,950.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,387,383.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,940,000.000	8,700,678.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	7,200,000.000	8,456,616.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,399,524.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	4,700,000.000	4,981,436.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,600,000.000	4,100,460.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	2,973,826.400	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,010,000.000	5,845,617.600	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	6,200,000.000	6,895,082.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,507,683.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,600,000.000	8,427,342.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,300,000.000	6,760,589.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,100,000.000	6,344,340.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,100,000.000	6,250,737.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,600,000.000	7,591,840.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,285,198.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	5,285,280.000	
IRISH 0.8 03/15/22	800,000.000	833,480.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,000,000.000	1,007,560.000	
IRISH 2.0 02/18/45	860,000.000	862,580.000	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,238,237.000	
IRISH 3.4 03/18/24	1,030,000.000	1,238,513.200	
IRISH 3.9 03/20/23	800,000.000	980,440.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,130,000.000	1,265,035.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,450,000.000	1,683,479.000	
IRISH 4.5 10/18/18	740,000.000	805,749.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,400,000.000	1,686,384.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,600,000.000	2,192,928.000	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,118,435.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,646,800.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,482,750.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,051,940.000	

ITALY BTPS 1.25 12/01/26	500,000.000	470,825.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,500,000.000	1,540,950.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,470,650.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,471,200.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,100,000.000	2,859,068.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,749,599.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,000,000.000	1,072,100.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	500,000.000	475,300.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,285,760.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,350,000.000	1,259,955.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	606,270.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,300,000.000	2,402,327.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,100,000.000	3,547,764.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,100,000.000	2,242,254.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,750,054.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,615,330.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	4,500,000.000	5,147,100.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,208,883.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,350,000.000	5,249,580.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	4,989,600.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,243,200.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,200,000.000	5,853,640.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	7,097,600.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	5,500,000.000	5,772,305.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,087,700.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,654,450.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,490,135.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,403,520.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,100,000.000	3,737,701.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	6,200,000.000	6,645,656.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,100,000.000	6,265,860.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,639,440.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,230,000.000	4,107,752.500	

ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,174,384.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	6,200,000.000	7,514,400.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,430,000.000	5,580,471.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,500,000.000	4,724,650.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	4,085,100.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	4,678,545.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,000,000.000	5,360,800.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	5,000,000.000	6,265,050.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,137,600.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,470,000.000	3,550,378.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,700,000.000	6,813,120.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	4,000,000.000	5,742,000.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,200,000.000	3,260,400.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	2,400,000.000	3,615,360.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	1,150,000.000	1,181,579.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,500,000.000	2,493,950.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,710,370.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,300,000.000	1,322,750.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	2,700,000.000	2,753,244.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	2,060,000.000	2,140,978.600	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,400,000.000	2,686,992.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,283,660.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,765,031.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,192,800.200	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,550,000.000	2,178,804.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,780,000.000	3,250,932.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,270,000.000	2,600,625.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,200,000.000	2,725,800.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,270,000.000	3,630,070.500	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,150,000.000	3,378,080.000	

		NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	2,848,594.000	
		NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,433,488.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,000,000.000	3,068,000.000	
		SPAIN 0.25 01/31/19	1,400,000.000	1,412,460.000	
		SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,738,658.000	
		SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,181,165.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,200,000.000	1,182,192.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,800,000.000	1,854,360.000	
		SPAIN 1.95 04/30/26	3,200,000.000	3,349,376.000	
		SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,712,690.000	
		SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,774,538.000	
		SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,133,700.000	
		SPAIN 2.75 10/31/24	3,400,000.000	3,815,718.000	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,338,961.000	
		SPAIN 3.45 07/30/66	500,000.000	534,555.000	
		SPAIN 3.75 10/31/18	2,700,000.000	2,896,479.000	
		SPAIN 3.8 04/30/24	3,400,000.000	4,067,556.000	
		SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,519,680.000	
		SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,590,379.000	
		SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,370,640.000	
		SPAIN 4.3 10/31/19	5,600,000.000	6,280,736.000	
		SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,585,241.000	
		SPAIN 4.5 01/31/18	2,500,000.000	2,625,825.000	
		SPAIN 4.6 07/30/19	4,700,000.000	5,260,898.000	
		SPAIN 4.65 07/30/25	3,600,000.000	4,580,100.000	
		SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,923,704.000	
		SPAIN 4.8 01/31/24	3,200,000.000	4,052,800.000	
		SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,421,043.000	
		SPAIN 4.9 07/30/40	2,400,000.000	3,417,600.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	3,002,120.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,800,000.000	2,660,742.000	
		SPAIN 5.4 01/31/23	3,200,000.000	4,106,208.000	
		SPAIN 5.5 04/30/21	4,200,000.000	5,154,744.000	
		SPAIN 5.75 07/30/32	3,000,000.000	4,493,580.000	
		SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,712,246.000	
		SPAIN 5.9 07/30/26	2,800,000.000	3,909,780.000	
		SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,123,965.000	
	ユーロ　小計		689,360,000.000 (84,398,344,800)	825,395,096.800 (101,053,121,701)	
	南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,800,750.000	
		SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,595,172.000	
		SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,461,320.000	

		SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	19,660,000.000	18,714,157.400	
		SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,567,680.000	
		SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	4,000,000.000	3,862,080.000	
		SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,919,218.700	
		SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	7,000,000.000	7,019,180.000	
		SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,113,400.000	
		SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,938,900.900	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,251,100.000	
		SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	15,686,580.000	
		SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	2,852,910.000	
		SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	3,000,000.000	2,850,060.000	
	南アフリカ・ランド　小計		160,740,000.000 (1,356,645,600)	147,632,509.000 (1,246,018,376)	
国債証券　合計			227,855,655,600 (227,855,655,600)	252,171,615,963 (252,171,615,963)	
合計			227,855,655,600 (227,855,655,600)	252,171,615,963 (252,171,615,963)	

（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	123銘柄	43.72%	44.97%
イギリス・ポンド	国債証券	37銘柄	6.77%	6.96%
オーストラリア・ドル	国債証券	20銘柄	2.05%	2.11%
カナダ・ドル	国債証券	23銘柄	2.12%	2.18%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	0.33%	0.34%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.39%	0.41%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.60%	0.61%
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.20%	0.21%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.54%	0.56%
マレーシア・リンギット	国債証券	16銘柄	0.37%	0.38%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	0.68%	0.70%
ユーロ	国債証券	249銘柄	38.96%	40.07%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	0.48%	0.49%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		551,295,658	1,415,085,713
コール・ローン		771,456,421	36,818,327
株式		33,016,616,407	38,892,263,440
投資信託受益証券		228,200,023	237,553,412
投資証券		108,141,051	93,373,243
派生商品評価勘定		56,533,988	19,708,307
未収入金		762,225	269,818
未収配当金		203,278,452	35,348,958
差入委託証拠金		358,743,475	593,122,646
流動資産合計		35,295,027,700	41,323,543,864
資産合計		35,295,027,700	41,323,543,864
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,676,969	－
未払金		722,729,675	7,137
未払解約金		17,307,000	17,413,000
流動負債合計		741,713,644	17,420,137
負債合計		741,713,644	17,420,137
純資産の部			
元本等			
元本	※１	43,354,457,363	42,090,393,658
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）	※２	△8,801,143,307	△784,269,931
元本等合計		34,553,314,056	41,306,123,727
純資産合計		34,553,314,056	41,306,123,727
負債純資産合計		35,295,027,700	41,323,543,864

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。 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。 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．　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。 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．　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。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,843,963,916円	43,354,457,363円
同期中追加設定元本額	13,462,610,283円	7,916,578,101円
同期中一部解約元本額	9,952,116,836円	9,180,641,806円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	1,287,494,886円	1,586,101,353円
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	109,971,037円	123,401,986円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	9,493,872円	5,258,828円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	25,710,953円	17,811,790円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	39,215,095円	27,031,131円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	19,789,538円	15,666,314円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	22,745,716円	17,178,142円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,870,387円	13,966,414円
たわらノーロード　新興国株式	426,894,579円	860,025,858円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	10,783,741円	302,701,465円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	534,755,049円	514,845,440円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	35,045,169円	40,980,588円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	98,599,627円	105,968,606円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	212,453,833円	239,780,908円
投資のソムリエ	1,812,394,970円	2,342,354,016円
クルーズコントロール	379,160,098円	2,326,917,948円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	41,920,471円	69,207,042円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	124,852,987円	129,816,015円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	102,607円	916,238円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	5,763,126円	34,356,782円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	10,101,934円	76,409,693円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	6,129,158円	11,904,041円
ダイナミック・ナビゲーション	495,412円	624,782円

	リスク抑制世界８資産バランスファンド	－円	260,124円
	エマージング株式パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	7,655,896,389円	6,552,597,287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）	190,433,666円	189,946,132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）	2,193,601,345円	2,135,654,775円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,217,537,348円	14,887,853,093円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,867,244,370円	9,460,856,867円
計		43,354,457,363円	42,090,393,658円
２．	受益権の総数	43,354,457,363口	42,090,393,658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8,801,143,307円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は784,269,931円であります。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	平成29年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△509,266,622	2,210,152,396
投資信託受益証券	△1,113,663	28,280,754
投資証券	△2,164,879	△14,817,383
合計	△512,545,164	2,223,615,767

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年4月19日から平成28年7月11日まで及び平成28年4月19日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年7月11日 現在				平成29年1月11日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	116,409,498	－	116,397,951	11,547	510,195,400	－	510,180,000	15,400
アメリカ・ドル	116,409,498	－	116,397,951	11,547	510,195,400	－	510,180,000	15,400
買　建	1,556,984,988	－	1,556,504,420	△480,568	－	－	－	－
アメリカ・ドル	928,462,800	－	927,360,000	△1,102,800	－	－	－	－
インド・ルピー	81,900,500	－	83,050,000	1,149,500	－	－	－	－
タイ・バーツ	23,548,743	－	23,480,600	△68,143	－	－	－	－
チェコ・コルナ	1,346,847	－	1,343,970	△2,877	－	－	－	－
トルコ・リラ	9,325,864	－	9,326,400	536	－	－	－	－
ハンガリー・フォリント	926,640	－	920,140	△6,500	－	－	－	－
フィリピン・ペソ	8,025,375	－	8,025,000	△375	－	－	－	－
ポーランド・ズロチ	9,165,604	－	9,147,600	△18,004	－	－	－	－
マレーシア・リンギット	28,225,705	－	28,218,300	△7,405	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	38,895,150	－	38,841,600	△53,550	－	－	－	－
韓国・ウォン	135,493,985	－	135,540,350	46,365	－	－	－	－
香港・ドル	157,234,660	－	157,179,000	△55,660	－	－	－	－
台湾・ドル	116,409,498	－	116,064,000	△345,498	－	－	－	－
南アフリカ・ランド	18,023,617	－	18,007,460	△16,157	－	－	－	－
合計	1,673,394,486	－	1,672,902,371	△469,021	510,195,400	－	510,180,000	15,400

（注）時価の算定方法

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

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

２．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
３．換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成28年7月11日 現在				平成29年1月11日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	1,824,551,117	－	1,879,877,157	55,326,040	1,523,154,893	－	1,542,847,800	19,692,907
合計	1,824,551,117	－	1,879,877,157	55,326,040	1,523,154,893	－	1,542,847,800	19,692,907

（注）１．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。
３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7970円 (7,970円)	0.9814円 (9,814円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
（１）株式

平成29年1月11日現在

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	31,200	43.710	1,363,752.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,673	13.100	257,716.300	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	65,400	5.455	356,757.000	
	CREDICORP LTD	5,549	165.000	915,585.000	
	SINA CORP	4,700	67.340	316,498.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	47,625	9.400	447,675.000	
	NETEASE INC-ADR	6,600	239.980	1,583,868.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,780	34.180	231,740.400	
	LUKOIL SPON ADR	36,954	56.340	2,081,988.360	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	48,121	2.000	96,242.000	
	GAZPROM PAO ADR	509,755	5.228	2,664,999.140	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	93,041	4.000	372,164.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	79,280	1.463	115,986.640	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	72,307	5.205	376,357.930	
	SISTEMA PJSC GDR	15,837	9.330	147,759.210	
	NOVATEK OAO GDR	8,095	128.000	1,036,160.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	22,700	180.310	4,093,037.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	50,414	17.600	887,286.400	
	ROSTELECOM SPON ADR	21,069	8.750	184,353.750	
	ROSNEFT OIL CO GDR	110,275	6.665	734,982.870	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	11,200	48.510	543,312.000	
	SEVERSTAL GDR	21,882	15.880	347,486.160	
	TATNEFT ADR	20,934	42.460	888,857.640	
	VTB BANK OJSC GDR	248,276	2.327	577,738.250	
	DP WORLD LTD	13,696	18.750	256,800.000	
	MAGNIT PJSC GDR	26,690	40.500	1,080,945.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	33,800	11.560	390,728.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	139,237	1.560	217,209.720	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	3,600	76.350	274,860.000	
	SBERBANK ADR	232,555	11.630	2,704,614.650	
	PHOSAGRO PJSC GDR	12,813	15.600	199,882.800	
	YY INC-ADR	2,400	42.240	101,376.000	
	58.COM INC ADR	6,800	30.480	207,264.000	
	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	3,200	30.320	97,024.000	

	WEIBO CORP ADR	2,700	45.700	123,390.000	
	JD.COM INC ADR	55,800	26.900	1,501,020.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	93,900	96.750	9,084,825.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	34,000	26.180	890,120.000	
アメリカ・ドル　小計		2,218,858		37,752,362.220 (4,377,763,923)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	75,484	13.300	1,003,937.200	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	101,220	5.930	600,234.600	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	144,932	18.900	2,739,214.800	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	164,030	7.470	1,225,304.100	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	55,579	10.500	583,579.500	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	293,731	7.680	2,255,854.080	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	267,344	2.680	716,481.920	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.650	472,139.900	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	272,783	1.300	354,617.900	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		1,553,269		9,951,364.000 (314,761,643)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	108,265	1,089.850	117,992,610.250	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	42,429	660.300	28,015,868.700	
	ASIAN PAINTS LTD	24,080	923.600	22,240,288.000	
	EICHER MOTORS LTD	1,119	23,005.000	25,742,595.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,126	1,213.500	37,771,401.000	
	SHREE CEMENT LTD	709	14,435.450	10,234,734.050	
	ICICI BANK LTD	91,887	260.200	23,908,997.400	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	34,445	479.250	16,507,766.250	
	STATE BANK OF INDIA LTD	129,282	248.300	32,100,720.600	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,923	1,192.150	3,484,654.450	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	25,256	521.550	13,172,266.800	
	TATA STEEL LTD	25,639	431.900	11,073,484.100	
	TATA MOTORS LTD	132,116	516.250	68,204,885.000	
	JSW STEEL LTD	70,280	178.450	12,541,466.000	
	TATA POWER CO LTD	91,986	77.100	7,092,120.600	
	NESTLE INDIA LTD	1,963	5,905.750	11,592,987.250	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	128.250	6,296,946.750	
	GAIL INDIA LTD	26,335	440.700	11,605,834.500	
	VEDANTA LTD	86,499	232.600	20,119,667.400	
	AXIS BANK LTD	139,731	447.350	62,508,662.850	
	TITAN COMPANY LTD	25,302	361.450	9,145,407.900	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	105,658	198.450	20,967,830.100	

LUPIN LTD	18,493	1,488.500	27,526,830.500	
ACC LTD	3,300	1,319.600	4,354,680.000	
BAJAJ FINANCE LTD	13,840	899.750	12,452,540.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	125,716	1,217.250	153,027,801.000	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	48,253	467.750	22,570,340.750	
INFOSYS LTD	153,655	970.550	149,129,860.250	
WIPRO LTD	51,131	476.500	24,363,921.500	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	54,107	830.550	44,938,568.850	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,454	1,196.900	7,724,792.600	
HCL TECHNOLOGIES LTD	47,180	837.850	39,529,763.000	
DABUR INDIA LTD	44,319	277.650	12,305,170.350	
HERO MOTOCORP LTD	4,116	3,059.000	12,590,844.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,660	3,041.850	29,384,271.000	
BHARTI AIRTEL LTD	82,983	320.100	26,562,858.300	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	1,909.400	10,394,773.600	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	80,338	638.550	51,299,829.900	
DIVI'S LABORATORIES LTD	6,922	739.350	5,117,780.700	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,833	5,674.850	50,125,950.050	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,618	899.900	10,455,038.200	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,467	699.650	15,719,036.550	
HAVELLS INDIA LTD	20,340	367.550	7,475,967.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	36,648	328.050	12,022,376.400	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	12,785	939.450	12,010,868.250	
CIPLA LTD/INDIA	28,876	574.900	16,600,812.400	
LARSEN & TOUBRO LTD	26,431	1,387.500	36,673,012.500	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,312	3,279.450	23,979,338.400	
ASHOK LEYLAND LTD	97,960	84.950	8,321,702.000	
BOSCH LTD	631	21,146.350	13,343,346.850	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	39,455	2,315.350	91,352,134.250	
NTPC LTD	140,731	162.300	22,840,641.300	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,629	1,734.750	11,499,657.750	
YES BANK LTD	26,203	1,264.600	33,136,313.800	
AMBUJA CEMENTS LTD	50,174	209.400	10,506,435.600	
BHARAT FORGE LTD	8,786	930.750	8,177,569.500	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	95,921	164.400	15,769,412.400	
ITC LTD	282,831	248.950	70,410,777.450	
UNITED PHOSPHORUS LTD	29,735	663.500	19,729,172.500	
SIEMENS INDIA LTD	5,885	1,172.550	6,900,456.750	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,178	1,562.850	15,906,687.300	

	TECH MAHINDRA LTD	19,661	473.500	9,309,483.500	
	CAIRN INDIA LTD	37,231	258.700	9,631,659.700	
	IDEA CELLULAR LTD	103,591	74.500	7,717,529.500	
	MARICO LTD	38,600	260.750	10,064,950.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	51,530	129.200	6,657,676.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	68,842	293.900	20,232,663.800	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,264	3,010.150	9,825,129.600	
	BAJAJ AUTO LTD	6,948	2,740.750	19,042,731.000	
	COAL INDIA LTD	59,515	300.600	17,890,209.000	
	TATA MOTORS LTD	31,568	326.300	10,300,638.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	281.250	6,669,843.750	
	BHARTI INFRATEL LTD	47,337	353.550	16,735,996.350	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,108	688.750	17,293,135.000	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	355.750	6,455,439.500	
	IDFC BANK LTD	114,421	61.850	7,076,938.850	
インド・ルピー　小計		3,621,946		1,893,456,552.400 (3,237,810,705)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	6,250.000	940,000,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	144,301	21,950.000	3,167,406,950.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	373,300	7,975.000	2,977,067,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	127,400	40,100.000	5,108,740,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,692,700	8,200.000	13,880,140,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,217,700	4,000.000	16,870,800,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,900	3,130.000	1,943,417,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	40,500	63,000.000	2,551,500,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	782,000	3,950.000	3,088,900,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	121,700	15,250.000	1,855,925,000.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	870,500	1,325.000	1,153,412,500.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	3,670.000	1,065,826,720.000	
	BANK MANDIRI	779,000	11,400.000	8,880,600,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	199,400	15,675.000	3,125,595,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	927,800	11,800.000	10,948,040,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	953,400	2,740.000	2,612,316,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	632,200	5,600.000	3,540,320,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,748,400	1,550.000	2,710,020,000.000	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	241,600	9,125.000	2,204,600,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,028,400	15,400.000	15,837,360,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	2,670.000	776,169,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,560,300	780.000	1,217,034,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	1,760.000	824,560,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,260.000	852,532,500.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	1,740.000	1,031,472,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,223,000	1,685.000	2,060,755,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	2,087,400	580.000	1,210,692,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	182,600	8,775.000	1,602,315,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	5,200.000	940,160,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	2,580.000	1,011,360,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	535,800	2,830.000	1,516,314,000.000	
インドネシア・ルピア　小計		23,656,042		117,505,350,170.000 (1,022,296,546)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	9,967	89.000	887,063.000	
	QATAR NATIONAL BANK	17,481	165.100	2,886,113.100	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	13,439	32.500	436,767.500	
	OOREDOO QSC	6,737	106.500	717,490.500	
	DOHA BANK QSC	10,788	35.200	379,737.600	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,406	234.000	563,004.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,841	120.000	1,540,920.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,187	106.700	553,452.900	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	23,294	23.530	548,107.820	
	MASRAF AL RAYAN	30,191	39.100	1,180,468.100	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	34.200	270,727.200	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	66,339	15.380	1,020,293.820	
	COMMERCIAL BANK QSC-RTS	2,420	4.460	10,793.200	
カタール・リアル　小計		209,006		10,994,938.740 (350,848,495)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	30,075	10,140.000	304,960,500.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	7,787	37,460.000	291,701,020.000	
	ECOPETROL SA	413,049	1,390.000	574,138,110.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	9,067	37,500.000	340,012,500.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	247,861	1,205.000	298,672,505.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	38,592	11,820.000	456,157,440.000	

	GRUPO ARGOS SA	24,430	19,680.000	480,782,400.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,502	28,280.000	1,060,556,560.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	19,160	38,200.000	731,912,000.000	
コロンビア・ペソ　小計		827,523		4,538,893,035.000 (177,924,607)	
タイ・バーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	171.500	3,378,550.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	18.700	1,611,940.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	100,100	47.500	4,754,750.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	293,900	18.800	5,525,320.000	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PCL-NVDR	39,400	59.750	2,354,150.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	146,700	157.500	23,105,250.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	834,855	7.100	5,927,470.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	49,000	189.000	9,261,000.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.280	2,302,800.000	
	IRPC PCL NVDR	863,400	5.100	4,403,340.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	127,000	20.300	2,578,100.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	10,100	200.000	2,020,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	229,000	30.250	6,927,250.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	86,300	153.000	13,203,900.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	361,920	10.200	3,691,584.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	45,500	84.750	3,856,125.000	
	PTT PCL	83,200	388.000	32,281,600.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	164,100	21.200	3,478,920.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,050	498.000	5,502,900.000	
	KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	24,900	124.500	3,100,050.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	35,500	393.000	13,951,500.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	22,700	498.000	11,304,600.000	
	KASIKORNBANK PCL -FOREIGN	96,400	190.000	18,316,000.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	113,600	56.500	6,418,400.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	323,800	22.500	7,285,500.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	184.500	5,590,350.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	183,910	36.000	6,620,760.000	
	THAI OIL PCL NVDR	70,200	69.000	4,843,800.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	79.500	3,307,200.000	
	CP ALL PCL NVDR	413,500	62.000	25,637,000.000	

	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	8.700	4,483,110.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	114,545	96.000	10,996,320.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	57,922	37.000	2,143,114.000	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	37.000	2,032,521.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	171,808	63.500	10,909,808.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	93,000	30.250	2,813,250.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	578,400	7.650	4,424,760.000	
タイ・バーツ　小計		7,503,743		280,342,992.500 (913,918,155)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,707	885.500	5,053,548.500	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	267.900	1,520,868.300	
	CEZ	13,588	423.700	5,757,235.600	
	MONETA MONEY BANK AS	35,735	81.850	2,924,909.750	
チェコ・コルナ　小計		60,707		15,256,562.150 (69,112,226)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,373,843	36.580	196,575,176.940	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,083	33,884.000	104,464,372.000	
	BANCO DE CHILE	2,049,363	78.390	160,649,565.570	
	EMPRESAS CMPC SA	102,793	1,348.300	138,595,801.900	
	EMPRESAS COPEC SA	36,937	6,517.500	240,736,897.500	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	6,917.300	91,239,187.000	
	ENTEL CHILE SA	12,913	7,034.400	90,835,207.200	
	ENEL GENERACION CHILE SA	274,605	435.410	119,565,763.050	
	ENEL AMERICAS SA	2,433,732	110.700	269,414,132.400	
	COLBUN SA	616,527	129.780	80,012,874.060	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	365.870	81,997,320.920	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,551.200	54,544,656.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	24,937	5,754.900	143,509,941.300	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,243	20,267.000	167,060,881.000	
	SACI FALABELLA	50,696	5,225.300	264,901,808.800	
	ITAU CORPBANCA	13,410,500	5.597	75,058,568.500	
	CENCOSUD SA	118,522	1,869.600	221,588,731.200	
	AES GENER SA	257,135	226.100	58,138,223.500	
	ENEL CHILE SA	1,664,838	63.000	104,884,794.000	
チリ・ペソ　小計		26,697,353		2,663,773,902.840 (460,832,885)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	184,037	7.470	1,374,756.390	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	16,570	18.830	312,013.100	
	ARCELIK	20,283	20.120	408,093.960	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	112,625	4.970	559,746.250	

	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	29.920	167,073.280	
	KOC HOLDING AS	52,699	13.360	704,058.640	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	47,602	3.830	182,315.660	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	56,871	3.720	211,560.120	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	10,370	23.680	245,561.600	
	TURK HAVA YOLLARI	39,958	4.830	192,997.140	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	71,853	10.220	734,337.660	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	194,188	7.410	1,438,933.080	
	TURKIYE IS BANKASI	134,746	5.160	695,289.360	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,559	71.500	754,968.500	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	14,893	15.650	233,075.450	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	78,404	3.310	259,517.240	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	79,625	9.060	721,402.500	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	32.800	211,592.800	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	17,758	48.240	856,645.920	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	4.260	270,970.080	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	15,347	14.180	217,620.460	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	51,480	9.350	481,338.000	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	39,975	5.160	206,271.000	
トルコ・リラ　小計		1,325,486		11,440,138.190 (348,237,806)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	11,774	6,448.000	75,918,752.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,236	20,970.000	67,858,920.000	
	OTP BANK NYRT	20,037	8,742.000	175,163,454.000	
ハンガリー・フォリント　小計		35,047		318,941,126.000 (126,268,792)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	615,600	34.400	21,176,640.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	157,720	75.000	11,829,000.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	59,486	92.400	5,496,506.400	
	AYALA CORP	21,453	793.000	17,012,229.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	169,800	13.700	2,326,260.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	13.000	4,574,050.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,960	1,826.000	5,404,960.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	75.450	3,069,306.000	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	236,480	76.300	18,043,424.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	36,030	219.000	7,890,570.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	47,451	80.150	3,803,197.650	
	BDO UNIBANK INC	136,318	113.800	15,512,988.400	
	MEGAWORLD CORP	962,000	3.920	3,771,040.000	
	PLDT INC	8,220	1,590.000	13,069,800.000	
	ROBINSONS LAND CORP	131,600	27.350	3,599,260.000	
	SECURITY BANK CORP	9,450	215.000	2,031,750.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	690,275	31.300	21,605,607.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	72,860	170.000	12,386,200.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,988	690.000	13,791,720.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	809,000	5.250	4,247,250.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,180,800	7.100	8,383,680.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	43.700	5,370,730.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,900	1,320.000	9,108,000.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,889,821		213,504,168.950 (499,599,755)	
ブラジル・レアル	BRF SA	51,092	45.920	2,346,144.640	
	VALE SA	106,827	28.540	3,048,842.580	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	28.700	230,116.600	
	VALE SA-PREF A	161,696	26.170	4,231,584.320	
	RAIA DROGASIL SA	19,500	60.040	1,170,780.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	8.300	578,510.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	24.990	486,055.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	18,000	21.980	395,640.000	
	BANCO DO BRASIL SA	71,800	28.180	2,023,324.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	325,078	8.700	2,828,178.600	
	LOJAS AMERICANAS SA	48,874	16.850	823,526.900	
	LOJAS AMERICANAS SA	14,670	12.600	184,842.000	
	GERDAU SA	76,630	11.980	918,027.400	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	13,106	55.640	729,217.840	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	248,010	17.610	4,367,456.100	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	328,912	15.480	5,091,557.760	
	KROTON EDUCACIONAL SA	115,968	13.390	1,552,811.520	
	CCR SA	73,820	16.430	1,212,862.600	
	WEG SA	47,540	15.230	724,034.200	
	BANCO BRADESCO SA PREF	233,315	30.370	7,085,776.550	
	BANCO BRADESCO SA	68,241	30.500	2,081,350.500	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	23.800	352,240.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	50,506	11.700	590,920.200	

	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	13.610	427,354.000	
	CPFL ENERGIA SA	17,474	25.240	441,043.760	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	270,098	35.750	9,656,003.500	
	PORTO SEGURO SA	9,400	27.330	256,902.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	21,490	31.360	673,926.400	
	BRASKEM SA	12,030	35.490	426,944.700	
	ENGIE BRASIL SA	13,970	35.050	489,648.500	
	LOCALIZA RENT A CAR	13,105	36.550	478,987.750	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	37,228	44.650	1,662,230.200	
	LOJAS RENNER SA	54,200	22.900	1,241,180.000	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,064	13.300	346,651.200	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	30,252	67.920	2,054,715.840	
	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	9,500	37.580	357,010.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	16,800	53.500	898,800.000	
	EMBRAER SA	56,360	16.450	927,122.000	
	M DIAS BRANCO SA	2,800	123.000	344,400.000	
	ODONTOPREV SA	22,300	11.260	251,098.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	49,400	12.870	635,778.000	
	JBS SA	61,100	12.050	736,255.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	64,349	7.450	479,400.050	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	28,998	29.250	848,191.500	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,000	60.910	426,370.000	
	DURATEX SA	27,734	7.560	209,669.040	
	SUL AMERICA SA	15,448	18.800	290,422.400	
	HYPERMARCAS SA	29,900	26.590	795,041.000	
	BM&FBOVESPA SA	144,900	17.370	2,516,913.000	
	QUALICORP SA	17,800	19.220	342,116.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	34,900	29.680	1,035,832.000	
	CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	19,459	46.030	895,697.770	
	CIELO SA	85,423	26.580	2,270,543.340	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,300	29.560	1,723,348.000	
	AMBEV SA	394,095	16.340	6,439,512.300	
	KLABIN SA	46,700	16.410	766,347.000	
	RUMO LOGISTICA OPERADORA MULTIMODAL SA	68,700	6.560	450,672.000	
	AES TIETE ENERGIA SA	14,758	14.410	212,662.780	
ブラジル・レアル　小計		3,998,988		85,062,588.840 (3,087,771,974)	

ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	52,647	5.740	302,193.780	
	MBANK	1,260	348.650	439,299.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	77.300	200,670.800	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,662	100.200	1,168,532.400	
	BANK PEKAO SA	13,007	129.550	1,685,056.850	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.630	329,918.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,795	88.300	2,365,998.500	
	LPP SA	112	5,420.000	607,040.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,975	324.050	964,048.750	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	72,885	30.300	2,208,415.500	
	CCC SA	2,228	217.100	483,698.800	
	SYNTHOS SA	46,508	5.070	235,795.560	
	EUROCASH SA	6,142	40.550	249,058.100	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	39.800	317,484.600	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	150,232	5.770	866,838.640	
	CYFROWY POLSAT SA	16,740	24.920	417,160.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	68.890	265,433.170	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,259	10.480	778,234.320	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	2.930	241,795.320	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	46,891	34.300	1,608,361.300	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,403	69.400	305,568.200	
	ALIOR BANK SA	7,434	59.250	440,464.500	
ポーランド・ズロチ　小計		691,730		16,481,066.890 (461,634,684)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	152,500	4.450	678,625.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.960	247,696.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	251,500	4.800	1,207,200.000	
	DIGI.COM BHD	287,500	4.900	1,408,750.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	6.040	417,484.800	
	RHB BANK BHD	64,480	4.930	317,886.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	54,700	9.000	492,300.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	69,235	2.920	202,166.200	
	GAMUDA BHD	135,700	4.950	671,715.000	
	GENTING BHD	188,200	8.210	1,545,122.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.520	562,415.200	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	16,656	14.960	249,173.760	
	HONG LEONG BANK BHD	48,008	13.300	638,506.400	

	IJM CORP BHD	245,560	3.390	832,448.400	
	IOI CORP BHD	189,613	4.500	853,258.500	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	36,500	24.100	879,650.000	
	MALAYAN BANKING BHD	293,575	8.280	2,430,801.000	
	LAFARGE MALAYSIA BHD	26,700	7.200	192,240.000	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	86,100	3.740	322,014.000	
	MISC BHD	94,580	7.440	703,675.200	
	PPB GROUP BHD	40,500	16.380	663,390.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	23.820	416,850.000	
	PETRONAS GAS BHD	58,700	20.980	1,231,526.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	248,400	4.850	1,204,740.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	46.280	527,592.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.160	585,200.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	286,250	13.800	3,950,250.000	
	UMW HOLDINGS BHD	36,300	4.610	167,343.000	
	DIALOG GROUP BHD	243,444	1.550	377,338.200	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	226,430	20.020	4,533,128.600	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.450	211,501.350	
	AIRASIA BHD	107,200	2.190	234,768.000	
	SIME DARBY BERHAD	192,100	8.450	1,623,245.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	63,700	4.810	306,397.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	219,100	4.740	1,038,534.000	
	MAXIS BHD	154,200	6.180	952,956.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	196,300	7.170	1,407,471.000	
	SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	319,200	1.720	549,024.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	125,500	2.700	338,850.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	282,100	6.380	1,799,798.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	1.760	209,792.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	83,500	4.300	359,050.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	139,639	2.210	308,602.190	
マレーシア・リンギット　小計		6,114,363		37,850,474.200 (980,705,786)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	233,900	25.030	5,854,517.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	42,300	130.910	5,537,493.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	15,600	141.230	2,203,188.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	152,500	30.720	4,684,800.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	203,500	87.190	17,743,165.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	136,100	46.630	6,346,343.000	

	GRUMA SAB DE CV	18,425	265.180	4,885,941.500	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,125	163.400	3,615,225.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	46,900	81.410	3,818,129.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	207,400	95.500	19,806,700.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	87,625	50.030	4,383,878.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,960	476.750	6,655,430.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	130,300	34.660	4,516,198.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,090	304.560	5,204,930.400	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	317,752	59.540	18,918,954.080	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,767,278	13.840	38,299,127.520	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	190,100	30.470	5,792,347.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	36,400	104.100	3,789,240.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	433,100	35.790	15,500,649.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	30,000	164.490	4,934,700.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	21.120	1,482,624.000	
	GENTERA SAB DE CV	84,900	32.690	2,775,381.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	45,500	89.690	4,080,895.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	50,400	27.420	1,381,968.000	
メキシコ・ペソ　小計		5,353,355		192,211,824.250 (1,022,566,905)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	500,000	0.219	109,500.000	
	ALPHA BANK A.E.	100,000	1.980	198,000.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.253	1,011.490	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	22.000	77,396.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	9.060	90,636.240	
	FF GROUP	3,130	19.050	59,626.500	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	0.664	1,082.320	
	OPAP SA	8,501	8.750	74,383.750	
	JUMBO SA	5,623	14.860	83,557.780	
ユーロ　小計		636,404		695,194.080 (85,112,611)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,627	16,350.000	92,001,450.000	
	HANMI PHARM CO LTD	1,068	56,300.000	60,128,400.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,205	101,000.000	323,705,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,766	266,500.000	737,139,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,192	62,400.000	261,580,800.000	

COWAY CO LTD	4,510	89,900.000	405,449,000.000	
KT&G CORP	9,779	99,500.000	973,010,500.000	
S-1 CORPORATION	1,579	90,400.000	142,741,600.000	
KOREA GAS CORP	2,424	47,700.000	115,624,800.000	
CJ CORP	1,242	190,000.000	235,980,000.000	
KAKAO CORP	2,569	82,000.000	210,658,000.000	
SK TELECOM CO LTD	1,695	225,000.000	381,375,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,400	84,700.000	203,280,000.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	15,692	8,000.000	125,536,000.000	
NCSOFT CORPORATION	1,481	263,500.000	390,243,500.000	
LG UPLUS CORP	18,179	11,500.000	209,058,500.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	29,350.000	118,867,500.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	8,516	5,200.000	44,283,200.000	
POSCO DAEWOO CORP	3,600	27,250.000	98,100,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	787	848,000.000	667,376,000.000	
LG CHEM LTD	3,876	267,500.000	1,036,830,000.000	
LG CHEM LTD	607	178,500.000	108,349,500.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	167	527,000.000	88,009,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	35,659	44,900.000	1,601,089,100.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	4,815	44,800.000	215,712,000.000	
S-OIL CORP	3,868	84,700.000	327,619,600.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	9,297	26,200.000	243,581,400.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,874	32,150.000	156,699,100.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,284	375,000.000	481,500,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	46,100.000	136,225,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,495	139,000.000	485,805,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,686	276,500.000	1,572,179,000.000	
SK HYNIX INC	48,682	49,750.000	2,421,929,500.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,099	41,200.000	251,278,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,907	98,000.000	186,886,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	12,850	152,000.000	1,953,200,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,608	56,600.000	374,012,800.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,291	12,250.000	260,814,750.000	
KCC CORP	483	359,000.000	173,397,000.000	
KIA MOTORS CORP	21,962	40,500.000	889,461,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	725	479,500.000	347,637,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,543	42,250.000	910,191,750.000	
HANWHA CORP	3,785	37,600.000	142,316,000.000	

KOREAN AIR CO LTD	2,950	26,050.000	76,847,500.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	79,000.000	118,500,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	591	168,000.000	99,288,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,423	85,800.000	122,093,400.000	
KT CORP	2,048	29,000.000	59,392,000.000	
LG ELECTRONICS INC	8,905	51,800.000	461,279,000.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	430	172,500.000	74,175,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	47	1,396,000.000	65,612,000.000	
HANSSEM CO LTD	869	191,500.000	166,413,500.000	
LG CORP	7,896	59,100.000	466,653,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	10,100.000	117,059,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	27,300.000	107,698,500.000	
NAVER CORP	2,347	792,000.000	1,858,824,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,243	98,500.000	122,435,500.000	
DONGSUH CO INC	2,798	26,050.000	72,887,900.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,287	43,800.000	143,970,600.000	
OTTOGI CORP	112	627,000.000	70,224,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,351	121,000.000	284,471,000.000	
KANGWON LAND INC	9,832	34,800.000	342,153,600.000	
POSCO	6,174	249,500.000	1,540,413,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,595	116,500.000	535,317,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,716	50,700.000	239,101,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,300	1,862,000.000	15,454,600,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	20,301	10,500.000	213,160,500.000	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,141	46,400.000	145,742,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,475	1,477,000.000	2,178,575,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	168,000.000	112,392,000.000	
HYOSUNG CORP	1,781	138,500.000	246,668,500.000	
ORION CORP	299	620,000.000	185,380,000.000	
YUHAN CORP	733	200,500.000	146,966,500.000	
HANON SYSTEMS	16,104	9,540.000	153,632,160.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,281	31,050.000	163,975,050.000	
GS HOLDINGS CORP	4,295	52,600.000	225,917,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	19,437	31,600.000	614,209,200.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	6,790.000	69,801,200.000	
CELLTRION INC	6,669	103,900.000	692,909,100.000	
HANA FINANCIAL GROUP	24,764	31,450.000	778,827,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,601	157,000.000	251,357,000.000	

	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	6,755	20,500.000	138,477,500.000	
	LOTTE SHOPPING CO	928	210,000.000	194,880,000.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,814	110,500.000	642,447,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,682	293,500.000	787,167,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	186,500.000	140,248,000.000	
	SAMSUNG CARD CO	2,877	38,950.000	112,059,150.000	
	SK INNOVATION CO LTD	5,408	155,500.000	840,944,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	669	352,500.000	235,822,500.000	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	54,500.000	99,462,500.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,196	89,400.000	106,922,400.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,820	229,500.000	876,690,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	33,223	43,250.000	1,436,894,750.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,454	74,100.000	107,741,400.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,708	69,700.000	397,847,600.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	21,890	8,680.000	190,005,200.000	
	HANMI PHARM CO LTD	440	287,500.000	126,500,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	16,882	6,270.000	105,850,140.000	
	O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,537	75,000.000	115,275,000.000	
	E-MART CO LTD	1,648	183,000.000	301,584,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	9,560.000	129,432,840.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	48,000.000	119,136,000.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,212	63,300.000	393,219,600.000	
	BGF RETAIL CO LTD	1,594	83,800.000	133,577,200.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,898	140,500.000	407,169,000.000	
	WOORI BANK	25,506	12,600.000	321,375,600.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,331	126,500.000	800,871,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,333	151,000.000	201,283,000.000	
韓国・ウォン　小計		698,061		58,402,668,640.000 (5,659,218,590)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	100,000	11.440	1,144,000.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	9.850	1,004,700.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	4.450	720,900.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	513,500	84.100	43,185,350.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	104,500	22.150	2,314,675.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,000	37.650	1,581,300.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	5.030	1,800,740.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	3.850	1,062,600.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	158,000	5.460	862,680.000	

HENGAN INTERNATIONAL GROUP	60,500	59.800	3,617,900.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	67,020	11.030	739,230.600	
CNOOC LTD	1,478,000	9.730	14,380,940.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	250,000	11.060	2,765,000.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	354,000	8.260	2,924,040.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	321,120	22.000	7,064,640.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	230,888	18.500	4,271,428.000	
CITIC LTD	363,000	11.380	4,130,940.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	126,000	7.600	957,600.000	
LENOVO GROUP LTD	602,000	5.010	3,016,020.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,758,000	6.180	10,864,440.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	496,742	9.100	4,520,352.200	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	136,790	16.500	2,257,035.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,129,200	5.900	12,562,280.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	16.720	1,287,440.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	62,000	35.200	2,182,400.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	268,000	6.000	1,608,000.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	130,000	7.820	1,016,600.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	108,000	20.350	2,197,800.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	326,000	3.280	1,069,280.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	14.800	1,154,400.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	144,000	11.160	1,607,040.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	440,000	8.270	3,638,800.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	74,000	24.050	1,779,700.000	
BYD CO LTD	53,000	42.500	2,252,500.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,156,000	3.690	4,265,640.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	146,000	7.620	1,112,520.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	950,000	1.250	1,187,500.000	
SINOTRANS LTD	147,000	3.490	513,030.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	208,000	8.950	1,861,600.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	383,192	12.200	4,674,942.400	

AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	164,000	5.410	887,240.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	161,200	12.700	2,047,240.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	260,000	7.590	1,973,400.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	621,000	21.100	13,103,100.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	583,000	2.590	1,509,970.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.280	844,800.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	230,700	11.200	2,583,840.000	
WEICHAI POWER CO LTD	84,720	13.260	1,123,387.200	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	4.430	1,315,710.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	41,000	21.250	871,250.000	
TINGYI HOLDING CORP	164,000	8.940	1,466,160.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	29.050	871,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	238,000	10.580	2,518,040.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	137,333	15.520	2,131,408.160	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	7.520	872,320.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	373,000	5.580	2,081,340.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	230,000	14.780	3,399,400.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	475,400	198.000	94,129,200.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	436,000	39.800	17,352,800.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	366,000	5.040	1,844,640.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	970,240	0.930	902,323.200	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	2.840	772,480.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	5.180	839,160.000	
ZTE CORP	58,488	12.460	728,760.480	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.650	912,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	283,000	15.620	4,420,460.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	725,205	5.720	4,148,172.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	146,000	11.500	1,679,000.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	61,500	75.000	4,612,500.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,032,530	5.900	41,491,927.000	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	47,000	48.000	2,256,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	7.710	1,757,880.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	141,000	7.700	1,085,700.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	238,000	3.910	930,580.000	
BANK OF CHINA LTD	6,641,200	3.510	23,310,612.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	102,000	10.380	1,058,760.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	84,400	9.790	826,276.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	324,970	18.760	6,096,437.200	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,165,235	4.710	29,038,256.850	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	199,600	5.490	1,095,804.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	370,000	9.210	3,407,700.000	
CHINA COAL ENERGY CO	162,000	3.830	620,460.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	15.880	857,520.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	45,500	40.950	1,863,225.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	13.840	1,453,200.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	489,142	4.300	2,103,310.600	
CHINA CITIC BANK-H	743,800	5.140	3,823,132.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	527,000	4.630	2,440,010.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	60,000	40.000	2,400,000.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	85,000	23.150	1,967,750.000	
FOSUN INTERNATIONAL	215,528	11.140	2,400,981.920	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	316,000	2.240	707,840.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	249,500	3.460	863,270.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	3.930	699,540.000	
KINGSOFT CORP LTD	65,000	16.600	1,079,000.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,096,000	0.960	1,052,160.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	343,000	6.550	2,246,650.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	161,000	10.260	1,651,860.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	478,000	5.010	2,394,780.000	

CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	219,600	27.700	6,082,920.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	349,000	5.210	1,818,290.000	
CRRC CORP LTD - H	354,450	7.270	2,576,851.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	104,000	12.540	1,304,160.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	200,500	7.850	1,573,925.000	
SINOPHARM GROUP CO	99,600	35.250	3,510,900.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	177,805	10.220	1,817,167.100	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	212,000	4.620	979,440.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	266,000	6.430	1,710,380.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	56,800	19.680	1,117,824.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	2.640	902,880.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	163,000	6.990	1,139,370.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	126,500	10.440	1,320,660.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	64,600	37.150	2,399,890.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	491,380	8.410	4,132,505.800	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.660	940,620.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,049,000	3.270	6,700,230.000	
FAR EAST HORIZON LTD	166,000	6.780	1,125,480.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	181,000	16.140	2,921,340.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	257,200	13.880	3,569,936.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	585,000	3.080	1,801,800.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	24.000	804,000.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	94,500	6.330	598,185.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	253,000	7.280	1,841,840.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	2.900	936,700.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	745,000	2.770	2,063,650.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	113,000	13.820	1,561,660.000	

	CHINA VANKE CO LTD-H	112,561	18.420	2,073,373.620	
	CGN POWER CO LTD	892,000	2.170	1,935,640.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	575,000	3.410	1,960,750.000	
	GF SECURITIES CO LTD	118,200	16.560	1,957,392.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	40,400	23.700	957,480.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	122,200	15.300	1,869,660.000	
	3SBIO INC	90,000	7.760	698,400.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	430,000	2.820	1,212,600.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	1,840,000	0.385	708,400.000	
香港・ドル　小計		63,474,439		550,562,267.430 (8,230,905,898)	
台湾・ドル	ACER INC	235,532	13.300	3,132,575.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	58,554	270.500	15,838,857.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	37,616	101.500	3,818,024.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	528,729	34.400	18,188,277.600	
	ASIA CEMENT CORP	197,928	26.200	5,185,713.600	
	TAIWAN BUSINESS BANK	326,380	8.160	2,663,260.800	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	58,000	40.450	2,346,100.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	56.300	4,391,400.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,000	76.700	4,371,900.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,312	73.600	3,408,563.200	
	QUANTA COMPUTER INC	224,858	61.500	13,828,767.000	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	63,070	45.900	2,894,913.000	
	EVA AIRWAYS CORP	153,555	14.850	2,280,291.750	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	53,760	223.000	11,988,480.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	411,196	17.150	7,052,011.400	
	CHINA AIRLINES	232,156	9.380	2,177,623.280	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	162,169	62.300	10,103,128.700	
	CHINA STEEL CORP	977,058	24.550	23,986,773.900	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	292,162	31.750	9,276,143.500	
	ADVANTECH CO LTD	26,264	257.000	6,749,848.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	354,304	18.700	6,625,484.800	
	DELTA ELECTRONICS INC	161,663	160.500	25,946,911.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	57,000	47.750	2,721,750.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	316,327	102.000	32,265,354.000	
	AU OPTRONICS CORP	731,194	12.800	9,359,283.200	

TAIWAN MOBILE CO LTD	140,800	105.500	14,854,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	12.000	1,924,704.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	268,824	24.650	6,626,511.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	130.000	3,877,250.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,022	330.000	4,957,260.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,285	110.000	5,201,350.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	342,633	89.500	30,665,653.500	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	70,000	30.100	2,107,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	267,594	95.600	25,581,986.400	
TRANSCEND INFORMATION INC	12,897	86.700	1,118,169.900	
GIANT MANUFACTURING	23,151	196.000	4,537,596.000	
MEDIATEK INC	124,507	214.500	26,706,751.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	557,936	52.000	29,012,672.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	621,632	16.450	10,225,846.400	
HOTAI MOTOR CO LTD	21,000	366.000	7,686,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	134,000	73.100	9,795,400.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	833,141	12.050	10,039,349.050	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	679,920	49.200	33,452,064.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,129,403	8.020	9,057,812.060	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	665,240	18.250	12,140,630.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,294,532	84.000	108,740,688.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	906,495	23.600	21,393,282.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	4,135.000	33,989,700.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	733,748	11.750	8,621,539.000	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	694,724	7.850	5,453,583.400	
INVENTEC CO LTD	207,005	23.450	4,854,267.250	
HTC CORPORATION	56,832	78.600	4,466,995.200	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	178,845	48.700	8,709,751.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	857,332	9.090	7,793,147.880	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,466,048	18.000	26,388,864.000	

	FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	820,282	17.400	14,272,906.800	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	16,950	163.500	2,771,325.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	55,560	85.600	4,755,936.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	392,828	73.100	28,715,726.800	
	WISTRON CORP	209,110	24.850	5,196,383.500	
	POU CHEN CORP	188,990	39.800	7,521,802.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	406,297	53.700	21,818,148.900	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,392	228.500	10,829,072.000	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	93,480	108.500	10,142,580.000	
	PHISON ELECTRONICS CORP	13,658	246.500	3,366,697.000	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	37.600	2,840,567.200	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	45,715	57.800	2,642,327.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	76,588	85.500	6,548,274.000	
	SILICONWARE PRECISION INDS	184,743	47.500	8,775,292.500	
	STANDARD FOODS CORP	35,653	75.300	2,684,670.900	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	114,899	32.250	3,705,492.750	
	TAIWAN CEMENT CORP	278,874	34.950	9,746,646.300	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	156,000	27.850	4,344,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,061,083	184.000	379,239,272.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,003,525	11.650	11,691,066.250	
	YULON MOTOR CO	65,149	26.900	1,752,508.100	
	INNOLUX CORPORATION	750,345	12.800	9,604,416.000	
	WPG HOLDINGS CO LTD	122,526	37.750	4,625,356.500	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	17,216	153.000	2,634,048.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	165.000	2,145,000.000	
	PEGATRON CORP	161,554	78.800	12,730,455.200	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	90,076	55.400	4,990,210.400	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.300	1,936,400.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	64.500	2,217,832.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	643,523	14.200	9,138,026.600	
	OBI PHARMA INC	9,000	294.500	2,650,500.000	
	CASETEK HOLDINGS LTD	12,000	86.500	1,038,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	12,000	294.500	3,534,000.000	
台湾・ドル　小計		26,785,718		1,311,187,200.670 (4,759,609,539)	

南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	BIDVEST GROUP LTD	26,558	175.000	4,647,650.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	36,673	75.600	2,772,478.800	
	DISCOVERY LTD	29,704	115.930	3,443,584.720	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	380,354	11.300	4,298,000.200	
	MASSMART HOLDINGS LTD	7,992	122.000	975,024.000	
	GOLD FIELDS LTD	78,154	45.700	3,571,637.800	
	REMGRO LTD	44,102	225.710	9,954,262.420	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	153.680	2,658,817.680	
	MMI HOLDINGS LTD	82,706	24.490	2,025,469.940	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	174,607	26.280	4,588,671.960	
	EXXARO RESOURCES LTD	12,410	90.600	1,124,346.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	700.000	2,228,800.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	8,524	114.450	975,571.800	
	MTN GROUP LTD	138,399	133.900	18,531,626.100	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,536	159.750	5,836,626.000	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	75.100	1,519,047.700	
	FIRSTRAND LTD	280,495	53.360	14,967,213.200	
	PSG GROUP LTD	8,154	221.760	1,808,231.040	
	NASPERS LTD	36,630	2,160.530	79,140,213.900	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	19,000	67.400	1,280,600.000	
	NEDBANK GROUP LTD	16,321	239.370	3,906,757.770	
	NETCARE LTD	77,025	32.100	2,472,502.500	
	PICK'N PAY STORES LTD	30,212	65.500	1,978,886.000	
	RMB HOLDINGS LTD	59,473	67.500	4,014,427.500	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	292.520	1,536,022.520	
	SAPPI LTD	45,540	88.100	4,012,074.000	
	SASOL LTD	46,142	404.110	18,646,443.620	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	35,731	168.140	6,007,810.340	
	MR PRICE GROUP LTD	20,254	152.050	3,079,620.700	
	BRAIT SE	28,931	79.350	2,295,674.850	
	STANDARD BANK GROUP LTD	107,593	150.640	16,207,809.520	
	SPAR GROUP LTD/THE	16,006	196.120	3,139,096.720	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	82,538	66.200	5,464,015.600	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,278	183.150	2,431,865.700	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,426	276.500	8,412,789.000	
	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	35,478	167.320	5,936,178.960	
	TIGER BRANDS LTD	13,642	399.000	5,443,158.000	
	SANLAM LTD	116,489	65.700	7,653,327.300	
	INVESTEC LTD	21,436	90.750	1,945,317.000	

	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	57,577	47.520	2,736,059.040	
	PIONEER FOODS LTD	10,707	155.600	1,666,009.200	
	NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	20,406	159.000	3,244,554.000	
	MONDI LTD	9,944	275.450	2,739,074.800	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	79,370	33.170	2,632,702.900	
	RMI HOLDINGS	52,887	39.790	2,104,373.730	
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	32,270	26.920	868,708.400	
	VODACOM GROUP PTY LTD	30,522	152.550	4,656,131.100	
	SIBANYE GOLD LTD	72,004	27.080	1,949,868.320	
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	17.290	1,364,993.630	
	FORTRESS INCOME FUND LTD	65,113	33.100	2,155,240.300	
	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	248,033	67.650	16,779,432.450	
	BID CORP LTD	27,891	239.390	6,676,826.490	
南アフリカ・ランド　小計		3,141,683		320,540,511.380 (2,705,361,915)	
合計		184,493,542		38,892,263,440 (38,892,263,440)	

（２）株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,171,911.000	19,817,015.010	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	153,100.000	24,835,882.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,325,011.000	44,652,897.010 (237,553,412)	
投資信託受益証券　合計			1,325,011	237,553,412 (237,553,412)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	483,319.980	
	トルコ・リラ　小計		162,734.000	483,319.980 (14,712,260)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	216,100.000	6,247,451.000	
	メキシコ・ペソ　小計		216,100.000	6,247,451.000 (33,236,439)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,836.000	2,521,364.360	
		RESILIENT REIT LTD	24,659.000	2,860,690.590	
	南アフリカ・ランド　小計		45,495.000	5,382,054.950 (45,424,544)	
投資証券　合計			424,329	93,373,243 (93,373,243)	
合計				330,926,655 (330,926,655)	

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	10.60%	-%	-%	11.16%
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式	9銘柄	0.76%	-%	-%	0.80%
インド・ルピー	株式	76銘柄	7.84%	-%	-%	8.25%
インドネシア・ルピア	株式	31銘柄	2.47%	-%	-%	2.61%
カタール・リアル	株式	13銘柄	0.85%	-%	-%	0.89%
コロンビア・ペソ	株式	9銘柄	0.43%	-%	-%	0.45%
タイ・バーツ	株式	37銘柄	2.21%	-%	-%	2.33%
チェコ・コルナ	株式	4銘柄	0.17%	-%	-%	0.18%
チリ・ペソ	株式	19銘柄	1.12%	-%	-%	1.17%
トルコ・リラ	株式	23銘柄	0.84%	-%	-%	0.93%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.04%	
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.31%	-%	-%	0.32%
フィリピン・ペソ	株式	23銘柄	1.21%	-%	-%	1.27%
ブラジル・レアル	株式	58銘柄	7.48%	-%	-%	7.87%
ポーランド・ズロチ	株式	22銘柄	1.12%	-%	-%	1.18%
マレーシア・リンギット	株式	43銘柄	2.37%	-%	-%	2.50%
メキシコ・ペソ	株式	24銘柄	2.48%	-%	-%	3.30%
	投資信託受益証券	2銘柄	-%	0.58%	-%	
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.08%	
ユーロ	株式	9銘柄	0.21%	-%	-%	0.22%
韓国・ウォン	株式	108銘柄	13.70%	-%	-%	14.43%
香港・ドル	株式	136銘柄	19.93%	-%	-%	20.98%
台湾・ドル	株式	88銘柄	11.52%	-%	-%	12.13%
南アフリカ・ランド	株式	53銘柄	6.55%	-%	-%	7.01%
	投資証券	2銘柄	-%	-%	0.11%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,340,658,664	1,392,947,346
コール・ローン		2,447,769,702	40,367,352
国債証券		50,188,470,405	59,705,345,865
派生商品評価勘定		―	15,050
未収入金		―	799,207,916
未収利息		675,837,437	889,379,035
前払費用		134,809,696	212,084,575
流動資産合計		54,787,545,904	63,039,347,139
資産合計		54,787,545,904	63,039,347,139
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,589,660	―
未払金		3,088,785,435	449,924,800
未払解約金		6,374,000	8,724,000
流動負債合計		3,098,749,095	458,648,800
負債合計		3,098,749,095	458,648,800
純資産の部			
元本等			
元本	※１	30,853,888,560	34,034,697,085
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		20,834,908,249	28,546,001,254
元本等合計		51,688,796,809	62,580,698,339
純資産合計		51,688,796,809	62,580,698,339
負債純資産合計		54,787,545,904	63,039,347,139

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 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。
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	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目			平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．	※１	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,117,451,125円	30,853,888,560円
		同期中追加設定元本額	15,576,655,407円	14,679,295,389円
		同期中一部解約元本額	16,840,217,972円	11,498,486,864円
		元本の内訳		
	ファンド名			
		ＤＩＡＭ新興国債券インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	94,766,105円	107,754,586円
		マネックス資産設計ファンドエボリューション	66,007,340円	62,904,586円
		ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	16,757,240円	21,415,594円
		ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	46,563,531円	56,453,241円
		ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	101,573,970円	127,202,886円
		投資のソムリエ	2,864,387,945円	2,270,942,339円
		クルーズコントロール	187,812,398円	1,232,756,282円
		投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	66,121,012円	67,005,956円
		ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	58,760,088円	68,279,113円
		クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	50,590円	484,717円
		ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,431,372円	9,088,948円

ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	2,489,686円	20,186,811円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	12,547,457円	5,239,965円
ダイナミック・ナビゲーション	352,463円	161,183円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	－円	113,191円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	3,120,641,050円	6,452,299,432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）	503,111,358円	－円
エマージング債券パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	3,663,571,532円	3,492,792,856円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,223,044,392円	7,824,353,289円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,179,610,606円	4,959,932,756円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,037,431,770円	2,913,975,455円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドＩＩ（適格機関投資家限定）	3,606,856,655円	4,341,353,899円
計	30,853,888,560円	34,034,697,085円
２．　受益権の総数	30,853,888,560口	34,034,697,085口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年1月13日 至　平成28年7月11日	自　平成28年7月12日 至　平成29年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	平成29年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,609,994,841	△2,083,575,977
合計	1,609,994,841	△2,083,575,977

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年4月19日から平成28年7月11日まで及び平成28年4月19日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年7月11日 現在				平成29年1月11日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	－	－	－	－	498,600,050	－	498,585,000	15,050
アメリカ・ドル	－	－	－	－	498,600,050	－	498,585,000	15,050
買　建	3,098,149,660	－	3,094,560,000	△3,589,660	－	－	－	－
アメリカ・ドル	3,098,149,660	－	3,094,560,000	△3,589,660	－	－	－	－
合計	3,098,149,660	－	3,094,560,000	△3,589,660	498,600,050	－	498,585,000	15,050

（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。

①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。

②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28年7月11日現在	平成29年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6753円 (16,753円)	1.8387円 (18,387円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	5,000,000.000	4,505,000.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	9,100,000.000	8,688,225.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	4,400,000.000	4,583,480.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	6,600,000.000	5,610,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	4,700,000.000	4,371,000.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	6,100,000.000	6,551,400.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	2,800,000.000	2,971,500.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	4,300,000.000	4,730,000.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	2,800,000.000	3,367,280.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	1,200,000.000	1,494,600.000	
		BRAZIL 8.875 04/15/24	1,600,000.000	1,966,400.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	1,200,000.000	1,398,000.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,700,000.000	1,617,550.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	4,300,000.000	4,392,450.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	4,000,000.000	4,216,000.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	2,600,000.000	2,725,450.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	5,200,000.000	5,158,400.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	5,200,000.000	5,564,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	4,800,000.000	5,364,000.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	5,100,000.000	5,674,209.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	3,400,000.000	4,241,500.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,100,000.000	2,638,650.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	2,600,000.000	2,806,362.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	3,000,000.000	3,327,810.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	2,700,000.000	2,972,565.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	2,800,000.000	3,078,824.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	3,600,000.000	3,936,996.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	1,200,000.000	1,247,712.000	
		HUNGARY 4.125 02/19/18	2,300,000.000	2,359,156.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	3,900,000.000	4,310,904.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	3,200,000.000	3,566,624.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	3,200,000.000	3,627,136.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	3,500,000.000	3,860,640.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	5,800,000.000	6,566,470.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	2,200,000.000	3,185,248.000	
		INDONESIA 11.625 03/04/19	3,200,000.000	3,832,704.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	2,300,000.000	2,267,731.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	2,200,000.000	2,234,848.000	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	3,200,000.000	3,248,896.000	

INDONESIA 4.625 04/15/43	2,200,000.000	2,209,174.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	4,000,000.000	4,208,760.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	5,100,000.000	5,436,549.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	3,400,000.000	3,504,278.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	3,700,000.000	3,847,223.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,700,000.000	1,861,347.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	2,800,000.000	3,141,684.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,100,000.000	2,304,666.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	2,000,000.000	2,281,460.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	3,500,000.000	4,351,340.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,100,000.000	4,126,441.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	3,000,000.000	3,033,750.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	2,400,000.000	2,408,400.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	5,000,000.000	5,393,750.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	5,600,000.000	6,907,040.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	2,600,000.000	3,269,500.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	2,300,000.000	3,312,000.000	
PERU 5.625 11/18/50	6,400,000.000	7,473,920.000	
PERU 6.55 03/14/37	3,200,000.000	4,073,280.000	
PERU 7.35 07/21/25	4,800,000.000	6,158,400.000	
PERU 8.75 11/21/33	5,500,000.000	8,207,100.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	3,200,000.000	3,208,000.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	3,600,000.000	3,720,384.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	3,200,000.000	3,436,800.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	1,800,000.000	1,965,402.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	2,400,000.000	2,830,272.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	2,000,000.000	2,415,640.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,000,000.000	2,648,580.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,600,000.000	4,867,776.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	911,504.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	3,500,000.000	5,108,495.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	2,300,000.000	2,675,590.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	3,400,000.000	5,508,884.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	2,500,000.000	2,912,400.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	2,400,000.000	2,507,088.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,200,000.000	2,368,146.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	2,000,000.000	2,460,240.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	5,300,000.000	6,109,416.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	4,800,000.000	5,121,888.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	20,062,500.000	24,147,826.870	

RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	7,400,000.000	8,436,074.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	5,200,000.000	5,297,656.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	3,400,000.000	3,562,996.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	4,800,000.000	4,970,400.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	6,000,000.000	6,396,480.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	5,400,000.000	5,963,166.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	2,400,000.000	2,742,480.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	2,800,000.000	2,842,112.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	1,600,000.000	1,621,600.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	2,600,000.000	2,772,848.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,200,000.000	1,317,720.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	3,400,000.000	3,700,322.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	1,100,000.000	1,237,808.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	3,500,000.000	3,810,275.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	2,700,000.000	4,022,190.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	3,500,000.000	3,095,470.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	3,200,000.000	2,831,232.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	5,300,000.000	4,224,842.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	4,600,000.000	4,236,922.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	2,700,000.000	2,663,847.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	3,300,000.000	3,375,933.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	3,900,000.000	3,910,218.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	4,300,000.000	3,963,783.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,400,000.000	2,486,184.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	5,300,000.000	5,237,672.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	5,600,000.000	5,831,000.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	3,700,000.000	3,714,171.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	5,000,000.000	5,073,000.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	2,500,000.000	2,653,850.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	4,500,000.000	4,837,320.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,400,000.000	1,484,042.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	5,100,000.000	5,482,500.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	1,800,000.000	1,955,700.000	
TURKEY 8.0 02/14/34	2,100,000.000	2,384,550.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	600,000.000	609,600.000	

		UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	4,600,000.000	4,425,200.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	5,300,000.000	5,313,250.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	6,700,000.000	6,706,700.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	5,600,000.000	5,552,400.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	6,000,000.000	5,389,980.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	8,200,000.000	7,482,500.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	2,800,000.000	3,011,400.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	4,600,000.000	4,686,250.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	5,000,000.000	4,662,500.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	5,600,000.000	6,046,600.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,900,000.000	6,364,625.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	3,600,000.000	4,274,280.000	
		UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	1,200,000.000	1,523,040.000	
	アメリカ・ドル　小計		473,962,500.000 (54,960,691,500)	514,878,801.870 (59,705,345,865)	
国債証券　合計			54,960,691,500 (54,960,691,500)	59,705,345,865 (59,705,345,865)	
合計			54,960,691,500 (54,960,691,500)	59,705,345,865 (59,705,345,865)	

（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　127銘柄	95.41%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成29年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	10,785,909円
Ⅱ　負債総額	6,913円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,778,996円
Ⅳ　発行済数量	10,556,003口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0211円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成29年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	290,101,746,607円
Ⅱ　負債総額	875,696,700円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	289,226,049,907円
Ⅳ　発行済数量	128,494,819,275口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2509円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	387,240,066,980円
Ⅱ　負債総額	5,124,822,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	382,115,244,980円
Ⅳ　発行済数量	299,427,425,319口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2762円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	271,145,311,063円
Ⅱ　負債総額	306,969,299円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	270,838,341,764円
Ⅳ　発行済数量	91,962,554,107口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9451円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	251,427,736,366円
Ⅱ　負債総額	117,029,087円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	251,310,707,279円
Ⅳ　発行済数量	144,380,428,662口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7406円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	41,308,313,066円
Ⅱ　負債総額	134,458,209円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	41,173,854,857円
Ⅳ　発行済数量	41,452,811,163口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9933円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	77,550,992,499円
Ⅱ　負債総額	8,523,880,281円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	69,027,112,218円
Ⅳ　発行済数量	38,258,854,634口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8042円

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報　第1　委託会社等の概況　1　委託会社等の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

＜更新・訂正後＞

（1）資本金の額（平成29年1月31日現在）

資本金の額	20億円
発行する株式総数※	100,000株 （普通株式 上限100,000株、Ａ種種類株式 上限30,000株）
発行済株式総数	40,000株 （普通株式24,490株、Ａ種種類株式15,510株）

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（2）会社の機構（平成29年1月31日現在）

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

②　投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

２【事業の内容及び営業の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報　第1　委託会社等の概況　2　事業の内容及び営業の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

＜更新・訂正後＞

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

平成29年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,153,760,242,911
追加型株式投資信託	868	11,607,919,733,086
単位型公社債投資信託	56	309,058,467,566
単位型株式投資信託	103	730,271,926,332
合計	1,065	13,801,010,369,895

３【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報　第1　委託会社等の概況　3　委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

＜更新・訂正後＞

１．委託会社であるＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「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31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

※ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更いたしました。
　委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）		第31期 （平成28年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		12,051,921		12,951,736
金銭の信託		14,169,657		13,094,914
前払費用		57,309		44,951
未収委託者報酬		4,622,292		4,460,404
未収運用受託報酬		1,737,052		1,859,778
未収投資助言報酬	※2	312,206	※2	277,603
未収収益		260,845		205,097
繰延税金資産		411,797		341,078
その他		46,782		40,689
流動資産計		33,669,865		33,276,255
固定資産				
有形固定資産		432,933		658,607
建物	※1	138,967	※1	29,219
車両運搬具	※1	941	※1	549
器具備品	※1	243,908	※1	184,683
建設仮勘定		49,116		444,155
無形固定資産		1,912,472		1,706,201
商標権	※1	101	※1	7
ソフトウエア	※1	1,702,633	※1	1,645,861
ソフトウエア仮勘定		202,399		53,036
電話加入権		7,148		7,148
電信電話専用施設利用権	※1	188	※1	146
投資その他の資産		4,343,365		6,497,772
投資有価証券		613,137		458,701
関係会社株式		2,316,596		3,229,196
繰延税金資産		582,861		679,092
差入保証金		733,907		2,040,945
その他		96,862		89,835
固定資産計		6,688,771		8,862,580
資産合計		40,358,637		42,138,836

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第31期　（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）
「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日） （1）概要 本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。 （2）適用予定日 平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。 （3）当該会計基準等の適用による影響 当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

会計上の見積りの変更

第31期　（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）
当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。 また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。 これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

追加情報

第31期　（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）
当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。 1. 商号　　：アセットマネジメントOne 株式会社 2. 代表者　　：西 惠正（現 ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長） 3. 本店所在地　：東京都千代田区丸の内1‐8‐2 4. 統合日　　：平成28年10月1日

注記事項

（貸借対照表関係）

※1．固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

※2．関係会社項目

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

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1．固定資産除却損の内訳

（千円）

	第30期 （自　平成26年4月　1日 至　平成27年3月31日）	第31期 （自　平成27年4月　1日 至　平成28年3月31日）
器具備品	0	182
ソフトウエア	12,988	442

※2．固定資産売却損の内訳

（千円）

	第30期 （自　平成26年4月　1日 至　平成27年3月31日）	第31期 （自　平成27年4月　1日 至　平成28年3月31日）
器具備品	―	2,653

（株主資本等変動計算書関係）

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引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

①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。

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）投資有価証券

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

負　債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
①非上場株式	80,246	77,696
②関係会社株式	2,316,596	3,229,196
③差入保証金	733,907	2,040,945

①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。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。
前事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

③差入保証金は、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

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

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券
該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。

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

4．その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	516,710	146,101	370,608
②債券	—	—	—
③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			
①株式	—	—	—
②債券	—	—	—
③その他（投資信託）	—	—	—
小計	—	—	—
合計	532,891	159,101	373,789

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	365,683	146,101	219,581
②債券	—	—	—
③その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	—	—	—
②債券	—	—	—
③その他（投資信託）	—	—	—
小計	—	—	—
合計	381,005	159,101	221,903

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）
1. 運用目的の金銭の信託
第30期 （平成27年3月31日現在）

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

第31期 （平成28年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	第31期 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
会計方針の変更による累積的影響額	△203,600	―
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	△49,633	△ 51,531
過去勤務費用の発生額	―	―
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	第31期 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	△89,550	△ 79,449
未認識過去勤務費用	△14,556	△ 9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	第31期 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。
この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

（資産除去債務関係）
当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。
なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）
1．セグメント情報

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

2．関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報
①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。

②有形固定資産
当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

（１）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名,出向3名,転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	862,448	未収投資助言報酬	237,575

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等
（注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
（注2）上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。
（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	2,217,439	未払手数料	306,365
								預金の預入（純額）	551,351	現金・預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収収益	71
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	－	兼務1名	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払	407,531	未払費用	240,725
								業務委託料の支払	8,540	未払金	6,501
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	－	－	当社信託財産の運用	信託元本の追加（純額）	3,500,000	金銭の信託	14,169,657
								信託報酬の支払	8,254		

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	兼務1名	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	3,023,040	未払手数料	372,837
								預金の預入（純額）	879,733	現金・預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収収益	123
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	―	兼務1名	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払	557,013	未払費用	292,861
								業務委託料の支払	8,540	未払金	7,581
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	―	―	当社信託財産の運用	信託元本の払戻（純額）	700,000	金銭の信託	13,094,914
								信託報酬の支払	8,336		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

（注4）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注5）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第32期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		11,605,537
金銭の信託		11,792,364
前払費用		122,161
未収委託者報酬		4,755,701
未収運用受託報酬		2,465,934
未収投資助言報酬		261,221
未収収益		181,959
繰延税金資産		329,236
その他		122,804
流動資産計		31,636,922
固定資産		
有形固定資産		1,541,889
建物	※1	6,517
器具備品	※1	152,176
建設仮勘定		1,383,196
無形固定資産		1,613,174
ソフトウエア		1,421,245
ソフトウエア仮勘定		184,656
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権		124
投資その他の資産		6,281,765
投資有価証券		441,519
関係会社株式		3,229,196
繰延税金資産		713,716
差入保証金		1,808,323
その他		89,010
固定資産計		9,436,830
資産合計		41,073,753

（単位：千円）

	第32期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	1,080,224
未払金	2,651,649
未払償還金	49,873
未払手数料	1,865,871
その他未払金	735,905
未払費用	2,673,720
未払法人税等	907,554
未払消費税等	69,484
賞与引当金	724,711
訴訟損失引当金	30,000
その他	21,000
流動負債計	8,158,344
固定負債	
退職給付引当金	1,027,049
固定負債計	1,027,049
負債合計	9,185,394
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	27,317,845
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	24,580,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,114,551
株主資本計	31,746,323
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	142,035
評価・換算差額等計	142,035
純資産合計	31,888,358
負債・純資産合計	41,073,753

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日至平成28年9月30日）	
営業収益		
委託者報酬	14,454,974	
運用受託報酬	3,732,759	
投資助言報酬	456,986	
その他営業収益	323,793	
営業収益計		18,968,513
営業費用		
支払手数料	6,111,449	
広告宣伝費	108,789	
公告費	428	
調査費	3,764,163	
調査費	2,639,714	
委託調査費	1,124,449	
委託計算費	216,712	
営業雑経費	278,529	
通信費	17,844	
印刷費	212,004	
協会費	11,277	
諸会費	18	
支払販売手数料	37,384	
営業費用計		10,480,072
一般管理費		
給料	2,330,263	
役員報酬	124,419	
給料・手当	2,205,843	
交際費	16,973	
寄付金	13,268	
旅費交通費	100,973	
租税公課	148,041	
不動産賃借料	1,329,821	
退職給付費用	121,590	
固定資産減価償却費	※1 353,322	
福利厚生費	11,020	
修繕費	10,082	
賞与引当金繰入額	724,711	
役員退職慰労金	63,072	
機器リース料	146	
事務委託費	182,857	
事務用消耗品費	37,442	
器具備品費	236,524	
諸経費	58,359	
一般管理費計		5,738,473
営業利益		2,749,968

（単位：千円）

	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日至平成28年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	7,882	
受取利息	341	
為替差益	32,301	
雑収入	4,836	
営業外収益計		45,361
営業外費用		
金銭の信託運用損	59,768	
営業外費用計		59,768
経常利益		2,735,561
特別損失		
固定資産除却損	2,820	
固定資産売却損	1,780	
訴訟損失引当金繰入額	30,000	
特別損失計		34,601
税引前中間純利益		2,700,960
法人税、住民税及び事業税		856,976
法人税等調整額		△17,520
法人税等合計		839,455
中間純利益		1,861,504

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
				別途積立金	研究開発積立金	運用責任準備積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818
当中間期変動額									
剰余金の配当							△2,544,000	△2,544,000	△2,544,000
別途積立金の積立				2,550,000			△2,550,000	—	—
中間純利益							1,861,504	1,861,504	1,861,504
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計	—	—	—	2,550,000	—	—	△3,232,495	△682,495	△682,495
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	24,580,000	300,000	200,000	2,114,551	27,317,845	31,746,323

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	
当期首残高	153,956	32,582,775
当中間期変動額		
剰余金の配当		△2,544,000
別途積立金の積立		—
中間純利益		1,861,504
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	△11,921	△11,921
当中間期変動額合計	△11,921	△694,416
当中間期末残高	142,035	31,888,358

重要な会計方針

項目	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
２．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
３．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
４．固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
５．引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる額を計上しております。
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
７．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号　平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。

追加情報

第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号　平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。 2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第32期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在）
※１．有形固定資産の減価償却累計額	建物　…　790,504千円 器具備品　…　596,199千円

（中間損益計算書関係）

項目	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
※１．減価償却実施額	有形固定資産　…　57,752千円 無形固定資産　…　295,570千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
（1）現金・預金	11,605,537	11,605,537	－
（2）金銭の信託	11,792,364	11,792,364	－
（3）投資有価証券			
その他有価証券	363,823	363,823	－
資産計	23,761,725	23,761,725	－
（1）未払法人税等	907,554	907,554	－
負債計	907,554	907,554	－

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）投資有価証券

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

負　債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 （千円）
①非上場株式	77,696
②関係会社株式	3,229,196
③差入保証金	1,808,323

①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。

②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。

③差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

（有価証券関係）

第32期中間会計期間末
（平成28年9月30日現在）

１．満期保有目的の債券
該当事項はありません。

２．子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額3,229,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

３．その他有価証券

区　分	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	349,644	146,101	203,542
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	14,179	13,000	1,179
小計	363,823	159,101	204,721
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	―	―	―
小計	―	―	―
合計	363,823	159,101	204,721

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

（金銭の信託関係）

第32期中間会計期間末
（平成28年9月30日現在）

１．満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

２．その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）
該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。
なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

１．セグメント情報

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

２．関連情報

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	14,454,974	4,189,745	323,793	18,968,513

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益 （千円）
第一生命グループ	1,928,739

（注）第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
1株当たり純資産額　1,328,681円　62銭 1株当たり中間純利益金額　77,562円　67銭 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
中間純利益	1,861,504千円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式に係る中間純利益	1,861,504千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第32期中間会計期間
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

１．結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

２．企業結合日
平成28年10月1日

３．企業結合の方法
①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

４．結合後企業の名称
アセットマネジメントOne株式会社

５．交付した株式数
「３．企業結合の方法」③の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種種類株式15,510株を交付しました。

６．企業結合の主な目的
当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合４社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、みずほフィナンシャルグループと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

７．取得企業を決定するに至った主な根拠
「３．企業結合の方法」③の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるみずほフィナンシャルグループが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

８．実施予定の会計処理
「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号　平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号　平成25年9月13日公表分）に基づき、「３．企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

（参考）みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況
※当該（参考）において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

１　当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第２条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

２　当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第53期事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。
また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第54期中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成２８年６月１０日

みずほ投信投資顧問株式会社

取　締　役　会　　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　江見　睦生　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　亀井　純子　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成２７年４月１日から平成２８年３月３１日までの第５３期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以　　上

(注)1.上記は、当社が監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成２８年１２月１３日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山野　浩　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成２８年４月１日から平成２９年３月３１日までの第５４期事業年度の中間会計期間（平成２８年４月１日から平成２８年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、みずほ投信投資顧問株式会社の平成２８年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成２８年４月１日から平成２８年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成２８年７月１３日付の「統合契約書」に基づき、平成２８年１０月１日にＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。

(1)貸借対照表

（単位：　千円）

	前事業年度 （平成27年３月31日）	当事業年度 （平成28年３月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	△ 1,092	△ 1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	124,850	100,000
工具、器具及び備品（純額）	71,443	90,655
リース資産（純額）	2,140	818
有形固定資産合計	※１ 198,434	※１ 191,474
無形固定資産		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
投資その他の資産		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	△ 19,534	△ 19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
負債の部		
流動負債		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
未払金		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033
未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
固定負債		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600

資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	4,716,474	4,716,474
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	17,872,927	19,042,177
自己株式	-	△377,863
株主資本合計	24,635,002	25,426,389
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	726,935	137,791
純資産合計	25,361,937	25,564,180
負債純資産合計	29,973,099	29,654,112

(2)損益計算書

（単位：　千円）

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405
営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767

営業外費用合計		85,321	9,688
経常利益		1,975,847	2,600,528
特別利益			
投資有価証券売却益		10,500	-
特別利益合計		10,500	-
特別損失			
減損損失	※1	51,292	-
事業再構築費用	※2	125,173	-
外国税負担損失	※3	53,547	-
貸倒引当金繰入		19,534	-
特別損失合計		249,548	-
税引前当期純利益		1,736,799	2,600,528
法人税、住民税及び事業税		616,760	839,827
法人税等調整額		16,247	40,166
法人税等合計		633,008	879,993
当期純利益		1,103,790	1,720,534

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

（単位：　千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本						
	利益剰余金						株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
		配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	6,988,395	17,121,579	23,883,654
当期変動額							
剰余金の配当					△352,443	△352,443	△352,443
当期純利益					1,103,790	1,103,790	1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計					751,347	751,347	751,347
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	24,635,002

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△41,248	△41,248	23,842,406
当期変動額			
剰余金の配当			△352,443
当期純利益			1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	768,183	768,183	768,183
当期変動額合計	768,183	768,183	1,519,530
当期末残高	726,935	726,935	25,361,937

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

（単位：　千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

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

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

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法
その他有価証券
時価のあるもの
決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。
時価のないもの
移動平均法による原価法を採用しております。

２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。

３．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産（リース資産を除く）
定率法（ただし、平成10年４月１日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。
（２）無形固定資産
定額法を採用しております。
（３）リース資産
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

４．引当金の計上基準
（１）貸倒引当金
当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
（２）賞与引当金
従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。
（３）退職給付引当金（前払年金費用）
従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日において発生していると認められる額を計上しております。
（４）役員退職慰労引当金
役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）
（５）時効後支払損引当金
時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

５．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

６．ヘッジ会計の方法
（１）ヘッジ会計の方法
時価ヘッジによっております。
（２）ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段…株価指数先物取引
ヘッジ対象…有価証券
（３）ヘッジ方針
当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。
（４）ヘッジの有効性評価の方法
ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

７．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

１．概要

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

２．適用予定日

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

３．当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

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

追加情報

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）
前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）
※１　減損損失
当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

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

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

※２　事業再構築費用
事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

※３　外国税負担損失
証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
該当するものはありません。

（株主資本等変動計算書関係）
前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）
１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

２．配当に関する事項
（１）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発効日
平成26年６月11日第51回定時株主総会	普通株式	352,443,450	335	平成26年３月31日	平成26年６月12日

（２）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額（円）	配当の原資	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発効日
平成27年６月11日第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	利益剰余金	524	平成27年３月31日	平成27年６月12日

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

２．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	-	13,662	-	13,662

（変動事由の概要）
平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得　13,662株

３．配当に関する事項
（１）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発効日
平成27年６月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	524	平成27年３月31日	平成27年６月12日

（２）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額（円）	配当の原資	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発効日
平成28年６月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年３月31日	平成28年６月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年３月31日	平成28年６月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

（リース取引関係）
１．ファイナンス・リース取引（借主側）
所有権移転外ファイナンス・リース取引
① リース資産の内容
有形固定資産
主として、事務用機器及び車両運搬具であります。
② リース資産の減価償却の方法
重要な会計方針「３．固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

（金融商品関係）
１．金融商品の状況に関する事項
（１）金融商品に対する取組方針
当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。
デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。
（２）金融商品の内容及びそのリスク
営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。
デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。
（３）金融商品に係るリスク管理体制
①信用リスクの管理
営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としています。
有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。
②市場リスクの管理
有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っています。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。
（４）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明
金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。（（注２）を参照ください。）

前事業年度（平成27年３月31日）　（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金及び預金	20,801,864	20,801,864	-
（２）未収委託者報酬	1,827,951	1,827,951	-
（３）未収運用受託報酬	1,812,198	1,812,198	-
（４）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	4,054,289	4,054,289	-
資産計	28,496,304	28,496,304	-
（１）未払手数料	819,341	819,341	-
負債計	819,341	819,341	-
デリバティブ取引（※１）			
①　ヘッジ会計が適用されていないもの	(3,601)	(3,601)	-
②　ヘッジ会計が適用されているもの	327	327	-
デリバティブ取引計	(3,274)	(3,274)	-

（※１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（　）で示しております。

当事業年度（平成28年３月31日）　（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金及び預金	20,903,257	20,903,257	-
（２）未収委託者報酬	2,183,032	2,183,032	-
（３）未収運用受託報酬	1,713,643	1,713,643	-
（４）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,282,026	3,282,026	-
資産計	28,081,960	28,081,960	-
（１）未払手数料	838,064	838,064	-
負債計	838,064	838,064	-
デリバティブ取引（※１）			
①　ヘッジ会計が適用されていないもの	(220)	(220)	-
②　ヘッジ会計が適用されているもの	(1,564)	(1,564)	-
デリバティブ取引計	(1,784)	(1,784)	-

（※１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（　）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資　産

（１）現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（２）未収委託者報酬及び（３）未収運用受託報酬

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

（４）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負　債

（１）未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位:千円）

区分	前事業年度 （平成27年３月31日）	当事業年度 （平成28年３月31日）
非上場株式	60,720	60,720

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（４）有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

（注３）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年３月31日）　（単位:千円）

	１年以内	１年超 ２年以内	２年超 ３年以内	３年超 ４年以内	４年超 ５年以内	５年超
預金	20,800,853	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,827,951	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,812,198	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	127,840	-	-	-	-	3,300,657
合計	24,568,844	-	-	-	-	3,300,657

当事業年度（平成28年３月31日）　（単位:千円）

	１年以内	１年超 ２年以内	２年超 ３年以内	３年超 ４年以内	４年超 ５年以内	５年超
預金	20,902,546	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	2,183,032	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,713,643	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

(有価証券関係)

１　その他有価証券

前事業年度（平成27年３月31日）

種類	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの ①　証券投資信託	3,740,183	2,664,442	1,075,740
小計	3,740,183	2,664,442	1,075,740
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの ①　証券投資信託	314,105	316,720	△ 2,615
小計	314,105	316,720	△ 2,615
合計	4,054,289	2,981,163	1,073,125

当事業年度（平成28年３月31日）

種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの ①　証券投資信託	2,698,875	2,500,000	198,875
小計	2,698,875	2,500,000	198,875
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの ①　証券投資信託	583,151	583,423	△ 271
小計	583,151	583,423	△ 271
合計	3,282,026	3,083,423	198,603

２　当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものはありません。

３　当事業年度中に解約・償還したその他有価証券
前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額（千円）	解約・償還損の合計額（千円）
①　証券投資信託	102,729	953	△ 2,197
合計	102,729	953	△ 2,197

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額（千円）	解約・償還損の合計額（千円）
①　証券投資信託	738,178	106,977	△ 2,920
合計	738,178	106,977	△ 2,920

（デリバティブ取引関係）
１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連
前事業年度（平成27年３月31日）

区分	取引の種類	契約額等（千円）	契約額のうち１年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引	株価指数先物取引 売建	197,054	-	△3,601	△3,601
合計		197,054	-	△3,601	△3,601

当事業年度（平成28年３月31日）

区分	取引の種類	契約額等（千円）	契約額のうち１年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引	株価指数先物取引 売建	148,005	-	△220	△220
合計		148,005	-	△220	△220

（注）時価の算定方法
取引所の価格に基づき算定しております。

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
株式関連
前事業年度（平成27年３月31日）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額のうち１年超（千円）	時価（千円）
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引 売建 買建	 投資有価証券 投資有価証券	 131,145 277,953	 - -	 △3,325 3,652
合計			409,098	-	327

（注）時価の算定方法
取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度（平成28年３月31日）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額のうち１年超（千円）	時価（千円）
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引 売建 買建	 投資有価証券 投資有価証券	 117,467 179,836	 - -	 147 △1,711
合計			297,303	-	△1,564

（注）時価の算定方法
取引所の価格に基づき算定しております。

（退職給付関係）
１．採用している退職給付制度の概要
当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。
当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

２．確定給付制度
（１）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）	当事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
退職給付引当金の期首残高	△357,258千円	△331,766千円
退職給付費用	150,018	51,208
退職給付の支払額	△21,349	-
制度への拠出額	△103,177	△66,102
退職給付引当金の期末残高	△331,766	△346,659

（２）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	前事業年度 (平成27年３月31日)	当事業年度 (平成28年３月31日)
積立型制度の退職給付債務	669,318千円	727,842千円
年金資産	△1,001,084	△1,074,502
貸借対照表に計上された前払年金費用	△331,766	△346,659

（３）退職給付費用
簡便法で計算した退職給付費用　前事業年度58,362千円　当事業年度51,208千円

３．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

(税効果会計関係)
１　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成27年３月31日）	当事業年度 （平成28年３月31日）
繰延税金資産		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円
ソフトウェア償却超過額	69,263	52,651
賞与引当金損金算入限度超過額	108,734	98,134
社会保険料損金不算入額	15,665	14,233
役員退職慰労引当金	34,461	45,488
未払事業税	30,421	39,817
その他	93,137	58,782
繰延税金資産小計	356,479	313,659
評価性引当額	△24,103	△22,331
繰延税金資産合計	332,375	291,328
繰延税金負債		
前払年金費用	△107,027	△106,147
その他有価証券評価差額金	△346,190	△60,812
繰延税金負債合計	△453,218	△166,959
繰延税金資産の純額	△120,843	124,368

２　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

３　法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正
「所得税法等の一部を改正する法律」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年３月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年４月１日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年４月１日から平成30年３月31日までのものは30.86%、平成30年４月１日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。
その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

（資産除去債務関係）
当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。
なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）
［セグメント情報］
前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）及び当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

［関連情報］

前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

１．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（１）売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90％を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10％以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家Ａ	2,629,803	資産運用業

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

１．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（１）売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90％を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10％以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家Ａ	3,061,207	資産運用業

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

該当するものはありません。

(関連当事者情報)

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,833,692	未払手数料	361,219
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	13,851,610	未収委託者報酬	1,661,682

当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,542,264	未払手数料	336,556
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	14,108,529	未収委託者報酬	2,053,638

（注）１．上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）	当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
１株当たり純資産額	24,106.70円	24,618.62円
１株当たり当期純利益金額	1,049.16円	1,639.16円

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

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）	当事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
１株当たり当期純利益金額		
当期純利益（千円）	1,103,790	1,720,534
普通株式に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益（千円）	1,103,790	1,720,534
期中平均株式数（株）	1,052,070	1,049,643

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

（単位：　千円）

		第54期中間会計期間 (平成28年９月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		4,120,018
未収委託者報酬		2,064,997
未収運用受託報酬		1,959,028
繰延税金資産		140,728
その他		398,383
貸倒引当金		△1,207
流動資産合計		8,681,950
固定資産		
有形固定資産		
工具、器具及び備品（純額）		62,971
有形固定資産合計	※1	62,971
無形固定資産		12,767
投資その他の資産		
投資有価証券		815,525
繰延税金資産		73,719
その他		638,830
貸倒引当金		△19,404
投資その他の資産合計		1,508,671
固定資産合計		1,584,410
資産合計		10,266,360
負債の部		
流動負債		
未払金		793,859
未払費用		1,675,771
未払法人税等		253,697
賞与引当金		319,200
その他		221,869
流動負債合計		3,264,398
固定負債		
役員退職慰労引当金		57,860
時効後支払損引当金		7,256
固定負債合計		65,116
負債合計		3,329,515
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,045,600
資本剰余金		
資本準備金		2,266,400
その他資本剰余金		1,103,259
資本剰余金合計		3,369,659
利益剰余金		
利益準備金		128,584
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,777,567
利益剰余金合計		1,906,152
自己株式		△377,863
株主資本合計		6,943,548
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△6,703
評価・換算差額等合計		△6,703
純資産合計		6,936,845
負債純資産合計		10,266,360

(2) 中間損益計算書

（単位：　千円）

		第54期中間会計期間 (自 平成28年４月１日 至 平成28年９月30日)
営業収益		
委託者報酬		7,935,613
運用受託報酬		2,105,866
営業収益合計		10,041,479
営業費用及び一般管理費	※1	9,415,997
営業利益		625,482
営業外収益		
受取配当金		19,694
受取利息		439
有価証券解約益		76,483
有価証券償還益		3,474
時効到来償還金等		727
雑収入		17,708
営業外収益合計		118,528
営業外費用		
有価証券解約損		96
有価証券償還損		12
雑損失		6,303
営業外費用合計		6,412
経常利益		737,598
特別利益		700
特別損失		11,641
税引前中間純利益		726,657
法人税、住民税及び事業税		236,054
法人税等調整額		△26,308
法人税等合計		209,746
中間純利益		516,910

(3)　中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日)

（単位：　　千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当中間期変動額				
積立金取崩				
剰余金の配当			△1,346,815	△1,346,815
中間純利益				
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）				
当中間期変動額合計			△1,346,815	△1,346,815
当中間期末残高	2,045,600	2,266,400	1,103,259	3,369,659

	株主資本					
	利益剰余金					
	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計
		配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177
当中間期変動額						
積立金取崩		△104,600	△100,000	△9,800,000	10,004,600	-
剰余金の配当					△17,652,936	△17,652,936
中間純利益					516,910	516,910
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計		△104,600	△100,000	△9,800,000	△7,131,425	△17,136,025
当中間期末残高	128,584	-	-	-	1,777,567	1,906,152

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△377,863	25,426,389	137,791	137,791	25,564,180
当中間期変動額					
積立金取崩		-			-
剰余金の配当		△18,999,751			△18,999,751
中間純利益		516,910			516,910
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			△144,494	△144,494	△144,494
当中間期変動額合計		△18,482,840	△144,494	△144,494	△18,627,334
当中間期末残高	△377,863	6,943,548	△6,703	△6,703	6,936,845

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却方法

（１）有形固定資産

定率法を採用しております。

（２）無形固定資産

定額法を採用しております。

３．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

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

（２）賞与引当金

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

（３）退職給付引当金（前払年金費用）

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

（４）役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

（５）時効後支払損引当金

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

４．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

５．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号　平成28年３月28日）を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

	第54期中間会計期間 (平成28年９月30日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額	476,786千円

（中間損益計算書関係）

	第54期中間会計期間 （自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日）
※１　減価償却実施額	有形固定資産　114,327千円 無形固定資産　15千円

（中間株主資本等変動計算書関係）
第54期中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日）

１　発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

２．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	13,662	-	-	13,662

３　配当に関する事項
（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（円）	配当の原資	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発効日
平成28年６月10日第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年３月31日	平成28年６月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年３月31日	平成28年６月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

（金融商品関係）
第54期中間会計期間(平成28年９月30日)

金融商品の時価等に関する事項
中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。（（注２）を参照ください。）

（単位：　千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金及び預金	4,120,018	4,120,018	-
（２）未収委託者報酬	2,064,997	2,064,997	-
（３）未収運用受託報酬	1,959,028	1,959,028	-
（４）投資有価証券			
その他有価証券	754,805	754,805	-
資産計	8,898,851	8,898,851	-
（１）未払手数料	785,089	785,089	-
負債計	785,089	785,089	-

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項
資　産
（１）現金及び預金
預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
（２）未収委託者報酬及び（３）未収運用受託報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（４）投資有価証券
これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。
また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	60,720

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（４）投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）
第54期中間会計期間（平成28年９月30日）
１　その他有価証券

種類	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①　証券投資信託	151,830	150,000	1,830
小計	151,830	150,000	1,830
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①　証券投資信託	602,975	614,467	△11,491
小計	602,975	614,467	△11,491
合計	754,805	764,467	△9,661

（資産除去債務関係）
当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。
なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）
［セグメント情報］
第54期中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日）
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。
［関連情報］
第54期中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日）
１　製品及びサービスごとの情報
当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。
２　地域ごとの情報
（１）売上高
本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90％を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。
（２）有形固定資産
有形固定資産はすべて本邦に所在しております。
３　主要な顧客ごとの情報
委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家Ａ	1,177,474	資産運用業

（１株当たり情報）

１株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (平成28年９月30日)	
１株当たり純資産額	6,680.26円

１株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)	
１株当たり中間純利益金額	497.79円
（算定上の基礎）	
中間純利益金額（千円）	516,910
普通株主に帰属しない金額（千円）	－
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	516,910
普通株式の期中平均株式数（株）	1,038,408

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

（重要な後発事象）

当社（以下「MHAM」という）は、平成28年７月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合４社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月１日付で統合いたしました。

１．企業結合日
平成28年10月１日

２．企業結合の方法
①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

（参考）新光投信株式会社の経理状況

１．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

２．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成２８年６月１０日

新　光　投　信　株　式　会　社
　取　締　役　会　　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　伊　藤　志　保

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　福　村　　寛

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成２７年４月１日から平成２８年３月３１日までの第５６期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

強調事項
追加情報に記載されているとおり、会社は平成２７年９月３０日付の統合基本合意書に基づき、平成２８年３月３日付で新会社に係わる主要事項を内定している。
当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

以　　上

（※）１．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成２８年１２月１３日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山野　浩　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成２８年４月１日から平成２９年３月３１日までの第５７期事業年度の中間会計期間（平成２８年４月１日から平成２８年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、新光投信株式会社の平成２８年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成２８年４月１日から平成２８年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成２８年７月１３日付の「統合契約書」に基づき、平成２８年１０月１日にＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
流動資産合計	20,404,659	21,767,367
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	※2 12,687	※2 0
構築物（純額）	※2 1,444	※2 0
器具・備品（純額）	※2 86,688	※2 44,868
有形固定資産合計	100,820	44,868
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
無形固定資産合計	86,278	57,152
投資その他の資産		
投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
未払金		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	※1 1,558,682	※1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
固定負債		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
純資産の部		
株主資本		
資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	△72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744

評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

（2）損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度 （自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	35,876,795	39,283,623
運用受託報酬	238,412	232,145
営業収益合計	36,115,207	39,515,769
営業費用		
支払手数料	※1　18,252,669	※1　19,472,734
広告宣伝費	456,430	507,020
公告費	548	469
調査費		
調査費	623,792	841,825
委託調査費	5,966,340	7,419,125
図書費	5,254	4,879
調査費合計	6,595,388	8,265,830
委託計算費	1,352,318	1,711,366
営業雑経費		
通信費	32,335	30,454
印刷費	103,093	1,022
協会費	18,150	19,367
諸会費	3,300	3,117
その他	41,594	44,518
営業雑経費合計	198,475	98,480
営業費用合計	26,855,830	30,055,901
一般管理費		
給料		
役員報酬	96,445	91,205
給料・手当	1,368,552	1,480,875
賞与	336,076	428,776
給料合計	1,801,073	2,000,857
交際費	11,426	10,708
寄付金	3,198	2,346
旅費交通費	100,386	109,240
租税公課	68,508	90,795
不動産賃借料	206,753	205,671
賞与引当金繰入	451,000	547,750
役員賞与引当金繰入	66,000	22,000
役員退職慰労引当金繰入	24,930	22,210
退職給付費用	191,900	169,238
減価償却費	70,676	102,532

諸経費	573,824	647,510
一般管理費合計	3,569,678	3,930,859
営業利益	5,689,698	5,529,008

(単位：千円)

	前事業年度 （自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
営業外収益		
受取配当金	163,006	65,772
有価証券利息	3,853	3,333
受取利息	10,741	10,751
時効成立分配金・償還金	5,080	923
受取保険金	-	10,300
雑益	487	2,845
営業外収益合計	183,170	93,926
営業外費用		
支払利息	26	3
時効成立後支払分配金・償還金	3,083	5,532
雑損	3,261	556
営業外費用合計	6,371	6,092
経常利益	5,866,496	5,616,842
特別利益		
投資有価証券売却益	68,179	225,965
外国税支払損失引当金戻入益	-	43,200
特別利益合計	68,179	269,166
特別損失		
固定資産除却損	3,177	13,017
投資有価証券売却損	54,613	60,150
投資有価証券評価損	10,952	62,800
外国税支払損失引当金繰入額	184,111	-
訴訟損失引当金繰入額	30,000	10,000
合併関連費用	※2 -	※2 164,657
その他特別損失	22,227	-
特別損失合計	305,082	310,625
税引前当期純利益	5,629,593	5,575,383
法人税、住民税及び事業税	2,111,379	1,832,729
法人税等調整額	△66,999	19,773
法人税等合計	2,044,380	1,852,503
当期純利益	3,585,212	3,722,880

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自　平成26年4月 1日　至　平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				
		資本剰余金	利益剰余金		
				その他利益剰余金	
	資本金	資　本 準備金	利　益 準備金	別　途 積立金	繰　越 利　益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による累積的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
剰余金の配当					△2,539,409
当期純利益					3,585,212
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金				
	利　益 剰余金 合　計	自　己 株　式	株　主 資　本 合　計	その他有価証券評価差額金	
当期首残高	12,149,658	△72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	12,195,935	△72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	△2,539,409		△2,539,409		△2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	△72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

当事業年度（自　平成27年4月 1日　至　平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
		資本剰余金			利益剰余金	
	資本金	資　本 準備金	その他 資　本 剰余金	資　本 剰余金 合　計	利　益 準備金	その他利益 剰余金 別　途 積立金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益						
自己株式の消却			△72,415	△72,415		
利益剰余金から 資本剰余金への振替			72,415	72,415		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-
当期末残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自　己 株　式	株　主 資　本 合　計	その他有 価証券評 価差額金	
	その他利益 剰余金 繰　越 利　益 剰余金	利　益 剰余金 合　計				
当期首残高	3,981,245	13,241,738	△ 72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	△ 3,446,341	△ 3,446,341		△ 3,446,341		△ 3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880
自己株式の消却			72,415	-		-
利益剰余金から資本剰余金への振替	△72,415	△72,415		-		-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				-	△187,941	△187,941
当期変動額合計	204,122	204,122	72,415	276,538	△187,941	88,597
当期末残高	4,185,368	13,445,861	-	20,731,861	94,744	20,826,605

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）関連会社株式

総平均法による原価法

（2）その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　8～18年

構築物　　20年

器具備品　2～20年

（2）無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。

３．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

（2）役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

（3）外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

（4）訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

（5）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

（6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

５．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（未適用の会計基準）

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

（追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

１．商　　号　　アセットマネジメントOne株式会社
２．代 表 者　　西　惠正（現　DIAMアセットマネジメント株式会社　代表取締役社長）
３．本店所在地　　東京都千代田区丸の内1-8-2
４．統 合 日　　平成28年10月1日

注記事項

（貸借対照表関係）

※１．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
未払手数料	777,631千円	570,839千円

※２．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
有形固定資産の減価償却累計額	573,602千円	657,201千円

（損益計算書関係）

※１．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
支払手数料	9,189,399千円	8,452,937千円

※２．特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
固定資産・敷金の償却	-千円	140,257千円
その他	-千円	24,400千円
合計	-千円	164,657千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	-	1,823,250

２．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

３．配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年12月24日臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	9,386	1,813,864

(変動事由の概要)

自己株式の消却

２．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	9,386	-

(変動事由の概要)

自己株式の消却

３．配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年11月17日取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常の取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行っております。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

② 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

③ 流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注）２．参照）。

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金及び預金	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

（注）１．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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

（注）２．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品　　（単位：千円）

区分	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
非上場株式	276,151	276,151

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（注）３．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
(1) 預金	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

当事業年度（平成28年3月31日）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
(1) 預金	14,861,112	―	―	―
(2) 有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	―	―	―

（有価証券関係）

１．関連会社株式

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額　77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額　77,100千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	△154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	△154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	△113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	△113,485
合計		6,159,600	6,023,210	136,389

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
①国債・地方債等	-	-	-
②社債	-	-	-
③その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	△54,613
合計	503,565	68,179	△54,613

当事業年度（平成28年3月31日）

	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
①国債・地方債等	-	-	-
②社債	-	-	-
③その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	△60,150
合計	2,209,763	225,965	△60,150

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円（その他有価証券）減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について62,800千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

２．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表　　(単位：千円)

	前事業年度 （自　平成26年4月1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月1日 至　平成28年3月31日）
退職給付債務の期首残高	1,424,739	1,348,083
会計方針の変更による累積的影響額	△71,902	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	△31,927	53,747
退職給付の支払額	△73,269	△60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表　(単位：千円)

	前事業年度 (自　平成26年4月1日 至　平成27年3月31日)	当事業年度 (自　平成27年4月1日 至　平成28年3月31日)
年金資産の期首残高	1,157,054	1,329,170
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の発生額	108,961	△128,633
事業主からの拠出額	78,464	77,164
退職給付の支払額	△38,450	△28,253
年金資産の期末残高	1,329,170	1,282,678

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,111,797	1,185,792
年金資産	△1,329,170	△1,282,678
	△217,373	△96,885
非積立型制度の退職給付債務	236,285	253,099
未積立退職給付債務	18,912	156,213
未認識数理計算上の差異	△270,020	△387,977
未認識過去勤務費用	10,703	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	△240,404	△231,764
退職給付引当金	155,806	146,617
前払年金費用	△396,211	△378,381
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	△240,404	△231,764

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額　(単位：千円)

	前事業年度 (自　平成26年4月1日 至　平成27年3月31日)	当事業年度 (自　平成27年4月1日 至　平成28年3月31日)
勤務費用(注1)	119,135	124,139
利息費用	9,476	6,074
期待運用収益	△23,141	△33,229
数理計算上の差異の費用処理額	85,138	64,424
過去勤務費用の費用処理額	△16,055	△10,703
確定給付制度に係る退職給付費用	174,553	150,705

（注）１.執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額（前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円）については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

(5)年金資産に関する事項

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
①年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%
現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	前事業年度 （自　平成26年4月1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月1日 至　平成28年3月31日）
割引率	0.0720%～1.625%	0.0120%～0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円　当事業年度16,733千円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
繰延税金資産		
賞与引当金	170,920千円	182,614千円
減価償却超過額	896	25,871
退職給付引当金	70,882	71,201
役員退職慰労引当金	12,688	14,799
投資有価証券評価損	15,033	19,229
非上場株式評価損	25,733	24,425
未払事業税	90,342	57,445
外国税支払損失引当金	60,867	-
訴訟損失引当金	9,918	12,344
その他	87,621	120,305
繰延税金資産小計	544,905	528,236
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	544,905	528,236
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△134,624	△56,708
前払年金費用	△127,817	△115,860
繰延税金負債合計	△262,442	△172,568
繰延税金資産の純額	282,463	355,668

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産－繰延税金資産	372,215千円	326,063千円
固定資産－長期繰延税金資産	-	29,604
固定負債－長期繰延税金負債	89,752	-

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

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

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については30.62%となります。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）及び
当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）及び
当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

１．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

該当事項はありません。

関連当事者情報

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接 7.73	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,452,937	未払手数料	570,839

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情　報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

当事業年度（自　平成27年4月1日　至　平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	16,314
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情　報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	96,300	その他未払金	8,725
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,163	その他未払金	1,728

（注）１．上記（ア）～（イ）の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

（注）２．取引条件及び取引条件の決定方法等

（１）代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。

（２）事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。

（３）計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
1株当たり純資産額	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45銭

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

（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。

	前事業年度 （自　平成26年4月 1日 至　平成27年3月31日）	当事業年度 （自　平成27年4月 1日 至　平成28年3月31日）
当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

	当中間会計期間 （平成28年9月30日）
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	7,314,360
有価証券	101,520
未収委託者報酬	3,004,856
未収運用受託報酬	74,687
繰延税金資産	281,201
その他	334,195
流動資産合計	11,110,820
固定資産	
有形固定資産	
器具・備品（純額）	31,241
建設仮勘定	3,819
有形固定資産合計	※1　35,061
無形固定資産	
ソフトウェア	52,424
ソフトウェア仮勘定	20,936
その他	91
無形固定資産合計	73,452
投資その他の資産	
投資有価証券	2,589,863
長期繰延税金資産	22,056
前払年金費用	352,195
その他	29,332
投資その他の資産合計	2,993,448
固定資産合計	3,101,961
資産合計	14,212,782

（単位：千円）

	当中間会計期間 （平成28年9月30日）
負債の部	
流動負債	
未払金	
未払収益分配金	153
未払償還金	4,216
未払手数料	1,406,798
その他未払金	284,198
未払金合計	1,695,367
未払費用	801,111
未払法人税等	850,492
未払消費税等	※2　113,638
賞与引当金	382,000
訴訟損失引当金	70,000
流動負債合計	3,912,609
固定負債	
退職給付引当金	160,185
固定負債合計	160,185
負債合計	4,072,794
純資産の部	
株主資本	
資本金	4,524,300
資本剰余金	
資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	2,473,372
利益剰余金合計	2,833,866
株主資本合計	10,119,866
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	20,122
評価・換算差額等合計	20,122
純資産合計	10,139,988
負債純資産合計	14,212,782

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 （自　平成28年4月 1日 至　平成28年9月30日）
営業収益	
委託者報酬	19,468,460
運用受託報酬	95,090
営業収益合計	19,563,551
営業費用及び一般管理費	※1　16,721,767
営業利益	2,841,783
営業外収益	
受取配当金	32,758
有価証券利息	522
受取利息	2,296
時効成立分配金・償還金	10
その他	531
営業外収益合計	36,119
営業外費用	
その他	34
営業外費用合計	34
経常利益	2,877,868
特別利益	
固定資産売却益	1,354
投資有価証券売却益	9,179
特別利益合計	10,533
特別損失	
固定資産売却損	3,996
投資有価証券評価損	58,055
固定資産除却損	50
訴訟損失引当金繰入額	30,000
合併関連費用	11,926
特別損失合計	104,028
税引前中間純利益	2,784,373
法人税、住民税及び事業税	795,495
法人税等調整額	85,212
法人税等合計	880,707
中間純利益	1,903,666

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　平成28年4月 1日　至　平成28年9月30日）　（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	
				別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	4,185,368
当中間期変動額					
別途積立金取崩				△8,900,000	8,900,000
剰余金の配当					△12,515,661
中間純利益					1,903,666
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	△8,900,000	△1,711,995
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	-	2,473,372

	株主資本		評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	利益剰余金合計			
当期首残高	13,445,861	20,731,861	94,744	20,826,605
当中間期変動額				
別途積立金取崩	-	-		-
剰余金の配当	△12,515,661	△12,515,661		△12,515,661
中間純利益	1,903,666	1,903,666		1,903,666
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			△74,622	△74,622
当中間期変動額合計	△10,611,995	△10,611,995	△74,622	△10,686,617
当中間期末残高	2,833,866	10,119,866	20,122	10,139,988

［注記事項］

（重要な会計方針）

１．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

① 関連会社株式

総平均法による原価法

② その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。

３．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

４．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

（中間貸借対照表関係）

※１．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	当中間会計期間 （平成28年9月30日）
有形固定資産の減価償却累計額	498,091千円

※２．消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

※１．減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 （自　平成28年4月1日 至　平成28年9月30日）
有形固定資産	9,695千円
無形固定資産	9,425千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　平成28年4月1日　至　平成28年9月30日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,813,864	-	-	1,813,864

２．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月15日 取締役会	普通株式	12,515,661	6,900	平成28年7月5日	平成28年7月27日

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、含まれておりません（（注）２．参照）。

当中間会計期間（自　平成28年4月1日　至　平成28年9月30日）

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	7,314,360	7,314,360	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	2,415,231	2,415,231	-
(3) 未収委託者報酬	3,004,856	3,004,856	-
(4) 未払手数料	1,406,798	1,406,798	-

（注）１．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 未払手数料

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

（注）２．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

１．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額　77,100千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額(千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	921,189	730,244	190,944
	小計	921,189	730,244	190,944
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	1,494,041	1,656,021	△161,979
	小計	1,494,041	1,656,021	△161,979
合計		2,415,231	2,386,265	28,965

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額199,051千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

［関連情報］

当中間会計期間（自　平成28年4月1日　至　平成28年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］
該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］
該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］
該当事項はありません。

（１株当たり情報）
１株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに１株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 （平成28年9月30日）
（1）1株当たり純資産額	5,590円26銭
（算定上の基礎）	
純資産の部の合計額（千円）	10,139,988
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	10,139,988
普通株式の発行済株式数（株）	1,813,864
普通株式の自己株式数（株）	-
１株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数（株）	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自　平成28年4月1日 至　平成28年9月30日)
（2）1株当たり中間純利益金額	1,049円50銭
（算定上の基礎）	
中間純利益金額（千円）	1,903,666
普通株主に帰属しない金額（千円）	-
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	1,903,666
普通株式の期中平均株式数（株）	1,813,864

（注）潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載しておりません。

（追加情報）
役員賞与引当金
当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。
これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

役員退職慰労引当金
当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

繰延税金資産

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号　平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

（重要な後発事象）

当社（以下「新光投信」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及びみずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

１．企業結合日
平成28年10月1日

２．企業結合の方法
①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

独立監査人の監査報告書

平成２９年３月１日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　佐々木　貴司　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　鶴　田　光夫　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているクルーズコントロール＜ＤＣ年金＞の平成２８年７月１２日から平成２９年１月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞の平成２９年１月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

※　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。

※　ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２８年５月３１日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山内　正彦　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山野　浩　印

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

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

強調事項
追加情報に記載されているとおり、会社は平成２７年９月３０日付の「統合基本合意書」に基づき、平成２８年３月３日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。
当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

以上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

次へ

独立監査人の中間監査報告書

平成２８年１２月１３日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山野　浩　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社）の平成２８年４月１日から平成２９年３月３１日までの第３２期事業年度の中間会計期間（平成２８年４月１日から平成２８年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社）の平成２８年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成２８年４月１日から平成２８年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社）は、平成２８年７月１３日付の「統合契約書」に基づき、平成２８年１０月１日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。