

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年6月24日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型） D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型） 5,000億円を上限とします。 D I A Mコア資産設計ファンド（積極型） 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

（以下、総称して「D I A Mコア資産設計ファンド」、「D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型／積極型）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）」は「（堅実型）」、「D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）」は「（積極型）」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「まもラップ」または「まもラップ（堅実型／積極型）」という名称を用いる場合があります。また、「D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）」の愛称として「まもラップ（堅実型）」、「D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）」の愛称として「まもラップ（積極型）」という名称を用いる場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
（ファンドの略称（堅実型）：まもラップ堅、（積極型）：まもラップ積）

（５）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成28年7月12日から平成29年7月11日まで

取得またはスイッチングの申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとし、払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は下記の通りです。

・ 株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ） 【 その他 】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付は行いません。

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

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

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場

合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

<スイッチング>

（堅実型）（積極型）の2つのファンド間でスイッチングができます。スイッチングとは、すでに保有しているファンドを解約すると同時に他のファンドの取得の申込みを行うことをいい、ファンドの解約代金が買付代金に充当されます。

スイッチングの際には、税金および各販売会社が定めるお申込手数料がかかる場合があります。

販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 国内外の6資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

- 主として、日本、先進国および新興国の債券・株式にマザーファンドを通じて実質的に投資します。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。
- 6資産の配分比率(以下、基本配分比率とします。)は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

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

- 資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
 - 基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(以下、合計資産比率とします。)を機動的に変更します。
 - 下値目安値は、3ヵ月毎に改定します(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には翌営業日)。
- (*)基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)

3 下値目安値の異なる堅実型と積極型から選択できます。なお、2ファンド間でスイッチングが可能です。

- 各ファンドの下値目安値は、以下の通りとします。ただし、委託会社の判断により今後変更する場合があります。
(堅実型)改定日の基準価額の-2.5%
(積極型)改定日の基準価額の-3.5%
- ※スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。
- ※基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

分配方針

年2回の決算時(毎年4月、10月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

属性区分表

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「資産複合（投資信託証券（債券、株式）、先物、E T F、短期金融資産）資産配分変更型」とは目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、E T F、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

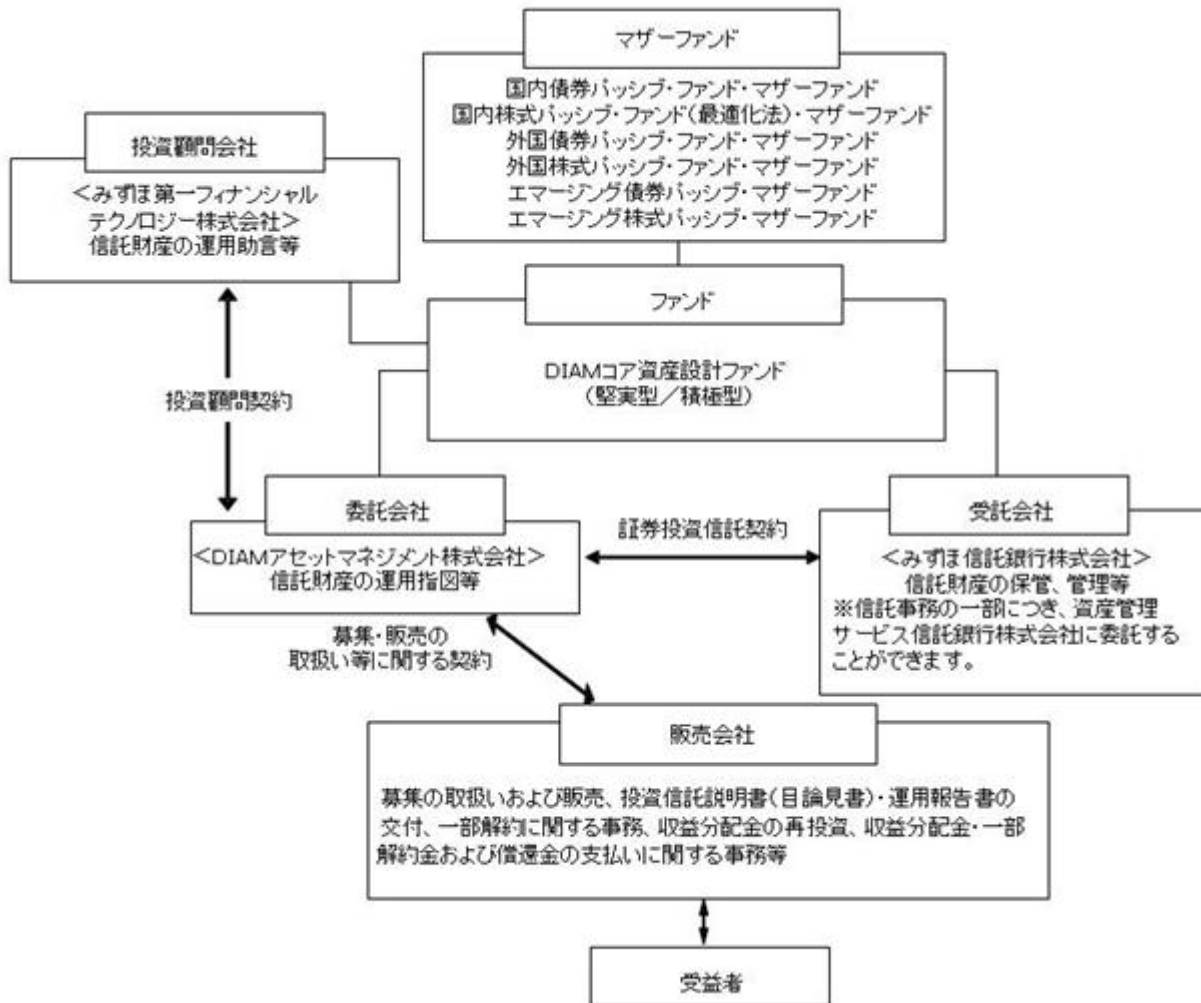
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

（２）【ファンドの沿革】

平成27年8月28日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、各ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・「投資顧問契約」の概要

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

「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成28年4月28日現在）

委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日	会社設立
平成10年 3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月 1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月 1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成28年4月28日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券（以下、それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）への投資を通じて、日本、先進国および新興国の債券・株式の6資産に実質的に分散投資を行います。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等（*）に投資する場合があります。

（*）市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

6資産の配分比率（以下、基本配分比率とします。）は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率（以下、合計資産比率といいます。）を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を一定水準（下値目安値（*））までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

運用プロセス

・基本配分比率の決定

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

・下値目安値の決定

委託会社は、3ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の97.5%（（堅実型）の場合）もしくは96.5%（（積極型）の場合）の水準を翌3ヵ月間の下値目安値とします。

・リバランスの実施

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

・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンドの各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

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

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書

のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

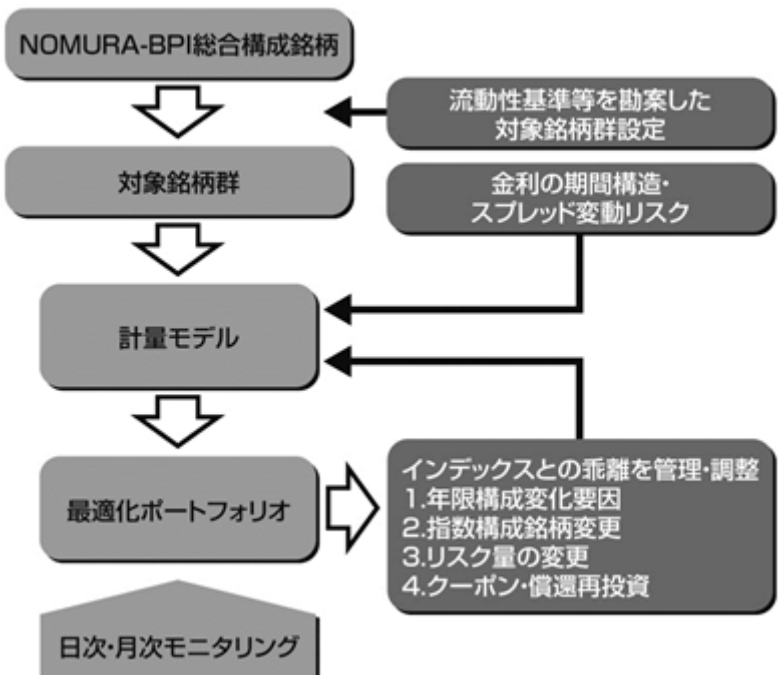
運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

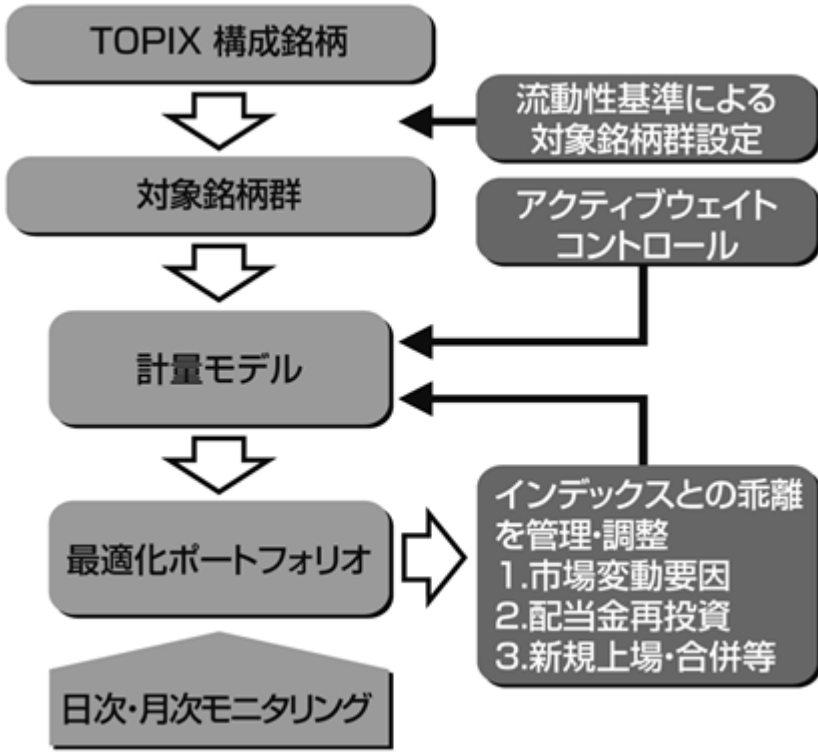
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p> 
主な投資制限	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

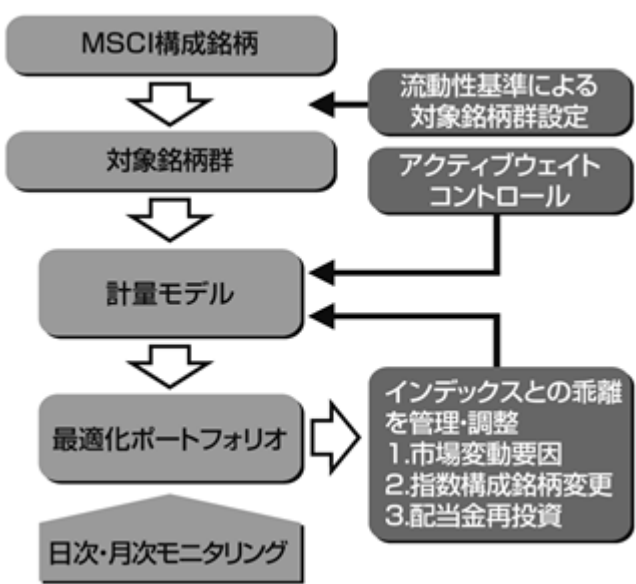
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	1. 株式への投資割合には、制限を設けません。

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
	<p>シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資

主な投資制限	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>
--------	--

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>

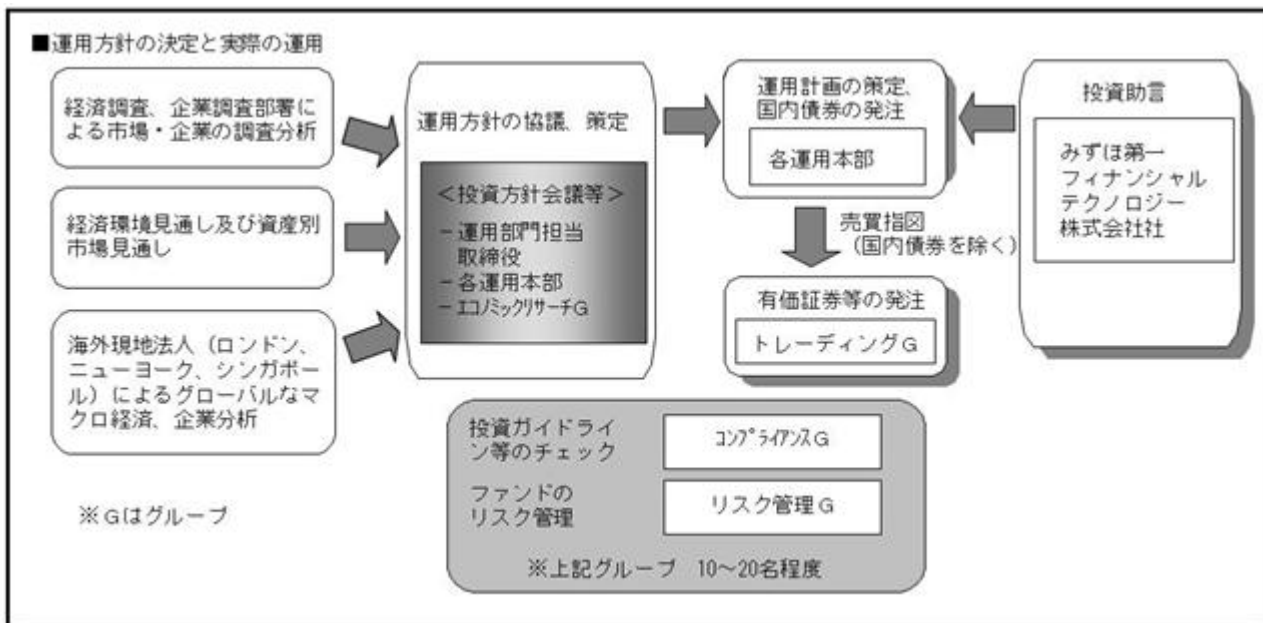
運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やか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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはM o o d y ' sの外貨建て長期格付がＢＢ - 格もしくはＢ a 3 格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
	<p>ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、Ｊ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B F[金利期間構造] --> C D --> G[インデックスとの乖離を管理・調整] G --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
主な投資制限	<p>1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D F["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D G[日次・月次モニタリング] --> D </pre> </div>
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



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

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

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

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

ファンドは、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を受けます。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成28年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【配分方針】

収益配分方針

毎決算時（原則として毎年4月、10月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての配分方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としません。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

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

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

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。))を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

スワップ取引、金利先渡し取引、為替先渡し取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図（約款第22条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとし（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。）を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額」といいます。）とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合に

は外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図（約款第23条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3）においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3）において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超え

ることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 6)上記5)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 7)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 8)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - 1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1) 1. ~ 2. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第27条）

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

外国為替予約取引の指図（約款第28条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第34条）

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

3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

・資産配分リスク

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

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

・株価変動リスク

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

・金利リスク

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

・為替リスク

ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

・信用リスク

ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

・カントリーリスク

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

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

< その他の留意点 >

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

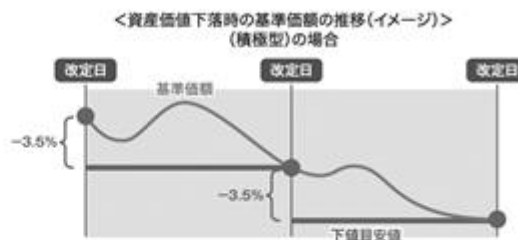
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

（堅実型）（積極型）の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

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

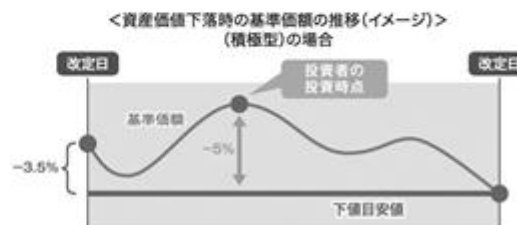
ケース① 下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月(四半期)毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、ファンドの基準価額は長期的に2.5%((堅実型)の場合)もしくは3.5%((積極型)の場合)よりも下落する場合があります。



ケース② 四半期中途の投資について

ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点で投資者がファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2.5%((堅実型)の場合)もしくは3.5%((積極型)の場合)以上となる場合があります。したがって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。



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

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

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

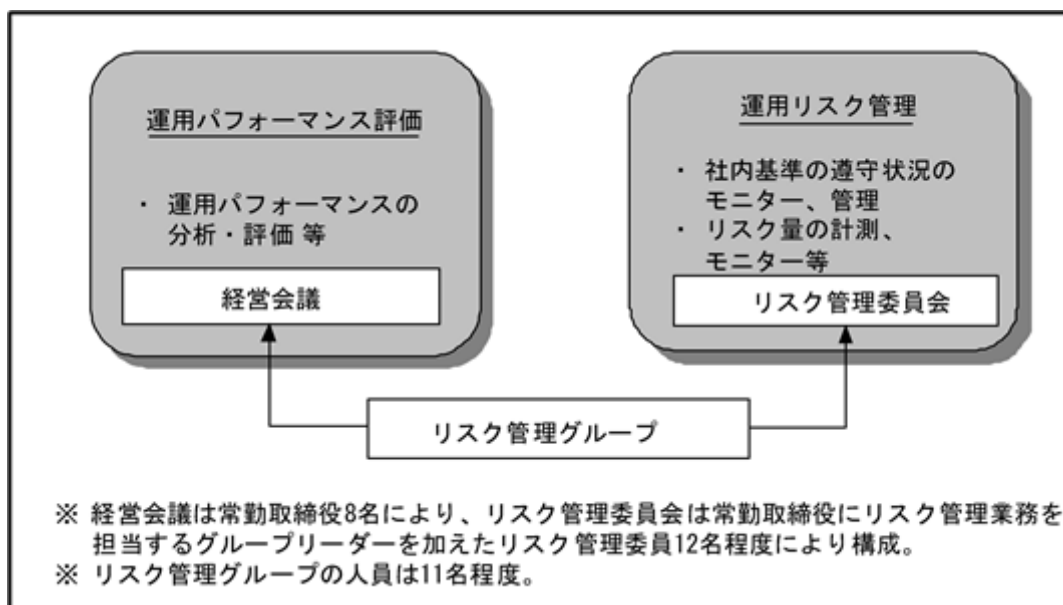
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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

注意事項

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

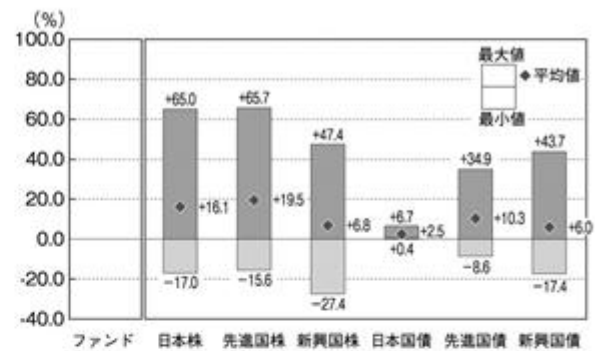
< 運用評価・運用リスク管理体制 >



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

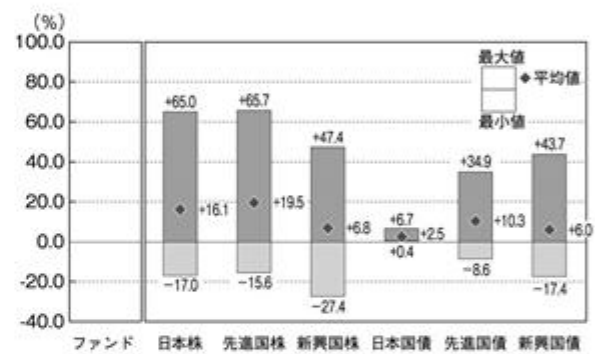
運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

上記体制は平成28年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)**ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移****(堅実型)****(積極型)****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:2016年4月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2011年5月~2016年4月



ファンド:2016年4月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2011年5月~2016年4月

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

*ファンドは2016年4月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.134%（税抜1.05%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、各ファンドにかかる投資顧問報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開

設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	72,684,500	29.88
内 日本	72,684,500	29.88
親投資信託受益証券	121,261,925	49.84
内 日本	121,261,925	49.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	49,345,484	20.28
純資産総額	243,291,909	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	51,961,500	12.26
内 日本	51,961,500	12.26
親投資信託受益証券	262,208,044	61.87
内 日本	262,208,044	61.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	109,605,588	25.86
純資産総額	423,775,132	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	277,030,512,200	98.47
内 日本	277,030,512,200	98.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,311,365,988	1.53
純資産総額	281,341,878,188	100.00

その他資産の投資状況

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	4,297,860,000	1.53
内 日本	4,297,860,000	1.53

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	332,391,057,900	82.62
内 日本	332,391,057,900	82.62
地方債証券	25,375,874,270	6.31
内 日本	25,375,874,270	6.31
特殊債券	22,149,993,139	5.51
内 日本	22,149,993,139	5.51
社債券	19,901,514,800	4.95
内 日本	19,601,163,800	4.87
内 オランダ	200,838,000	0.05
内 イギリス	99,513,000	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,475,654,026	0.62
純資産総額	402,294,094,135	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	251,286,498,315	94.93
内 アメリカ	152,729,546,084	57.70
内 イギリス	19,558,164,316	7.39
内 スイス	10,337,946,087	3.91
内 カナダ	9,955,192,233	3.76
内 フランス	9,688,021,535	3.66
内 ドイツ	9,641,157,746	3.64
内 オーストラリア	6,673,026,799	2.52
内 オランダ	4,348,437,209	1.64
内 アイルランド	4,302,290,204	1.63
内 スペイン	3,469,011,416	1.31
内 スウェーデン	3,022,545,455	1.14
内 香港	2,439,506,445	0.92
内 イタリア	2,083,960,653	0.79
内 デンマーク	2,066,318,833	0.78
内 シンガポール	1,769,316,962	0.67
内 ベルギー	1,520,110,974	0.57

内 ジャージー	1,477,028,359	0.56
内 フィンランド	1,005,832,721	0.38
内 オランダ領キュラソー	982,269,721	0.37
内 バミューダ	938,470,764	0.35
内 イスラエル	722,102,759	0.27
内 ケイマン諸島	630,080,859	0.24
内 ノルウェー	627,765,935	0.24
内 ルクセンブルグ	257,514,516	0.10
内 オーストリア	182,232,493	0.07
内 パナマ	176,372,560	0.07
内 ポルトガル	175,148,407	0.07
内 ニュージーランド	157,343,181	0.06
内 リベリア	129,863,720	0.05
内 イギリス領バージン諸島	97,008,499	0.04
内 パプアニューギニア	59,596,291	0.02
内 マン島	40,474,375	0.02
内 モーリシャス	22,840,204	0.01
投資信託受益証券	844,752,143	0.32
内 オーストラリア	705,550,475	0.27
内 シンガポール	139,201,668	0.05
投資証券	6,005,096,368	2.27
内 アメリカ	5,046,229,247	1.91
内 フランス	404,340,055	0.15
内 イギリス	379,552,991	0.14
内 香港	117,162,000	0.04
内 カナダ	57,812,075	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,569,587,210	2.48
純資産総額	264,705,934,036	100.00

その他資産の投資状況

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	377,796,200	0.14
-	377,796,200	0.14
株価指数先物取引（買建）	6,069,722,879	2.29
内 アメリカ	3,958,087,106	1.50
内 ドイツ	1,141,283,400	0.43
内 イギリス	479,817,907	0.18
内 カナダ	254,120,486	0.10
内 オーストラリア	236,413,980	0.09

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	258,292,088,254	96.53
内 アメリカ	110,886,680,801	41.44
内 フランス	25,852,757,717	9.66
内 イタリア	25,696,647,232	9.60
内 イギリス	20,545,680,007	7.68
内 ドイツ	19,501,554,771	7.29
内 スペイン	14,458,721,785	5.40
内 ベルギー	6,592,342,606	2.46
内 オランダ	6,453,289,691	2.41
内 カナダ	5,386,335,948	2.01
内 オーストラリア	4,667,592,417	1.74
内 オーストリア	3,963,129,921	1.48
内 メキシコ	2,507,348,901	0.94
内 アイルランド	2,073,334,321	0.77
内 フィンランド	1,680,741,992	0.63
内 デンマーク	1,625,498,850	0.61
内 ポーランド	1,421,051,082	0.53
内 スウェーデン	1,172,419,880	0.44
内 マレーシア	1,162,983,709	0.43
内 南アフリカ	1,041,508,072	0.39
内 シンガポール	900,940,418	0.34
内 ノルウェー	701,528,133	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,280,183,491	3.47
純資産総額	267,572,271,745	100.00

その他資産の投資状況

平成28年4月28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）	1,985,128,040	0.74
-	1,985,128,040	0.74
為替予約取引（売建）	116,921,040	0.04
-	116,921,040	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	34,988,105,594	94.72
内 韓国	5,502,660,890	14.90
内 台湾	4,164,533,433	11.27
内 中国	3,849,458,409	10.42
内 インド	2,920,967,321	7.91
内 ケイマン諸島	2,736,131,905	7.41
内 ブラジル	2,516,155,802	6.81
内 南アフリカ	2,347,847,177	6.36
内 香港	1,621,586,570	4.39
内 ロシア	1,384,391,415	3.75
内 メキシコ	1,266,138,885	3.43
内 マレーシア	1,208,188,586	3.27
内 インドネシア	937,154,621	2.54
内 タイ	769,117,087	2.08
内 トルコ	538,394,873	1.46
内 フィリピン	493,897,044	1.34
内 ポーランド	447,220,250	1.21
内 チリ	447,065,182	1.21
内 バミューダ	394,507,988	1.07
内 カタール	332,520,778	0.90
内 アラブ首長国連邦	330,823,170	0.90
内 コロンビア	176,121,375	0.48
内 オランダ	169,391,512	0.46
内 ハンガリー	110,951,855	0.30
内 ギリシャ	84,200,789	0.23
内 チェコ	64,343,837	0.17
内 エジプト	48,086,399	0.13
内 アメリカ	44,693,580	0.12
内 マルタ	35,853,855	0.10
内 マン島	27,691,960	0.07
内 ベルー	18,009,046	0.05
投資信託受益証券	259,709,509	0.70
内 メキシコ	259,709,509	0.70
投資証券	123,879,800	0.34
内 メキシコ	58,096,023	0.16
内 南アフリカ	46,656,284	0.13
内 トルコ	19,127,493	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,567,172,297	4.24
純資産総額	36,938,867,200	100.00

その他資産の投資状況

平成28年4月28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）	201,962,825	0.55
-	201,962,825	0.55
為替予約取引（売建）	202,037,791	0.55
-	202,037,791	0.55
株価指数先物取引（買建）	1,548,390,315	4.19
内 アメリカ	1,548,390,315	4.19

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	51,784,658,171	97.24
内 トルコ	7,710,494,915	14.48
内 メキシコ	6,924,092,927	13.00
内 ロシア	6,476,492,601	12.16
内 インドネシア	5,403,684,798	10.15
内 ブラジル	5,055,207,370	9.49
内 フィリピン	4,572,705,652	8.59
内 コロンビア	4,102,369,393	7.70
内 ハンガリー	2,738,380,149	5.14
内 ベルギー	2,234,509,999	4.20
内 パナマ	1,915,373,462	3.60
内 南アフリカ	1,794,326,895	3.37
内 クロアチア	1,540,478,217	2.89
内 ルーマニア	1,316,541,793	2.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,467,916,474	2.76
純資産総額	53,252,574,645	100.00

その他資産の投資状況

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	213,993,000	0.40
-	213,993,000	0.40

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

平成28年4月28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	886回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	70,000,000	103.91 72,742,600	103.83 72,684,500	1.800000 2018/6/19	29.88%
2	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	18,876,540	1.9164 36,175,072	1.9592 36,982,917	- -	15.20%
3	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	28,174,186	0.8455 23,822,218	0.8738 24,618,603	- -	10.12%
4	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	13,384,652	1.7571 23,518,434	1.7591 23,544,941	- -	9.68%
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	4,670,582	2.5407 11,866,683	2.6324 12,294,840	- -	5.05%
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	6,937,088	1.7069 11,841,256	1.7313 12,010,180	- -	4.94%
7	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	9,052,924	1.3026 11,792,770	1.3046 11,810,444	- -	4.85%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
特殊債券	29.88%
親投資信託受益証券	49.84%
合計	79.72%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

平成28年4月28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	40,614,932	1.9114 77,631,526	1.9592 79,572,774	- -	18.78%
2	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	60,888,306	0.8438 51,378,142	0.8738 53,204,201	- -	12.55%
3	13回 政保東日本高速道路債券 日本	特殊債券	50,000,000	104.01 52,005,000	103.92 51,961,500	1.600000 2018/10/19	12.26%
4	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	29,125,062	1.7538 51,081,402	1.7591 51,233,896	- -	12.09%
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	10,117,080	2.5305 25,601,789	2.6324 26,632,201	- -	6.28%
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	15,046,842	1.7020 25,610,937	1.7313 26,050,597	- -	6.15%
7	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	19,557,240	1.3030 25,484,876	1.3046 25,514,375	- -	6.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
特殊債券	12.26%
親投資信託受益証券	61.87%
合計	74.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年4月28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	1,736,300	6,540.53 11,356,332,477	5,654.00 9,817,040,200	- -	3.49%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	11,054,800	538.70 5,955,249,820	520.10 5,749,601,480	- -	2.04%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,065,000	5,291.89 5,635,864,911	4,864.00 5,180,160,000	- -	1.84%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	780,700	5,132.96 4,007,306,784	5,988.00 4,674,831,600	- -	1.66%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,399,700	3,193.02 4,469,270,404	3,169.00 4,435,649,300	- -	1.58%
6	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	924,700	4,648.79 4,298,741,902	4,530.00 4,188,891,000	- -	1.49%
7	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,103,200	3,419.36 3,772,240,032	3,413.00 3,765,221,600	- -	1.34%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,256,300	3,130.80 3,933,229,820	2,992.50 3,759,477,750	- -	1.34%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	19,523,800	181.67 3,546,889,348	167.80 3,276,093,640	- -	1.16%
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	582,300	5,833.89 3,397,079,815	5,262.00 3,064,062,600	- -	1.09%
11	ソニー 日本	株式 電気機器	985,000	2,567.11 2,528,611,631	2,778.00 2,736,330,000	- -	0.97%
12	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,029,200	2,832.96 2,915,683,090	2,597.00 2,672,832,400	- -	0.95%
13	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	576,300	5,145.34 2,965,261,124	4,543.00 2,618,130,900	- -	0.93%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	255,200	10,847.18 2,768,200,376	9,824.00 2,507,084,800	- -	0.89%
15	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,637,300	1,661.06 2,719,655,566	1,497.00 2,451,038,100	- -	0.87%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	125,000	22,387.46 2,798,433,144	19,435.00 2,429,375,000	- -	0.86%
17	花王 日本	株式 化学	393,200	6,194.39 2,435,636,932	6,116.00 2,404,811,200	- -	0.85%
18	ファナック 日本	株式 電気機器	142,800	16,431.21 2,346,378,039	16,505.00 2,356,914,000	- -	0.84%
19	キヤノン 日本	株式 電気機器	751,600	3,368.84 2,532,026,408	3,112.00 2,338,979,200	- -	0.83%
20	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,025,000	2,251.54 2,307,829,840	2,121.00 2,174,025,000	- -	0.77%

21	村田製作所 日本	株式 電気機器	146,500	13,989.45 2,049,455,255	14,795.00 2,167,467,500	- -	0.77%
22	キーエンス 日本	株式 電気機器	31,600	58,095.66 1,835,822,906	67,160.00 2,122,256,000	- -	0.75%
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	558,200	3,950.12 2,204,958,104	3,689.00 2,059,199,800	- -	0.73%
24	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	493,400	4,140.07 2,042,713,620	4,116.00 2,030,834,400	- -	0.72%
25	三井不動産 日本	株式 不動産業	731,000	2,671.12 1,952,590,600	2,725.00 1,991,975,000	- -	0.71%
26	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,947,700	1,081.69 2,106,811,263	1,000.00 1,947,700,000	- -	0.69%
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,033,800	1,874.98 1,938,362,936	1,863.00 1,925,969,400	- -	0.68%
28	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,562,000	495.75 1,765,879,600	515.60 1,836,567,200	- -	0.65%
29	ダイキン工業 日本	株式 機械	203,300	7,723.80 1,570,250,340	8,884.00 1,806,117,200	- -	0.64%
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,489,000	1,145.86 1,706,185,880	1,198.00 1,783,822,000	- -	0.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
株式	98.47%
合計	98.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.53%
輸送用機器		9.21%
情報・通信業		8.26%
銀行業		7.37%
化学		6.11%
医薬品		5.74%
食料品		4.93%
小売業		4.78%
機械		4.66%
陸運業		4.54%
卸売業		4.18%
サービス業		3.84%
建設業		3.09%
不動産業		2.81%
保険業		2.23%
電気・ガス業		2.00%
精密機器		1.60%
その他製品		1.53%
その他金融業		1.36%
鉄鋼		1.25%
証券、商品先物取引業		1.04%
ゴム製品		0.97%
ガラス・土石製品		0.92%
非鉄金属		0.85%
繊維製品		0.73%
空運業		0.66%
金属製品		0.65%
石油・石炭製品		0.54%
鉱業		0.30%
パルプ・紙		0.26%
海運業	0.23%	
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.11%	
合計		98.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 2 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	101.02 5,051,250,000	101.28 5,064,450,000	0.100000 2020/6/20	1.26%
2	1 2 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	101.18 4,553,415,000	0.100000 2019/12/20	1.13%
3	1 0 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.54 4,524,705,000	100.62 4,528,215,000	0.200000 2017/9/20	1.13%
4	1 0 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.46 4,520,790,000	100.50 4,522,770,000	0.200000 2017/6/20	1.12%
5	1 1 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	101.17 4,249,350,000	0.200000 2018/12/20	1.06%
6	3 4 0 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.35 4,134,275,000	104.78 4,191,240,000	0.400000 2025/9/20	1.04%
7	3 4 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.40 4,136,380,000	103.83 4,153,440,000	0.300000 2025/12/20	1.03%
8	1 2 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.06 4,042,440,000	101.34 4,053,840,000	0.100000 2020/9/20	1.01%
9	1 1 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	101.27 4,050,880,000	0.200000 2019/3/20	1.01%
10	3 3 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	103.50 3,622,835,000	104.74 3,666,180,000	0.400000 2025/6/20	0.91%
11	1 1 8 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,650,000	101.36 3,547,880,000	0.200000 2019/6/20	0.88%
12	1 1 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.31 3,545,990,000	0.300000 2018/9/20	0.88%
13	1 2 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,210,000	101.22 3,543,015,000	0.100000 2020/3/20	0.88%
14	1 0 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.64 3,321,285,000	100.74 3,324,486,000	0.200000 2017/12/20	0.83%
15	2 8 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.03 3,297,024,000	102.86 3,291,616,000	1.500000 2017/12/20	0.82%

16	126回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,044,000	101.42 3,245,568,000	0.100000 2020/12/20	0.81%
17	313回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	107.37 3,221,340,000	1.300000 2021/3/20	0.80%
18	325回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	106.20 3,186,010,000	106.42 3,192,690,000	0.800000 2022/9/20	0.79%
19	296回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	104.30 3,129,060,000	104.16 3,125,070,000	1.500000 2018/9/20	0.78%
20	301回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	105.44 3,057,818,000	1.500000 2019/6/20	0.76%
21	355回 利付国庫債券（2年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.36 3,010,950,000	100.46 3,014,010,000	0.100000 2017/8/15	0.75%
22	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	105.26 2,947,420,000	106.21 2,973,908,000	0.600000 2024/6/20	0.74%
23	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	105.32 2,948,960,000	1.000000 2020/9/20	0.73%
24	330回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.81 2,670,325,000	107.32 2,683,125,000	0.800000 2023/9/20	0.67%
25	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.86 2,671,625,000	107.16 2,679,025,000	1.000000 2022/3/20	0.67%
26	286回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,600,000,000	102.59 2,667,548,000	102.32 2,660,320,000	1.800000 2017/6/20	0.66%
27	306回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.34 2,658,700,000	106.30 2,657,600,000	1.400000 2020/3/20	0.66%
28	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	105.55 2,638,825,000	1.300000 2019/12/20	0.66%
29	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	123.85 2,601,039,000	1.600000 2033/3/20	0.65%
30	149回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	2,100,000,000	113.46 2,382,670,000	122.84 2,579,703,000	1.500000 2034/6/20	0.64%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
国債証券	82.62%
地方債証券	6.31%
特殊債券	5.51%
社債券	4.95%
合計	99.38%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28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	439,559	10,315.40 4,534,228,007	10,735.74 4,718,993,336	- -	1.78%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	596,787	5,542.37 3,307,617,349	5,590.66 3,336,436,193	- -	1.26%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	328,253	8,893.04 2,919,167,879	9,708.48 3,186,839,326	- -	1.20%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	220,226	11,174.74 2,460,969,392	12,376.50 2,725,628,740	- -	1.03%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	743,387	3,101.53 2,305,640,799	3,394.56 2,523,477,350	- -	0.95%
6	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	382,951	5,192.27 1,988,385,946	5,589.56 2,140,530,463	- -	0.81%
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	178,299	11,221.60 2,000,801,614	11,950.67 2,130,793,847	- -	0.80%
8	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	31,822	55,652.02 1,770,958,898	66,571.05 2,118,424,191	- -	0.80%
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	254,437	8,117.50 2,065,394,891	8,190.89 2,084,066,751	- -	0.79%
10	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	487,453	4,002.58 1,951,070,847	4,249.51 2,071,441,272	- -	0.78%
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	290,575	6,309.52 1,833,390,953	7,036.07 2,044,506,766	- -	0.77%
12	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	24,454	74,893.39 1,831,443,203	77,465.93 1,894,352,096	- -	0.72%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	214,929	8,888.65 1,910,429,193	8,767.92 1,884,481,889	- -	0.71%
14	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	324,572	5,499.57 1,785,007,245	5,672.97 1,841,289,653	- -	0.70%
15	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	22,941	77,581.17 1,779,789,793	79,180.23 1,816,473,771	- -	0.69%
16	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	493,340	3,222.25 1,589,669,748	3,621.75 1,786,754,145	- -	0.67%

17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	148,683	9,375.94 1,394,043,258	11,397.53 1,694,620,068	- -	0.64%
18	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	326,767	4,731.32 1,546,040,059	4,903.62 1,602,344,464	- -	0.61%
19	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	56,244	27,581.46 1,551,292,198	28,055.64 1,577,961,978	- -	0.60%
20	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	93,004	14,055.68 1,307,234,695	16,199.09 1,506,581,096	- -	0.57%
21	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	176,826	8,004.60 1,415,423,167	8,427.98 1,490,286,875	- -	0.56%
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	97,944	12,766.11 1,250,364,857	14,898.56 1,459,224,805	- -	0.55%
23	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	122,749	10,003.71 1,227,945,705	11,554.47 1,418,300,865	- -	0.54%
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	834,572	1,311.51 1,094,551,610	1,648.44 1,375,746,040	- -	0.52%
25	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	218,294	5,381.04 1,174,649,291	6,180.02 1,349,061,831	- -	0.51%
26	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	123,555	9,774.33 1,207,667,960	10,675.38 1,318,996,884	- -	0.50%
27	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	151,890	7,728.59 1,173,896,294	8,643.90 1,312,923,489	- -	0.50%
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	193,903	6,231.60 1,208,326,904	6,727.67 1,304,516,365	- -	0.49%
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	115,738	10,809.27 1,251,044,159	11,263.64 1,303,631,455	- -	0.49%
30	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	370,286	3,143.23 1,163,897,766	3,484.56 1,290,284,709	- -	0.49%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
株式	94.93%
投資信託受益証券	0.32%
投資証券	2.27%
合計	97.52%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.41%
医薬品		6.56%
石油・ガス・消耗燃料		6.42%
保険		4.12%
ソフトウェア		3.06%
メディア		2.97%
各種電気通信サービス		2.85%
化学		2.60%
インターネットソフトウェア・サービス		2.59%
情報技術サービス		2.59%
バイオテクノロジー		2.44%
飲料		2.44%
コンピュータ・周辺機器		2.27%
食品		2.27%
食品・生活必需品小売り		2.12%
コングロマリット		2.10%
航空宇宙・防衛		2.05%
半導体・半導体製造装置		1.99%
専門小売り		1.95%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.94%
資本市場		1.87%
電力		1.83%
ホテル・レストラン・レジャー		1.79%
ヘルスケア機器・用品		1.70%
タバコ		1.58%
家庭用品		1.52%
各種金融サービス		1.44%
機械		1.32%
金属・鉱業		1.30%
インターネット販売・カタログ販売		1.27%
繊維・アパレル・贅沢品		1.23%
総合公益事業		1.19%
自動車		1.02%
通信機器		0.83%
陸運・鉄道		0.82%
エネルギー設備・サービス		0.75%
電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.70%
不動産管理・開発		0.65%
航空貨物・物流サービス		0.60%
自動車部品		0.58%
消費者金融		0.54%
複合小売り		0.53%
専門サービス		0.47%
家庭用耐久財		0.46%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.44%
商業サービス・用品		0.43%

無線通信サービス	0.40%
電子装置・機器・部品	0.38%
商社・流通業	0.33%
建設・土木	0.33%
建設資材	0.33%
容器・包装	0.32%
建設関連製品	0.26%
運送インフラ	0.25%
ガス	0.20%
旅客航空輸送業	0.17%
販売	0.10%
水道	0.10%
レジャー用品	0.09%
海運業	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
紙製品・林産品	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.03%
各種消費者サービス	0.02%
合計	94.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	2,271,825,000	104.09 2,364,810,797	103.58 2,353,269,926	2.125000 2021/12/31	0.88%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,975,500,000	109.69 2,167,024,725	109.28 2,158,846,155	3.625000 2020/2/15	0.81%
3	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	2,063,300,000	102.29 2,110,673,368	101.60 2,096,498,497	2.000000 2025/2/15	0.78%
4	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	2,085,250,000	99.98 2,084,832,950	99.92 2,083,769,472	0.750000 2017/12/31	0.78%
5	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	2,030,375,000	101.43 2,059,551,488	101.12 2,053,216,718	1.375000 2018/9/30	0.77%
6	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	1,975,500,000	102.92 2,033,283,375	102.48 2,024,650,440	3.125000 2017/4/30	0.76%
7	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	1,975,500,000	99.93 1,974,176,415	99.98 1,975,104,900	0.625000 2017/5/31	0.74%
8	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,975,500,000	99.70 1,969,711,785	99.76 1,970,778,555	0.500000 2017/7/31	0.74%
9	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,810,875,000	106.17 1,922,624,096	105.68 1,913,859,461	2.625000 2020/8/15	0.72%
10	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,865,750,000	101.72 1,897,952,845	101.48 1,893,437,730	1.500000 2018/12/31	0.71%
11	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,646,250,000	105.93 1,743,922,012	105.21 1,732,085,475	4.750000 2017/8/15	0.65%
12	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,646,250,000	103.65 1,706,380,927	103.23 1,699,555,575	2.375000 2018/6/30	0.64%
13	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,701,125,000	99.70 1,696,140,703	99.60 1,694,337,511	1.000000 2019/11/30	0.63%
14	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,536,500,000	109.57 1,683,543,050	109.04 1,675,491,790	3.500000 2020/5/15	0.63%
15	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,646,250,000	101.82 1,676,211,750	101.33 1,668,227,437	1.750000 2022/5/15	0.62%
16	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,536,500,000	105.34 1,618,656,655	104.79 1,610,129,080	3.500000 2018/2/15	0.60%
17	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,452,204,000	108.60 1,577,093,544	107.90 1,567,015,248	4.500000 2018/2/1	0.59%
18	US T N/B 1.875 08/31/17 アメリカ	国債証券	1,536,500,000	101.71 1,562,835,610	101.51 1,559,839,435	1.875000 2017/8/31	0.58%
19	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,426,750,000	106.89 1,525,167,215	106.39 1,517,919,325	3.125000 2019/5/15	0.57%
20	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,481,625,000	100.85 1,494,233,628	100.65 1,491,344,460	1.375000 2020/5/31	0.56%
21	US T N/B 8.75 05/15/17 アメリカ	国債証券	1,317,000,000	109.91 1,447,606,890	108.53 1,429,405,950	8.750000 2017/5/15	0.53%
22	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,317,000,000	108.00 1,422,360,000	107.32 1,413,509,760	4.000000 2018/8/15	0.53%
23	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,317,000,000	103.48 1,362,936,960	103.09 1,357,734,810	2.000000 2021/5/31	0.51%

24	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,317,000,000	101.92 1,342,378,590	101.42 1,335,714,570	2.000000 2025/8/15	0.50%
25	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,317,000,000	100.88 1,328,602,770	100.64 1,325,534,160	1.375000 2020/4/30	0.50%
26	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,141,904,000	112.58 1,285,669,713	112.17 1,280,930,812	2.500000 2020/10/25	0.48%
27	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,262,125,000	99.98 1,261,872,575	99.88 1,260,686,177	0.750000 2018/2/28	0.47%
28	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,207,250,000	104.15 1,257,423,310	103.64 1,251,290,480	2.125000 2021/8/15	0.47%
29	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,207,250,000	102.98 1,243,226,050	102.65 1,239,314,560	1.875000 2020/6/30	0.46%
30	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	1,207,250,000	100.53 1,213,660,497	100.37 1,211,777,187	1.125000 2019/5/31	0.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
国債証券	96.53%
合計	96.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	9,718	124,660.80 1,211,453,732	124,670.00 1,211,543,060	- -	3.28%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,167,083	540.45 1,171,206,020	530.53 1,149,713,379	- -	3.11%
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	454,900	2,337.78 1,063,459,726	2,256.92 1,026,675,182	- -	2.78%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	540,000	1,271.88 686,817,663	1,296.14 699,915,600	- -	1.89%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	35,068	16,265.85 570,410,955	15,448.29 541,740,984	- -	1.47%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,402,530	71.72 530,917,555	71.31 527,918,829	- -	1.43%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,494,235	61.51 399,465,993	59.85 388,709,188	- -	1.05%
8	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	43,500	8,665.98 376,970,397	8,522.08 370,710,806	- -	1.00%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,268,120	280.70 355,968,397	269.50 341,764,680	- -	0.93%
10	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	162,216	1,949.89 316,303,733	2,058.64 333,945,806	- -	0.90%
11	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,993,200	45.83 320,518,913	45.28 316,652,096	- -	0.86%
12	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	530,309	482.37 255,809,331	534.59 283,499,080	- -	0.77%
13	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	267,708	1,024.16 274,176,271	1,044.95 279,744,151	- -	0.76%
14	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	416,295	590.81 245,955,010	602.09 250,649,554	- -	0.68%
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	132,122	1,851.44 244,616,796	1,861.68 245,970,206	- -	0.67%

16	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	11,900	21,187.59 252,132,406	20,627.51 245,467,398	- -	0.66%
17	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	459,000	535.27 245,689,401	529.21 242,907,390	- -	0.66%
18	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,768,578	85.93 237,904,129	86.61 239,797,614	- -	0.65%
19	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,539,000	137.72 211,955,583	140.79 216,679,657	- -	0.59%
20	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	45,975	4,617.72 212,299,754	4,554.62 209,398,884	- -	0.57%
21	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	243,824	829.06 202,145,636	852.20 207,788,946	- -	0.56%
22	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	240,715	814.82 196,141,442	832.54 200,406,551	- -	0.54%
23	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	13,636	14,532.16 198,160,579	14,289.09 194,846,167	- -	0.53%
24	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	114,824	1,767.27 202,925,830	1,692.20 194,305,632	- -	0.53%
25	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,809	103,014.57 186,353,374	102,996.59 186,320,849	- -	0.50%
26	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,255,200	75.20 169,604,079	77.82 175,510,940	- -	0.48%
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	41,845	4,191.52 175,394,327	4,168.42 174,427,785	- -	0.47%
28	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	655,000	278.91 182,692,461	262.05 171,647,990	- -	0.46%
29	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	48,847	3,415.63 166,843,504	3,497.40 170,837,683	- -	0.46%
30	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV オランダ	株式 家庭用耐久財	255,411	677.90 173,143,496	663.21 169,391,512	- -	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
株式	94.72%
投資信託受益証券	0.70%
投資証券	0.34%
合計	95.76%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	15.76%
石油・ガス・消耗燃料		7.57%
インターネットソフトウェア・サービス		5.28%
コンピュータ・周辺機器		4.92%
半導体・半導体製造装置		4.71%
無線通信サービス		4.68%
保険		3.56%
金属・鉱業		2.94%
自動車		2.51%
不動産管理・開発		2.37%
コングロマリット		2.30%
メディア		2.18%
食品		2.18%
情報技術サービス		2.17%
電子装置・機器・部品		2.11%
化学		2.09%
各種電気通信サービス		1.98%
食品・生活必需品小売り		1.76%
各種金融サービス		1.66%
医薬品		1.62%
電力		1.34%
飲料		1.23%
資本市場		1.19%
パーソナル用品		1.13%
運送インフラ		1.09%
建設・土木		0.98%
建設資材		0.85%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.85%
家庭用耐久財		0.84%
タバコ		0.80%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.80%
自動車部品		0.79%
複合小売り		0.74%
機械		0.69%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.62%
ホテル・レストラン・レジャー		0.52%
繊維・アパレル・贅沢品		0.51%
家庭用品		0.49%

ガス	0.48%
専門小売り	0.45%
インターネット販売・カタログ販売	0.36%
紙製品・林産品	0.34%
水道	0.28%
不動産投資信託	0.27%
各種消費者サービス	0.25%
航空宇宙・防衛	0.24%
旅客航空輸送業	0.24%
電気設備	0.21%
バイオテクノロジー	0.19%
消費者金融	0.18%
陸運・鉄道	0.17%
ソフトウェア	0.16%
商業サービス・用品	0.16%
海運業	0.13%
航空貨物・物流サービス	0.11%
商社・流通業	0.10%
総合公益事業	0.10%
エネルギー設備・サービス	0.10%
容器・包装	0.08%
レジャー用品	0.07%
建設関連製品	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
販売	0.05%
通信機器	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03%
合計	94.72%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28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	2,015,284,375	121.92 2,457,135,473	121.62 2,451,009,009	7.500000 2030/3/31	4.60%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	932,875,000	93.37 871,072,031	92.47 862,676,156	4.250000 2025/1/7	1.62%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	812,150,000	102.64 833,606,125	101.75 826,362,625	4.750000 2044/3/8	1.55%
4	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	449,975,000	170.92 769,117,025	170.82 768,692,292	12.750000 2028/6/24	1.44%
5	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	603,625,000	120.36 726,558,718	119.37 720,577,343	6.050000 2040/1/11	1.35%
6	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	460,950,000	144.72 667,086,840	142.52 656,973,597	6.375000 2034/10/23	1.23%
7	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 メキシコ	国債証券	636,550,000	102.84 654,653,262	102.00 649,281,000	3.600000 2025/1/30	1.22%
8	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	614,600,000	102.25 628,428,500	101.50 623,819,000	4.875000 2021/1/22	1.17%
9	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	515,825,000	121.20 625,179,900	120.70 622,600,775	7.375000 2025/2/5	1.17%
10	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	548,750,000	114.27 627,084,062	113.37 622,145,312	5.550000 2045/1/21	1.17%
11	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	526,800,000	117.07 616,751,100	117.26 617,752,020	11.000000 2018/7/24	1.16%
12	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	406,075,000	151.58 615,528,485	150.88 612,726,567	8.750000 2033/11/21	1.15%
13	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	537,775,000	113.93 612,690,350	113.62 611,046,843	7.375000 2019/3/18	1.15%
14	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	581,675,000	105.90 615,993,825	104.90 610,177,075	4.000000 2023/10/2	1.15%
15	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	724,350,000	81.45 590,016,000	81.00 586,723,500	5.000000 2045/1/27	1.10%
16	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	504,850,000	116.84 589,867,837	116.06 585,954,152	5.625000 2050/11/18	1.10%
17	BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル	国債証券	537,775,000	108.77 584,962,012	108.74 584,830,312	5.875000 2019/1/15	1.10%
18	TURKEY 5.625 03/30/21 トルコ	国債証券	537,775,000	108.78 585,040,044	108.52 583,604,185	5.625000 2021/3/30	1.10%
19	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	504,850,000	113.77 574,393,087	113.60 573,514,648	6.375000 2021/3/29	1.08%

20	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	329,250,000	172.97 569,523,480	171.37 564,242,310	9.500000 2030/2/2	1.06%
21	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	515,825,000	109.87 566,762,718	108.84 561,460,037	6.000000 2041/1/14	1.05%
22	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	526,800,000	105.68 556,748,580	105.73 557,011,980	5.000000 2020/4/29	1.05%
23	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	417,050,000	133.00 554,676,500	132.33 551,882,265	7.350000 2025/7/21	1.04%
24	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	548,750,000	101.02 554,374,687	99.62 546,692,187	4.600000 2046/1/23	1.03%
25	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	504,850,000	108.25 546,500,125	106.75 538,927,375	6.125000 2041/1/18	1.01%
26	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	504,850,000	106.16 535,958,857	106.24 536,367,785	4.875000 2023/9/16	1.01%
27	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	493,875,000	108.52 535,972,905	108.24 534,580,177	4.875000 2021/5/5	1.00%
28	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	526,800,000	102.75 541,287,000	101.25 533,385,000	5.625000 2044/2/26	1.00%
29	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	515,825,000	104.00 536,458,000	103.40 533,363,050	3.625000 2022/3/15	1.00%
30	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20 メキシコ	国債証券	482,900,000	110.50 533,604,500	110.35 532,880,150	5.125000 2020/1/15	1.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
国債証券	97.24%
合計	97.24%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年4月28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 2806月	買建	324	4,225,194,976	4,297,860,000	1.53%

（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28年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2016年05月	売建	2,350,000	262,584,300	257,865,500	0.10%
		ユーロ売/円買201 6年05月	売建	540,000	68,251,680	67,024,800	0.03%
		イギリス・ポンド売/ 円買2016年05月	売建	150,000	24,354,450	23,917,500	0.01%
		カナダ・ドル売/円買 2016年05月	売建	170,000	15,090,832	14,818,900	0.01%
		オーストラリア・ドル 売/円買2016年0 5月	売建	170,000	14,429,600	14,169,500	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 5 0 0 F U T U R E J u n 1 6	買建	69	3,901,143,318	3,958,087,106	1.50%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 J u n 1 6	買建	300	1,073,255,710	1,141,283,400	0.43%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E J u n 1 6	買建	48	468,886,350	479,817,907	0.18%
	モントリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T J u n 1 6	買建	18	246,437,303	254,120,486	0.10%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S J u n 1 6	買建	22	229,145,670	236,413,980	0.09%

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年05月	買建	9,042,000	1,006,151,262	992,269,080	0.37%
		ユーロ買/円売201 6年05月	買建	4,801,000	604,078,623	595,900,120	0.22%
		メキシコ・ペソ買/円 売2016年05月	買建	31,426,000	201,252,104	199,240,840	0.07%
		イギリス・ポンド買/ 円売2016年05月	買建	1,240,000	201,212,320	197,718,000	0.07%
		ユーロ売/円買201 6年05月	売建	942,000	119,061,264	116,921,040	0.04%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28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	-	ブラジル・レアル買/ 円売2016年04月	買建	2,119,679	66,921,406	65,922,014	0.18%
		南アフリカ・ランド 買/円売2016年0 4月	買建	5,400,000	41,869,565	41,040,000	0.11%
		メキシコ・ペソ買/円 売2016年04月	買建	5,900,000	37,798,042	37,406,000	0.10%
		マレーシア・リンギッ ト買/円売2016年 04月	買建	1,120,000	31,883,755	31,561,600	0.09%
		インドネシア・ルピア 買/円売2016年0 4月	買建	2,000,000,000	16,873,388	16,600,000	0.04%
		コロンビア・ペソ買/ 円売2016年04月	買建	252,224,913	9,526,868	9,433,211	0.03%
		アメリカ・ドル売/円 買2016年04月	売建	1,841,058	204,873,024	202,037,791	0.55%
株価指数先物 取引	ICE - US	MINI MSCI EMG MKT Ju n16	買建	332	1,534,151,898	1,548,390,315	4.19%

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

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買 2 0 1 6 年 0 5 月	売建	1,950,000	216,986,835	213,993,000	0.40%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成28年4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。

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	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10月13日)	301	301	0.9926	0.9926
第2計算期間末 (平成28年4月11日)	240	240	0.9460	0.9460
平成27年8月末日	299	-	0.9993	-
9月末日	299	-	0.9848	-
10月末日	294	-	0.9964	-
11月末日	292	-	0.9962	-
12月末日	284	-	0.9806	-
平成28年1月末日	279	-	0.9642	-
2月末日	281	-	0.9473	-
3月末日	244	-	0.9509	-
4月末日	243	-	0.9544	-

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	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10月13日)	519	519	0.9901	0.9901
第2計算期間末 (平成28年4月11日)	418	418	0.9230	0.9230
平成27年8月末日	466	-	0.9991	-
9月末日	491	-	0.9789	-
10月末日	521	-	0.9952	-
11月末日	523	-	0.9953	-
12月末日	504	-	0.9732	-
平成28年1月末日	490	-	0.9549	-
2月末日	448	-	0.9239	-
3月末日	433	-	0.9272	-
4月末日	423	-	0.9342	-

【分配の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	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

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

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

【収益率の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	4.7

（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。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	収益率(%)
第1計算期間	1.0
第2計算期間	6.8

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	312,448,290	8,299,019
第2計算期間	41,355,881	91,105,022

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	538,147,596	13,046,804
第2計算期間	67,620,276	138,974,156

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年4月28日

基準価額・純資産の推移

〈設定日(2015年8月28日)～2016年4月28日〉



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年8月28日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

■DIAMコア資産設計ファンド

	(堅実型)	(積極型)
第1期(2015.10.13)	0円	0円
第2期(2016.04.11)	0円	0円
設定来累計	0円	0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■DIAMコア資産設計ファンド

(注)投資比率(%)は、各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。

(堅実型)

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	886回 政保公営企業債券	特殊債券	日本	1.800000	2018/6/19	29.88%
2	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	—	—	15.20%
3	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	—	—	10.12%
4	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	—	—	9.68%
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	—	—	5.05%
6	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	—	—	4.94%
7	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	—	—	4.85%

(積極型)

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	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	—	—	18.78%
2	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	—	—	12.55%
3	13回 政保東日本高速道路債券	特殊債券	日本	1.600000	2018/10/19	12.26%
4	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	—	—	12.09%
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	—	—	6.28%
6	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	—	—	6.15%
7	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	—	—	6.02%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2016年4月28日

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	82.62
内 日本	82.62
地方債証券	6.31
内 日本	6.31
特殊債券	5.51
内 日本	5.51
社債券	4.95
内 日本	4.87
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.62
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.26%
2	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.13%
3	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.13%
4	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.12%
5	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.06%

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.47
内 日本	98.47
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.53
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.49%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.04%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.84%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.66%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.58%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.53%
2	輸送用機器	9.21%
3	情報・通信業	8.26%
4	銀行業	7.37%
5	化学	6.11%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.53

■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	96.53
内 アメリカ	41.44
内 フランス	9.66
内 イタリア	9.60
内 イギリス	7.68
内 ドイツ	7.29
内 その他	20.86
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.47
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	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/12/31	0.88%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.81%
3	US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	アメリカ	2.000000	2025/2/15	0.78%
4	US T N/B 0.75 12/31/17	国債証券	アメリカ	0.750000	2017/12/31	0.78%
5	US T N/B 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	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)	0.74
為替予約取引(売建)	△0.04

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.93
内 アメリカ	57.70
内 イギリス	7.39
内 スイス	3.91
内 カナダ	3.76
内 フランス	3.66
内 その他	18.51
投資信託受益証券	0.32
内 オーストラリア	0.27
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.27
内 アメリカ	1.91
内 フランス	0.15
内 イギリス	0.14
内 香港	0.04
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.48
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	1.78%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.26%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.20%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.03%
5	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロメリット	0.95%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	8.41%
2	医薬品	6.56%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.42%
4	保険	4.12%
5	ソフトウェア	3.06%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.14
株価指数先物取引(買建)	2.29

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2016年4月28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	97.24
内 トルコ	14.48
内 メキシコ	13.00
内 ロシア	12.16
内 インドネシア	10.15
内 ブラジル	9.49
内 その他	37.96
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.76
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	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.62%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.55%
4	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	国債証券	ロシア	12.750000	2028/6/24	1.44%
5	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.050000	2040/1/11	1.35%

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(先建)	△0.40

■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	94.72
内 韓国	14.90
内 台湾	11.27
内 中国	10.42
内 インド	7.91
内 ケイマン諸島	7.41
内 その他	42.81
投資信託受益証券	0.70
内 メキシコ	0.70
投資証券	0.34
内 メキシコ	0.16
内 南アフリカ	0.13
内 トルコ	0.05
コールローン、その他の資産(負債控除後)	4.24
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	3.28%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体半導体製造装置	3.11%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェアサービス	2.78%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.89%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.47%

組入上位5業種(外国株式)

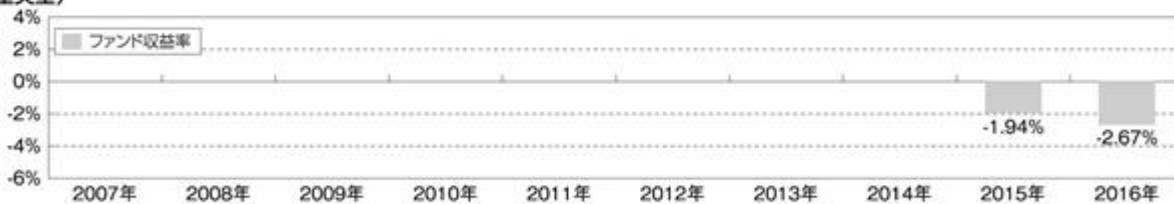
順位	業種	投資比率
1	商業銀行	15.76%
2	石油・ガス・消耗燃料	7.57%
3	インターネットソフトウェアサービス	5.28%
4	コンピュータ周辺機器	4.92%
5	半導体半導体製造装置	4.71%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.55
為替予約取引(先建)	△0.55
株価指数先物取引(買建)	4.19

年間収益率の推移

(堅実型)



(積極型)



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

※各ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
株式	国内株式 原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。 外国株式 原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。 外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

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

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

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

信託期間は、平成27年8月28日から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年4月12日から10月11日まで、および10月12日から翌年4月11日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合

しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

八．関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半年毎に自動的に更新されず。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年4月11日、10月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

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

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成27年8月28日から平成27年10月13日までとなっております。
- (4) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成27年10月14日から平成28年4月11日まで）の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	76,894,667
コール・ローン	98,167,877	-
国債証券	135,874,450	65,240,500
特殊債券	-	72,742,600
親投資信託受益証券	68,476,319	23,916,433
未収入金	-	3,400,000
未収利息	120,370	423,703
前払費用	274,068	-
流動資産合計	302,913,084	242,617,903
資産合計	302,913,084	242,617,903
負債の部		
流動負債		
未払解約金	594,840	378,939
未払受託者報酬	20,392	74,648
未払委託者報酬	408,133	1,493,751
その他未払費用	1,924	6,982
流動負債合計	1,025,289	1,954,320
負債合計	1,025,289	1,954,320
純資産の部		
元本等		
元本	1 304,149,271	1 254,400,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 2,261,476	2 13,736,547
（分配準備積立金）	96,525	164,278
元本等合計	301,887,795	240,663,583
純資産合計	301,887,795	240,663,583
負債純資産合計	302,913,084	242,617,903

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	第2期 自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
営業収益		
受取利息	131,559	1,029,025
有価証券売買等損益	1,948,931	12,731,636
営業収益合計	1,817,372	11,702,611
営業費用		
受託者報酬	20,392	74,648
委託者報酬	408,133	1,493,751
その他費用	23,524	6,982
営業費用合計	452,049	1,575,381
営業利益又は営業損失（ ）	2,269,421	13,277,992
経常利益又は経常損失（ ）	2,269,421	13,277,992
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,269,421	13,277,992
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（ ）	84,011	2,436,908
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	2,261,476
剰余金増加額又は欠損金減少額	773	857,916
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	773	857,916
剰余金減少額又は欠損金増加額	76,839	1,491,903
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	76,839	1,491,903
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,261,476	13,736,547

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4月11日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	300,159,380円 12,288,910円 8,299,019円	304,149,271円 41,355,881円 91,105,022円
2 . 受益権の総数	304,149,271口	254,400,130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2,261,476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13,736,547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1期 自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	第2期 自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1 . 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（96,525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（3,804円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は100,329円（1万口当たり3.30円）であります。分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（94,306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（23,062円）及び分配準備積立金（69,972円）より分配対象収益は187,340円（1万口当たり7.36円）であります。分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	第2期 自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これら(親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む)は、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4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1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	125,250	603,850
特殊債券	-	311,500
親投資信託受益証券	910,941	1,215,740
合計	785,691	2,131,090

(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1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	0.9926円	0.9460円
(1万口当たり純資産額)	(9,926円)	(9,460円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	2 8 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	65,000,000	65,240,500	
国債証券 合計		65,000,000	65,240,500	
特殊債券	8 8 6 回 政保公営企業債券	70,000,000	72,742,600	
特殊債券 合計		70,000,000	72,742,600	
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	3,595,142	6,725,072	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,989,847	2,592,770	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	943,052	2,366,683	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	2,723,108	4,768,434	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	6,092,755	5,072,218	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	1,414,359	2,391,256	
親投資信託受益証券 合計		16,758,263	23,916,433	
合計		151,758,263	161,899,533	

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。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成27年8月28日から平成27年10月13日までとなっております。

(4) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成27年10月14日から平成28年4月11日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

【D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	172,097,017
コール・ローン	146,847,791	-
国債証券	212,099,900	-
特殊債券	-	207,930,000
親投資信託受益証券	160,962,615	42,288,672
未収利息	286,960	387,897
前払費用	674,630	254,246
流動資産合計	520,871,896	422,957,832
負債の部		
流動負債		
未払解約金	279,999	1,394,582
未払受託者報酬	32,896	130,880
未払委託者報酬	658,139	2,618,420
その他未払費用	3,102	12,306
流動負債合計	974,136	4,156,188
純資産の部		
元本等		
元本	1 525,100,792	1 453,746,912
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 5,203,032	2 34,945,268
（分配準備積立金）	538,691	420,674
元本等合計	519,897,760	418,801,644
純資産合計	519,897,760	418,801,644
負債純資産合計	520,871,896	422,957,832

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	第2期 自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
営業収益		
受取利息	300,535	1,220,957
有価証券売買等損益	4,234,685	33,162,943
営業収益合計	3,934,150	31,941,986
営業費用		
受託者報酬	32,896	130,880
委託者報酬	658,139	2,618,420
その他費用	24,702	12,306
営業費用合計	715,737	2,761,606
営業利益又は営業損失()	4,649,887	34,703,592
経常利益又は経常損失()	4,649,887	34,703,592
当期純利益又は当期純損失()	4,649,887	34,703,592
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()	179,663	5,927,235
期首剰余金又は期首欠損金()	-	5,203,032
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,922	1,588,780
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,922	1,588,780
剰余金減少額又は欠損金増加額	736,730	2,554,659
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	736,730	2,554,659
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	5,203,032	34,945,268

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4月11日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	466,575,487円 71,572,109円 13,046,804円	525,100,792円 67,620,276円 138,974,156円
2 . 受益権の総数	525,100,792口	453,746,912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5,203,032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34,945,268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1期 自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	第2期 自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1 . 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（538,691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（30,088円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は568,779円（1万口当たり10.83円）であります。分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,761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（107,278円）及び分配準備積立金（407,913円）より分配対象収益は527,952円（1万口当たり11.64円）であります。分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	第2期 自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これら（親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む）は、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	第2期
	平成27年10月13日現在	平成28年4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1期	第2期
	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	297,300	-
特殊債券	-	652,000
親投資信託受益証券	2,027,981	1,647,143
合計	1,730,681	2,299,143

(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1期 平成27年10月13日現在	第2期 平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	0.9901円	0.9230円
(1万口当たり純資産額)	(9,901円)	(9,230円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
特殊債券	8 8 6 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,918,000	
	1 3 回 政保東日本高速道路債券	100,000,000	104,012,000	
特殊債券 合計		200,000,000	207,930,000	
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	6,378,449	11,931,526	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	3,480,335	4,534,876	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,694,210	4,251,789	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	4,757,811	8,331,402	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	10,784,555	8,978,142	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	2,520,221	4,260,937	
親投資信託受益証券 合計		29,615,581	42,288,672	
合計		229,615,581	250,218,672	

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）

「D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）」、「D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）」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27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		-	7,354,081,048
コール・ローン		15,699,526,390	-
株式	2	298,006,771,240	264,099,098,513
派生商品評価勘定		912,484,328	10,092,136
未収入金		270,897	-
未収配当金		2,254,145,788	2,788,200,509
前払金		-	411,409,000
流動資産合計		316,873,198,643	274,662,881,206
資産合計		316,873,198,643	274,662,881,206
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,777,864	480,904,268
前受金		1,048,336,000	-
未払解約金		95,077,000	177,596,000
流動負債合計		1,145,190,864	658,500,268
負債合計		1,145,190,864	658,500,268
純資産の部			
元本等			
元本	1	145,322,675,861	146,475,536,103
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		170,405,331,918	127,528,844,835
元本等合計		315,728,007,779	274,004,380,938
純資産合計		315,728,007,779	274,004,380,938
負債純資産合計		316,873,198,643	274,662,881,206

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4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	135,729,834,453円	145,322,675,861円
同期中追加設定元本額	10,867,207,942円	23,733,976,332円
同期中一部解約元本額	1,274,366,534円	22,581,116,090円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	4,904,881,467円	6,093,466,326円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,710,587,958円	1,677,220,569円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	7,734,360円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	15,572,830円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	35,759,464円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	17,774,809円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	12,903,531円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	13,331,289円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	37,051,819,937円	38,613,377,919円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	764,634,018円	858,954,036円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,684,633,915円	3,011,107,233円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	2,872,820,592円	3,044,058,246円
D I A M D C バランス30 インデックスファンド	373,358,353円	383,213,452円
D I A M D C バランス50 インデックスファンド	1,245,398,675円	1,245,532,615円
D I A M D C バランス70 インデックスファンド	1,086,857,834円	1,114,539,971円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	62,619,404円	64,838,938円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,203,210,489円	1,331,391,371円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	27,396,594円	30,640,565円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	23,756,350円	26,593,888円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	45,682,466円	54,495,702円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	101,283,311円	115,279,811円
投資のソムリエ	1,020,790,717円	1,345,982,599円
クルーズコントロール	155,459,929円	292,854,639円
投資のソムリエ<D C年金>	16,812,882円	26,676,139円
D I A M 8資産バランスマ ンドN<D C年金>	61,807,655円	87,001,387円
D I A M D C バランス・F (成長型)	31,375,738円	66,412,316円
クルーズコントロール<D C年 金>	49,425円	73,605円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	9,172,876円	3,595,142円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	21,543,025円	6,378,449円
投資のソムリエ<D C年金>リ スク抑制型	- 円	953,471円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	632,097円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	207,698,063円	221,564,648円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	118,114,707円	118,813,540円
D I A Mグローバル・バラン スファンド25VA(適格機関投 資家限定)	926,465,668円	320,848,113円
D I A Mグローバル・バラン スファンド50VA(適格機関投 資家限定)	504,047,033円	482,802,766円
D I A M国際分散バランスマ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	45,923,119円	40,879,493円
D I A M国際分散バランスマ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	188,212,246円	158,416,046円

D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家 限定)	46,957,650円	39,110,488円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	68,517,010円	59,191,101円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	6,574,581,132円	4,684,666,063円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	2,491,550,675円	1,820,937,489円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	2,353,033,392円	2,018,077,213円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,672,753,796円	1,641,054,193円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,338,155,069円	4,260,219,513円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	338,073,544円	340,382,917円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	907,582,858円	876,326,957円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,044,848,687円	1,028,624,777円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	4,367,379,494円	4,154,988,261円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	41,880,337円	46,003,219円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	1,418,624,773円	1,420,124,636円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	5,591,983,651円	5,701,386,854円
D I A Mグローバル分散ファン ドVA(適格機関投資家限定)	3,307,217円	- 円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	21,654,420,117円	22,006,032,379円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	846,229,797円	829,707,209円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	2,502,748,523円	2,520,313,494円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	13,786,277,812円	13,921,306,411円

D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	35,673円	39,346円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	16,727,956円	17,028,416円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	6,456,080円	6,337,348円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	12,371,832,331円	12,510,935,640円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	118,620,812円	116,283,534円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	43,123,009円	44,117,803円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	25,728,391円	30,178,969円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	42,787,484円	36,728,762円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	120,989円	129,034円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	709,042,970円	729,123,003円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,887,540,594円	1,971,158,603円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,485,634,300円	2,597,804,800円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	99,705,292円	105,546,296円
計	145,322,675,861円	146,475,536,103円
2. 受益権の総数	145,322,675,861口	146,475,536,103口
3. 2 差入代用有価証券	株式 3,658,000,000円	株式 2,639,000,000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27年8月28日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年10月13日現在	平成28年4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	15,187,364,441	20,689,953,715
合計	15,187,364,441	20,689,953,715

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年2月10日から平成27年10月13日まで及び平成28年2月9日から平成28年4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27年10月13日 現在				平成28年4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	18,086,804,000	-	18,997,920,000	911,116,000	11,252,509,000	-	10,781,970,000	470,539,000
合計	18,086,804,000	-	18,997,920,000	911,116,000	11,252,509,000	-	10,781,970,000	470,539,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	2.1726円	1.8706円
(1万口当たり純資産額)	(21,726円)	(18,706円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年4月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	68,000	259.00	17,612,000	
日本水産	180,200	591.00	106,498,200	
マルハニチロ	32,000	2,321.00	74,272,000	
ハウスイ	12,000	122.00	1,464,000	
サカタのタネ	23,100	2,691.00	62,162,100	
ホクト	16,000	2,106.00	33,696,000	
ショーボンドホールディングス	16,400	4,635.00	76,014,000	
ミライト・ホールディングス	48,200	894.00	43,090,800	
タマホーム	12,100	425.00	5,142,500	
サンヨーホームズ	3,400	491.00	1,669,400	
住石ホールディングス	46,500	92.00	4,278,000	
日鉄鉱業	43,000	394.00	16,942,000	
三井松島産業	103,000	111.00	11,433,000	
国際石油開発帝石	824,000	803.40	662,001,600	
日本海洋掘削	4,700	2,262.00	10,631,400	
石油資源開発	24,800	2,332.00	57,833,600	
K&Oエナジーグループ	10,500	1,279.00	13,429,500	
ダイセキ環境ソリューション	3,700	1,090.00	4,033,000	
安藤・間	104,400	543.00	56,689,200	
東急建設	50,900	890.00	45,301,000	
コムシスホールディングス	67,300	1,650.00	111,045,000	
ミサワホーム	18,500	700.00	12,950,000	
高松コンストラクショングループ	11,800	2,246.00	26,502,800	
東建コーポレーション	6,400	8,860.00	56,704,000	
ヤマウラ	7,200	473.00	3,405,600	
大成建設	812,000	725.00	588,700,000	
大林組	469,100	1,059.00	496,776,900	
清水建設	479,000	949.00	454,571,000	
飛鳥建設	125,600	171.00	21,477,600	
長谷工コーポレーション	182,500	992.00	181,040,000	
松井建設	17,300	709.00	12,265,700	
銭高組	22,000	440.00	9,680,000	
鹿島建設	733,000	681.00	499,173,000	
不動テトラ	110,900	118.00	13,086,200	
大末建設	6,000	719.00	4,314,000	
鉄建建設	95,000	266.00	25,270,000	
西松建設	181,000	473.00	85,613,000	
三井住友建設	599,400	96.00	57,542,400	
大豊建設	60,000	454.00	27,240,000	
前田建設工業	96,000	801.00	76,896,000	
佐田建設	10,900	401.00	4,370,900	
ナカノフドー建設	12,000	487.00	5,844,000	
奥村組	149,000	546.00	81,354,000	

東鉄工業	18,800	3,265.00	61,382,000
イチケン	17,000	279.00	4,743,000
浅沼組	50,000	271.00	13,550,000
戸田建設	182,000	511.00	93,002,000
熊谷組	229,000	288.00	65,952,000
青木あすなろ建設	10,400	681.00	7,082,400
北野建設	33,000	257.00	8,481,000
植木組	19,000	213.00	4,047,000
三井ホーム	20,000	497.00	9,940,000
矢作建設工業	21,300	764.00	16,273,200
ピーエス三菱	18,700	394.00	7,367,800
日本ハウスホールディングス	32,000	390.00	12,480,000
大東建託	58,400	16,190.00	945,496,000
新日本建設	18,600	497.00	9,244,200
N I P P O	36,000	1,762.00	63,432,000
東亜道路工業	30,000	338.00	10,140,000
前田道路	49,000	1,865.00	91,385,000
日本道路	47,000	465.00	21,855,000
東亜建設工業	137,000	245.00	33,565,000
若築建設	90,000	121.00	10,890,000
東洋建設	49,200	466.00	22,927,200
五洋建設	173,700	486.00	84,418,200
大林道路	18,300	701.00	12,828,300
世紀東急工業	24,700	455.00	11,238,500
福田組	25,000	1,100.00	27,500,000
日本ドライケミカル	1,900	2,256.00	4,286,400
住友林業	107,700	1,256.00	135,271,200
日本基礎技術	17,500	373.00	6,527,500
日成ビルド工業	43,000	373.00	16,039,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	81,000	80.00	6,480,000
巴コーポレーション	19,700	339.00	6,678,300
パナホーム	59,000	801.00	47,259,000
大和ハウス工業	462,000	2,897.50	1,338,645,000
ライト工業	30,100	1,117.00	33,621,700
積水ハウス	522,900	1,829.00	956,384,100
日特建設	17,400	376.00	6,542,400
北陸電気工事	5,800	766.00	4,442,800
ユアテック	25,000	896.00	22,400,000
西部電気工業	12,000	401.00	4,812,000
四電工	6,000	358.00	2,148,000
中電工	22,600	2,060.00	46,556,000
関電工	62,000	778.00	48,236,000
きんでん	94,700	1,300.00	123,110,000
東京エネシス	18,000	813.00	14,634,000
トーエネック	22,000	664.00	14,608,000
住友電設	12,400	1,358.00	16,839,200
日本電設工業	25,500	2,155.00	54,952,500
協和エクシオ	61,400	1,195.00	73,373,000
新日本空調	13,300	926.00	12,315,800
日本工営	49,000	338.00	16,562,000

N D S	25,000	286.00	7,150,000
九電工	29,000	2,823.00	81,867,000
三機工業	34,800	829.00	28,849,200
日揮	157,000	1,656.00	259,992,000
中外炉工業	47,000	177.00	8,319,000
ヤマト	14,400	434.00	6,249,600
太平電業	23,000	859.00	19,757,000
高砂熱学工業	46,800	1,340.00	62,712,000
三晃金属工業	16,000	334.00	5,344,000
N E C ネットエスアイ	17,300	1,672.00	28,925,600
朝日工業社	16,000	430.00	6,880,000
明星工業	28,600	430.00	12,298,000
大気社	19,200	2,583.00	49,593,600
ダイダン	20,000	705.00	14,100,000
日比谷総合設備	18,900	1,463.00	27,650,700
東芝プラントシステム	25,400	1,346.00	34,188,400
日本製粉	103,000	861.00	88,683,000
日清製粉グループ本社	171,600	1,755.00	301,158,000
日東富士製粉	8,000	347.00	2,776,000
昭和産業	65,000	453.00	29,445,000
鳥越製粉	12,800	625.00	8,000,000
中部飼料	14,600	812.00	11,855,200
フィード・ワン	95,200	120.00	11,424,000
東洋精糖	26,000	101.00	2,626,000
日本甜菜製糖	81,000	184.00	14,904,000
三井製糖	62,000	480.00	29,760,000
塩水港精糖	17,400	236.00	4,106,400
日新製糖	6,700	1,300.00	8,710,000
ネクスト	41,200	1,179.00	48,574,800
ジェイエイシーリクルートメント	6,700	1,360.00	9,112,000
日本M&Aセンター	22,500	6,610.00	148,725,000
ノバレーゼ	4,000	823.00	3,292,000
アコーディア・ゴルフ	40,500	1,046.00	42,363,000
中広	1,400	604.00	845,600
タケエイ	12,800	1,014.00	12,979,200
トラスト・テック	5,800	1,384.00	8,027,200
パソナグループ	12,600	673.00	8,479,800
C D S	3,500	864.00	3,024,000
リンクアンドモチベーション	29,700	137.00	4,068,900
G C A サヴィアン	12,900	1,079.00	13,919,100
エス・エム・エス	18,100	1,902.00	34,426,200
テンプホールディングス	102,200	1,682.00	171,900,400
リニカル	8,600	1,934.00	16,632,400
クックパッド	32,500	1,710.00	55,575,000
エスクリ	6,300	605.00	3,811,500
アイ・ケイ・ケイ	7,900	653.00	5,158,700
森永製菓	141,000	545.00	76,845,000
中村屋	35,000	445.00	15,575,000
江崎グリコ	36,100	5,500.00	198,550,000
名糖産業	7,200	1,265.00	9,108,000

不二家	91,000	188.00	17,108,000
山崎製パン	115,000	2,309.00	265,535,000
第一屋製パン	27,000	106.00	2,862,000
モロゾフ	24,000	418.00	10,032,000
亀田製菓	8,700	4,390.00	38,193,000
寿スピリッツ	11,100	2,337.00	25,940,700
カルビー	58,000	4,155.00	240,990,000
森永乳業	141,000	596.00	84,036,000
六甲バター	7,000	1,773.00	12,411,000
ヤクルト本社	83,900	5,280.00	442,992,000
明治ホールディングス	92,700	8,920.00	826,884,000
雪印メグミルク	36,800	2,756.00	101,420,800
プリマハム	99,000	276.00	27,324,000
日本ハム	115,000	2,380.00	273,700,000
林兼産業	51,000	96.00	4,896,000
丸大食品	81,000	431.00	34,911,000
S Foods	9,800	2,442.00	23,931,600
伊藤ハム米久ホールディングス	93,350	849.00	79,254,150
学情	5,400	1,212.00	6,544,800
スタジオアリス	6,700	2,634.00	17,647,800
シミックホールディングス	6,600	1,286.00	8,487,600
システナ	13,400	1,695.00	22,713,000
N J S	3,000	1,156.00	3,468,000
デジタルアーツ	6,700	2,382.00	15,959,400
新日鉄住金ソリューションズ	23,000	2,075.00	47,725,000
総合警備保障	48,700	6,060.00	295,122,000
キューブシステム	6,200	661.00	4,098,200
いちごグループホールディングス	114,200	468.00	53,445,600
日本駐車場開発	150,500	123.00	18,511,500
コア	5,800	1,301.00	7,545,800
カカクコム	104,700	2,106.00	220,498,200
アイロムグループ	4,100	1,154.00	4,731,400
ルネサンス	7,500	1,197.00	8,977,500
ディップ	16,100	2,690.00	43,309,000
S B Sホールディングス	13,800	671.00	9,259,800
オプトホールディング	9,200	617.00	5,676,400
新日本科学	13,800	428.00	5,906,400
ツクイ	17,300	1,464.00	25,327,200
キャリアデザインセンター	4,100	919.00	3,767,900
エムスリー	126,300	2,793.00	352,755,900
ツカダ・グローバルホールディング	10,800	734.00	7,927,200
アウトソーシング	6,800	3,875.00	26,350,000
ウェルネット	5,500	4,465.00	24,557,500
ディー・エヌ・エー	65,400	1,954.00	127,791,600
博報堂D Yホールディングス	202,100	1,194.00	241,307,400
ぐるなび	16,900	2,832.00	47,860,800
エスアールジータカミヤ	11,800	377.00	4,448,600
ジャパンベストレスキューシステム	17,100	224.00	3,830,400
ファンコミュニケーションズ	33,600	803.00	26,980,800
ジェイコムホールディングス	3,000	2,799.00	8,397,000

WDBホールディングス	5,200	963.00	5,007,600
ティア	6,200	608.00	3,769,600
バリューコマース	13,400	364.00	4,877,600
インフォマート	21,100	1,009.00	21,289,900
サッポロホールディングス	239,000	559.00	133,601,000
アサヒグループホールディングス	293,500	3,372.00	989,682,000
キリンホールディングス	634,000	1,548.00	981,432,000
宝ホールディングス	113,400	890.00	100,926,000
オエノンホールディングス	45,000	208.00	9,360,000
養命酒製造	5,000	1,894.00	9,470,000
コカ・コーラウエスト	53,000	2,693.00	142,729,000
コカ・コーライーストジャパン	55,400	1,720.00	95,288,000
サントリー食品インターナショナル	107,200	4,700.00	503,840,000
ダイドードリンコ	8,000	5,260.00	42,080,000
伊藤園	46,400	3,500.00	162,400,000
キーコーヒー	13,900	1,791.00	24,894,900
ユニカフェ	4,500	878.00	3,951,000
ジャパンフーズ	2,400	1,152.00	2,764,800
日清オイリオグループ	83,000	439.00	36,437,000
不二製油グループ本社	41,800	2,004.00	83,767,200
J-オイルミルズ	66,000	334.00	22,044,000
ローソン	52,200	9,070.00	473,454,000
サンエー	9,400	5,320.00	50,008,000
ダイユーエイト	3,700	671.00	2,482,700
カワチ薬品	10,700	2,012.00	21,528,400
エービーシー・マート	17,800	6,990.00	124,422,000
ハードオフコーポレーション	6,700	1,508.00	10,103,600
高千穂交易	5,500	861.00	4,735,500
アスクル	16,800	4,570.00	76,776,000
ゲオホールディングス	23,000	1,937.00	44,551,000
アダストリア	25,400	3,830.00	97,282,000
ジーフット	8,300	793.00	6,581,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	20,000	93.00	1,860,000
伊藤忠食品	3,300	4,140.00	13,662,000
くらコーポレーション	8,100	5,030.00	40,743,000
キャンドゥ	7,400	1,557.00	11,521,800
エレマテック	6,400	1,840.00	11,776,000
パル	8,000	2,591.00	20,728,000
JALUX	4,400	2,024.00	8,905,600
エディオン	58,300	849.00	49,496,700
あらた	6,200	2,392.00	14,830,400
サーラコーポレーション	11,900	552.00	6,568,800
ワッツ	5,500	855.00	4,702,500
トーマンデバイス	1,900	1,722.00	3,271,800
ハローズ	4,100	2,195.00	8,999,500
J Pホールディングス	36,300	434.00	15,754,200
あみやき亭	2,700	4,210.00	11,367,000
東京エレクトロン デバイス	5,100	1,442.00	7,354,200
ひらまつ	19,000	668.00	12,692,000
フィールズ	9,000	1,762.00	15,858,000

双日	867,600	212.00	183,931,200
ゲンキー	2,700	3,535.00	9,544,500
アルフレッサ ホールディングス	173,200	2,075.00	359,390,000
サッポロドラッグストア	1,400	2,132.00	2,984,800
大黒天物産	3,300	4,650.00	15,345,000
ハニーズ	12,100	1,030.00	12,463,000
ファーマライズホールディングス	3,300	579.00	1,910,700
キッコーマン	119,000	3,590.00	427,210,000
味の素	329,000	2,505.50	824,309,500
キュービー	79,600	2,945.00	234,422,000
ハウス食品グループ本社	53,500	2,034.00	108,819,000
カゴメ	56,300	2,237.00	125,943,100
焼津水産化学工業	7,900	988.00	7,805,200
アリアケジャパン	12,800	6,350.00	81,280,000
ピエトロ	1,500	1,843.00	2,764,500
エバラ食品工業	3,900	1,935.00	7,546,500
ニチレイ	167,000	957.00	159,819,000
横浜冷凍	34,300	1,041.00	35,706,300
東洋水産	76,900	3,880.00	298,372,000
イトアンド	1,700	2,108.00	3,583,600
日清食品ホールディングス	66,200	5,100.00	337,620,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,102.00	7,714,000
一正蒲鉾	5,500	970.00	5,335,000
フジッコ	15,200	2,259.00	34,336,800
ロック・フィールド	8,200	3,335.00	27,347,000
日本たばこ産業	924,700	4,655.00	4,304,478,500
ケンコーマヨネーズ	5,100	2,511.00	12,806,100
わらべや日洋	8,400	2,426.00	20,378,400
なとり	8,000	1,690.00	13,520,000
北の達人コーポレーション	2,100	493.00	1,035,300
ユージェナ	52,900	1,526.00	80,725,400
片倉工業	18,400	1,158.00	21,307,200
グンゼ	118,000	304.00	35,872,000
ヒューリック	287,200	1,033.00	296,677,600
神栄	19,000	99.00	1,881,000
山下医科器械	1,200	1,789.00	2,146,800
ラサ商事	6,800	545.00	3,706,000
アルペン	12,300	1,766.00	21,721,800
クオール	14,000	1,566.00	21,924,000
アルコニックス	7,800	1,428.00	11,138,400
神戸物産	8,900	2,397.00	21,333,300
ジェイアイエヌ	9,400	3,780.00	35,532,000
ビックカメラ	71,200	1,076.00	76,611,200
D C Mホールディングス	67,700	768.00	51,993,600
MonotaRO	48,600	3,190.00	155,034,000
東京一番フーズ	2,400	518.00	1,243,200
ダイヤモンドダイニング	2,300	983.00	2,260,900
あい ホールディングス	24,500	3,095.00	75,827,500
ディービーエックス	3,700	1,080.00	3,996,000
きちり	3,700	640.00	2,368,000

アーランドサービス	4,300	2,987.00	12,844,100
J.フロント リテイリング	174,300	1,422.00	247,854,600
ドトール・日レスホールディングス	24,100	1,796.00	43,283,600
マツモトキヨシホールディングス	28,400	5,650.00	160,460,000
ブロンコピリー	5,400	2,813.00	15,190,200
スタートトゥデイ	41,900	4,755.00	199,234,500
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,125.00	4,387,500
物語コーポレーション	3,600	5,520.00	19,872,000
ココカラファイン	14,400	4,825.00	69,480,000
三越伊勢丹ホールディングス	274,000	1,156.00	316,744,000
東洋紡	579,000	185.00	107,115,000
ユニチカ	426,000	54.00	23,004,000
富士紡ホールディングス	71,000	205.00	14,555,000
日清紡ホールディングス	77,500	1,099.00	85,172,500
倉敷紡績	150,000	183.00	27,450,000
ダイワボウホールディングス	126,000	207.00	26,082,000
シキボウ	90,000	109.00	9,810,000
日東紡績	97,000	339.00	32,883,000
トヨタ紡織	48,800	1,701.00	83,008,800
マクニカ・富士エレホールディングス	24,800	1,210.00	30,008,000
ウエルシアホールディングス	11,900	6,280.00	74,732,000
クリエイトSDホールディングス	20,300	2,689.00	54,586,700
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,000	893.00	21,432,000
八洲電機	10,800	539.00	5,821,200
U K Cホールディングス	8,800	2,109.00	18,559,200
丸善C H Iホールディングス	16,000	353.00	5,648,000
O C H Iホールディングス	3,300	953.00	3,144,900
T O K A Iホールディングス	60,700	573.00	34,781,100
ミサワ	1,800	484.00	871,200
エー・ピーカンパニー	2,300	1,135.00	2,610,500
三洋貿易	7,600	1,391.00	10,571,600
チムニー	3,400	2,849.00	9,686,600
シュッピン	3,900	1,242.00	4,843,800
ウイン・パートナーズ	5,000	1,476.00	7,380,000
ネクステージ	2,200	527.00	1,159,400
ジョイフル本田	22,400	2,403.00	53,827,200
キリン堂ホールディングス	4,400	946.00	4,162,400
ホットランド	3,600	1,073.00	3,862,800
すかいらく	42,100	1,400.00	58,940,000
綿半ホールディングス	3,800	1,315.00	4,997,000
日本毛織	45,000	725.00	32,625,000
大東紡織	24,000	57.00	1,368,000
トーア紡コーポレーション	6,400	476.00	3,046,400
ダイドーリミテッド	16,800	465.00	7,812,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,700	1,057.00	48,304,900
三栄建築設計	5,500	1,180.00	6,490,000
野村不動産ホールディングス	91,400	1,959.00	179,052,600
三重交通グループホールディングス	24,700	566.00	13,980,200

サムティ	7,300	1,026.00	7,489,800
ディア・ライフ	6,800	385.00	2,618,000
エー・ディー・ワークス	95,700	44.00	4,210,800
日本商業開発	4,500	2,127.00	9,571,500
プレサンスコーポレーション	4,700	3,915.00	18,400,500
ユニゾホールディングス	8,600	4,820.00	41,452,000
日本管理センター	9,000	1,630.00	14,670,000
サンセイランディック	3,100	927.00	2,873,700
エストラスト	2,400	534.00	1,281,600
フージャースホールディングス	19,200	519.00	9,964,800
オープンハウス	19,900	2,086.00	41,511,400
東急不動産ホールディングス	333,300	747.00	248,975,100
飯田グループホールディングス	127,600	2,108.00	268,980,800
ムゲンエステート	2,000	2,013.00	4,026,000
帝国繊維	15,300	1,417.00	21,680,100
ブックオフコーポレーション	8,000	856.00	6,848,000
日本コークス工業	118,800	74.00	8,791,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,800	1,017.00	2,847,600
ミタチ産業	3,600	610.00	2,196,000
あさひ	10,300	1,711.00	17,623,300
日本調剤	3,500	3,315.00	11,602,500
コスモス薬品	6,900	18,190.00	125,511,000
シップヘルスケアホールディングス	28,000	2,833.00	79,324,000
トーエル	6,700	782.00	5,239,400
一六堂	3,600	326.00	1,173,600
ソフトクリエイトホールディングス	5,200	825.00	4,290,000
セブン&アイ・ホールディングス	576,300	4,642.00	2,675,184,600
薬王堂	1,900	3,440.00	6,536,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	36,900	1,037.00	38,265,300
明治電機工業	4,400	1,101.00	4,844,400
ツルハホールディングス	31,600	11,160.00	352,656,000
デリカフーズ	3,300	903.00	2,979,900
スターティア	2,600	487.00	1,266,200
サンマルクホールディングス	10,900	2,873.00	31,315,700
フェリシモ	4,000	1,047.00	4,188,000
トリドール	16,900	2,015.00	34,053,500
クスリのアオキ	12,300	6,260.00	76,998,000
帝人	598,000	372.00	222,456,000
東レ	1,061,000	895.40	950,019,400
クラレ	230,700	1,283.00	295,988,100
旭化成	912,000	701.80	640,041,600
サカイオーベックス	39,000	163.00	6,357,000
稲葉製作所	7,900	1,319.00	10,420,100
宮地エンジニアリンググループ	45,000	135.00	6,075,000
トーカロ	10,300	1,891.00	19,477,300
アルファ	5,000	982.00	4,910,000
SUMCO	114,400	626.00	71,614,400
川田テクノロジーズ	2,800	3,000.00	8,400,000
住江織物	37,000	314.00	11,618,000

日本フエルト	7,800	430.00	3,354,000
イチカワ	10,000	262.00	2,620,000
エコナックホールディングス	43,000	48.00	2,064,000
日東製網	16,000	149.00	2,384,000
芦森工業	32,000	147.00	4,704,000
アツギ	114,000	111.00	12,654,000
ダイニック	28,000	143.00	4,004,000
共和レザー	9,600	809.00	7,766,400
セーレン	36,400	1,135.00	41,314,000
東海染工	21,000	127.00	2,667,000
小松精練	22,500	605.00	13,612,500
ワコールホールディングス	87,000	1,317.00	114,579,000
ホギメディカル	9,200	5,970.00	54,924,000
レナウン	39,600	107.00	4,237,200
クラウドシア	3,600	552.00	1,987,200
T S Iホールディングス	65,200	669.00	43,618,800
I Tホールディングス	45,700	2,466.00	112,696,200
ネオス	4,000	519.00	2,076,000
電算システム	4,800	1,516.00	7,276,800
グリー	83,600	598.00	49,992,800
コーエーテクモホールディングス	32,700	1,671.00	54,641,700
三菱総合研究所	5,400	3,470.00	18,738,000
ボルテージ	2,700	1,202.00	3,245,400
電算	1,600	2,258.00	3,612,800
A G S	2,600	926.00	2,407,600
ファインデックス	9,000	1,370.00	12,330,000
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	2,236.00	6,931,600
ブレインパッド	2,000	710.00	1,420,000
K L a b	21,300	611.00	13,014,300
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	9,100	938.00	8,535,800
イーブックイニシアティブジャパン	3,000	551.00	1,653,000
ネクソン	131,700	1,783.00	234,821,100
アイスタイル	20,900	957.00	20,001,300
エムアップ	3,500	524.00	1,834,000
エイチーム	5,000	1,627.00	8,135,000
テクノスジャパン	1,500	4,945.00	7,417,500
e n i s h	4,000	600.00	2,400,000
コロプラ	38,300	2,389.00	91,498,700
モバイルクリエイイト	9,300	457.00	4,250,100
オルトプラス	5,000	378.00	1,890,000
ブロードリーフ	14,200	1,196.00	16,983,200
ハーツユナイテッドグループ	4,100	2,319.00	9,507,900
メディアドゥ	2,900	1,424.00	4,129,600
ブイキューブ	6,700	1,214.00	8,133,800
サイバーリンクス	1,500	966.00	1,449,000
VOYAGE GROUP	3,100	1,400.00	4,340,000
オブティム	900	5,330.00	4,797,000
特種東海製紙	85,000	349.00	29,665,000
ベリサーブ	1,600	4,600.00	7,360,000

ティーガイア	13,700	1,318.00	18,056,600
日本アジアグループ	11,700	483.00	5,651,100
豆蔵ホールディングス	10,800	667.00	7,203,600
テクマトリックス	5,900	1,931.00	11,392,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	240,700	288.00	69,321,600
GMOペイメントゲートウェイ	12,000	8,060.00	96,720,000
ザッパラス	8,000	369.00	2,952,000
インターネットイニシアティブ	22,300	2,258.00	50,353,400
さくらインターネット	6,700	1,241.00	8,314,700
GMOクラウド	3,200	1,059.00	3,388,800
SRAホールディングス	7,900	2,323.00	18,351,700
MINORIソリューションズ	2,000	851.00	1,702,000
システムインテグレータ	2,000	704.00	1,408,000
朝日ネット	12,800	472.00	6,041,600
コムチュア	2,300	2,284.00	5,253,200
王子ホールディングス	600,000	427.00	256,200,000
日本製紙	75,600	1,995.00	150,822,000
三菱製紙	224,000	79.00	17,696,000
北越紀州製紙	90,700	646.00	58,592,200
中越パルプ工業	58,000	211.00	12,238,000
巴川製紙所	21,000	166.00	3,486,000
大王製紙	64,700	915.00	59,200,500
gumi	14,200	852.00	12,098,400
パイプドHD	1,800	1,325.00	2,385,000
レンゴー	129,000	568.00	73,272,000
トーモク	46,000	265.00	12,190,000
ザ・パック	10,400	2,467.00	25,656,800
昭和電工	974,000	107.00	104,218,000
住友化学	1,076,000	461.00	496,036,000
日本化成	28,000	108.00	3,024,000
住友精化	30,000	506.00	15,180,000
日産化学工業	87,900	2,743.00	241,109,700
ラサ工業	55,000	103.00	5,665,000
クレハ	110,000	338.00	37,180,000
多木化学	8,000	617.00	4,936,000
テイカ	25,000	481.00	12,025,000
石原産業	263,000	71.00	18,673,000
片倉コープアグリ	18,000	214.00	3,852,000
日東エフシー	8,600	866.00	7,447,600
日本曹達	94,000	507.00	47,658,000
東ソー	394,000	435.00	171,390,000
トクヤマ	243,000	160.00	38,880,000
セントラル硝子	158,000	594.00	93,852,000
東亜合成	91,600	894.00	81,890,400
大阪ソーダ	63,000	404.00	25,452,000
関東電化工業	35,000	768.00	26,880,000
デンカ	303,000	456.00	138,168,000
イビデン	85,400	1,349.00	115,204,600
信越化学工業	262,200	5,821.00	1,526,266,200

日本カーバイド工業	50,000	142.00	7,100,000
堺化学工業	59,000	289.00	17,051,000
エア・ウォーター	121,000	1,537.00	185,977,000
大陽日酸	112,600	964.00	108,546,400
日本化学工業	54,000	193.00	10,422,000
日本パーカライジング	74,700	943.00	70,442,100
高压ガス工業	20,000	617.00	12,340,000
チタン工業	18,000	172.00	3,096,000
四国化成工業	21,000	887.00	18,627,000
戸田工業	29,000	308.00	8,932,000
ステラ ケミファ	7,500	2,140.00	16,050,000
保土谷化学工業	44,000	188.00	8,272,000
日本触媒	21,200	5,400.00	114,480,000
大日精化工業	57,000	430.00	24,510,000
カネカ	197,000	940.00	185,180,000
協和発酵キリン	175,000	1,774.00	310,450,000
三菱瓦斯化学	251,000	563.00	141,313,000
三井化学	620,000	334.00	207,080,000
J S R	137,200	1,504.00	206,348,800
東京応化工業	29,300	2,846.00	83,387,800
大阪有機化学工業	10,500	590.00	6,195,000
三菱ケミカルホールディングス	979,400	523.50	512,715,900
日本合成化学工業	34,000	658.00	22,372,000
ダイセル	205,600	1,364.00	280,438,400
住友ベークライト	137,000	431.00	59,047,000
積水化学工業	331,900	1,343.00	445,741,700
日本ゼオン	126,000	682.00	85,932,000
アイカ工業	44,000	2,241.00	98,604,000
宇部興産	782,000	185.00	144,670,000
積水樹脂	22,700	1,454.00	33,005,800
タキロン	34,000	531.00	18,054,000
旭有機材	48,000	199.00	9,552,000
日立化成	72,200	1,814.00	130,970,800
ニチバン	14,000	609.00	8,526,000
リケンテクノス	23,800	387.00	9,210,600
大倉工業	35,000	275.00	9,625,000
積水化成品工業	38,000	306.00	11,628,000
群栄化学工業	39,000	299.00	11,661,000
タイガースポリマー	7,300	568.00	4,146,400
ミライアル	5,500	772.00	4,246,000
ダイキアクシス	2,900	837.00	2,427,300
ダイキョーニシカワ	18,800	1,464.00	27,523,200
日本化薬	95,000	1,095.00	104,025,000
カーリットホールディングス	13,800	474.00	6,541,200
E P Sホールディングス	16,300	1,340.00	21,842,000
レグス	2,100	635.00	1,333,500
プレステージ・インターナショナル	12,300	1,331.00	16,371,300
フェイス	3,700	1,335.00	4,939,500
アミューズ	8,000	2,129.00	17,032,000
野村総合研究所	96,500	3,885.00	374,902,500

ドリームインキュベータ	4,800	2,201.00	10,564,800
サイバネットシステム	11,200	779.00	8,724,800
クイック	7,500	874.00	6,555,000
T A C	8,200	196.00	1,607,200
C Eホールディングス	1,800	794.00	1,429,200
ケネディクス	195,600	461.00	90,171,600
電通	162,500	5,290.00	859,625,000
インテージホールディングス	7,200	1,387.00	9,986,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	440.00	2,992,000
東邦システムサイエンス	4,300	605.00	2,601,500
ぴあ	4,400	1,954.00	8,597,600
イオンファンタジー	5,100	2,155.00	10,990,500
ソースネクスト	7,100	474.00	3,365,400
シーティーエス	3,500	779.00	2,726,500
ネクシィーズグループ	5,200	1,043.00	5,423,600
メディカルシステムネットワーク	15,600	598.00	9,328,800
ティー・ワイ・オー	19,500	164.00	3,198,000
日本精化	12,200	729.00	8,893,800
扶桑化学工業	9,200	1,678.00	15,437,600
A D E K A	71,900	1,519.00	109,216,100
日油	111,000	777.00	86,247,000
ミヨシ油脂	55,000	121.00	6,655,000
新日本理化	24,100	137.00	3,301,700
ハリマ化成グループ	12,500	490.00	6,125,000
花王	393,200	5,612.00	2,206,638,400
第一工業製薬	33,000	316.00	10,428,000
三洋化成工業	46,000	777.00	35,742,000
武田薬品工業	582,300	5,105.00	2,972,641,500
アステラス製薬	1,637,300	1,448.00	2,370,810,400
大日本住友製薬	103,600	1,356.00	140,481,600
塩野義製薬	213,100	5,286.00	1,126,446,600
田辺三菱製薬	170,400	1,897.00	323,248,800
わかもと製薬	7,000	253.00	1,771,000
あすか製薬	18,600	1,390.00	25,854,000
日本新薬	33,500	4,550.00	152,425,000
バイオフェルミン製薬	2,400	3,830.00	9,192,000
中外製薬	145,600	3,365.00	489,944,000
科研製薬	25,200	6,820.00	171,864,000
エーザイ	180,000	6,863.00	1,235,340,000
理研ビタミン	4,700	3,875.00	18,212,500
ロート製薬	71,600	1,957.00	140,121,200
小野薬品工業	332,000	5,136.00	1,705,152,000
久光製薬	45,400	5,550.00	251,970,000
有機合成薬品工業	10,000	236.00	2,360,000
持田製薬	10,100	8,130.00	82,113,000
参天製薬	269,300	1,638.00	441,113,400
扶桑薬品工業	50,000	245.00	12,250,000
日本ケミファ	18,000	452.00	8,136,000
ツムラ	46,000	2,757.00	126,822,000
日医工	34,200	2,505.00	85,671,000

テルモ	214,000	3,990.00	853,860,000
みらかホールディングス	37,200	4,555.00	169,446,000
キッセイ薬品工業	25,900	2,552.00	66,096,800
生化学工業	28,000	1,677.00	46,956,000
栄研化学	12,300	2,180.00	26,814,000
日水製薬	6,000	1,250.00	7,500,000
鳥居薬品	10,000	2,563.00	25,630,000
J C Rファーマ	11,300	2,756.00	31,142,800
東和薬品	6,700	4,525.00	30,317,500
富士製薬工業	4,100	1,850.00	7,585,000
沢井製薬	24,800	6,940.00	172,112,000
ゼリア新薬工業	30,000	1,355.00	40,650,000
第一三共	491,800	2,534.00	1,246,221,200
キョーリン製薬ホールディングス	39,000	2,160.00	84,240,000
大幸薬品	7,200	1,375.00	9,900,000
ダイト	6,100	3,195.00	19,489,500
大塚ホールディングス	314,400	3,875.00	1,218,300,000
大正製薬ホールディングス	35,200	8,660.00	304,832,000
ペプチドリーム	18,000	6,830.00	122,940,000
大日本塗料	84,000	190.00	15,960,000
日本ペイントホールディングス	112,800	2,331.00	262,936,800
関西ペイント	165,400	1,789.00	295,900,600
神東塗料	11,000	164.00	1,804,000
中国塗料	42,000	695.00	29,190,000
日本特殊塗料	10,300	843.00	8,682,900
藤倉化成	20,000	484.00	9,680,000
太陽ホールディングス	10,700	3,495.00	37,396,500
D I C	577,000	246.00	141,942,000
サカタインクス	29,800	1,192.00	35,521,600
東洋インキ S Cホールディングス	145,000	417.00	60,465,000
T & K T O K A	10,600	874.00	9,264,400
アルプス技研	5,400	2,278.00	12,301,200
サニックス	23,300	194.00	4,520,200
ダイオーズ	2,700	1,028.00	2,775,600
日本空調サービス	14,400	538.00	7,747,200
オリエンタルランド	157,600	7,687.00	1,211,471,200
ダスキン	41,300	1,980.00	81,774,000
パーク24	69,500	3,180.00	221,010,000
明光ネットワークジャパン	16,900	1,230.00	20,787,000
ファルコホールディングス	6,400	1,318.00	8,435,200
クレスコ	3,200	1,639.00	5,244,800
フジ・メディア・ホールディングス	143,500	1,200.00	172,200,000
秀英予備校	2,500	403.00	1,007,500
田谷	3,000	667.00	2,001,000
ラウンドワン	45,500	643.00	29,256,500
リゾートトラスト	61,100	2,335.00	142,668,500
オービック	47,500	5,750.00	273,125,000
ジャストシステム	25,100	900.00	22,590,000
T D Cソフトウェアエンジニアリング	6,000	607.00	3,642,000
ヤフー	987,400	489.00	482,838,600

ビー・エム・エル	8,600	4,430.00	38,098,000
ワタベウェディング	4,300	424.00	1,823,200
トレンドマイクロ	66,900	3,905.00	261,244,500
りらいあコミュニケーションズ	24,100	1,131.00	27,257,100
インフォメーション・ディベロプメント	2,900	800.00	2,320,000
リソー教育	27,200	357.00	9,710,400
日本オラクル	22,100	5,990.00	132,379,000
早稲田アカデミー	2,100	882.00	1,852,200
アルファシステムズ	4,500	1,654.00	7,443,000
フューチャー	16,600	833.00	13,827,800
C A C Holdings	10,300	797.00	8,209,100
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	1,410.00	5,217,000
トーセ	3,800	682.00	2,591,600
ユー・エス・エス	176,500	1,720.00	303,580,000
オービックビジネスコンサルタント	7,000	4,440.00	31,080,000
伊藤忠テクノソリューションズ	31,200	1,989.00	62,056,800
アイティフォー	17,900	470.00	8,413,000
東京個別指導学院	7,100	753.00	5,346,300
東計電算	2,500	1,970.00	4,925,000
サイバーエージェント	35,600	5,160.00	183,696,000
楽天	682,100	1,237.00	843,757,700
エクスネット	1,500	1,505.00	2,257,500
テー・オー・ダブリュー	8,800	663.00	5,834,400
大塚商会	37,100	5,460.00	202,566,000
総合メディカル	6,700	3,430.00	22,981,000
サイボウズ	18,600	330.00	6,138,000
ソフトブレイン	21,000	155.00	3,255,000
セントラルスポーツ	5,000	2,248.00	11,240,000
パラカ	4,800	1,391.00	6,676,800
電通国際情報サービス	8,500	2,246.00	19,091,000
イーエムシステムズ	4,600	1,155.00	5,313,000
ウェザーニューズ	4,600	3,590.00	16,514,000
C I J	12,700	446.00	5,664,200
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,343.00	2,014,500
日本エンタープライズ	14,300	255.00	3,646,500
WOWOW	6,600	2,364.00	15,602,400
フュージョンパートナー	8,000	526.00	4,208,000
フルキャストホールディングス	13,300	826.00	10,985,800
富士フイルムホールディングス	334,600	4,016.00	1,343,753,600
コニカミノルタ	348,600	911.00	317,574,600
資生堂	277,400	2,395.00	664,373,000
ライオン	169,000	1,372.00	231,868,000
高砂香料工業	9,600	2,387.00	22,915,200
マンダム	13,600	4,745.00	64,532,000
ミルボン	8,600	4,535.00	39,001,000
ファンケル	34,000	1,462.00	49,708,000
コーセー	23,600	10,500.00	247,800,000
コタ	5,060	1,104.00	5,586,240
シーズ・ホールディングス	18,400	2,243.00	41,271,200

シーボン	1,600	2,290.00	3,664,000
ポーラ・オルビスホールディングス	14,900	9,180.00	136,782,000
ノエビアホールディングス	9,200	3,060.00	28,152,000
アジュバンコスメジャパン	3,100	912.00	2,827,200
エステー	10,200	1,047.00	10,679,400
アグロ カネショウ	5,700	1,028.00	5,859,600
コニシ	23,000	1,336.00	30,728,000
長谷川香料	18,500	1,676.00	31,006,000
星光PMC	8,000	1,272.00	10,176,000
小林製薬	22,100	9,120.00	201,552,000
荒川化学工業	12,500	898.00	11,225,000
メック	11,300	789.00	8,915,700
日本高純度化学	4,200	1,998.00	8,391,600
JCU	4,300	3,365.00	14,469,500
新田ゼラチン	9,700	714.00	6,925,800
OATアグリオ	1,300	1,412.00	1,835,600
デクセリアルズ	32,800	976.00	32,012,800
アース製薬	10,500	4,330.00	45,465,000
イハラケミカル工業	22,500	1,304.00	29,340,000
北興化学工業	16,000	286.00	4,576,000
大成ラミック	4,200	2,784.00	11,692,800
クミアイ化学工業	30,100	915.00	27,541,500
日本農薬	33,400	510.00	17,034,000
昭和シェル石油	147,000	965.00	141,855,000
富士興産	5,500	397.00	2,183,500
ニチレキ	18,000	740.00	13,320,000
東燃ゼネラル石油	220,000	961.00	211,420,000
ユシロ化学工業	7,900	1,225.00	9,677,500
ビーピー・カストロール	6,000	1,238.00	7,428,000
富士石油	34,000	314.00	10,676,000
MORESCO	4,600	1,141.00	5,248,600
出光興産	76,300	1,928.00	147,106,400
JXホールディングス	1,730,700	436.70	755,796,690
コスモエネルギーホールディングス	44,100	1,294.00	57,065,400
横浜ゴム	88,200	1,706.00	150,469,200
東洋ゴム工業	66,100	1,463.00	96,704,300
ブリヂストン	493,400	3,905.00	1,926,727,000
住友ゴム工業	136,800	1,567.00	214,365,600
藤倉ゴム工業	12,300	406.00	4,993,800
オカモト	46,000	926.00	42,596,000
アキレス	120,000	136.00	16,320,000
フコク	5,400	837.00	4,519,800
ニッタ	15,800	2,609.00	41,222,200
クリエートメディック	4,900	849.00	4,160,100
住友理工	31,600	886.00	27,997,600
三ツ星ベルト	36,000	825.00	29,700,000
バンドー化学	53,000	511.00	27,083,000
鬼怒川ゴム工業	32,000	767.00	24,544,000
旭硝子	771,000	587.00	452,577,000
日本板硝子	705,000	80.00	56,400,000

石塚硝子	21,000	192.00	4,032,000
有沢製作所	21,500	537.00	11,545,500
日本山村硝子	59,000	160.00	9,440,000
日本電気硝子	302,000	545.00	164,590,000
オハラ	5,900	515.00	3,038,500
住友大阪セメント	289,000	461.00	133,229,000
太平洋セメント	912,000	268.00	244,416,000
デイ・シイ	13,600	304.00	4,134,400
リゾートソリューション	14,000	296.00	4,144,000
日本ヒューム	14,100	538.00	7,585,800
日本コンクリート工業	30,200	256.00	7,731,200
三谷セキサン	7,400	1,475.00	10,915,000
アジアパイルホールディングス	18,000	393.00	7,074,000
東海カーボン	127,000	252.00	32,004,000
日本カーボン	72,000	212.00	15,264,000
東洋炭素	8,100	1,329.00	10,764,900
ノリタケカンパニーリミテド	83,000	236.00	19,588,000
TOTO	107,400	3,390.00	364,086,000
日本碍子	185,000	1,915.00	354,275,000
日本特殊陶業	125,900	1,898.00	238,958,200
ダントーホールディングス	17,000	185.00	3,145,000
MARUWA	5,400	2,652.00	14,320,800
品川リフラクトリーズ	37,000	193.00	7,141,000
黒崎播磨	32,000	234.00	7,488,000
ヨータイ	8,000	282.00	2,256,000
イソライト工業	7,100	181.00	1,285,100
東京窯業	17,000	163.00	2,771,000
ニッカトー	5,500	355.00	1,952,500
フジインコーポレーテッド	12,900	1,399.00	18,047,100
エーアンドエーマテリアル	32,000	73.00	2,336,000
ニチアス	75,000	681.00	51,075,000
新日鐵住金	659,100	2,075.50	1,367,962,050
神戸製鋼所	2,684,000	100.00	268,400,000
中山製鋼所	165,000	64.00	10,560,000
合同製鐵	82,000	192.00	15,744,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	399,500	1,512.50	604,243,750
日新製鋼	66,700	1,297.00	86,509,900
東京製鐵	80,600	647.00	52,148,200
共英製鋼	15,600	1,606.00	25,053,600
大和工業	32,300	2,341.00	75,614,300
東京鐵鋼	30,000	337.00	10,110,000
大阪製鐵	9,200	1,638.00	15,069,600
淀川製鋼所	21,800	2,396.00	52,232,800
東洋鋼鈑	35,000	319.00	11,165,000
丸一鋼管	48,900	2,993.00	146,357,700
モリ工業	21,000	289.00	6,069,000
大同特殊鋼	245,000	365.00	89,425,000
日本高周波鋼業	58,000	73.00	4,234,000
日本冶金工業	107,500	127.00	13,652,500

山陽特殊製鋼	87,000	465.00	40,455,000
愛知製鋼	86,000	409.00	35,174,000
日立金属	167,300	1,080.00	180,684,000
日本金属	38,000	96.00	3,648,000
大平洋金属	102,000	307.00	31,314,000
新日本電工	82,900	163.00	13,512,700
栗本鐵工所	70,000	154.00	10,780,000
虹 技	21,000	153.00	3,213,000
日本鑄鉄管	16,000	131.00	2,096,000
日本製鋼所	242,000	343.00	83,006,000
三菱製鋼	102,000	176.00	17,952,000
日亜鋼業	18,800	225.00	4,230,000
日本精線	10,000	401.00	4,010,000
大紀アルミニウム工業所	23,000	256.00	5,888,000
日本軽金属ホールディングス	330,700	175.00	57,872,500
三井金属鉱業	373,000	177.00	66,021,000
東邦亜鉛	77,000	257.00	19,789,000
三菱マテリアル	912,000	303.00	276,336,000
住友金属鉱山	403,000	1,077.00	434,031,000
D O W Aホールディングス	188,000	631.00	118,628,000
古河機械金属	228,000	149.00	33,972,000
エス・サイエンス	65,100	36.00	2,343,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	1,440.00	20,736,000
東邦チタニウム	24,700	799.00	19,735,300
U A C J	204,000	215.00	43,860,000
古河電気工業	460,000	246.00	113,160,000
住友電気工業	585,000	1,216.00	711,360,000
フジクラ	203,000	523.00	106,169,000
昭和電線ホールディングス	175,000	62.00	10,850,000
東京特殊電線	2,300	826.00	1,899,800
タツタ電線	30,600	325.00	9,945,000
沖電線	17,000	193.00	3,281,000
カナレ電気	2,300	1,888.00	4,342,400
平河ビューテック	6,900	820.00	5,658,000
リョービ	89,000	392.00	34,888,000
アーレスティ	16,900	662.00	11,187,800
アサヒホールディングス	22,000	1,360.00	29,920,000
東洋製罐グループホールディングス	103,800	1,941.00	201,475,800
ホッカンホールディングス	35,000	309.00	10,815,000
コロナ	7,700	1,029.00	7,923,300
横河ブリッジホールディングス	27,700	1,106.00	30,636,200
O S J Bホールディングス	32,100	244.00	7,832,400
駒井ハルテック	27,000	227.00	6,129,000
高田機工	12,000	194.00	2,328,000
三和ホールディングス	145,000	809.00	117,305,000
文化シャッター	40,700	893.00	36,345,100
三協立山	19,200	1,478.00	28,377,600
アルインコ	8,300	994.00	8,250,200
東洋シャッター	3,600	566.00	2,037,600
L I X I Lグループ	203,600	2,190.00	445,884,000

日本ファイルコン	10,700	408.00	4,365,600	
ノーリツ	28,700	1,765.00	50,655,500	
長府製作所	15,600	2,461.00	38,391,600	
リンナイ	27,200	9,650.00	262,480,000	
ユニプレス	28,900	1,741.00	50,314,900	
ダイニチ工業	7,700	590.00	4,543,000	
日東精工	20,000	271.00	5,420,000	
三洋工業	19,000	144.00	2,736,000	
岡部	30,400	738.00	22,435,200	
ジーテクト	15,200	1,129.00	17,160,800	
中国工業	2,500	657.00	1,642,500	
東プレ	28,100	2,068.00	58,110,800	
高周波熱錬	27,200	701.00	19,067,200	
東京製綱	99,000	141.00	13,959,000	
サンコール	7,900	475.00	3,752,500	
モリテックスチール	7,500	237.00	1,777,500	
パイオラックス	7,400	5,070.00	37,518,000	
日本発条	137,500	961.00	132,137,500	
中央発條	17,000	262.00	4,454,000	
アドバネクス	2,700	1,160.00	3,132,000	
三浦工業	65,200	2,026.00	132,095,200	
タクマ	54,000	925.00	49,950,000	
テクノプロ・ホールディングス	23,600	3,125.00	73,750,000	
インターワークス	1,900	728.00	1,383,200	
リブセンス	9,900	443.00	4,385,700	
ジャパンマテリアル	6,100	2,832.00	17,275,200	
ベクトル	4,500	2,495.00	11,227,500	
ウチヤマホールディングス	7,700	534.00	4,111,800	
サクセスホールディングス	1,300	1,424.00	1,851,200	
キャリアリンク	1,900	1,697.00	3,224,300	
I B J	8,500	477.00	4,054,500	
アサンテ	5,400	1,544.00	8,337,600	
N・フィールド	5,200	1,757.00	9,136,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	1,705.00	2,046,000	
ライドオン・エクスプレス	2,300	1,577.00	3,627,100	
E R Iホールディングス	3,800	832.00	3,161,600	
アピスト	1,600	2,179.00	3,486,400	
ウィルグループ	3,300	1,012.00	3,339,600	
日本ビューホテル	1,600	1,683.00	2,692,800	
リクルートホールディングス	294,100	3,265.00	960,236,500	
エラン	1,300	1,099.00	1,428,700	
ツガミ	42,000	408.00	17,136,000	
オークマ	95,000	792.00	75,240,000	
東芝機械	80,000	323.00	25,840,000	
アマダホールディングス	213,100	1,044.00	222,476,400	
アイダエンジニアリング	38,300	927.00	35,504,100	
滝澤鉄工所	46,000	116.00	5,336,000	
富士機械製造	47,700	1,097.00	52,326,900	
牧野フライス製作所	73,000	646.00	47,158,000	
オーエスジー	66,600	1,869.00	124,475,400	

ダイジェット工業	17,000	129.00	2,193,000
旭ダイヤモンド工業	40,000	1,019.00	40,760,000
D M G 森精機	80,600	1,141.00	91,964,600
ソディック	27,800	794.00	22,073,200
ディスコ	18,600	9,270.00	172,422,000
日東工器	8,500	2,034.00	17,289,000
パンチ工業	5,800	717.00	4,158,600
日本郵政	321,500	1,448.00	465,532,000
ベルシステム24ホールディングス	21,400	1,150.00	24,610,000
豊田自動織機	127,100	4,480.00	569,408,000
豊和工業	8,400	527.00	4,426,800
O K K	57,000	101.00	5,757,000
石川製作所	37,000	73.00	2,701,000
東洋機械金属	10,900	313.00	3,411,700
津田駒工業	36,000	100.00	3,600,000
エンシュウ	38,000	67.00	2,546,000
島精機製作所	20,600	1,735.00	35,741,000
N C ホールディングス	4,800	1,386.00	6,652,800
フリー	2,200	2,711.00	5,964,200
日阪製作所	18,500	791.00	14,633,500
やまびこ	26,800	724.00	19,403,200
ペガサスミシン製造	15,100	488.00	7,368,800
ナブテスコ	75,900	2,337.00	177,378,300
三井海洋開発	17,100	1,537.00	26,282,700
レオン自動機	12,300	632.00	7,773,600
S M C	43,800	24,835.00	1,087,773,000
新川	13,000	402.00	5,226,000
ホソカワミクロン	24,000	558.00	13,392,000
ユニオンツール	6,300	2,814.00	17,728,200
オイレス工業	18,900	1,543.00	29,162,700
日精エー・エス・ピー機械	5,300	2,120.00	11,236,000
サトーホールディングス	19,700	2,173.00	42,808,100
日本エアテック	5,100	619.00	3,156,900
日精樹脂工業	10,600	621.00	6,582,600
ワイエイシイ	6,000	865.00	5,190,000
小松製作所	716,200	1,824.00	1,306,348,800
住友重機械工業	426,000	428.00	182,328,000
日立建機	65,300	1,699.00	110,944,700
日工	22,000	309.00	6,798,000
巴工業	6,000	1,447.00	8,682,000
井関農機	149,000	218.00	32,482,000
T O W A	14,100	668.00	9,418,800
丸山製作所	31,000	169.00	5,239,000
北川鉄工所	67,000	193.00	12,931,000
シンニッタン	13,200	650.00	8,580,000
タカキタ	3,600	491.00	1,767,600
クボタ	701,500	1,353.00	949,129,500
荏原実業	4,500	1,175.00	5,287,500
東洋エンジニアリング	84,000	299.00	25,116,000
三菱化工機	48,000	208.00	9,984,000

月島機械	27,700	879.00	24,348,300
帝国電機製作所	10,600	705.00	7,473,000
東京機械製作所	57,000	40.00	2,280,000
新東工業	33,200	970.00	32,204,000
澁谷工業	12,200	1,198.00	14,615,600
アイチコーポレーション	20,700	765.00	15,835,500
小森コーポレーション	35,500	1,191.00	42,280,500
鶴見製作所	10,900	1,520.00	16,568,000
住友精密工業	23,000	314.00	7,222,000
酒井重工業	28,000	173.00	4,844,000
荏原製作所	323,000	482.00	155,686,000
石井鐵工所	22,000	140.00	3,080,000
西島製作所	15,600	1,017.00	15,865,200
北越工業	15,700	621.00	9,749,700
千代田化工建設	113,000	799.00	90,287,000
ダイキン工業	203,300	8,139.00	1,654,658,700
オルガノ	25,000	402.00	10,050,000
トヨーカネツ	78,000	228.00	17,784,000
栗田工業	87,800	2,401.00	210,807,800
椿本チエイン	83,000	667.00	55,361,000
大同工業	27,000	184.00	4,968,000
日機装	50,300	778.00	39,133,400
木村化工機	12,600	350.00	4,410,000
新興プランテック	32,100	784.00	25,166,400
アネスト岩田	23,600	1,099.00	25,936,400
ダイフク	75,000	1,886.00	141,450,000
サムコ	2,500	882.00	2,205,000
加藤製作所	33,000	393.00	12,969,000
油研工業	27,000	171.00	4,617,000
タダノ	67,000	960.00	64,320,000
フジテック	40,600	1,091.00	44,294,600
C K D	38,800	798.00	30,962,400
キトー	17,600	725.00	12,760,000
平和	43,300	2,296.00	99,416,800
理想科学工業	15,400	1,669.00	25,702,600
S A N K Y O	38,800	4,025.00	156,170,000
日本金銭機械	12,900	864.00	11,145,600
マースエンジニアリング	7,900	1,922.00	15,183,800
福島工業	8,600	2,537.00	21,818,200
オーイズミ	5,800	445.00	2,581,000
ダイコク電機	5,800	1,261.00	7,313,800
竹内製作所	20,700	1,420.00	29,394,000
アマノ	43,200	1,747.00	75,470,400
J U K I	20,700	879.00	18,195,300
サンデンホールディングス	85,000	290.00	24,650,000
蛇の目ミシン工業	13,600	558.00	7,588,800
ブラザー工業	180,500	1,233.00	222,556,500
マックス	20,000	1,100.00	22,000,000
モリタホールディングス	24,400	1,253.00	30,573,200
グローリー	47,600	3,690.00	175,644,000

新晃工業	9,700	1,649.00	15,995,300
大和冷機工業	22,400	915.00	20,496,000
セガサミーホールディングス	150,000	1,178.00	176,700,000
日本ピストンリング	5,800	1,333.00	7,731,400
リケン	65,000	339.00	22,035,000
T P R	17,200	2,593.00	44,599,600
ツバキ・ナカシマ	13,000	1,451.00	18,863,000
ホシザキ電機	30,600	9,290.00	284,274,000
大豊工業	11,300	1,014.00	11,458,200
日本精工	286,700	888.00	254,589,600
N T N	346,000	305.00	105,530,000
ジェイテクト	148,800	1,331.00	198,052,800
不二越	130,000	330.00	42,900,000
ミネベア	225,000	799.00	179,775,000
日本トムソン	48,000	353.00	16,944,000
T H K	92,800	2,065.00	191,632,000
ユーシン精機	5,400	1,826.00	9,860,400
前澤給装工業	5,800	1,358.00	7,876,400
イーグル工業	17,200	1,341.00	23,065,200
前澤工業	10,700	279.00	2,985,300
日本ピラー工業	14,200	920.00	13,064,000
キッツ	62,200	450.00	27,990,000
日立製作所	3,562,000	467.00	1,663,454,000
東芝	2,939,000	213.30	626,888,700
三菱電機	1,489,000	1,106.00	1,646,834,000
富士電機	421,000	360.00	151,560,000
東洋電機製造	28,000	317.00	8,876,000
安川電機	173,400	1,289.00	223,512,600
シンフォニア テクノロジー	91,000	143.00	13,013,000
明電舎	128,000	483.00	61,824,000
オリジン電気	21,000	254.00	5,334,000
山洋電気	37,000	475.00	17,575,000
デンヨー	12,900	1,093.00	14,099,700
日立工機	37,400	688.00	25,731,200
三櫻工業	17,800	559.00	9,950,200
マキタ	91,000	6,600.00	600,600,000
東芝テック	100,000	415.00	41,500,000
芝浦メカトロニクス	23,000	206.00	4,738,000
マブチモーター	40,000	4,725.00	189,000,000
日本電産	168,000	7,221.00	1,213,128,000
東光高岳	7,800	1,483.00	11,567,400
ダブル・スコープ	4,100	5,290.00	21,689,000
宮越ホールディングス	4,900	348.00	1,705,200
ダイヘン	82,000	470.00	38,540,000
田淵電機	15,800	457.00	7,220,600
ヤーマン	1,800	2,185.00	3,933,000
J V C ケンウッド	102,500	279.00	28,597,500
ミマキエンジニアリング	9,400	574.00	5,395,600
第一精工	5,800	1,138.00	6,600,400
日新電機	32,700	1,244.00	40,678,800

大崎電気工業	25,000	745.00	18,625,000
オムロン	157,700	3,185.00	502,274,500
日東工業	22,400	1,646.00	36,870,400
I D E C	18,300	1,011.00	18,501,300
不二電機工業	1,400	1,387.00	1,941,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	269,000	463.00	124,547,000
サクサホールディングス	35,000	198.00	6,930,000
メルコホールディングス	7,700	2,378.00	18,310,600
テクノメディカ	3,000	2,112.00	6,336,000
日本電気	1,919,000	267.00	512,373,000
富士通	1,346,000	379.60	510,941,600
沖電気工業	605,000	145.00	87,725,000
岩崎通信機	67,000	72.00	4,824,000
電気興業	37,000	491.00	18,167,000
サンケン電気	76,000	349.00	26,524,000
ナカヨ	13,000	317.00	4,121,000
アイホン	7,900	1,753.00	13,848,700
ルネサスエレクトロニクス	72,200	652.00	47,074,400
セイコーエプソン	207,900	1,719.00	357,380,100
ワコム	110,000	448.00	49,280,000
アルバック	25,700	3,325.00	85,452,500
アクセル	6,300	785.00	4,945,500
E I Z O	13,800	2,667.00	36,804,600
ジャパンディスプレイ	260,600	204.00	53,162,400
日本信号	38,500	845.00	32,532,500
京三製作所	33,000	327.00	10,791,000
能美防災	15,900	1,665.00	26,473,500
ホーチキ	10,100	1,278.00	12,907,800
エレコム	12,100	2,101.00	25,422,100
日本無線	37,000	297.00	10,989,000
パナソニック	1,594,900	906.30	1,445,457,870
シャープ	1,180,000	128.00	151,040,000
アンリツ	83,800	571.00	47,849,800
富士通ゼネラル	43,000	1,748.00	75,164,000
日立国際電気	31,900	1,207.00	38,503,300
ソニー	985,000	2,965.00	2,920,525,000
T D K	84,300	5,760.00	485,568,000
帝国通信工業	34,000	154.00	5,236,000
ミツミ電機	53,100	472.00	25,063,200
タムラ製作所	54,000	268.00	14,472,000
アルプス電気	118,400	1,700.00	201,280,000
池上通信機	44,000	130.00	5,720,000
パイオニア	225,900	338.00	76,354,200
日本電波工業	12,700	702.00	8,915,400
鈴木	4,000	503.00	2,012,000
日本トリム	3,800	5,700.00	21,660,000
ローランド ディー・ジー	6,900	2,027.00	13,986,300
日本コロムビア	4,800	424.00	2,035,200
フォスター電機	17,500	2,142.00	37,485,000
クラリオン	74,000	326.00	24,124,000

S M K	41,000	527.00	21,607,000
ヨコオ	10,000	474.00	4,740,000
東光	28,000	342.00	9,576,000
ティアック	101,000	42.00	4,242,000
ホシデン	42,300	691.00	29,229,300
ヒロセ電機	22,500	12,370.00	278,325,000
日本航空電子工業	40,000	1,158.00	46,320,000
T O A	16,500	1,004.00	16,566,000
日立マクセル	23,100	1,638.00	37,837,800
古野電気	16,700	655.00	10,938,500
ユニデンホールディングス	44,000	118.00	5,192,000
アルパイン	33,300	1,150.00	38,295,000
スミダコーポレーション	11,400	651.00	7,421,400
アイコム	7,800	2,024.00	15,787,200
リオン	5,300	1,588.00	8,416,400
船井電機	14,100	954.00	13,451,400
横河電機	139,700	1,073.00	149,898,100
新電元工業	49,000	356.00	17,444,000
アズビル	45,600	2,788.00	127,132,800
東亜ディーケーケー	5,900	516.00	3,044,400
日本光電工業	58,300	2,683.00	156,418,900
チノー	5,200	995.00	5,174,000
共和電業	17,200	374.00	6,432,800
日本電子材料	5,500	404.00	2,222,000
堀場製作所	25,800	3,830.00	98,814,000
アドバンテスト	95,200	975.00	92,820,000
小野測器	6,900	683.00	4,712,700
エスベック	14,400	1,404.00	20,217,600
パナソニック デバイス S U N X	12,300	550.00	6,765,000
キーエンス	31,600	58,420.00	1,846,072,000
日置電機	7,300	2,305.00	16,826,500
シスメックス	108,300	6,810.00	737,523,000
日本マイクロニクス	18,200	1,008.00	18,345,600
メガチップス	14,600	1,193.00	17,417,800
O B A R A G R O U P	9,000	3,915.00	35,235,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,600	382.00	4,431,200
澤藤電機	8,000	166.00	1,328,000
デンソー	344,900	3,954.00	1,363,734,600
コーセル	19,400	1,113.00	21,592,200
新日本無線	10,400	385.00	4,004,000
オブテックス	10,300	3,630.00	37,389,000
千代田インテグレ	7,300	2,350.00	17,155,000
レーザーテック	16,300	1,504.00	24,515,200
スタンレー電気	100,200	2,219.00	222,343,800
岩崎電気	48,000	179.00	8,592,000
ウシオ電機	84,700	1,473.00	124,763,100
岡谷電機産業	8,000	364.00	2,912,000
ヘリオス テクノ ホールディング	12,000	370.00	4,440,000
日本セラミック	8,000	1,918.00	15,344,000

遠藤照明	7,100	935.00	6,638,500
日本デジタル研究所	11,800	1,521.00	17,947,800
古河電池	10,000	610.00	6,100,000
双信電機	6,900	256.00	1,766,400
山一電機	12,100	521.00	6,304,100
図研	10,100	1,183.00	11,948,300
日本電子	55,000	471.00	25,905,000
カシオ計算機	139,900	2,111.00	295,328,900
ファナック	142,800	17,135.00	2,446,878,000
日本シイエムケイ	30,000	423.00	12,690,000
エンプラス	7,100	3,800.00	26,980,000
大真空	26,000	229.00	5,954,000
ローム	68,800	4,410.00	303,408,000
浜松ホトニクス	108,900	3,010.00	327,789,000
三井ハイテック	20,200	658.00	13,291,600
新光電気工業	52,700	595.00	31,356,500
京セラ	229,200	4,680.00	1,072,656,000
協栄産業	15,000	121.00	1,815,000
太陽誘電	67,900	1,017.00	69,054,300
村田製作所	146,500	12,700.00	1,860,550,000
ユーシン	18,600	685.00	12,741,000
双葉電子工業	22,800	1,498.00	34,154,400
日東電工	113,000	5,902.00	666,926,000
北陸電気工業	56,000	122.00	6,832,000
東海理化電機製作所	40,800	1,831.00	74,704,800
ニチコン	44,000	710.00	31,240,000
日本ケミコン	113,000	134.00	15,142,000
K O A	19,300	761.00	14,687,300
三井造船	540,000	149.00	80,460,000
日立造船	110,700	505.00	55,903,500
三菱重工業	2,486,000	386.30	960,341,800
川崎重工業	1,086,000	288.00	312,768,000
I H I	1,073,000	208.00	223,184,000
名村造船所	41,900	764.00	32,011,600
サノヤホールディングス	17,200	206.00	3,543,200
日本車輛製造	57,000	263.00	14,991,000
ニチュ三菱フォークリフト	16,200	469.00	7,597,800
近畿車輛	21,000	298.00	6,258,000
F P G	40,900	1,372.00	56,114,800
島根銀行	3,100	1,142.00	3,540,200
じもとホールディングス	98,900	131.00	12,955,900
全国保証	35,800	3,755.00	134,429,000
足利ホールディングス	101,100	298.00	30,127,800
東京T Yフィナンシャルグループ	19,000	2,441.00	46,379,000
九州フィナンシャルグループ	210,900	555.00	117,049,500
かんぽ生命保険	42,100	2,421.00	101,924,100
ゆうちょ銀行	264,800	1,291.00	341,856,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	959,706	477.20	457,971,703
日産自動車	1,959,500	952.00	1,865,444,000

いすゞ自動車	404,500	1,055.50	426,949,750	
トヨタ自動車	1,736,300	5,278.00	9,164,191,400	*
日野自動車	199,200	1,085.00	216,132,000	
三菱自動車工業	554,300	778.00	431,245,400	
エフテック	7,400	1,007.00	7,451,800	
レシップホールディングス	4,700	715.00	3,360,500	
G M B	2,200	753.00	1,656,600	
ファルテック	2,500	1,250.00	3,125,000	
武蔵精密工業	14,900	1,963.00	29,248,700	
日産車体	68,200	982.00	66,972,400	
新明和工業	61,000	711.00	43,371,000	
極東開発工業	27,800	1,037.00	28,828,600	
日信工業	31,200	1,401.00	43,711,200	
トピー工業	115,000	210.00	24,150,000	
ティラド	55,000	160.00	8,800,000	
曙ブレーキ工業	70,900	244.00	17,299,600	
タチエス	22,100	1,498.00	33,105,800	
N O K	67,500	1,693.00	114,277,500	
フタバ産業	42,600	410.00	17,466,000	
K Y B	156,000	313.00	48,828,000	
市光工業	33,000	236.00	7,788,000	
大同メタル工業	19,500	774.00	15,093,000	
プレス工業	74,200	350.00	25,970,000	
ミクニ	13,400	318.00	4,261,200	
カルソニックカンセイ	107,000	709.00	75,863,000	
太平洋工業	31,000	966.00	29,946,000	
ケーヒン	32,100	1,464.00	46,994,400	
河西工業	17,100	1,045.00	17,869,500	
アイシン精機	143,090	3,960.00	566,636,400	
富士機工	16,200	401.00	6,496,200	
マツダ	442,000	1,475.00	651,950,000	
ダイハツ工業	166,600	1,402.00	233,573,200	
今仙電機製作所	12,800	902.00	11,545,600	
本田技研工業	1,256,300	2,822.50	3,545,906,750	
スズキ	291,800	2,871.50	837,903,700	
富士重工業	441,100	3,358.00	1,481,213,800	
安永	4,300	463.00	1,990,900	
ヤマハ発動機	197,100	1,647.00	324,623,700	
ショーワ	36,200	877.00	31,747,400	
小糸製作所	83,600	4,615.00	385,814,000	
T B K	16,700	357.00	5,961,900	
エクセディ	19,000	2,160.00	41,040,000	
ミツバ	23,700	1,445.00	34,246,500	
豊田合成	50,700	1,909.00	96,786,300	
愛三工業	24,400	796.00	19,422,400	
盟和産業	1,800	975.00	1,755,000	
ヨロズ	13,000	2,134.00	27,742,000	
エフ・シー・シー	22,800	1,659.00	37,825,200	
新家工業	30,000	119.00	3,570,000	
シマノ	56,300	16,510.00	929,513,000	

タカタ	25,200	358.00	9,021,600
テイ・エス テック	32,400	2,356.00	76,334,400
ジャムコ	6,100	2,454.00	14,969,400
小野建	12,100	942.00	11,398,200
はるやま商事	5,900	718.00	4,236,200
佐島電機	11,000	706.00	7,766,000
カッパ・クリエイト	19,400	1,191.00	23,105,400
エコートレーディング	3,800	574.00	2,181,200
伯東	10,500	857.00	8,998,500
コンドーテック	11,000	843.00	9,273,000
中山福	8,900	713.00	6,345,700
ライトオン	10,300	1,642.00	16,912,600
ナガイレーベン	19,900	2,263.00	45,033,700
ジーンズメイト	4,600	179.00	823,400
三菱食品	15,200	2,739.00	41,632,800
良品計画	15,800	23,410.00	369,878,000
三城ホールディングス	17,500	441.00	7,717,500
松田産業	10,100	1,115.00	11,261,500
第一興商	24,400	4,590.00	111,996,000
メディバルホールディングス	137,800	1,721.00	237,153,800
アドヴァン	14,000	1,003.00	14,042,000
S P K	3,300	1,917.00	6,326,100
萩原電気	3,500	1,840.00	6,440,000
アルピス	3,700	1,877.00	6,944,900
アズワン	10,800	4,040.00	43,632,000
スズデン	4,500	1,011.00	4,549,500
尾家産業	4,800	859.00	4,123,200
シモジマ	9,700	1,067.00	10,349,900
ドウシシャ	16,200	1,981.00	32,092,200
小津産業	3,100	2,203.00	6,829,300
コナカ	16,300	508.00	8,280,400
高速	8,300	829.00	6,880,700
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,402.00	2,383,400
G - 7ホールディングス	4,000	1,160.00	4,640,000
たけびし	5,000	946.00	4,730,000
イオン北海道	9,500	516.00	4,902,000
コジマ	20,400	239.00	4,875,600
ヒマラヤ	4,500	989.00	4,450,500
コーナン商事	19,600	1,569.00	30,752,400
黒田電気	25,600	1,623.00	41,548,800
ネットワンシステムズ	59,700	567.00	33,849,900
エコス	5,100	1,359.00	6,930,900
ワタミ	16,300	1,049.00	17,098,700
マルシェ	3,700	813.00	3,008,100
ドンキホーテホールディングス	89,100	3,625.00	322,987,500
丸文	12,200	723.00	8,820,600
西松屋チェーン	27,200	1,186.00	32,259,200
ゼンショーホールディングス	70,900	1,343.00	95,218,700
ハビネット	12,500	914.00	11,425,000
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,443.00	12,698,400

ハークスレイ	3,900	1,031.00	4,020,900
橋本総業ホールディングス	2,600	1,466.00	3,811,600
サイゼリヤ	22,700	2,255.00	51,188,500
エクセル	6,700	1,351.00	9,051,700
V Tホールディングス	46,500	554.00	25,761,000
マルカキカイ	4,500	1,292.00	5,814,000
アルゴグラフィックス	6,400	1,669.00	10,681,600
魚力	4,300	1,219.00	5,241,700
ガリバーインターナショナル	37,000	1,393.00	51,541,000
日本エム・ディ・エム	11,500	573.00	6,589,500
ポブラ	3,500	476.00	1,666,000
ユナイテッドアローズ	19,700	4,215.00	83,035,500
進和	8,100	1,446.00	11,712,600
エスケイジャパン	3,200	330.00	1,056,000
ダイトエレクトロン	6,300	661.00	4,164,300
ハイデイ日高	12,500	2,619.00	32,737,500
シークス	8,700	3,115.00	27,100,500
京都きもの友禅	9,500	813.00	7,723,500
コロワイド	45,700	1,681.00	76,821,700
ピーシーデポコーポレーション	11,400	1,076.00	12,266,400
田中商事	4,500	613.00	2,758,500
オーハシテクニカ	7,800	1,170.00	9,126,000
壱番屋	6,200	6,700.00	41,540,000
白銅	4,000	1,015.00	4,060,000
トップカルチャー	5,400	469.00	2,532,600
P L A N T	3,200	1,175.00	3,760,000
スギホールディングス	24,700	5,610.00	138,567,000
島津製作所	180,000	1,619.00	291,420,000
J M S	24,000	282.00	6,768,000
クボテック	3,000	455.00	1,365,000
長野計器	8,500	597.00	5,074,500
プイ・テクノロジー	3,300	4,320.00	14,256,000
スター精密	26,500	1,212.00	32,118,000
東京計器	44,000	147.00	6,468,000
愛知時計電機	18,000	302.00	5,436,000
オーバル	14,000	228.00	3,192,000
東京精密	26,900	2,128.00	57,243,200
マニー	12,700	1,689.00	21,450,300
ニコン	260,700	1,632.00	425,462,400
トプコン	46,800	1,356.00	63,460,800
オリンパス	207,900	4,025.00	836,797,500
理研計器	11,300	1,001.00	11,311,300
S C R E E Nホールディングス	143,000	849.00	121,407,000
キヤノン電子	12,800	1,583.00	20,262,400
タムロン	11,300	1,652.00	18,667,600
H O Y A	315,700	4,100.00	1,294,370,000
ノーリツ鋼機	12,600	637.00	8,026,200
エー・アンド・デイ	12,800	371.00	4,748,800
キヤノン	751,600	3,140.00	2,360,024,000
リコー	452,100	1,058.00	478,321,800

シチズンホールディングス	171,900	597.00	102,624,300
リズム時計工業	62,000	138.00	8,556,000
大研医器	11,100	892.00	9,901,200
メニコン	7,000	3,855.00	26,985,000
スノーピーク	1,100	3,585.00	3,943,500
パラマウントベッドホールディングス	14,700	4,185.00	61,519,500
トランザクション	2,200	650.00	1,430,000
S H O B I	5,000	392.00	1,960,000
ニホンフラッシュ	4,100	1,033.00	4,235,300
前田工織	15,400	1,120.00	17,248,000
永大産業	19,000	389.00	7,391,000
アートネイチャー	11,200	1,033.00	11,569,600
ダンロップスポーツ	8,800	999.00	8,791,200
バンダイナムコホールディングス	144,300	2,364.00	341,125,200
アイフィスジャパン	2,400	447.00	1,072,800
共立印刷	23,600	272.00	6,419,200
S H O E I	6,700	1,685.00	11,289,500
フランスベッドホールディングス	19,600	1,000.00	19,600,000
マーベラス	23,200	906.00	21,019,200
パイロットコーポレーション	24,400	3,955.00	96,502,000
萩原工業	2,900	2,511.00	7,281,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,400	1,408.00	35,763,200
トッパン・フォームズ	25,000	1,176.00	29,400,000
フジシールインターナショナル	17,000	3,655.00	62,135,000
タカラトミー	45,900	757.00	34,746,300
廣済堂	13,000	328.00	4,264,000
アーク	59,000	88.00	5,192,000
レック	4,600	1,237.00	5,690,200
タカノ	6,000	603.00	3,618,000
プロネクサス	13,000	1,159.00	15,067,000
ホクシン	11,900	115.00	1,368,500
ウッドワン	23,000	241.00	5,543,000
大建工業	55,000	298.00	16,390,000
きもと	23,900	154.00	3,680,600
凸版印刷	394,000	911.00	358,934,000
大日本印刷	413,000	960.00	396,480,000
図書印刷	26,000	549.00	14,274,000
共同印刷	47,000	324.00	15,228,000
日本写真印刷	23,400	1,571.00	36,761,400
光村印刷	3,000	204.00	612,000
藤森工業	12,500	2,367.00	29,587,500
宝印刷	6,800	1,298.00	8,826,400
前澤化成工業	10,400	981.00	10,202,400
アシックス	130,000	1,903.00	247,390,000
ツツミ	7,000	2,220.00	15,540,000
J S P	9,600	1,903.00	18,268,800
ニチハ	19,400	1,594.00	30,923,600
エフピコ	13,000	4,645.00	60,385,000
小松ウオール工業	4,800	1,715.00	8,232,000

ヤマハ	102,600	3,220.00	330,372,000
河合楽器製作所	5,200	1,875.00	9,750,000
クリナップ	16,500	739.00	12,193,500
ピジョン	79,100	2,809.00	222,191,900
天馬	11,300	1,682.00	19,006,600
兼松日産農林	14,000	137.00	1,918,000
キングジム	11,800	825.00	9,735,000
リンテック	33,200	1,939.00	64,374,800
T A S A K I	2,600	1,635.00	4,251,000
信越ポリマー	28,700	563.00	16,158,100
東リ	36,000	280.00	10,080,000
イトーキ	29,400	739.00	21,726,600
任天堂	86,000	15,855.00	1,363,530,000
三菱鉛筆	10,500	4,910.00	51,555,000
松風	6,900	1,319.00	9,101,100
タカラスタANDARD	58,000	973.00	56,434,000
コクヨ	72,600	1,300.00	94,380,000
ナカバヤシ	29,000	290.00	8,410,000
ニフコ	28,000	4,990.00	139,720,000
立川ブラインド工業	6,200	675.00	4,185,000
グロープライド	6,800	1,310.00	8,908,000
岡村製作所	48,800	1,033.00	50,410,400
日本バルカー工業	57,000	275.00	15,675,000
M U T O Hホールディングス	17,000	208.00	3,536,000
伊藤忠商事	1,081,100	1,317.50	1,424,349,250
丸紅	1,355,900	541.90	734,762,210
スクロール	20,800	452.00	9,401,600
高島	26,000	169.00	4,394,000
ヨンドシーホールディングス	10,500	2,455.00	25,777,500
三陽商会	82,000	248.00	20,336,000
長瀬産業	82,800	1,165.00	96,462,000
ナイガイ	52,000	47.00	2,444,000
蝶理	8,800	1,378.00	12,126,400
豊田通商	153,500	2,370.00	363,795,000
オンワードホールディングス	95,000	776.00	73,720,000
三共生興	21,000	367.00	7,707,000
兼松	293,000	154.00	45,122,000
美津濃	75,000	514.00	38,550,000
ツカモトコーポレーション	25,000	105.00	2,625,000
ファミリーマート	42,300	5,940.00	251,262,000
ルック	27,000	142.00	3,834,000
三井物産	1,245,900	1,268.00	1,579,801,200
日本紙バルブ商事	72,000	309.00	22,248,000
東京エレクトロン	114,600	6,983.00	800,251,800
日立ハイテクノロジーズ	47,800	3,030.00	144,834,000
カメイ	18,000	999.00	17,982,000
東都水産	24,000	168.00	4,032,000
O U Gホールディングス	20,000	226.00	4,520,000
スターゼン	5,000	3,020.00	15,100,000
セイコーホールディングス	90,000	408.00	36,720,000

山善	52,900	809.00	42,796,100	
橋本興業	15,000	283.00	4,245,000	
住友商事	867,300	1,087.50	943,188,750	
日本ユニシス	38,000	1,383.00	52,554,000	
内田洋行	34,000	439.00	14,926,000	
三菱商事	1,033,800	1,789.00	1,849,468,200	
第一実業	31,000	462.00	14,322,000	
キヤノンマーケティングジャパン	39,300	1,824.00	71,683,200	
西華産業	45,000	213.00	9,585,000	
佐藤商事	12,400	607.00	7,526,800	
菱洋エレクトロ	15,900	1,270.00	20,193,000	
東京産業	13,800	375.00	5,175,000	
ユアサ商事	13,000	2,444.00	31,772,000	
神鋼商事	31,000	189.00	5,859,000	
小林産業	9,800	186.00	1,822,800	
阪和興業	138,000	451.00	62,238,000	
カナデン	13,200	804.00	10,612,800	
菱電商事	22,000	604.00	13,288,000	
ニプロ	104,100	1,018.00	105,973,800	
フルサト工業	7,600	1,598.00	12,144,800	
岩谷産業	163,000	616.00	100,408,000	
すてきナイスグループ	59,000	130.00	7,670,000	
昭光通商	50,000	70.00	3,500,000	
ニチモウ	22,000	170.00	3,740,000	
極東貿易	20,000	213.00	4,260,000	
イワキ	21,000	180.00	3,780,000	
兼松エレクトロニクス	8,700	1,863.00	16,208,100	
三愛石油	35,000	758.00	26,530,000	
稲畑産業	33,100	1,028.00	34,026,800	
G S Iクレオス	36,000	112.00	4,032,000	
明和産業	12,800	355.00	4,544,000	
キムラタン	588,000	6.00	3,528,000	
ゴールドウイン	6,200	4,075.00	25,265,000	
ユニ・チャーム	296,000	2,395.50	709,068,000	
デサント	33,300	1,540.00	51,282,000	
キング	6,900	365.00	2,518,500	
ワキタ	29,300	737.00	21,594,100	
ヤマトインターナショナル	9,200	382.00	3,514,400	
東邦ホールディングス	44,100	2,258.00	99,577,800	
サンゲツ	48,000	1,953.00	93,744,000	
ミツウロコグループホールディングス	22,300	518.00	11,551,400	
シナネンホールディングス	28,000	417.00	11,676,000	
伊藤忠エネクス	35,500	842.00	29,891,000	
サンリオ	42,500	2,012.00	85,510,000	
サンワテクノス	8,800	668.00	5,878,400	
リョーサン	21,800	2,596.00	56,592,800	
新光商事	16,200	1,032.00	16,718,400	
トーヨー	6,300	2,441.00	15,378,300	
三信電気	19,000	855.00	16,245,000	
東陽テクニカ	19,500	1,116.00	21,762,000	

モスフードサービス	18,000	2,960.00	53,280,000
加賀電子	12,500	1,279.00	15,987,500
三益半導体工業	10,800	977.00	10,551,600
ソーダニッカ	14,500	434.00	6,293,000
立花エレテック	10,200	1,125.00	11,475,000
木曽路	16,900	2,124.00	35,895,600
サトレストラシシステムズ	16,300	787.00	12,828,100
千趣会	27,300	704.00	19,219,200
タカキュー	11,600	193.00	2,238,800
ケーヨー	23,600	512.00	12,083,200
アデランス	24,300	638.00	15,503,400
上新電機	32,000	836.00	26,752,000
日本瓦斯	15,800	2,482.00	39,215,600
ベスト電器	44,900	116.00	5,208,400
ロイヤルホールディングス	22,800	2,181.00	49,726,800
東天紅	10,000	130.00	1,300,000
いなげや	15,400	1,346.00	20,728,400
島忠	35,600	2,371.00	84,407,600
チヨダ	16,200	2,933.00	47,514,600
ライフコーポレーション	8,700	2,633.00	22,907,100
リンガーハット	12,500	2,173.00	27,162,500
さが美	10,000	89.00	890,000
MR MAX	12,400	275.00	3,410,000
テナアライド	13,100	356.00	4,663,600
AOKIホールディングス	31,400	1,260.00	39,564,000
オークワ	20,000	1,103.00	22,060,000
コメリ	21,200	2,179.00	46,194,800
青山商事	26,400	4,055.00	107,052,000
しまむら	16,000	13,800.00	220,800,000
はせがわ	4,800	417.00	2,001,600
高島屋	200,000	849.00	169,800,000
松屋	27,700	849.00	23,517,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	70,600	1,844.00	130,186,400
近鉄百貨店	53,000	285.00	15,105,000
丸栄	29,000	87.00	2,523,000
ニッセンホールディングス	20,600	127.00	2,616,200
パルコ	13,200	920.00	12,144,000
丸井グループ	169,100	1,504.00	254,326,400
クレディセゾン	104,500	1,840.00	192,280,000
アクシアル リテイリング	10,600	3,450.00	36,570,000
井筒屋	76,000	55.00	4,180,000
イオン	566,900	1,517.50	860,270,750
ユニーグループ・ホールディングス	132,000	816.00	107,712,000
イズミ	27,400	4,705.00	128,917,000
東武ストア	17,000	294.00	4,998,000
フォーバル	5,400	750.00	4,050,000
平和堂	27,900	2,282.00	63,667,800
フジ	15,300	2,244.00	34,333,200
ヤオコー	15,600	4,745.00	74,022,000
ゼビオホールディングス	18,700	1,749.00	32,706,300

ケーズホールディングス	29,100	3,610.00	105,051,000
PALTAC	22,100	1,964.00	43,404,400
三谷産業	14,700	321.00	4,718,700
Olympicグループ	8,300	474.00	3,934,200
日産東京販売ホールディングス	23,200	261.00	6,055,200
新生銀行	1,192,000	135.00	160,920,000
あおぞら銀行	872,000	359.00	313,048,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,054,800	477.70	5,280,877,960
りそなホールディングス	1,611,800	369.50	595,560,100
三井住友トラスト・ホールディングス	2,877,000	294.40	846,988,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,103,200	3,135.00	3,458,532,000
第四銀行	174,000	352.00	61,248,000
北越銀行	149,000	168.00	25,032,000
西日本シティ銀行	448,000	184.00	82,432,000
千葉銀行	531,000	511.00	271,341,000
常陽銀行	498,000	357.00	177,786,000
群馬銀行	306,000	420.00	128,520,000
武蔵野銀行	22,000	2,637.00	58,014,000
千葉興業銀行	37,700	438.00	16,512,600
筑波銀行	57,200	266.00	15,215,200
七十七銀行	216,000	361.00	77,976,000
青森銀行	101,000	303.00	30,603,000
秋田銀行	90,000	271.00	24,390,000
山形銀行	78,000	384.00	29,952,000
岩手銀行	9,600	3,675.00	35,280,000
東邦銀行	123,000	327.00	40,221,000
東北銀行	71,000	136.00	9,656,000
みちのく銀行	69,000	167.00	11,523,000
ふくおかフィナンシャルグループ	596,000	333.00	198,468,000
静岡銀行	404,000	750.00	303,000,000
十六銀行	173,000	300.00	51,900,000
スルガ銀行	130,800	1,797.00	235,047,600
八十二銀行	249,000	446.00	111,054,000
山梨中央銀行	85,000	374.00	31,790,000
大垣共立銀行	184,000	314.00	57,776,000
福井銀行	118,000	190.00	22,420,000
北國銀行	153,000	272.00	41,616,000
清水銀行	4,700	2,136.00	10,039,200
富山銀行	2,700	3,225.00	8,707,500
滋賀銀行	130,000	437.00	56,810,000
南都銀行	133,000	282.00	37,506,000
百五銀行	124,000	380.00	47,120,000
京都銀行	263,000	660.00	173,580,000
紀陽銀行	54,100	1,187.00	64,216,700
三重銀行	62,000	185.00	11,470,000
ほくほくフィナンシャルグループ	937,000	135.00	126,495,000
広島銀行	406,000	367.00	149,002,000
山陰合同銀行	83,500	652.00	54,442,000
中国銀行	97,600	1,036.00	101,113,600
鳥取銀行	44,000	155.00	6,820,000

伊予銀行	147,300	653.00	96,186,900	
百十四銀行	151,000	297.00	44,847,000	
四国銀行	107,000	199.00	21,293,000	
阿波銀行	113,000	495.00	55,935,000	
大分銀行	79,000	318.00	25,122,000	
宮崎銀行	92,000	257.00	23,644,000	
佐賀銀行	84,000	199.00	16,716,000	
十八銀行	85,000	218.00	18,530,000	
沖縄銀行	10,900	3,215.00	35,043,500	
琉球銀行	28,400	1,156.00	32,830,400	
セブン銀行	516,200	443.00	228,676,600	
みずほフィナンシャルグループ	19,458,700	154.00	2,996,639,800	
高知銀行	54,000	110.00	5,940,000	
山口フィナンシャルグループ	129,000	934.00	120,486,000	
アクリーティブ	11,500	452.00	5,198,000	
芙蓉総合リース	15,800	4,520.00	71,416,000	
興銀リース	25,900	1,812.00	46,930,800	
東京センチュリーリース	32,300	3,860.00	124,678,000	
S B Iホールディングス	165,400	1,079.00	178,466,600	
日本証券金融	60,700	411.00	24,947,700	
アイフル	230,600	371.00	85,552,600	
日本アジア投資	9,500	237.00	2,251,500	
ポケットカード	13,800	540.00	7,452,000	
長野銀行	46,000	177.00	8,142,000	
名古屋銀行	116,000	346.00	40,136,000	
北洋銀行	207,400	257.00	53,301,800	
愛知銀行	4,600	4,240.00	19,504,000	
第三銀行	79,000	141.00	11,139,000	
中京銀行	57,000	197.00	11,229,000	
大光銀行	49,000	187.00	9,163,000	
愛媛銀行	82,000	217.00	17,794,000	
トマト銀行	54,000	137.00	7,398,000	
みなと銀行	125,000	142.00	17,750,000	
京葉銀行	113,000	369.00	41,697,000	
関西アーバン銀行	19,200	996.00	19,123,200	
栃木銀行	74,000	375.00	27,750,000	
北日本銀行	4,300	2,625.00	11,287,500	
東和銀行	194,000	81.00	15,714,000	
福島銀行	170,000	80.00	13,600,000	
大東銀行	83,000	171.00	14,193,000	
リコーリース	10,900	3,055.00	33,299,500	
イオンフィナンシャルサービス	90,400	2,446.00	221,118,400	
アコム	276,700	548.00	151,631,600	
ジャックス	76,000	438.00	33,288,000	
オリエントコーポレーション	595,600	207.00	123,289,200	
日立キャピタル	32,500	2,224.00	72,280,000	
アプラスフィナンシャル	66,100	96.00	6,345,600	
オリックス	975,600	1,531.50	1,494,131,400	
三菱UFJリース	349,400	462.00	161,422,800	
ジャフコ	23,000	3,230.00	74,290,000	

トモニホールディングス	105,700	291.00	30,758,700
大和証券グループ本社	1,289,000	644.90	831,276,100
野村ホールディングス	2,650,900	448.20	1,188,133,380
岡三証券グループ	117,000	552.00	64,584,000
丸三証券	40,900	972.00	39,754,800
東洋証券	53,000	257.00	13,621,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	158,000	540.00	85,320,000
光世証券	33,000	128.00	4,224,000
水戸証券	42,600	282.00	12,013,200
いちよし証券	30,900	903.00	27,902,700
松井証券	67,400	880.00	59,312,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	306,100	2,923.50	894,883,350
だいこう証券ビジネス	6,700	669.00	4,482,300
日本取引所グループ	404,600	1,594.00	644,932,400
マネックスグループ	162,100	259.00	41,983,900
カブドットコム証券	122,100	338.00	41,269,800
極東証券	18,500	1,219.00	22,551,500
岩井コスモホールディングス	13,000	998.00	12,974,000
藍澤証券	19,300	535.00	10,325,500
フィデアホールディングス	84,000	162.00	13,608,000
池田泉州ホールディングス	145,900	380.00	55,442,000
アニコムホールディングス	9,300	2,872.00	26,709,600
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	411,800	2,882.50	1,187,013,500
マネースクウェアHD	4,700	936.00	4,399,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	132,000	1,339.00	176,748,000
マネーパートナーズグループ	12,700	737.00	9,359,900
小林洋行	4,700	235.00	1,104,500
第一生命保険	882,800	1,232.00	1,087,609,600
東京海上ホールディングス	558,200	3,435.00	1,917,417,000
イー・ギャランティ	4,500	2,432.00	10,944,000
アサックス	2,500	1,320.00	3,300,000
NECキャピタルソリューション	5,600	1,504.00	8,422,400
T & Dホールディングス	502,200	989.80	497,077,560
三井不動産	731,000	2,545.00	1,860,395,000
三菱地所	1,025,000	2,001.00	2,051,025,000
平和不動産	26,100	1,294.00	33,773,400
東京建物	150,500	1,340.00	201,670,000
ダイビル	35,500	898.00	31,879,000
京阪神ビルディング	22,900	564.00	12,915,600
住友不動産	330,000	3,034.00	1,001,220,000
太平洋興発	59,000	72.00	4,248,000
大京	256,000	171.00	43,776,000
テーオーシー	53,400	899.00	48,006,600
東京楽天地	23,000	472.00	10,856,000
レオパレス21	162,200	638.00	103,483,600
スターツコーポレーション	15,800	2,372.00	37,477,600

フジ住宅	17,700	663.00	11,735,100
空港施設	16,700	488.00	8,149,600
明和地所	7,500	591.00	4,432,500
住友不動産販売	9,900	1,989.00	19,691,100
ゴールドクレスト	10,800	1,501.00	16,210,800
リロ・ホールディング	5,500	15,300.00	84,150,000
日本エスリード	5,500	996.00	5,478,000
日神不動産	18,500	359.00	6,641,500
タカラレーベン	60,000	619.00	37,140,000
サンヨーハウジング名古屋	7,800	951.00	7,417,800
イオンモール	88,900	1,525.00	135,572,500
ファースト住建	5,200	1,294.00	6,728,800
ランド	64,400	13.00	837,200
東祥	4,400	4,535.00	19,954,000
トーセイ	20,900	743.00	15,528,700
穴吹興産	13,000	247.00	3,211,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	85,600	1,029.00	88,082,400
サンフロンティア不動産	16,600	1,017.00	16,882,200
エフ・ジェー・ネクスト	12,100	480.00	5,808,000
ランドビジネス	9,400	256.00	2,406,400
グランディハウス	12,100	340.00	4,114,000
東武鉄道	746,000	549.00	409,554,000
相鉄ホールディングス	239,000	703.00	168,017,000
東京急行電鉄	813,000	942.00	765,846,000
京浜急行電鉄	383,000	973.00	372,659,000
小田急電鉄	447,000	1,192.00	532,824,000
京王電鉄	390,000	969.00	377,910,000
京成電鉄	209,000	1,533.00	320,397,000
富士急行	38,000	1,488.00	56,544,000
新京成電鉄	18,000	427.00	7,686,000
東日本旅客鉄道	255,200	9,650.00	2,462,680,000
西日本旅客鉄道	134,400	6,414.00	862,041,600
東海旅客鉄道	125,000	18,960.00	2,370,000,000
西武ホールディングス	111,200	2,300.00	255,760,000
鴻池運輸	19,700	1,219.00	24,014,300
西日本鉄道	181,000	703.00	127,243,000
ハマキョウレックス	10,700	1,751.00	18,735,700
サカイ引越センター	5,500	2,707.00	14,888,500
近鉄グループホールディングス	1,405,000	445.00	625,225,000
阪急阪神ホールディングス	937,000	684.00	640,908,000
南海電気鉄道	313,000	595.00	186,235,000
京阪ホールディングス	313,000	803.00	251,339,000
神戸電鉄	33,000	355.00	11,715,000
名古屋鉄道	509,000	550.00	279,950,000
山陽電気鉄道	52,000	502.00	26,104,000
トランコム	4,000	6,180.00	24,720,000
日本通運	540,000	473.00	255,420,000
ヤマトホールディングス	258,000	2,087.50	538,575,000
山九	184,000	478.00	87,952,000
日新	57,000	292.00	16,644,000

丸運	8,600	235.00	2,021,000
丸全昭和運輸	45,000	389.00	17,505,000
センコー	63,000	668.00	42,084,000
トナミホールディングス	29,000	273.00	7,917,000
ニッコンホールディングス	45,700	1,923.00	87,881,100
日本石油輸送	17,000	228.00	3,876,000
福山通運	85,000	535.00	45,475,000
セイノーホールディングス	99,000	1,119.00	110,781,000
神奈川中央交通	16,000	649.00	10,384,000
日立物流	29,100	1,899.00	55,260,900
丸和運輸機関	3,100	2,532.00	7,849,200
C & F ロジホールディングス	13,400	785.00	10,519,000
日本郵船	1,253,000	208.00	260,624,000
商船三井	680,000	224.00	152,320,000
川崎汽船	611,000	214.00	130,754,000
N S ユナイテッド海運	62,000	136.00	8,432,000
明治海運	12,500	338.00	4,225,000
飯野海運	72,300	413.00	29,859,900
共栄タンカー	12,000	139.00	1,668,000
日本航空	267,200	4,058.00	1,084,297,600
A N A ホールディングス	2,591,000	307.40	796,473,400
パスコ	13,000	438.00	5,694,000
三菱倉庫	99,000	1,356.00	134,244,000
三井倉庫ホールディングス	81,000	277.00	22,437,000
住友倉庫	102,000	529.00	53,958,000
澁澤倉庫	37,000	273.00	10,101,000
ヤマタネ	65,000	146.00	9,490,000
東陽倉庫	24,000	220.00	5,280,000
乾汽船	11,000	792.00	8,712,000
日本トランスシティ	31,000	356.00	11,036,000
ケイヒン	26,000	131.00	3,406,000
中央倉庫	7,900	889.00	7,023,100
安田倉庫	11,000	655.00	7,205,000
東洋埠頭	41,000	142.00	5,822,000
宇徳	11,400	315.00	3,591,000
上組	167,000	998.00	166,666,000
サンリツ	1,700	474.00	805,800
キムラユニティー	3,600	1,060.00	3,816,000
キューソー流通システム	3,800	2,789.00	10,598,200
郵船ロジスティクス	12,800	1,266.00	16,204,800
近鉄エクスプレス	25,000	1,357.00	33,925,000
東海運	8,300	266.00	2,207,800
エーアイティー	6,500	918.00	5,967,000
内外トランスライン	3,500	953.00	3,335,500
東京放送ホールディングス	82,500	1,605.00	132,412,500
日本テレビホールディングス	125,800	1,791.00	225,307,800
朝日放送	13,700	654.00	8,959,800
テレビ朝日ホールディングス	37,600	1,893.00	71,176,800
スカパー J S A T ホールディングス	104,600	617.00	64,538,200
テレビ東京ホールディングス	12,500	1,912.00	23,900,000

日本BS放送	2,300	985.00	2,265,500
U-NEXT	3,200	965.00	3,088,000
コネクシオ	12,300	1,157.00	14,231,100
日本通信	73,100	196.00	14,327,600
クロップス	1,400	501.00	701,400
日本電信電話	1,065,000	4,752.00	5,060,880,000
KDDI	1,399,700	3,024.00	4,232,692,800
光通信	16,600	8,170.00	135,622,000
NTTドコモ	1,062,600	2,615.50	2,779,230,300
エムティーアイ	17,600	784.00	13,798,400
GMOインターネット	51,000	1,314.00	67,014,000
カドカワ	43,000	1,538.00	66,134,000
学研ホールディングス	46,000	244.00	11,224,000
ゼンリン	18,200	2,371.00	43,152,200
昭文社	7,700	583.00	4,489,100
インプレスホールディングス	11,100	137.00	1,520,700
東京電力ホールディングス	1,184,100	577.00	683,225,700
中部電力	427,100	1,473.00	629,118,300
関西電力	569,700	977.50	556,881,750
中国電力	193,000	1,401.00	270,393,000
北陸電力	136,800	1,495.00	204,516,000
東北電力	348,800	1,356.00	472,972,800
四国電力	125,700	1,456.00	183,019,200
九州電力	308,300	1,091.00	336,355,300
北海道電力	130,600	928.00	121,196,800
沖縄電力	14,800	2,797.00	41,395,600
電源開発	119,000	3,280.00	390,320,000
ファーストエスコ	5,700	542.00	3,089,400
イーレックス	2,700	1,657.00	4,473,900
東京瓦斯	1,558,000	476.30	742,075,400
大阪瓦斯	1,445,000	395.80	571,931,000
東邦瓦斯	352,000	746.00	262,592,000
北海道瓦斯	35,000	268.00	9,380,000
広島ガス	24,600	357.00	8,782,200
西部瓦斯	158,000	238.00	37,604,000
静岡ガス	39,700	745.00	29,576,500
メタウォーター	9,000	2,538.00	22,842,000
アイネット	7,700	1,056.00	8,131,200
松竹	91,000	1,018.00	92,638,000
東宝	98,300	2,837.00	278,877,100
エイチ・アイ・エス	23,800	2,979.00	70,900,200
東映	51,000	880.00	44,880,000
AOI Pro.	7,000	922.00	6,454,000
ラックランド	2,100	1,587.00	3,332,700
エヌ・ティ・ティ・データ	85,100	5,360.00	456,136,000
共立メンテナンス	10,900	9,290.00	101,261,000
イチネンホールディングス	15,300	957.00	14,642,100
建設技術研究所	8,600	897.00	7,714,200
スペース	7,900	1,341.00	10,593,900
アインホールディングス	16,600	5,800.00	96,280,000

燦ホールディングス	2,900	1,384.00	4,013,600
ピー・シー・エー	1,800	1,304.00	2,347,200
スバル興業	3,000	372.00	1,116,000
東京テアトル	57,000	115.00	6,555,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	922.00	1,567,400
ナガワ	2,700	2,557.00	6,903,900
よみうりランド	29,000	529.00	15,341,000
東京都競馬	100,000	211.00	21,100,000
常磐興産	55,000	147.00	8,085,000
カナモト	20,300	2,455.00	49,836,500
東京ドーム	116,000	484.00	56,144,000
D T S	15,300	2,064.00	31,579,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58,300	2,872.00	167,437,600
シーイーシー	9,000	1,396.00	12,564,000
カブコン	35,200	2,713.00	95,497,600
西尾レントオール	11,700	2,478.00	28,992,600
アイ・エス・ビー	1,600	830.00	1,328,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	73,000	41.00	2,993,000
日本空港ビルデング	43,900	3,700.00	162,430,000
トランス・コスモス	16,900	2,748.00	46,441,200
乃村工藝社	31,200	1,868.00	58,281,600
ジャステック	8,800	878.00	7,726,400
S C S K	32,800	4,175.00	136,940,000
藤田観光	53,000	541.00	28,673,000
K N T - C Tホールディングス	71,000	171.00	12,141,000
日本管財	12,500	1,655.00	20,687,500
トーカイ	6,500	3,075.00	19,987,500
白洋舎	5,000	254.00	1,270,000
セコム	151,700	7,994.00	1,212,689,800
日本システムウエア	5,200	995.00	5,174,000
セントラル警備保障	6,400	2,643.00	16,915,200
アイネス	19,500	1,133.00	22,093,500
丹青社	27,300	865.00	23,614,500
メイテック	18,100	3,780.00	68,418,000
T K C	12,700	2,889.00	36,690,300
アサツー ディ・ケイ	25,600	2,720.00	69,632,000
富士ソフト	20,500	2,376.00	48,708,000
応用地質	13,800	1,119.00	15,442,200
船井総研ホールディングス	20,300	1,695.00	34,408,500
N S D	29,300	1,665.00	48,784,500
進学会	7,000	557.00	3,899,000
丸紅建材リース	12,000	166.00	1,992,000
オオバ	8,200	404.00	3,312,800
コナミホールディングス	62,200	3,460.00	215,212,000
学究社	2,200	1,186.00	2,609,200
ベネッセホールディングス	48,900	3,125.00	152,812,500
イオンディライト	14,100	3,345.00	47,164,500
ナック	9,000	829.00	7,461,000

福井コンピュータホールディングス	3,000	1,423.00	4,269,000
ニチイ学館	25,400	755.00	19,177,000
ダイセキ	27,400	1,918.00	52,553,200
ステップ	5,100	1,037.00	5,288,700
日鉄住金物産	91,000	354.00	32,214,000
元気寿司	3,900	2,156.00	8,408,400
トラスコ中山	15,700	4,365.00	68,530,500
ヤマダ電機	418,900	555.00	232,489,500
オートバックスセブン	52,800	1,810.00	95,568,000
アークランドサカモト	23,300	1,089.00	25,373,700
ニトリホールディングス	59,500	10,410.00	619,395,000
グルメ杵屋	9,000	992.00	8,928,000
愛眼	10,800	213.00	2,300,400
ケーユーホールディングス	7,200	697.00	5,018,400
吉野家ホールディングス	50,800	1,341.00	68,122,800
加藤産業	21,500	2,688.00	57,792,000
イノテック	12,700	415.00	5,270,500
イエローハット	13,000	2,215.00	28,795,000
松屋フーズ	6,600	2,885.00	19,041,000
J B C Cホールディングス	11,700	659.00	7,710,300
J Kホールディングス	14,100	451.00	6,359,100
サガミチェーン	18,500	1,214.00	22,459,000
日伝	5,500	2,749.00	15,119,500
関西スーパーマーケット	11,500	774.00	8,901,000
ミロク情報サービス	10,200	1,174.00	11,974,800
北沢産業	11,000	157.00	1,727,000
杉本商事	8,000	1,129.00	9,032,000
因幡電機産業	19,300	3,405.00	65,716,500
王将フードサービス	10,100	3,310.00	33,431,000
プレナス	15,400	2,028.00	31,231,200
ミニストップ	10,200	1,899.00	19,369,800
アークス	25,800	2,490.00	64,242,000
パローホールディングス	29,700	2,706.00	80,368,200
バイテックホールディングス	4,200	870.00	3,654,000
ミスミグループ本社	154,700	1,493.00	230,967,100
アルテック	11,700	142.00	1,661,400
ベルク	6,800	4,225.00	28,730,000
大 庄	6,500	1,500.00	9,750,000
タキヒヨー	22,000	414.00	9,108,000
ファーストリテイリング	27,600	26,815.00	740,094,000
ソフトバンクグループ	780,700	5,677.00	4,432,033,900
蔵王産業	2,400	1,254.00	3,009,600
スズケン	62,700	3,695.00	231,676,500
サンドラッグ	29,100	8,080.00	235,128,000
サックスパー ホールディングス	12,900	1,435.00	18,511,500
ジェコス	9,500	920.00	8,740,000
ヤマザワ	3,000	1,648.00	4,944,000
やまや	2,800	1,984.00	5,555,200
ルネサスイーストン	8,700	399.00	3,471,300
ベルーナ	34,400	541.00	18,610,400

合計	231,743,106		264,099,098,513	
----	-------------	--	-----------------	--

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		-	3,756,083,368
コール・ローン		2,224,478,564	-
国債証券		317,928,930,800	329,136,399,100
地方債証券		26,783,612,286	25,587,051,778
特殊債券		23,721,372,706	22,513,454,636
社債券		20,909,216,540	20,225,236,220
未収利息		794,409,192	719,893,333
前払費用		9,719,715	15,431,464
流動資産合計		392,371,739,803	401,953,549,899
資産合計		392,371,739,803	401,953,549,899
負債の部			
流動負債			
未払解約金		210,279,000	309,803,000
流動負債合計		210,279,000	309,803,000
負債合計		210,279,000	309,803,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	316,855,478,878	308,243,052,850
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		75,305,981,925	93,400,694,049
元本等合計		392,161,460,803	401,643,746,899
純資産合計		392,161,460,803	401,643,746,899
負債純資産合計		392,371,739,803	401,953,549,899

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	329,990,067,102円 5,819,947,068円 18,954,535,292円	316,855,478,878円 53,785,582,072円 62,398,008,100円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	10,610,110,772円	10,189,723,711円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	177,424,282円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	129,810,216円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	52,465,611円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	407,909,092円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	107,590,970円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	19,551,322円
たわらノーロード 国内債券	- 円	499,029,979円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	11,183,879,620円	11,809,576,538円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	4,560,763,857円	4,411,073,872円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	6,939,063,876円	6,480,491,204円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,800,386,834円	2,615,279,280円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,703,049,604円	1,653,291,162円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,857,722,753円	1,806,678,912円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	285,255,001円	268,626,805円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	122,199,952円	107,576,268円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,386,777,943円	2,209,086,423円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,346,875円	5,452,881円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	226,593,600円	231,432,354円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	159,689,036円	174,623,598円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	43,621,584円	44,208,206円
投資のソムリエ	7,603,993,960円	6,344,706,145円
クルーズコントロール	395,203,752円	604,204,415円
投資のソムリエ<DC年金>	125,186,249円	125,649,262円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	583,823,917円	767,551,057円
D I A M D C バランス・F (成長型)	27,996,987円	56,353,219円
クルーズコントロール<DC年 金>	126,052円	151,948円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	5,523,880円	1,989,847円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	13,004,249円	3,480,335円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	- 円	20,893,399円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	1,931,127円
みずほエマージングボンドオー プン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	12,016,292,940円	31,096,487,907円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	1,279,005,279円	1,137,777,976円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	642,627,808円	594,706,063円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	1,837,672,697円	586,764,909円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	333,370,299円	293,906,868円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	177,639,936円	145,321,307円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	467,309,828円	361,970,931円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	194,420,100円	148,960,776円

D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	151,181,830円	120,207,345円
D I A M世界バランスファン ド4 0 V A (適格機関投資家限 定)	16,332,125,844円	10,701,542,796円
D I A M世界バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家限 定)	6,187,740,575円	4,159,400,477円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	10,375,754,139円	8,198,032,403円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	4,155,493,213円	3,748,904,424円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	7,170,742,145円	6,487,138,553円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	840,840,673円	777,766,005円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	3,756,926,921円	3,349,309,389円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	5,189,873,187円	4,700,107,293円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	7,219,477,959円	6,328,177,230円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	884,082,241円	839,267,900円
D I A M世界バランスファン ド5 5 V A (適格機関投資家限 定)	7,050,158,468円	6,492,607,467円
D I A M世界バランスファン ド3 5 V A (適格機関投資家限 定)	7,564,188,784円	6,792,117,861円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	18,960,024円	- 円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	95,547,128,459円	89,389,465,051円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	1,399,541,344円	1,263,312,175円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	8,283,528,234円	7,678,814,912円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	30,413,681,432円	28,270,093,182円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	486,613円	479,010円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	69,332,819円	64,892,567円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	10,688,870円	9,650,616円
	D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	34,126,849,735円	31,761,944,157円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	645,177,103円	582,247,446円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	166,391,543円	156,781,930円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	427,964,083円	451,004,519円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	248,307,734円	195,890,787円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	334,827円	326,339円
	計	316,855,478,878円	308,243,052,850円
2.	受益権の総数	316,855,478,878口	308,243,052,850口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4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27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	4,129,823,600	11,866,127,200
地方債証券	19,735,673	16,907,361
特殊債券	48,505,831	430,784
社債券	88,889,040	35,623,290
合計	3,972,693,056	11,918,227,067

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年2月17日から平成27年10月13日まで及び平成28年2月16日から平成28年4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27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.2377円	1.3030円
（1万口当たり純資産額）	（12,377円）	（13,030円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 5 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,007,860,000	
	3 5 4 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,506,315,000	
	3 5 5 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,013,500,000	
	3 5 6 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,009,720,000	
	3 5 8 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,508,145,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,523,265,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,528,575,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,324,882,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,013,600,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,021,380,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,521,420,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,024,180,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,547,215,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,251,702,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,053,800,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,550,015,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,522,875,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,517,670,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,556,925,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,546,550,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,069,700,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,059,160,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,250,016,000	
	1 2 7 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,016,460,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	925,050,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,087,842,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,254,832,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,209,752,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,041,236,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,140,656,000	
	8 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,327,930,000	
	2 8 6 回 利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,662,920,000	
	2 8 8 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,542,000,000	
	2 8 9 回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,294,624,000	
	2 9 0 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,031,960,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,298,890,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,129,540,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,402,672,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,673,296,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,062,487,000	

303回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,373,905,000	
305回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,643,225,000	
306回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,662,300,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,384,071,000	
309回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,056,210,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,954,420,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,348,522,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,227,460,000	
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,612,155,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,072,950,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,814,648,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,614,495,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,070,570,000	
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,684,175,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,128,600,000	
325回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,667,400,000	
326回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,806,148,000	
328回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,114,720,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,072,910,000	
330回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,687,750,000	
332回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,122,420,000	
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,124,700,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,978,976,000	
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,112,900,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,585,815,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,351,493,000	
338回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,622,125,000	
339回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,670,730,000	
340回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,196,560,000	
341回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,678,335,000	
342回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,019,040,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	137,166,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	132,614,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,196,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	282,034,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,068,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	270,474,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	402,987,000	
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	380,223,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	502,192,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	397,722,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	393,255,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	691,640,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	280,720,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	563,096,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	278,260,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,127,975,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	275,566,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	425,127,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	691,035,000	

2 2 回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	668,889,900	
2 3 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	855,312,000	
2 4 回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	428,751,000	
2 5 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	835,368,000	
2 6 回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	990,521,000	
2 7 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,298,826,000	
2 8 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,161,008,000	
2 9 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,582,306,000	
3 0 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,424,570,000	
3 1 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,268,901,000	
3 2 回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	2,016,252,000	
3 3 回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,790,958,000	
3 4 回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,716,984,000	
3 5 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	2,085,420,000	
3 6 回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,956,192,000	
3 7 回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,932,126,000	
3 8 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,360,240,000	
3 9 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,110,576,000	
4 0 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,364,700,000	
4 1 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,072,608,000	
4 2 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,341,810,000	
4 3 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,344,620,000	
4 4 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,077,936,000	
4 5 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,037,136,000	
4 6 回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,815,842,000	
4 7 回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,856,036,000	
4 8 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,398,914,000	
4 9 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,273,810,000	
5 0 回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	442,772,000	
3 7 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	628,878,000	
3 9 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	422,116,000	
4 0 回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	764,848,800	
4 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	867,136,000	
4 3 回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	953,284,200	
4 5 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	993,573,000	
4 6 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	550,955,000	
4 7 回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,053,103,500	
4 8 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	564,450,000	
5 0 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	862,360,200	
5 1 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	670,092,000	
5 2 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	620,438,500	
5 4 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	797,566,000	
5 5 回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	918,167,400	
5 7 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,279,838,000	
5 8 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	682,848,000	
6 0 回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,098,484,200	
6 1 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	868,112,000	
6 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,394,783,000	
6 4 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	694,614,000	
6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,278,354,000	

67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,217,205,000
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,516,062,500
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,491,000,000
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,414,576,800
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,682,198,000
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,722,063,500
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,681,722,000
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,701,294,000
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,706,474,000
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,492,536,000
90回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,734,166,000
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,602,900,000
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	858,711,000
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	990,184,000
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,517,220,000
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,760,346,000
99回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,500,660,000
100回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,899,495,000
102回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,201,211,000
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,640,587,000
107回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,771,882,000
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,990,624,000
111回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,058,720,000
113回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,170,985,000
114回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,178,210,000
116回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,338,758,000
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,274,680,000
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,121,859,000
121回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,400,422,000
123回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,460,728,000
125回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,363,148,000
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	889,812,000
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,130,562,000
130回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,139,382,000
132回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,992,320,000
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,136,403,000
135回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,247,030,000
137回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,123,096,000
140回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,376,254,000
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,379,446,000
143回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,598,582,000
145回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,010,448,000
146回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,012,880,000
147回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,360,465,000
148回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,082,619,000
149回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,574,537,000
150回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,416,040,000
151回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,343,400,000
152回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,757,610,000
153回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,499,105,000

	154回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,109,168,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,266,560,000	
	156回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	507,970,000	
国債証券 合計		288,320,000,000	329,136,399,100	
地方債証券	659回 東京都公募公債	203,500,000	210,657,095	
	667回 東京都公募公債	300,000,000	313,755,000	
	680回 東京都公募公債	200,000,000	210,778,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	523,120,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	208,112,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	528,095,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	736,463,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	526,895,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	317,628,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	420,684,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	248,204,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	210,250,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	211,268,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	313,671,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,835,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	312,003,000	
	307回 大阪府公募公債	100,000,000	102,688,000	
	310回 大阪府公募公債	240,000,000	246,573,600	
	319回 大阪府公募公債	200,000,000	208,204,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	210,706,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	315,783,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	210,904,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	313,290,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	318,555,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	362,271,000	
	19年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,746,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	206,530,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	325,215,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	206,107,310	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	208,850,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	211,160,000	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	103,893,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	209,728,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	530,700,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	317,100,000	
	22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	211,088,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	460,504,000	
	23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	211,752,000	
	26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	418,036,000	
	21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	210,366,000	
	25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	210,026,000	
	21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	209,496,000	
	24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	313,932,000	
	25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	211,528,000	
	55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,566,000	
	57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,474,000	

65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,790,000		
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	738,269,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	528,565,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	741,090,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,029,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	530,320,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	737,037,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	525,865,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,160,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	838,413,973		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,265,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,893,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,305,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	520,805,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,470,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	414,440,000		
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	417,376,000		
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	522,280,000		
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	138,291,300		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	470,767,500		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	209,994,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	211,318,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	474,687,000		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	423,624,000		
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	308,343,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	210,598,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,640,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	209,880,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	213,346,000		
地方債証券 合計		24,359,400,000	25,587,051,778		
特殊債券	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,540,000	
	25回	高速道路機構債	300,000,000	307,821,000	
	48回	高速道路機構債	700,000,000	734,972,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	734,237,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	104,828,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,362,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	335,007,000	
	36回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	351,770,960	
	40回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	339,725,160	
	47回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,102,000	
	54回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,540,000	
	56回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,628,000	

6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	735,046,690	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	167,951,880	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	417,292,630	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	622,566,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	729,694,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,787,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,431,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	421,836,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,047,550,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,065,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	530,685,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	351,189,300	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	519,025,000	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	513,305,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	681,232,440	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,037,880	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,280,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,613,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,275,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,594,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,049,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,096,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,990,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	421,900,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	531,900,000	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,110,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	207,896,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,586,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	314,193,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	63,798,000	68,843,783	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	44,652,000	48,108,064	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	65,883,000	71,045,591	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	71,268,000	77,347,160	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	31,093,000	32,686,516	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	159,390,000	166,417,505	

	4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,243,000	43,635,329	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,675,000	30,132,540	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	103,032,000	112,058,633	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,259,000	87,074,594	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,315,000	146,267,358	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,990,000	256,835,542	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	463,440,000	497,104,281	
	7 5 5 号 利付商工債	260,000,000	261,541,800	
	い第 7 6 9 号 利付商工債	200,000,000	201,410,000	
	い第 7 7 9 号 利付商工債	200,000,000	201,412,000	
	7 5 3 号 利附農林債	300,000,000	301,269,000	
	7 6 0 号 利附農林債	300,000,000	302,841,000	
	7 6 4 号 利附農林債	500,000,000	504,530,000	
	2 7 5 回 利附信金中金債	400,000,000	401,780,000	
	2 8 2 回 利附信金中金債	300,000,000	301,845,000	
	2 9 3 回 利附信金中金債	400,000,000	402,732,000	
	3 0 2 回 利附信金中金債	300,000,000	301,818,000	
	1 8 6 号 利附商工債(3年)	200,000,000	200,688,000	
	2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	310,695,000	
	5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	209,066,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	527,560,000	
特殊債券 合計		21,613,038,000	22,513,454,636	
社債券	1 回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,545,000	
	2 7 回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,086,000	
	2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	313,305,000	
	7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,463,000	
	9 回 日本たばこ産業社債	200,000,000	201,034,000	
	3 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	104,190,000	
	4 1 回 住友化学社債	100,000,000	105,354,000	
	3 7 回 三菱化学社債	100,000,000	104,642,000	
	8 回 プリヂストン社債	200,000,000	201,216,000	
	6 4 回 新日本製鐵社債	100,000,000	105,488,000	
	1 回 日本電産社債	100,000,000	100,442,000	
	1 1 回 パナソニック社債	100,000,000	101,893,000	
	1 2 回 パナソニック社債	200,000,000	202,022,000	
	5 6 回 日産自動車社債	100,000,000	101,865,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	211,528,000	
	1 6 回 トヨタ自動車社債	100,000,000	103,760,000	
	4 9 回 伊藤忠商事社債	100,000,000	104,889,000	
	6 6 回 伊藤忠商事社債	200,000,000	200,886,000	
	9 1 回 丸紅社債	100,000,000	100,566,000	
	9 4 回 丸紅社債	100,000,000	105,268,000	
	4 5 回 住友商事社債	100,000,000	104,759,000	
	4 7 回 住友商事社債	100,000,000	103,640,000	
	6 9 回 三菱商事社債	300,000,000	312,297,000	
	4 8 回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,964,000	
	3 1 回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,320,000	

32回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,828,000	
7回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	107,248,000	
140回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,176,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	214,594,000	
12回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,304,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,334,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,124,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	322,422,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,164,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,184,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,652,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,406,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	101,873,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,220,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	207,050,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	104,508,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,862,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,624,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,044,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	426,512,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,329,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	213,396,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,465,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	215,092,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	209,058,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	102,341,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,301,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,386,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,876,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,221,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,642,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,708,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	210,718,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	116,817,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	103,259,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	210,184,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,574,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,769,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	103,771,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,510,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	333,813,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,502,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	351,519,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,558,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,440,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,410,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	343,128,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,651,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,614,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	193,855,100	

1 1 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,197,000	
1 4 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	116,536,000	
1 5 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	212,626,000	
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,277,000	
5 4 回	日本電信電話社債	200,000,000	206,880,000	
6 0 回	日本電信電話社債	300,000,000	317,379,000	
1 5 回	N T T ドコモ社債	200,000,000	208,512,000	
4 5 5 回	東京電力社債	200,000,000	208,770,000	
5 4 2 回	東京電力社債	500,000,000	512,670,000	
4 7 6 回	中部電力社債	100,000,000	104,572,000	
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	522,815,000	
4 1 0 回	関西電力社債	300,000,000	314,463,000	
4 8 6 回	関西電力社債	154,000,000	155,407,560	
4 9 2 回	関西電力社債	200,000,000	202,686,000	
4 9 3 回	関西電力社債	200,000,000	202,472,000	
3 1 0 回	中国電力社債	200,000,000	208,144,000	
3 7 7 回	中国電力社債	200,000,000	212,610,000	
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	108,972,000	
2 8 1 回	北陸電力社債	200,000,000	207,820,000	
4 7 1 回	東北電力社債	200,000,000	212,916,000	
4 7 3 回	東北電力社債	300,000,000	305,553,000	
2 3 7 回	四国電力社債	100,000,000	105,198,000	
2 5 3 回	四国電力社債	200,000,000	210,682,000	
4 2 3 回	九州電力社債	200,000,000	205,388,000	
4 2 4 回	九州電力社債	200,000,000	212,400,000	
4 2 6 回	九州電力社債	400,000,000	420,104,000	
3 2 0 回	北海道電力社債	200,000,000	203,652,000	
3 2 1 回	北海道電力社債	161,000,000	168,077,560	
3 8 回	電源開発社債	300,000,000	315,135,000	
1 7 回	東京ガス社債	100,000,000	105,575,000	
9 回	大阪ガス社債	100,000,000	105,131,000	
1 8 回	大阪ガス社債	100,000,000	109,219,000	
2 7 回	N T T データ社債	100,000,000	105,939,000	
社債券 合計		19,305,000,000	20,225,236,220	
合計		353,597,438,000	397,462,141,734	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		8,814,164,373	3,247,452,913
金銭信託		-	224,738,554
コール・ローン		56,656,644	-
株式		270,386,591,397	239,693,327,057
投資信託受益証券		807,368,710	815,185,569
投資証券		6,260,359,022	5,954,684,803
派生商品評価勘定		407,897,463	16,090,033
未収入金		2,043,961	2,608,193
未収配当金		316,123,934	452,532,441
差入委託証拠金		2,080,064,646	1,737,386,133
流動資産合計		289,131,270,150	252,144,005,696
資産合計		289,131,270,150	252,144,005,696
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		423,664	49,753,814
未払解約金		80,724,000	188,279,000
流動負債合計		81,147,664	238,032,814
負債合計		81,147,664	238,032,814
純資産の部			
元本等			
元本	1	102,800,378,688	100,376,486,929
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		186,249,743,798	151,529,485,953
元本等合計		289,050,122,486	251,905,972,882
純資産合計		289,050,122,486	251,905,972,882
負債純資産合計		289,131,270,150	252,144,005,696

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4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	98,157,384,691円	102,800,378,688円
同期中追加設定元本額	6,250,756,324円	12,128,150,669円
同期中一部解約元本額	1,607,762,327円	14,552,042,428円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,119,175,509円	1,788,595,308円
M I T O ラップ型ファンド （安定型）	- 円	6,604,725円
M I T O ラップ型ファンド （中立型）	- 円	15,524,269円
M I T O ラップ型ファンド （積極型）	- 円	38,959,726円
グローバル8資産ラップファン ド（安定型）	- 円	15,179,952円
グローバル8資産ラップファン ド（中立型）	- 円	12,864,502円
グローバル8資産ラップファン ド（積極型）	- 円	14,523,807円
たわらノーロード 先進国株式	- 円	1,072,918,679円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C年金>	33,993,104,111円	34,766,616,203円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	148,265,440円	173,118,894円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	818,639,464円	917,639,046円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,044,869,296円	1,111,350,088円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	142,164,161円	142,155,136円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	408,169,305円	406,671,520円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	331,856,954円	338,651,848円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	44,564,223円	45,878,510円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	855,892,942円	941,290,466円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	242,749,015円	233,871,162円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国1 0）	18,376,910円	20,137,197円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国2 0）	35,655,942円	41,952,336円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国3 0）	79,250,573円	87,646,721円
投資のソムリエ	338,753,785円	482,795,796円
クルーズコントロール	55,856,701円	116,268,511円

投資のソムリエ<DC年金>	5,573,276円	9,613,588円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	48,256,073円	66,974,299円
D I A M DC バランス・F (成長型)	11,405,832円	24,170,672円
クルーズコントロール<DC年 金>	17,772円	29,118円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	2,432,944円	943,052円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	5,730,205円	1,694,210円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	- 円	687,689円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	481,486円
D I A M外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	278,372,403円	236,086,422円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,406,456,936円	3,289,774,540円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	124,104,729円	128,257,996円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	39,486,856円	37,893,303円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	724,016,406円	238,952,951円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	393,841,463円	359,374,805円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	35,887,852円	30,433,874円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	220,681,027円	176,929,290円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	18,321,569円	14,554,579円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	35,678,126円	29,380,982円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	5,136,920,981円	3,486,933,737円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	2,921,275,554円	2,033,275,948円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,225,421,906円	1,001,022,717円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	1,143,720,278円	1,068,670,511円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,389,655,512円	3,170,868,674円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	1,330,757,724円	1,268,826,641円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	2,129,038,401円	1,978,553,654円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	1,635,609,518円	1,531,346,790円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	1,134,201,469円	1,026,284,541円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	11,130,233円	12,333,699円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	4,994,233,495円	4,760,748,846円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	1,750,857,571円	1,750,696,285円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	843,239円	- 円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	11,275,001,774円	10,919,205,164円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	661,196,750円	617,500,459円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	1,955,551,826円	1,875,935,770円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	7,178,571,130円	6,907,398,462円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	142,381円	146,181円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	52,307,284円	50,768,531円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	18,504,997円	17,305,113円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	9,666,803,838円	9,312,519,661円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	60,448,279円	66,316,398円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	100,292,840円	82,094,578円

	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	283,908円	287,311円
計		102,800,378,688円	100,376,486,929円
2.	受益権の総数	102,800,378,688口	100,376,486,929口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年10月13日現在	平成28年4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	12,479,024,127	19,340,099,479
投資信託受益証券	73,146,640	40,013,207
投資証券	303,801,843	772,994,733
合計	12,855,972,610	20,153,107,419

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年2月17日から平成27年10月13日まで及び平成28年2月16日から平成28年4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27年10月13日 現在				平成28年4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	46,399,180	-	46,762,600	363,420	-	-	-	-
イギリス・債券	3,684,900	-	3,672,000	12,900	-	-	-	-
オーストラリア・ ドル	42,714,280	-	43,090,600	376,320	-	-	-	-
買 建	680,956,654	-	680,913,900	42,754	352,526,790	-	352,503,900	22,890
アメリカ・ドル	437,814,580	-	437,781,000	33,580	252,968,040	-	252,954,000	14,040
イギリス・債券	58,753,984	-	58,752,000	1,984	19,837,480	-	19,836,700	780
オーストラリア・ ドル	21,985,250	-	21,982,500	2,750	12,232,800	-	12,231,000	1,800
カナダ・ドル	27,602,460	-	27,600,000	2,460	10,806,120	-	10,805,600	520
ユーロ	134,800,380	-	134,798,400	1,980	56,682,350	-	56,676,600	5,750
合計	727,355,834	-	727,676,500	406,174	352,526,790	-	352,503,900	22,890

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

株式関連

種類	平成27年10月13日 現在				平成28年4月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	11,761,249,479	-	12,169,129,452	407,879,973	5,705,191,196	-	5,671,550,305	33,640,891
合計	11,761,249,479	-	12,169,129,452	407,879,973	5,705,191,196	-	5,671,550,305	33,640,891

(注) 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	2.8118円	2.5096円
(1万口当たり純資産額)	(28,118円)	(25,096円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年4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	31,822	594.600	18,921,361.200	
	ABBOTT LABORATORIES	112,250	42.370	4,756,032.500	
	AES CORP	50,413	10.960	552,526.480	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,137	149.350	10,773,660.950	
	ADOBE SYSTEMS INC	40,204	94.070	3,781,990.280	
	CHUBB LTD	36,008	118.810	4,278,110.480	
	AGCO CORP	6,536	48.630	317,845.680	
	AIRGAS INC	4,576	142.050	650,020.800	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,355	142.520	2,330,914.600	
	ALLEGHANY CORP	1,188	488.560	580,409.280	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	69,529	63.200	4,394,232.800	
	RALPH LAUREN CORP	4,294	91.240	391,784.560	
	ALLSTATE CORP	31,687	66.840	2,117,959.080	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	56,995	112.120	6,390,279.400	
	ALCOA INC	102,779	9.370	963,039.230	
	AMGEN INC	59,554	156.460	9,317,818.840	
	HESS CORP	20,456	54.480	1,114,442.880	
	AMERICAN EXPRESS CO	68,554	59.500	4,078,963.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	38,075	66.010	2,513,330.750	
	AFLAC INC	30,414	63.910	1,943,758.740	
	AMERICAN INTL GROUP	95,042	53.160	5,052,432.720	
	AMERCO	551	338.490	186,507.990	
	JARDEN CORP	13,598	58.620	797,114.760	
	ANALOG DEVICES	26,862	58.800	1,579,485.600	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,466	48.290	1,905,813.140	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,216	148.890	2,712,180.240	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	31,929	35.420	1,130,925.180	
	TIME WARNER	62,035	73.610	4,566,396.350	
	JONES LANG LASALLE INC	4,328	115.210	498,628.880	
	VALERO ENERGY CORP	40,916	63.060	2,580,162.960	
	APACHE CORP	29,768	50.660	1,508,046.880	
	ANSYS INC	7,266	87.670	637,010.220	
	APPLE INC	439,559	108.660	47,762,480.940	
APPLIED MATERIALS INC	92,368	20.790	1,920,330.720		
ALBEMARLE CORP	7,690	64.850	498,696.500		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,013	36.090	1,696,699.170		

PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	74.360	696,009.600	
AMEREN CORP	19,716	48.780	961,746.480	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	63.260	491,340.420	
ASHLAND INC	5,128	109.100	559,464.800	
AGL RESOURCES INC	8,945	65.380	584,824.100	
AUTOLIV INC	5,831	111.560	650,506.360	
AUTODESK INC	16,361	56.760	928,650.360	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,207	90.330	3,360,908.310	
AUTOZONE INC	2,371	783.930	1,858,698.030	
AVERY DENNISON CORP	9,595	71.720	688,153.400	
AVNET INC	10,288	43.480	447,322.240	
BAKER HUGHES INC	34,030	43.110	1,467,033.300	
BALL CORP	10,625	70.800	752,250.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	93,004	141.060	13,119,144.240	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,330	35.490	2,992,871.700	
CR BARD INC	5,892	203.200	1,197,254.400	
BAXTER INTERNATIONAL INC	41,887	41.840	1,752,552.080	
BED BATH & BEYOND INC	13,962	46.990	656,074.380	
BECTON DICKINSON & CO	15,840	154.640	2,449,497.600	
AMETEK INC	19,168	49.530	949,391.040	
BE AEROSPACE INC	7,540	47.360	357,094.400	
VERIZON COMM INC	324,572	52.180	16,936,166.960	
WR BERKLEY CORP	6,604	55.420	365,993.680	
BEST BUY CO INC	23,778	30.110	715,955.580	
YUM! BRANDS INC	32,791	82.340	2,700,010.940	
FIRSTENERGY CORP	33,061	35.120	1,161,102.320	
H&R BLOCK INC	20,906	24.350	509,061.100	
BOEING CO	51,618	127.880	6,600,909.840	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	44.480	482,430.080	
BORGWARNER INC	17,824	34.180	609,224.320	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,273	19.310	2,090,751.630	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	71.840	832,769.280	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	350.280	771,666.840	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,814	66.070	8,775,020.980	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	157.280	672,529.280	
ONEOK INC	16,401	29.990	491,865.990	
UNITED RENTALS INC	7,795	59.500	463,802.500	
SEMPRA ENERGY	18,407	104.240	1,918,745.680	
FEDEX CORP	20,378	163.420	3,330,172.760	
VERISIGN INC	7,229	89.760	648,875.040	
AMPHENOL CORP	27,155	58.370	1,585,037.350	
BROWN-FORMAN CORP	9,485	96.240	912,836.400	

QUANTA SERVICES INC	16,615	22.130	367,689.950	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	26,032	51.830	1,349,238.560	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	179,873	3.850	692,511.050	
CSX CORP	80,888	24.800	2,006,022.400	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,517	32.930	510,974.810	
CABOT OIL & GAS CORP	33,871	23.480	795,291.080	
CAMPBELL SOUP CO	13,787	64.210	885,263.270	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,338	33.230	775,521.740	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,276	159.010	2,111,016.760	
CARDINAL HEALTH INC	26,820	83.000	2,226,060.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	51.140	1,660,618.080	
CATERPILLAR INC	43,844	74.350	3,259,801.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,933	85.140	505,135.620	
CELGENE CORP	61,933	106.260	6,581,000.580	
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	106.610	336,780.990	
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	78.500	980,465.000	
CENTURYLINK INC	40,487	31.880	1,290,725.560	
CERNER CORP	25,633	56.450	1,446,982.850	
JPMORGAN CHASE & CO	290,575	57.740	16,777,800.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,603	94.110	997,848.330	
CIGNA CORP	20,009	130.410	2,609,373.690	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	64.650	764,938.800	
CINTAS CORP	7,454	89.320	665,791.280	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	79,229	5.250	415,952.250	
CISCO SYSTEMS INC	396,526	27.690	10,979,804.940	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	7,706	34.300	264,315.800	
CLOROX COMPANY	9,481	128.530	1,218,592.930	
COCA-COLA CO/THE	326,767	46.870	15,315,569.290	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	16,090	52.540	845,368.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,256	71.070	4,850,953.920	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	16,077	66.570	1,070,245.890	
COMERICA INC	13,912	36.760	511,405.120	
NRG ENERGY, INC.	23,703	12.670	300,317.010	
COMCAST CORP-CL A	193,903	61.600	11,944,424.800	
CA INC	26,267	30.040	789,060.680	
CONAGRA FOODS INC	34,323	46.140	1,583,663.220	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,012	76.040	1,673,792.480	
CMS ENERGY CORP	20,017	41.710	834,909.070	
COOPER COS INC	3,794	155.210	588,866.740	
MOLSON COORS BREWING CO	14,823	93.120	1,380,317.760	

CORNING INC	91,502	20.530	1,878,536.060	
WR GRACE & CO	2,495	74.350	185,503.250	
SEALED AIR CORP	15,017	49.510	743,491.670	
CUMMINS INC	12,850	106.280	1,365,698.000	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	119.410	790,374.790	
WASTE CONNECTIONS INC	5,555	63.940	355,186.700	
DR HORTON INC	26,166	30.500	798,063.000	
DANAHER CORP	47,517	93.190	4,428,109.230	
MOODY'S CORP	16,620	93.310	1,550,812.200	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	46,508	60.160	2,797,921.280	
TARGET CORP	46,717	80.880	3,778,470.960	
DEERE & CO	23,624	76.310	1,802,747.440	
MORGAN STANLEY	110,016	23.750	2,612,880.000	
REPUBLIC SERVICES INC	18,651	46.390	865,219.890	
THE WALT DISNEY CO	122,749	96.420	11,835,458.580	
DOLLAR TREE INC	18,245	79.660	1,453,396.700	
DOVER CORP	11,617	62.910	730,825.470	
DOW CHEMICAL	86,405	50.770	4,386,781.850	
OMNICOM GROUP	16,819	83.150	1,398,499.850	
DTE ENERGY CO	14,055	89.000	1,250,895.000	
XL GROUP PLC	23,051	35.720	823,381.720	
DUKE ENERGY CORP	54,951	79.770	4,383,441.270	
FLOWSERVE CORP	9,241	42.210	390,062.610	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	64.790	611,358.440	
EBAY INC	89,434	24.070	2,152,676.380	
EMC CORP/MASS	146,656	25.690	3,767,592.640	
BANK OF AMERICA CORP	834,572	12.880	10,749,287.360	
CITIGROUP INC	240,026	40.470	9,713,852.220	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,592	71.950	834,044.400	
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,478	23.200	475,089.600	
EATON CORP PLC	38,338	59.910	2,296,829.580	
EATON VANCE CORP	9,128	32.800	299,398.400	
DISH NETWORK CORP	20,344	43.450	883,946.800	
ECOLAB INC	21,384	111.630	2,387,095.920	
ELECTRONIC ARTS INC	23,902	64.240	1,535,464.480	
SALESFORCE.COM INC	51,055	74.850	3,821,466.750	
EMERSON ELECTRIC CO	49,885	53.840	2,685,808.400	
ATMOS ENERGY CORP	6,503	74.190	482,457.570	
WEATHERFORD INTL PLC	58,791	7.230	425,058.930	
ENTERGY CORP	13,984	76.960	1,076,208.640	
EOG RESOURCES INC	42,044	73.470	3,088,972.680	
EQUIFAX INC	8,986	115.020	1,033,569.720	
EQT CORP	12,314	67.180	827,254.520	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,769	95.210	1,786,996.490	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	47.490	678,109.710	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	52,940	70.090	3,710,564.600	

EXXON MOBIL CORP	328,253	83.210	27,313,932.130	
FMC CORP	9,724	37.480	364,455.520	
NEXTERA ENERGY INC	34,500	116.810	4,029,945.000	
ASSURANT INC	7,098	77.910	553,005.180	
FASTENAL CO	24,929	47.130	1,174,903.770	
FIFTH THIRD BANCORP	70,195	16.300	1,144,178.500	
M&T BANK CORP	10,650	108.860	1,159,359.000	
FISERV INC	20,271	100.460	2,036,424.660	
FLIR SYSTEMS INC	8,840	32.060	283,410.400	
MACY'S INC	25,499	39.680	1,011,800.320	
FORD MOTOR CO	282,813	12.550	3,549,303.150	
FRANKLIN RESOURCES INC	30,371	37.240	1,131,016.040	
FREEMPORT-MCMORAN INC	89,094	9.330	831,247.020	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	11.800	523,483.400	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,532	43.590	546,269.880	
TEGNA INC	14,989	22.680	339,950.520	
GAP INC/THE	18,180	23.850	433,593.000	
DENTSPLY SIRONA INC	14,948	59.720	892,694.560	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,348	132.910	2,704,452.680	
GENERAL MILLS INC	47,773	63.300	3,024,030.900	
GENUINE PARTS CO	12,418	97.190	1,206,905.420	
GILEAD SCIENCES INC	113,659	96.090	10,921,493.310	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	13,585	78.970	1,072,807.450	
GARTNER INC	5,772	87.900	507,358.800	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	19,208	30.960	594,679.680	
MCKESSON CORP	18,548	162.200	3,008,485.600	
NVIDIA CORP	47,038	35.660	1,677,375.080	
GENERAL ELECTRIC CO	743,387	30.790	22,888,885.730	
WW GRAINGER INC	5,060	230.640	1,167,038.400	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	19.090	424,485.240	
HALLIBURTON CO	64,473	37.330	2,406,777.090	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,657	132.580	1,545,485.060	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	31,864	150.280	4,788,521.920	
HARLEY-DAVIDSON INC	15,057	44.620	671,843.340	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,014	81.350	407,888.900	
HARRIS CORP	11,245	76.710	862,603.950	
HASBRO INC	8,909	78.760	701,672.840	
HENRY SCHEIN INC	6,256	167.990	1,050,945.440	
HELMERICH & PAYNE INC	7,163	57.230	409,938.490	
HERSHEY FOODS CORP	12,284	91.810	1,127,794.040	
HP INC	140,131	12.060	1,689,979.860	
F5 NETWORKS INC	5,809	97.450	566,087.050	
CROWN HOLDINGS INC NPR	9,809	48.790	478,581.110	
REYNOLDS AMERICAN INC	65,630	50.940	3,343,192.200	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	99.810	1,034,929.890	

UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	112.940	389,304.180	
JUNIPER NETWORKS INC	25,642	24.930	639,255.060	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	35.310	490,385.280	
HOLOGIC INC	18,649	35.370	659,615.130	
UNUM GROUP	22,632	30.600	692,539.200	
HOME DEPOT INC	97,944	133.620	13,087,277.280	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,610	85.210	1,074,498.100	
HORMEL FOODS CORP	23,322	41.820	975,326.040	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	20.910	668,116.320	
HUMANA INC	11,821	171.030	2,021,745.630	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	82.970	550,671.890	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	9.330	560,359.800	
RED HAT INC	14,283	73.800	1,054,085.400	
BIOGEN INC	17,976	270.830	4,868,440.080	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,709	103.210	2,550,215.890	
INTUIT INC	20,568	103.380	2,126,319.840	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	9,222	40.390	372,476.580	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	60.350	1,271,152.050	
INTEL CORP	370,286	31.630	11,712,146.180	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,217	117.700	849,440.900	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,541	40.220	1,268,579.020	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	37,561	22.750	854,512.750	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	41.200	383,036.400	
INCYTE CORP	12,683	77.470	982,552.010	
JOHNSON & JOHNSON	220,226	109.100	24,026,656.600	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28,441	45.030	1,280,698.230	
JOHNSON CONTROLS INC	54,035	38.430	2,076,565.050	
KLA-TENCOR CORP	14,558	72.070	1,049,195.060	
DEVON ENERGY CORP	34,792	28.770	1,000,965.840	
KELLOGG CO	20,813	77.250	1,607,804.250	
KEYCORP	66,833	10.720	716,449.760	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,934	137.490	3,840,645.660	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,284	331.600	3,078,574.400	
KOHL'S CORP	15,787	43.370	684,682.190	
KROGER CO	73,891	37.990	2,807,119.090	
LAM RESEARCH CORP	12,091	81.120	980,821.920	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,466	60.180	509,483.880	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	52.380	752,543.460	
LEGG MASON INC	6,295	31.370	197,474.150	
LEGGETT & PLATT INC	12,274	48.670	597,375.580	

LENNAR CORP	12,932	47.590	615,433.880	
LEUCADIA NATIONAL CORP	23,605	15.420	363,989.100	
ELI LILLY & CO	79,275	74.390	5,897,267.250	
L BRANDS INC	19,395	80.500	1,561,297.500	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,267	37.520	685,377.840	
LINEAR TECH CORP	18,324	44.290	811,569.960	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,910	104.310	5,831,972.100	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	22,615	39.540	894,197.100	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,285	226.300	5,043,095.500	
LOEWS CORP	21,320	37.920	808,454.400	
RANGE RESOURCES CORP	12,431	34.920	434,090.520	
LOWE'S COS INC	69,106	75.030	5,185,023.180	
DOMINION RESOURCES INC/VA	47,796	73.040	3,491,019.840	
SCANA CORP	9,574	69.630	666,637.620	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	22.390	755,192.310	
MCCORMICK & CO INC	9,163	100.030	916,574.890	
MCDONALD'S CORPORATION	74,184	127.960	9,492,584.640	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	20,207	97.230	1,964,726.610	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	194.880	637,647.360	
MANPOWERGROUP INC	5,703	79.630	454,129.890	
MARKEL CORPORATION	1,049	887.220	930,693.780	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,526	104.470	1,726,471.220	
MARSH & MCLENNAN COS	42,209	60.510	2,554,066.590	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,542	81.500	451,673.000	
MASCO CORP	25,045	31.730	794,677.850	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,501	166.180	747,976.180	
MATTEL INC	25,152	32.300	812,409.600	
METLIFE INC	76,374	41.890	3,199,306.860	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,891	36.650	802,305.150	
MEDTRONIC PLC	112,777	76.370	8,612,779.490	
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,543	33.970	1,275,335.710	
CVS HEALTH CORP	88,983	101.470	9,029,105.010	
MERCK & CO. INC.	218,294	55.360	12,084,755.840	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,810	118.520	925,641.200	
MICROSOFT CORP	596,787	54.420	32,477,148.540	
MICRON TECH INC	83,952	10.720	899,965.440	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,953	48.450	724,472.850	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	10.520	324,941.760	
3M CO	48,107	166.630	8,016,069.410	

MOHAWK INDUSTRIES INC	5,366	193.920	1,040,574.720	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,590	75.240	872,031.600	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	87.870	764,381.130	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	25.690	319,660.670	
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,883	28.300	449,488.900	
MYLAN NV	32,656	47.000	1,534,832.000	
ILLUMINA INC	12,052	168.360	2,029,074.720	
XCEL ENERGY INC	38,007	41.010	1,558,667.070	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,546	29.110	976,524.060	
NETAPP INC	24,525	25.810	632,990.250	
NEWELL RUBBERMAID INC	21,322	43.840	934,756.480	
DUN & BRADSTREET CORP	4,306	103.570	445,972.420	
NEWMONT MINING CORP	46,504	29.100	1,353,266.400	
NIKE INC-CL B	104,906	59.420	6,233,514.520	
NOBLE ENERGY INC	32,369	31.760	1,028,039.440	
NORDSTROM INC	11,509	51.140	588,570.260	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,576	81.490	1,839,718.240	
EVERSOURCE ENERGY	23,786	57.050	1,356,991.300	
COACH INC	24,737	38.970	964,000.890	
NORTHERN TRUST CORP	19,573	63.260	1,238,187.980	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,077	200.570	2,622,853.890	
WELLS FARGO & CO	382,951	47.070	18,025,503.570	
NUCOR CORP	24,612	47.290	1,163,901.480	
MONSANTO CO	35,035	86.630	3,035,082.050	
CHENIERE ENERGY INC	17,814	34.870	621,174.180	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,273	66.670	2,751,670.910	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,971	70.600	4,233,952.600	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	31.620	287,141.220	
OGE ENERGY CORP	16,028	28.220	452,310.160	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,954	269.820	2,146,148.280	
ORACLE CORP	250,242	40.360	10,099,767.120	
PACCAR INC	27,939	52.650	1,470,988.350	
EXELON CORP	67,643	34.700	2,347,212.100	
PARKER HANNIFIN CORP	12,188	109.910	1,339,583.080	
PATTERSON COS INC	10,152	44.940	456,230.880	
PAYCHEX INC	25,896	53.040	1,373,523.840	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	54.080	460,707.520	
MEDNAX INC	7,106	63.770	453,149.620	
PPL CORPORATION	52,418	37.400	1,960,433.200	
PEPSICO INC	115,738	105.080	12,161,749.040	
PENTAIR PLC	14,306	51.510	736,902.060	
PFIZER INC	493,340	32.500	16,033,550.000	
CONOCOPHILLIPS	97,893	41.230	4,036,128.390	
PVH CORP	6,479	93.050	602,870.950	

PG&E CORP	36,973	59.300	2,192,498.900	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,074	144.770	2,037,492.980	
ALTRIA GROUP INC	155,451	63.800	9,917,773.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,338	81.820	3,218,635.160	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	94.320	469,713.600	
GARMIN LTD	9,959	39.630	394,675.170	
AETNA INC	28,172	108.870	3,067,085.640	
FLUOR CORP (NEW)	11,793	51.270	604,627.110	
PPG INDUSTRIES INC	22,588	111.830	2,526,016.040	
PRAXAIR INC	22,840	112.300	2,564,932.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,453	151.650	5,224,797.450	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,074	71.800	1,225,913.200	
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	72.350	799,901.600	
PROCTER & GAMBLE CO	214,929	83.200	17,882,092.800	
PROGRESSIVE CORP	45,883	34.430	1,579,751.690	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,399	45.980	1,811,566.020	
PULTE GROUP INC	25,477	17.800	453,490.600	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	46,646	15.030	701,089.380	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,632	72.200	695,430.400	
QUALCOMM INC	121,641	50.560	6,150,168.960	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	44.630	462,991.620	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	116.870	413,135.450	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,155	404.940	2,492,405.700	
AUTONATION INC	7,394	44.650	330,142.100	
RESMED INC	11,376	58.580	666,406.080	
US BANCORP	137,201	39.380	5,402,975.380	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,021	69.750	629,214.750	
RITE AID CORP	73,930	8.020	592,918.600	
ROSS STORES INC	33,529	56.530	1,895,394.370	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,573	177.950	1,525,565.350	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,766	111.490	1,088,811.340	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,174	80.600	1,223,024.400	
RAYTHEON COMPANY	24,384	126.430	3,082,869.120	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,362	215.270	1,154,277.740	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	27.560	516,446.840	
ACCENTURE PLC-CL A	49,522	112.830	5,587,567.260	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	120,479	42.320	5,098,671.280	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,266	113.410	1,164,267.060	
SANDISK CORP	16,366	76.520	1,252,326.320	

ROCKWELL COLLINS INC	9,595	91.510	878,038.450	
ST JUDE MEDICAL INC	23,176	55.370	1,283,255.120	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,590	115.230	2,718,275.700	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	20,743	63.980	1,327,137.140	
PRICELINE GROUP INC	3,998	1,274.150	5,094,051.700	
SCHLUMBERGER LTD	111,043	73.850	8,200,525.550	
SCHWAB (CHARLES) CORP	99,932	26.610	2,659,190.520	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,768	108.960	1,500,161.280	
BUNGE LTD	11,801	56.250	663,806.250	
SEI INVESTMENTS CO	13,638	43.760	596,798.880	
ANTHEM INC	20,646	143.740	2,967,656.040	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,201	85.310	1,467,417.310	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	39.030	911,389.530	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,687	296.980	1,985,905.260	
CENTENE CORP	10,224	60.900	622,641.600	
ACUITY BRANDS INC	3,145	250.120	786,627.400	
SNAP-ON INC	5,313	157.800	838,391.400	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,611	70.170	2,428,653.870	
TRANSOCEAN LTD	26,823	8.670	232,555.410	
ADVANCE AUTO PARTS	5,295	156.110	826,602.450	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	8.680	245,887.040	
EDISON INTERNATIONAL	23,842	70.690	1,685,390.980	
SOUTHERN CO	68,059	50.730	3,452,633.070	
BB&T CORP	60,610	32.490	1,969,218.900	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	44.500	611,697.000	
AT&T INC	487,453	38.500	18,766,940.500	
CHEVRON CORP	148,683	96.330	14,322,633.390	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,306	105.840	1,090,787.040	
STAPLES INC	52,662	11.020	580,335.240	
STATE STREET CORP	31,417	56.270	1,767,834.590	
STARBUCKS CORP	114,795	61.040	7,007,086.800	
STRYKER CORP	27,397	108.540	2,973,670.380	
NETFLIX INC	31,646	103.810	3,285,171.260	
STERICYCLE INC	6,853	128.200	878,554.600	
SUNTRUST BANKS INC	38,067	35.630	1,356,327.210	
SYMANTEC CORP	58,552	18.150	1,062,718.800	
SYNOPSIS INC	14,769	48.240	712,456.560	
SYSCO CORP	43,896	46.940	2,060,478.240	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,954	619.770	1,830,800.580	
TECO ENERGY INC	17,025	27.450	467,336.250	
TESORO CORP	9,395	83.170	781,382.150	
TEXAS INSTRUMENTS INC	77,930	57.890	4,511,367.700	
TEXTRON INC	21,846	36.680	801,311.280	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,898	142.210	4,536,214.580	
TIFFANY & CO	10,305	70.630	727,842.150	
TOLL BROTHERS INC	12,654	28.740	363,675.960	
TORCHMARK CORP	10,414	53.390	556,003.460	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	48.510	661,530.870	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	74.100	1,033,398.600	
TRACTOR SUPPLY CO	9,788	86.900	850,577.200	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	19,110	24.560	469,341.600	
TYSON FOODS INC	24,179	68.110	1,646,831.690	
MARATHON OIL CORP	52,743	11.780	621,312.540	
UNION PACIFIC CORP	66,271	79.170	5,246,675.070	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	65,816	101.320	6,668,477.120	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,643	125.680	9,506,812.240	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	123.220	916,880.020	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	80.120	664,675.520	
VF CORP	25,690	62.620	1,608,707.800	
CBS CORP	33,562	54.120	1,816,375.440	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,746	85.250	1,598,096.500	
VULCAN MATERIALS CO	11,687	108.000	1,262,196.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,110	81.370	5,460,740.700	
WAL-MART STORES INC	127,663	68.060	8,688,743.780	
WASTE MANAGEMENT INC	34,984	57.670	2,017,527.280	
WATERS CORP	6,779	131.330	890,286.070	
ALLERGAN PLC	31,565	236.000	7,449,340.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,264	127.900	1,184,865.600	
WESTERN DIGITAL CORP	18,200	43.100	784,420.000	
WABTEC CORP	7,250	78.640	570,140.000	
WHIRLPOOL CORP	6,288	182.590	1,148,125.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,061	77.360	1,165,118.960	
WYNN RESORTS LTD	6,279	98.780	620,239.620	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	30.270	879,494.850	
NASDAQ INC	9,132	63.650	581,251.800	
CME GROUP INC	26,133	89.090	2,328,188.970	
WILLIAMS COS INC	55,297	16.240	898,023.280	
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,927	44.640	264,581.280	
LKQ CORP	25,910	31.640	819,792.400	
ALLIANT ENERGY CORP	11,212	73.770	827,109.240	
WEC ENERGY GROUP INC	24,880	58.930	1,466,178.400	
FOOT LOCKER INC	11,034	61.910	683,114.940	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,310	29.880	636,742.800	

CARMAX INC	17,241	50.980	878,946.180	
XEROX CORP	82,090	10.980	901,348.200	
XILINX INC	20,017	46.300	926,787.100	
YAHOO! INC	67,381	36.070	2,430,432.670	
CIMAREX ENERGY CO	9,256	101.600	940,409.600	
TJX COMPANIES INC	52,219	76.180	3,978,043.420	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,700	6.080	393,376.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	16,300	58.030	945,889.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,740	69.150	396,921.000	
SIGNATURE BANK	3,706	134.060	496,826.360	
CBRE GROUP INC	21,235	28.660	608,595.100	
LIBERTY GLOBAL PLC	21,524	39.020	839,866.480	
REGIONS FINANCIAL CORP	116,784	7.670	895,733.280	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,417	44.420	196,203.140	
T-MOBILE US INC	23,522	38.700	910,301.400	
LAS VEGAS SANDS CORP	32,819	49.480	1,623,884.120	
MEDIVATION INC	12,474	46.450	579,417.300	
MOSAIC CO/THE	25,355	24.960	632,860.800	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	28.780	1,038,296.060	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	90,569	28.590	2,589,367.710	
CELANESE CORP	11,777	66.980	788,823.460	
IHS INC-CLASS A	5,758	120.180	691,996.440	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,144	28.170	257,586.480	
EXPEDIA INC	10,401	102.970	1,070,990.970	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,719	29.770	527,494.630	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,346	91.300	1,401,089.800	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	48,706	37.880	1,844,983.280	
GAMESTOP CORP. - CL. A	8,633	29.490	254,587.170	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,531	233.520	2,225,679.120	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,591	43.540	591,752.140	
VIACOM INC-CLASS B	27,414	37.990	1,041,457.860	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,433	451.250	1,097,891.250	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	53.080	369,489.880	
TRANSDIGM GROUP INC	4,845	224.140	1,085,958.300	
MASTERCARD INC	76,614	93.790	7,185,627.060	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	38,306	25.980	995,189.880	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	8,473	75.500	639,711.500	

HANESBRANDS INC	32,964	27.190	896,291.160	
WESTERN UNION CO	41,207	19.600	807,657.200	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	27,621	9.700	267,923.700	
AERCAP HOLDINGS NV	11,152	37.880	422,437.760	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	12,299	15.680	192,848.320	
SPECTRA ENERGY CORP	52,852	30.010	1,586,088.520	
TIME WARNER CABLE INC	22,777	204.460	4,656,985.420	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	10,969	15.375	168,648.370	
DELTA AIR LINES INC	17,228	46.290	797,484.120	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,680	32.250	279,930.000	
DISCOVER FINANCIAL	32,943	50.550	1,665,268.650	
TE CONNECTIVITY LTD	29,611	61.430	1,819,003.730	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	12,050	105.200	1,267,660.000	
WABCO HOLDING INC	4,395	104.910	461,079.450	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	63.750	489,600.000	
VMWARE INC	6,987	52.000	363,324.000	
TERADATA CORP	12,117	24.940	302,197.980	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	200.510	983,902.570	
INVESCO LTD	34,162	29.600	1,011,195.200	
MSCI INC	4,158	73.440	305,363.520	
NETSUITE INC	3,281	71.410	234,296.210	
CALPINE CORP NPR	26,738	14.390	384,759.820	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,555	100.880	12,464,228.400	
VISA INC	151,890	78.030	11,851,976.700	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,201	91.520	1,482,715.520	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,027	70.380	916,840.260	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,702	65.180	306,476.360	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	114.000	694,830.000	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,028	27.380	575,746.640	
MARATHON PETROLEUM CORP	46,329	38.700	1,792,932.300	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	14,093	56.870	801,468.910	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	148,609	17.940	2,666,045.460	
XYLEM INC	17,859	41.220	736,147.980	
ALKERMES PLC	11,218	38.400	430,771.200	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	30,416	83.870	2,550,989.920	

LINKEDIN CORP	9,511	108.440	1,031,372.840	
SPLUNK INC	9,277	49.490	459,118.730	
HCA HOLDINGS INC	23,967	79.140	1,896,748.380	
VERISK ANALYTICS INC	13,563	77.580	1,052,217.540	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	140.010	682,408.740	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,223	145.680	906,566.640	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,325	84.570	1,126,895.250	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,944	64.460	705,450.240	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,182	202.550	1,252,164.100	
CIT GROUP INC	13,340	30.740	410,071.600	
NXP SEMICONDUCTOR NV	11,421	82.740	944,973.540	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	562,500	0.495	278,437.500	
LEAR CORP	6,259	104.660	655,066.940	
DOLLAR GENERAL CORP	23,585	82.310	1,941,281.350	
FORTINET INC	10,861	30.360	329,739.960	
AON PLC	21,841	101.310	2,212,711.710	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	35.400	405,825.600	
TESLA MOTORS INC	7,375	250.070	1,844,266.250	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,990	37.750	452,622.500	
GENERAL MOTORS CO	117,233	29.370	3,443,133.210	
VANTIV INC	12,141	54.770	664,962.570	
TRIPADVISOR INC	9,263	62.240	576,529.120	
ALLY FINANCIAL INC	42,461	16.960	720,138.560	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,036	51.190	820,882.840	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	29.250	486,544.500	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	24,755	71.590	1,772,210.450	
PHILLIPS 66	40,891	86.060	3,519,079.460	
LIBERTY MEDIA CORP	5,006	38.480	192,630.880	
FACEBOOK INC	178,299	110.630	19,725,218.370	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	7,204	70.830	510,259.320	
ADT CORP	11,734	41.440	486,256.960	
SERVICENOW INC	10,829	64.500	698,470.500	
WHITEWAVE FOODS CO	12,239	38.940	476,586.660	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,614	147.850	830,029.900	
TABLEAU SOFTWARE INC	5,133	45.620	234,167.460	
WORKDAY INC	7,948	78.290	622,248.920	
ABBVIE INC	128,984	58.470	7,541,694.480	
ZOETIS INC	39,109	46.940	1,835,776.460	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,645	53.640	678,277.800	
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	12.410	410,845.460	

MALLINCKRODT PLC	9,419	63.290	596,128.510	
CDW CORP	10,726	41.560	445,772.560	
SPRINT CORP	57,295	3.500	200,532.500	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	18,034	21.150	381,419.100	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	13,572	38.500	522,522.000	
BROADCOM LTD	30,291	156.150	4,729,939.650	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	13,591	44.020	598,275.820	
ANTERO RESOURCES CORP	8,460	25.450	215,307.000	
TWITTER INC	43,632	16.650	726,472.800	
PLAINS GP HOLDINGS LP	16,533	8.600	142,183.800	
PERRIGO CO PLC	10,966	128.700	1,411,324.200	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	36,830	22.300	821,309.000	
ARAMARK	20,586	33.250	684,484.500	
IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,407	26.110	323,946.770	
SABRE CORP	17,624	28.900	509,333.600	
NAVIENT CORP	28,699	11.820	339,222.180	
FNF GROUP	18,087	33.760	610,617.120	
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	37.610	689,391.300	
SYNCHRONY FINANCIAL	64,620	28.020	1,810,652.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	44,329	20.870	925,146.230	
CDK GLOBAL INC	9,646	46.970	453,072.620	
QORVO INC	12,235	49.240	602,451.400	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,524	28.800	360,691.200	
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,438	52.510	1,545,789.380	
WESTROCK CO	19,981	37.190	743,093.390	
KRAFT HEINZ CO	46,857	78.470	3,676,868.790	
ALPHABET INC-CL A	22,941	759.470	17,423,001.270	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	140,131	17.890	2,506,943.590	
PAYPAL HOLDINGS INC	89,501	38.410	3,437,733.410	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	21.090	171,546.060	
ALPHABET INC-CL C	24,454	739.150	18,075,174.100	
COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	25,231	25.250	637,082.750	
BAXALTA INC	48,546	40.260	1,954,461.960	
アメリカ・ドル 小計	25,417,747		1,438,079,073.950 (155,470,728,685)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.636	188,054.870	
ANTOFAGASTA PLC	25,905	4.337	112,349.980	
ASHTED GROUP	38,160	8.400	320,544.000	
SEVERN TRENT PLC	19,770	22.390	442,650.300	
BHP BILLITON PLC	163,133	7.605	1,240,626.460	
BARCLAYS PLC	1,270,807	1.507	1,915,106.140	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	95,491	5.470	522,335.770	

BT GROUP PLC	681,176	4.374	2,979,463.820	
SKY PLC	82,222	10.180	837,019.960	
AGGREKO PLC	18,550	10.440	193,662.000	
BUNZL PLC	26,929	20.510	552,313.790	
EASYJET PLC	13,628	14.540	198,151.120	
CAPITA PLC	50,523	10.370	523,923.510	
AVIVA PLC	299,716	4.287	1,284,882.490	
CRODA INTERNATIONAL	9,774	29.700	290,287.800	
DIAGEO PLC	202,256	19.120	3,867,134.720	
SCHRODERS PLC	10,331	25.000	258,275.000	
NATIONAL GRID PLC	300,529	10.005	3,006,792.640	
GKN PLC	134,097	2.822	378,421.730	
KINGFISHER PLC	196,101	3.778	740,869.570	
BAE SYSTEMS PLC	245,770	4.981	1,224,180.370	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,370	29.460	334,960.200	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	142,209	41.900	5,958,557.100	
COBHAM PLC	88,449	2.059	182,116.490	
NEXT PLC	10,966	55.200	605,323.200	
REXAM PLC	54,770	6.175	338,204.750	
IMPERIAL BRANDS PLC	77,589	38.500	2,987,176.500	
IMI PLC	22,272	9.210	205,125.120	
JOHNSON MATTHEY PLC	13,463	27.200	366,193.600	
SABMILLER PLC	77,950	42.170	3,287,151.500	
ANGLO AMERICAN PLC	109,290	5.472	598,034.880	
COMPASS GROUP PLC	125,596	12.640	1,587,533.440	
HSBC HOLDINGS PLC	1,521,398	4.180	6,359,443.640	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.338	1,081,799.610	
ARM HOLDINGS PLC	120,951	10.460	1,265,147.460	
CENTRICA PLC	374,013	2.323	868,832.190	
UNILEVER PLC	102,250	32.385	3,311,366.250	
MEGGITT PLC	54,676	3.902	213,345.750	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	211,968	2.014	426,903.550	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	9.575	532,360.420	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	4.701	344,052.080	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,749	33.680	934,586.320	
PEARSON PLC	65,464	8.340	545,969.760	
PERSIMMON PLC	23,150	20.640	477,816.000	
PRUDENTIAL PLC	197,057	13.105	2,582,431.980	
RIO TINTO PLC	95,185	19.875	1,891,801.870	
VODAFONE GROUP PLC	2,081,451	2.275	4,735,301.020	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,222	67.780	3,404,047.160	
RELX PLC	91,193	13.040	1,189,156.720	

OLD MUTUAL PLC	389,986	1.848	720,694.120	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	145,152	6.670	968,163.840	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	259,456	2.115	548,749.440	
ST JAMES'S PLACE PLC	41,514	8.850	367,398.900	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	18.260	363,282.700	
SSE PLC	76,640	15.060	1,154,198.400	
BP PLC	1,435,182	3.503	5,027,442.540	
SHIRE PLC	48,495	42.500	2,061,037.500	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.300	537,207.300	
SMITHS GROUP PLC	27,324	10.820	295,645.680	
STANDARD CHARTERED PLC	245,759	4.435	1,089,941.160	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,735,568	0.659	3,120,739.310	
TATE & LYLE PLC	39,915	5.905	235,698.070	
TAYLOR WIMPLEY PLC	306,496	1.862	570,695.550	
TESCO PLC	631,592	1.905	1,203,182.760	
3I GROUP PLC	70,216	4.522	317,516.750	
SMITH & NEPHEW PLC	74,628	11.750	876,879.000	
GLAXOSMITHKLINE PLC	372,130	14.715	5,475,892.950	
WEIR GROUP	18,336	10.540	193,261.440	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,036	28.280	708,018.080	
BABCOCK INT'L GROUP	15,650	9.675	151,413.750	
WPP PLC	108,159	16.390	1,772,726.010	
WOLSELEY PLC	23,413	39.500	924,813.500	
ASTRAZENECA PLC	96,443	41.465	3,999,008.990	
WHITBREAD PLC	13,806	37.980	524,351.880	
CARNIVAL PLC	14,275	37.640	537,311.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	147,471	4.442	655,066.180	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	32.300	434,305.800	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.300	198,313.500	
BURBERRY GROUP PLC	36,044	12.960	467,130.240	
INVESTEC PLC	50,655	4.984	252,464.520	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	28.520	509,994.640	
ICAP PLC	36,584	4.558	166,749.870	
ITV PLC	328,003	2.384	781,959.150	
SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.885	257,266.990	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	66.350	575,453.550	
G4S PLC	124,374	1.889	234,942.480	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.330	307,211.690	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	8,214	31.240	256,605.360	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	307,710	17.330	5,332,614.300	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	315,234	17.405	5,486,647.770	
INMARSAT PLC	34,127	10.120	345,365.240	

	PETROFAC LTD	21,025	8.665	182,181.620	
	TUI AG-DI	19,394	10.440	202,473.360	
	STANDARD LIFE PLC	194,084	3.399	659,691.510	
	EXPERIAN PLC	83,009	12.390	1,028,481.510	
	MONDI PLC	25,855	12.940	334,563.700	
	SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	21,006	3.797	79,759.780	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	12.930	275,279.700	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	9.330	145,911.870	
	GLENCORE PLC	961,310	1.368	1,315,072.080	
	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	4.220	357,176.580	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	98,404	3.607	354,943.220	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	21,893	9.220	201,853.460	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	14.410	193,180.460	
	ROYAL MAIL PLC	79,209	4.776	378,302.180	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	71,339	4.627	330,085.550	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.875	295,848.500	
	WORLDPAY GROUP PLC	23,107	2.767	63,937.060	
イギリス・ポンド	小計	23,043,222		124,097,888.640 (18,937,337,807)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,152	18.840	1,924,543.680	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	13.070	1,624,208.900	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	8.310	1,564,191.300	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	53,545	15.790	845,475.550	
	NICE SYSTEMS LTD	5,638	233.500	1,316,473.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	72,855	212.700	15,496,258.500	
イスラエル・シュケル	小計	546,690		22,771,150.930 (652,165,763)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,312	61.800	884,481.600	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,911	22.280	4,877,337.080	
	AMCOR LTD	105,429	14.590	1,538,209.110	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	256,616	28.520	7,318,688.320	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	10.960	369,373.920	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	2.660	396,887.960	
	TELSTRA CORP LTD	328,099	5.160	1,692,990.840	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	8.350	266,147.900	
	AMP LTD	240,810	5.490	1,322,046.900	
	ASX LTD	23,079	41.490	957,547.710	

BHP BILLITON LTD	246,516	16.180	3,988,628.880	
CALTEX AUSTRALIA LTD	27,545	34.510	950,577.950	
COMPUTERSHARE LT	34,030	9.470	322,264.100	
CSL LIMITED	37,056	101.250	3,751,920.000	
REA GROUP LTD	4,119	52.980	218,224.620	
TRANSURBAN GROUP	179,333	11.200	2,008,529.600	
COCA-COLA AMATIL LTD	35,256	8.490	299,323.440	
COCHLEAR LTD	5,226	103.980	543,399.480	
ORIGIN ENERGY LTD	132,102	4.470	590,495.940	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	138,660	70.760	9,811,581.600	
BORAL LIMITED	43,430	6.340	275,346.200	
RIO TINTO LIMITED	41,081	43.260	1,777,164.060	
APA GROUP	94,292	8.670	817,511.640	
ARISTOCRAT LEISU	40,226	9.730	391,398.980	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,933	5.450	1,220,434.850	
TPG TELECOM LTD	12,142	11.200	135,990.400	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,322	41.870	55,352.140	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	18.490	661,757.100	
ORICA LTD	34,301	14.600	500,794.600	
CIMIC GROUP LTD	7,290	35.440	258,357.600	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.730	572,924.900	
MACQUARIE GROUP LTD	23,603	62.340	1,471,411.020	
SUNCORP GROUP LTD	103,375	11.780	1,217,757.500	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	199,962	25.130	5,025,045.060	
NEWCREST MINING LTD	57,418	17.530	1,006,537.540	
OIL SEARCH LTD	103,413	6.450	667,013.850	
INCITEC PIVOT LTD	112,083	2.890	323,919.870	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	10.810	1,147,340.970	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	44,294	8.510	376,941.940	
SANTOS LTD	133,862	3.830	512,691.460	
SONIC HEALTHCARE	33,734	18.410	621,042.940	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.560	322,738.560	
WESFARMERS LTD	87,657	40.330	3,535,206.810	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.275	235,381.570	
ILUKA RESOURCES LIM I	45,912	5.820	267,207.840	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	24.940	1,444,599.620	
WOOLWORTHS LTD	87,443	21.140	1,848,545.020	
DUET GROUP	207,776	2.240	465,418.240	
SEEK LTD	29,830	15.500	462,365.000	
TATTS GROUP LTD	109,937	3.780	415,561.860	
AUSNET SERVICES	165,066	1.450	239,345.700	
AGL ENERGY LTD	52,720	18.360	967,939.200	

	BRAMBLES LTD	123,431	12.060	1,488,577.860	
	ASCIANO LTD	47,166	8.740	412,230.840	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.010	394,660.610	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	26,750	8.580	229,515.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	180,471	3.820	689,399.220	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	9.110	582,329.420	
	HEALTHSCOPE LTD	120,242	2.630	316,236.460	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.940	690,456.060	
	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	1.460	630,759.420	
オーストラリア・ドル 小計		6,140,071		76,783,865.880 (6,262,492,102)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	50.070	808,179.870	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	34,037	57.890	1,970,401.930	
	BARRICK GOLD CORP	89,708	19.750	1,771,733.000	
	ATCO LTD	7,193	38.680	278,225.240	
	BANK OF MONTREAL	49,935	78.330	3,911,408.550	
	BANK OF NOVA SCOTIA	93,334	61.850	5,772,707.900	
	NATIONAL BANK OF CANADA	33,308	42.310	1,409,261.480	
	BCE INC	9,856	59.860	589,980.160	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	76,037	43.180	3,283,277.660	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,546	43.860	1,120,447.560	
	BOMBARDIER INC 'B'	126,625	1.280	162,080.000	
	SAPUTO INC	20,680	40.400	835,472.000	
	BLACKBERRY LTD	38,780	9.200	356,776.000	
	CGI GROUP INC	17,094	62.150	1,062,392.100	
	CCL INDUSTRIES INC	2,207	235.100	518,865.700	
	CAE INC	17,352	14.700	255,074.400	
	CAMECO CORP	29,078	15.680	455,943.040	
	ROGERS COMM-CL B	29,459	50.050	1,474,422.950	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,500	96.270	2,936,235.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,216	35.970	3,101,189.520	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,911	132.630	783,975.930	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	35.850	326,916.150	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,409	80.640	4,871,381.760	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.240	231,080.080	
	AGRIUM INC	9,963	113.970	1,135,483.110	
	YAMANA GOLD INC	67,520	4.670	315,318.400	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	38.500	722,183.000	
	OPEN TEXT CORP	8,895	68.610	610,285.950	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.410	206,343.900	
	EMPIRE CO LTD	15,093	20.650	311,670.450	
KINROSS GOLD CORP	125,461	5.090	638,596.490		

FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	18.940	325,010.400	
FORTIS INC	20,884	39.860	832,436.240	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	6.280	297,891.800	
TELUS CORP	18,945	41.360	783,565.200	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	35.000	869,295.000	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	40.950	937,058.850	
ENBRIDGE INC	71,235	50.680	3,610,189.800	
IGM FINANCIAL INC	8,010	37.490	300,294.900	
JEAN COUTU GROUP INC	3,791	21.090	79,952.190	
MANULIFE FINANCIAL CORP	165,426	17.210	2,846,981.460	
LINAMAR CORP	3,827	56.530	216,340.310	
LOBLAW CO LTD	17,936	69.160	1,240,453.760	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	38.960	375,184.800	
MAGNA INTERNATIONAL INC	36,225	51.730	1,873,919.250	
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,005	41.310	2,189,636.550	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,614	719.460	1,161,208.440	
METRO INC	16,790	42.490	713,407.100	
HUSKY ENERGY INC	27,568	15.770	434,747.360	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	18.320	732,653.440	
METHANEX CORP	7,381	39.640	292,582.840	
ONEX CORP	6,646	77.630	515,928.980	
GOLDCORP INC	67,652	22.240	1,504,580.480	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	65,526	20.770	1,360,975.020	
POWER CORP OF CANADA	38,592	29.600	1,142,323.200	
POWER FINANCIAL CORP	18,286	31.610	578,020.460	
ROYAL BANK OF CANADA	117,177	74.810	8,766,011.370	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,939	45.960	548,716.440	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,142	175.310	1,953,304.020	
SHAW COMM INC-B	29,011	24.640	714,831.040	
SUNCOR ENERGY INC	124,823	35.820	4,471,159.860	
ENCANA CORP	59,596	7.810	465,444.760	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	9.530	416,298.990	
THOMSON REUTERS CORP	26,087	51.990	1,356,263.130	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	146,349	54.470	7,971,630.030	
TRANSCANADA CORP	55,737	50.290	2,803,013.730	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,200	45.230	189,966.000	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	111.300	527,895.900	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	91.340	978,982.120	
SILVER WHEATON CORP	28,408	21.490	610,487.920	

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	529.090	790,460.460	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	12,782	84.770	1,083,530.140	
	PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS LTD	5,046	39.710	200,376.660	
	CI FINANCIAL CORP	16,683	28.300	472,128.900	
	VERESEN INC	17,460	8.600	150,156.000	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	25.780	406,782.620	
	KEYERA CORP	13,728	38.100	523,036.800	
	ALTAGAS LTD	12,358	32.730	404,477.340	
	PEMBINA PIPELINE CORP	26,797	34.880	934,679.360	
	DOLLARAMA INC	9,286	89.530	831,375.580	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	68,440	17.000	1,163,480.000	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	35.930	297,895.630	
	ARC RESOURCES LTD	30,676	18.480	566,892.480	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	28.690	320,409.920	
	ELEMENT FINANCIAL CORP	30,631	14.080	431,284.480	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	26.040	773,830.680	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	13,190	23.180	305,744.200	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	12,162	21.010	255,523.620	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	49.490	815,149.790	
	カナダ・ドル 小計	3,049,470		109,943,167.080 (9,139,575,480)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.230	403,750.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	92,000	2.940	270,480.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	4.000	494,800.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.410	283,777.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	148,700	15.000	2,230,500.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	8.400	310,800.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	39.780	407,506.320	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	57,800	7.650	442,170.000	
	CAPITALAND LTD	184,415	2.980	549,556.700	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.825	482,130.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	5.770	614,505.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	135,400	2.870	388,598.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	311,000	0.425	132,175.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	239,253	8.780	2,100,641.340	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	626,022	3.710	2,322,541.620	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.320	537,700.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	18.530	1,751,085.000	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	102,800	3.370	346,436.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	389,100	0.955	371,590.500	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	1.970	561,450.000	
シンガポール・ドル	小計	4,392,474		15,002,192.880 (1,202,575,780)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	137,671	13.000	1,789,723.000	
	SYNGENTA AG	7,721	400.700	3,093,804.700	
	NESTLE SA-REGISTERED	254,437	72.550	18,459,404.350	
	CIE FINANC RICHEMONT	44,767	60.200	2,694,973.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	56,244	243.400	13,689,789.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	178.600	633,672.800	
	SIKA INHABER	157	3,905.000	613,085.000	
	SGS SA-REG	300	2,112.000	633,600.000	
	SULZER AG-REG	683	93.950	64,167.850	
	NOVARTIS AG-REG SHS	176,826	72.000	12,731,472.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,687	120.400	443,914.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	232	1,090.000	252,880.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,105	502.500	1,057,762.500	
	ABB LTD	168,155	18.570	3,122,638.350	
	ADECCO SA-REG	11,997	62.950	755,211.150	
	GEBERIT AG	3,062	354.900	1,086,703.800	
	LONZA GROUP AG-REG	3,997	165.100	659,904.700	
	LINDT & SPRUENGLI PART	65	6,150.000	399,750.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	72,720.000	654,480.000	
	GIVAUDAN-REG	708	1,910.000	1,352,280.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,670	197.700	2,504,859.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	18,410	45.140	831,027.400	
	ACTELION	8,330	147.500	1,228,675.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	128.300	579,787.700	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	137.600	612,732.800	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,193	317.400	696,058.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,655	62.700	417,268.500	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	176.900	294,184.700	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,263	247.400	559,866.200	
	GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,517.000	462,685.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	808	489.500	395,516.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.950	520,830.500	
	DUFREY GROUP	3,162	114.700	362,681.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,056	385.500	407,088.000	
	ARYZTA AG	5,959	38.190	227,574.210	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,617	39.430	694,638.310	
	SWISS RE LTD	25,010	87.550	2,189,625.500	
	UBS GROUP AG	287,690	14.580	4,194,520.200	

スイス・フラン 小計		1,285,124		81,368,836.620 (9,225,598,696)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	47,392	203.200	9,630,054.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,729	190.900	6,438,866.100	
	ERICSSON LM-B SHS	264,062	82.100	21,679,490.200	
	GETINGE AB-B SHS	19,578	189.300	3,706,115.400	
	SKF AB-B SHS	32,306	140.500	4,538,993.000	
	SANDVIK AB	77,917	85.350	6,650,215.950	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	110,157	77.600	8,548,183.200	
	SKANSKA AB-B SHS	26,640	169.000	4,502,160.000	
	SWEDBANK AB	70,859	166.300	11,783,851.700	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	50,376	259.600	13,077,609.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	100.400	11,938,463.600	
	VOLVO AB-B SHS	118,487	88.350	10,468,326.450	
	SWEDISH MATCH AB	19,509	283.400	5,528,850.600	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	72.100	1,752,390.500	
	NORDEA AB	227,871	76.350	17,397,950.850	
	INDUSTRIVARDEN C	10,813	139.200	1,505,169.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	209.800	3,628,700.800	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	136.900	3,732,030.900	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	288.100	10,332,706.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	69,875	288.000	20,124,000.000	
	ASSA ABLOY AB-B	85,163	161.600	13,762,340.800	
	TELIASONERA AB	194,938	41.510	8,091,876.380	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	133.300	2,340,081.500	
BOLIDEN AB	21,855	126.400	2,762,472.000		
ALFA LAVAL AB	24,553	127.500	3,130,507.500		
KINNEVIK INVESTMENT B	18,310	226.700	4,150,877.000		
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	435.100	2,238,589.500		
ICA GRUPPEN AB	5,920	286.400	1,695,488.000		
HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	59.350	1,845,013.450		
HEXAGON AB	18,226	320.000	5,832,320.000		
スウェーデン・クローナ 小計		1,825,959		222,813,695.480 (2,954,509,602)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,563	626.000	4,734,438.000	
	A P MOLLER A/S	550	8,410.000	4,625,500.000	
	AP MOLLER MAERSK A	291	8,270.000	2,406,570.000	
	DANSKE BANK A/S	60,349	174.600	10,536,935.400	
	GENMAB A/S	4,112	944.500	3,883,784.000	
	NOVOZYMES-B SHS	16,988	297.600	5,055,628.800	
	NOVO NORDISK A/S-B	153,188	367.800	56,342,546.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,857	458.800	8,192,791.600	
	TDC A/S	70,447	31.610	2,226,829.670	

	COLOPLAST-B	8,513	493.400	4,200,314.200	
	DSV A/S	14,315	278.100	3,981,001.500	
	WILLIAM DEMANT	2,595	667.500	1,732,162.500	
	TRYG A/S	11,107	124.900	1,387,264.300	
	PANDORA A/S	8,392	868.500	7,288,452.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	438.300	3,378,416.400	
	ISS A/S	14,618	258.300	3,775,829.400	
デンマーク・クローネ 小計		398,593		123,748,464.170 (2,049,274,568)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.470	634,008.240	
	CONTACT ENERGY L	64,605	4.970	321,086.850	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	7.760	574,177.920	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	149,990	3.535	530,214.650	
ニュージーランド・ドル 小計		386,579		2,059,487.660 (151,722,456)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	68,855	96.700	6,658,278.500	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	31.860	3,410,995.320	
	TELENOR ASA	60,554	130.100	7,878,075.400	
	SCHIBSTED ASA	7,643	223.600	1,708,974.800	
	ORKLA ASA	77,644	71.650	5,563,192.600	
	STATOIL ASA	88,513	126.500	11,196,894.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	17,756	307.000	5,451,092.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,642	130.500	1,780,281.000	
ノルウェー・クローネ 小計		441,669		43,647,784.120 (573,968,361)	
ユーロ	CRH PLC	67,207	25.070	1,684,879.490	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	118.550	740,463.300	
	KERRY GROUP PLC-A	11,920	82.150	979,228.000	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.246	540,864.700	
	UMICORE	6,363	43.440	276,408.720	
	AIR LIQUIDE	26,318	94.380	2,483,892.840	
	AIRBUS GROUP SE	44,733	57.510	2,572,594.830	
	AXA	150,698	19.920	3,001,904.160	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,774	20.965	812,896.910	
	ADIDAS AG	16,367	103.000	1,685,801.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	99,122	12.400	1,229,112.800	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	39,703	14.450	573,708.350	
	DANONE	47,942	61.260	2,936,926.920	
	SAFRAN SA	25,619	58.940	1,509,983.860	
	INTESA SANPAOLO	1,029,888	2.294	2,362,563.070	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	2.174	244,498.910	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,541	74.300	2,046,296.300	
ACCOR SA	14,860	36.300	539,418.000		

BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	34.555	205,014.810	
BOUYGUES	15,864	29.850	473,540.400	
BNP PARIBAS	81,517	41.935	3,418,415.390	
RELX NV	80,368	15.195	1,221,191.760	
THALES SA	8,128	76.500	621,792.000	
CAP GEMINI SA	15,271	80.190	1,224,581.490	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	49.565	203,662.580	
CHRISTIAN DIOR SE	4,128	155.850	643,348.800	
INGENICO GROUP	4,239	98.300	416,693.700	
UNICREDIT SPA	354,830	3.070	1,089,328.100	
NATIXIS	70,166	4.289	300,941.970	
KONINKLIJKE DSM NV	13,718	49.335	676,777.530	
DELHAIZE GROUP	8,529	93.260	795,414.540	
COMMERZBANK AG	80,064	7.493	599,919.550	
FRESENIUS SE & CO KGAA	29,762	63.360	1,885,720.320	
UNITED INTERNET	12,876	44.155	568,539.780	
FUCHS PETROLUB SE PREF	4,422	38.485	170,180.670	
PUBLICIS GROUPE	14,367	62.950	904,402.650	
MAN SE	3,396	94.500	320,922.000	
IBERDROLA SA	440,361	5.808	2,557,616.680	
ENI SPA	193,698	12.850	2,489,019.300	
IMERYS SA	2,738	60.170	164,745.460	
JERONIMO MARTINS	19,517	14.570	284,362.690	
KBC GROUPE	17,923	46.405	831,716.810	
HANNOVER RUECK SE	4,399	100.550	442,319.450	
WARTSILA OYJ	11,298	39.100	441,751.800	
L'OREAL	19,100	154.700	2,954,770.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,488	145.650	3,129,727.200	
LAGARDERE S.C.A.	14,725	23.350	343,828.750	
GEA GROUP AG	18,086	42.250	764,133.500	
BOLLORE	76,431	3.380	258,336.780	
MEDIOBANCA SPA	42,404	6.310	267,569.240	
MICHELIN(CGDE)-B	14,584	88.290	1,287,621.360	
CONTINENTAL AG	8,194	182.000	1,491,308.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	75,581	24.045	1,817,345.140	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	29.730	279,432.270	
AXEL SPRINGER SE	3,067	50.350	154,423.450	
OMV AG	9,779	24.210	236,749.590	
PERNOD-RICARD	15,084	96.940	1,462,242.960	
PEUGEOT SA	33,969	13.380	454,505.220	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,007	43.260	519,422.820	
RENAULT SA	14,323	81.800	1,171,621.400	
REPSOL SA	81,374	9.472	770,774.520	
REMY COINTREAU	905	65.860	59,603.300	
MERCK KGAA	9,627	76.600	737,428.200	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	62,694	106.850	6,698,853.900	

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,989	38.695	1,392,594.350	
SAIPEM	465,751	0.326	151,834.820	
RWE AG	41,149	11.645	479,180.100	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,658	48.700	665,144.600	
SOCIETE GENERALE-A	59,007	30.885	1,822,431.190	
VINCI S.A.	36,668	65.020	2,384,153.360	
SODEXO	7,368	94.280	694,655.040	
SOLVAY SA	5,034	83.980	422,755.320	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,735	53.120	2,216,963.200	
VIVENDI SA	90,768	18.420	1,671,946.560	
SAP SE	77,382	67.510	5,224,058.820	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	7,795	48.400	377,278.000	
TELEFONICA S.A	357,281	9.310	3,326,286.110	
TOTAL SA	171,288	40.010	6,853,232.880	
VALEO	7,056	126.950	895,759.200	
E.ON SE	182,365	8.271	1,508,340.910	
VOEST-ALPINE AG	9,875	28.030	276,796.250	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	16.940	258,877.080	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	88.460	761,994.440	
METRO AG	15,629	27.745	433,626.600	
SIEMENS AG-REG	62,794	89.250	5,604,364.500	
UPM-KYMMENE OYJ	38,638	14.450	558,319.100	
ING GROEP NV-CVA	296,220	10.160	3,009,595.200	
BAYER AG	64,911	101.750	6,604,694.250	
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	7.580	338,151.380	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,837	98.350	1,459,218.950	
DAIMLER AG	73,572	59.620	4,386,362.640	
BASF SE	73,655	63.090	4,646,893.950	
BEIERSDORF AG	9,149	76.880	703,375.120	
HEIDELBERGCEMENT AG	10,251	74.420	762,879.420	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,988	78.230	1,407,201.240	
ORANGE	148,319	14.230	2,110,579.370	
SAMPO OYJ-A SHS	33,916	41.110	1,394,286.760	
RANDSTAD HOLDINGS	8,654	46.460	402,064.840	
ALLIANZ SE	35,957	138.900	4,994,427.300	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.925	558,949.950	
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,600	20.080	1,417,648.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,917	45.015	761,518.750	
HERMES INTL	2,185	297.950	651,020.750	
ENDESA S.A.	27,930	16.770	468,386.100	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28,244	13.850	391,179.400	
ERSTE GROUP BANK AG	21,896	24.400	534,262.400	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,853	174.800	2,421,504.400	

ARCELOR MITTAL (NL)	130,503	4.045	527,884.630	
SOCIETE BIC SA	2,165	134.450	291,084.250	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,429	70.260	662,481.540	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,099	26.705	376,513.790	
HEINEKEN NV	19,424	79.020	1,534,884.480	
AKZO NOBEL	18,274	58.110	1,061,902.140	
ASML HOLDING NV	25,963	88.650	2,301,619.950	
AEGON NV	144,321	4.716	680,617.830	
BANKINTER S.A.	52,241	6.132	320,341.810	
VOLKSWAGEN AG	2,794	120.350	336,257.900	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,091	103.950	1,464,759.450	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	482,863	5.407	2,610,840.240	
KERING	6,033	151.050	911,284.650	
FORTUM OYJ	39,778	11.530	458,640.340	
AGEAS	14,964	34.435	515,285.340	
UCB SA	10,367	71.400	740,203.800	
THYSSENKRUPP AG	29,522	18.660	550,880.520	
UNILEVER NV-CVA	124,921	39.475	4,931,256.470	
CARREFOUR SA	51,966	23.555	1,224,059.130	
GAS NATURAL SDG SA	34,253	17.230	590,179.190	
ATOS SE	6,025	71.730	432,173.250	
NOKIA OYJ	439,256	5.295	2,325,860.520	
TUI AG	19,196	12.880	247,244.480	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	72,718	23.975	1,743,414.050	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	35.275	870,269.520	
SANOFI	92,276	74.570	6,881,021.320	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	4.894	288,794.940	
ELISA OYJ	13,644	32.490	443,293.560	
BANCO SANTANDER SA	1,159,051	3.663	4,245,603.810	
METSO OYJ	10,879	20.970	228,132.630	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	8,649	76.550	662,080.950	
QIAGEN N.V.	19,737	19.860	391,976.820	
LINDE AG	13,880	121.450	1,685,726.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	103,124	13.990	1,442,704.760	
BMW VORZUG	4,116	64.500	265,482.000	
K & S	13,745	18.915	259,986.670	
ENEL SPA	639,949	3.762	2,407,488.130	
COLRUYT NV	4,673	51.700	241,594.100	
VOPAK (KON.)	5,364	43.945	235,720.980	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.033	111,729.180	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	253,358	15.105	3,826,972.590	
BANCO POPULAR ESPANOL	119,774	2.118	253,681.330	
FINMECCANICA SPA	34,431	10.960	377,363.760	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	84,994	12.405	1,054,350.570	
KONINKLIJKE KPN NV	257,686	3.465	892,881.990	

UNIPOLSAI SPA	91,992	2.016	185,455.870	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,463	71.680	1,036,707.840	
EURAZEO	3,870	60.700	234,909.000	
BANCO SABADELL	415,927	1.409	586,041.140	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,276	72.500	600,010.000	
FRAPORT AG	3,149	52.390	164,976.110	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	69.620	557,934.680	
INDITEX	84,119	28.570	2,403,279.830	
JC DECAUX SA	5,728	38.760	222,017.280	
ANDRITZ AG	4,704	47.015	221,158.560	
MAPFRE SA	80,219	1.829	146,720.550	
ESSILOR INTL	17,154	107.450	1,843,197.300	
SNAM SPA	158,640	5.510	874,106.400	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	9.101	778,909.080	
ENAGAS	18,095	26.865	486,122.170	
WENDEL	1,994	94.430	188,293.420	
TENARIS SA	33,458	11.080	370,714.640	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	3.056	229,059.420	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	0.888	775,851.810	
TELECOM ITALIA-RNC	615,947	0.719	442,865.890	
ATLANTIA SPA	33,870	24.340	824,395.800	
ILIAD SA	2,102	192.700	405,055.400	
PROXIMUS	13,498	30.080	406,019.840	
SES FDR	24,850	25.825	641,751.250	
TERNA SPA	117,108	5.045	590,809.860	
GRIFOLS SA	20,422	20.120	410,890.640	
FERROVIAL SA	43,345	18.240	790,612.800	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	41.650	285,552.400	
EXOR SPA	6,823	30.200	206,054.600	
NESTE OYJ	10,692	29.740	317,980.080	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	8,947	12.845	114,924.210	
KONE OYJ	25,273	41.370	1,045,544.010	
ENGIE	120,884	13.330	1,611,383.720	
ALSTOM	17,252	21.970	379,026.440	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	44.800	225,120.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	18,706	27.945	522,739.170	
ELECTRICITE DE FRANCE	38,234	10.170	388,839.780	
DEUTSCHE WOHNEN AG	26,714	28.200	753,334.800	
ARKEMA SA	5,658	65.650	371,447.700	
LEGRAND SA	20,657	48.430	1,000,418.510	
ADP	2,313	109.700	253,736.100	
ORION OYJ	8,051	29.590	238,229.090	
RTL GROUP SA	2,768	72.600	200,956.800	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	10.950	372,497.100	

SYMRISE AG	9,463	59.080	559,074.040	
SCOR SE	17,385	29.630	515,117.550	
REXEL SA	20,799	11.740	244,180.260	
PRYSMIAN SPA	14,445	19.000	274,455.000	
BANCO POPOLARE SC	29,282	4.864	142,427.640	
CAIXABANK	206,138	2.485	512,252.930	
BUREAU VERITAS SA	23,255	20.280	471,611.400	
GROUPE EUROTUNNEL SE	51,096	9.759	498,645.860	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	25,406	16.365	415,769.190	
ENGIE	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	33,641	38.150	1,283,404.150	
TNT EXPRESS NV W/I	44,157	7.897	348,707.820	
BRENNTAG AG	11,108	51.060	567,174.480	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	67,082	6.516	437,106.310	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	38,477	4.569	175,801.410	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,928	25.800	256,142.400	
EDENRED	18,682	16.805	313,951.010	
BANKIA SA	330,088	0.786	259,449.160	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	39,139	4.633	181,330.980	
HUGO BOSS AG -ORD	5,197	56.300	292,591.100	
OSRAM LICHT AG	7,598	44.850	340,770.300	
GEMALTO	5,952	60.470	359,917.440	
VONOVIA SE	36,696	32.170	1,180,510.320	
OCI NV	2,947	16.595	48,905.460	
FERRARI NV	12,402	36.310	450,316.620	
CNH INDUSTRIAL NV	67,754	5.540	375,357.160	
NUMERICABLE-SFR	9,058	29.500	267,211.000	
NN GROUP NV	20,757	28.745	596,659.960	
ZALANDO SE	6,674	28.575	190,709.550	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	6.350	445,198.500	
AENA SA	5,256	117.500	617,580.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA-RTS	482,863	0.118	56,977.830	
BANCO DE SABADELL SA-RTS	410,991	0.042	17,261.620	
ALTICE NV-A	41,585	13.965	580,734.520	
LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	41.500	585,357.500	
ユーロ 小計	22,484,943		243,912,732.220 (30,054,926,864)	
香港・ドル				
HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	14.420	3,619,420.000	
BANK OF EAST ASIA	111,660	28.000	3,126,480.000	
CLP HOLDINGS LTD	155,000	70.500	10,927,500.000	
PCCW LTD	150,000	5.130	769,500.000	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	12.780	1,099,080.000	

LI & FUNG LTD	532,400	4.540	2,417,096.000	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	74.950	3,672,550.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,640	185.600	17,565,184.000	
MTR CORP	103,000	38.650	3,980,950.000	
HANG SENG BANK LTD	57,100	133.900	7,645,690.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	85,657	47.600	4,077,273.200	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	107,500	79.450	8,540,875.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	40.950	4,903,762.500	
HONG KONG & CHINA GAS	560,535	14.280	8,004,439.800	
HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	31.950	1,278,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	27.750	5,244,750.000	
KERRY PROPERTIES LTD	65,000	20.950	1,361,750.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	344,500	22.900	7,889,050.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	54,000	27.400	1,479,600.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	394,266	7.390	2,913,625.740	
SINO LAND CO	255,400	11.780	3,008,612.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	92.800	12,899,200.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	82.550	3,508,375.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	30.050	2,719,525.000	
WHEELOCK & CO LTD	76,000	33.950	2,580,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	5.370	1,052,520.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	12.320	2,089,472.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	11.420	479,640.000	
AIA GROUP LTD	945,427	43.250	40,889,717.750	
HKT TRUST / HKT LTD	178,000	10.640	1,893,920.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	29.600	5,316,160.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	19.960	2,079,832.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	270,000	6.970	1,881,900.000	
WH GROUP LTD	530,500	5.820	3,087,510.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	221,332	99.000	21,911,868.000	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	212,332	50.000	10,616,600.000	
香港・ドル 小計	7,202,399		216,531,627.990 (3,018,450,893)	
合計	96,614,940		239,693,327,057 (239,693,327,057)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	695,518.390	
		GOODMAN GROUP	128,133.000	854,647.110	
		GPT GROUP	131,618.000	651,509.100	
		LENLEASE GROUP	46,860.000	622,769.400	
		MIRVAC GROUP	407,090.000	781,612.800	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,828,571.100	
		STOCKLAND	163,015.000	697,704.200	
		VICINITY CENTRES	252,110.000	799,188.700	
	WESTFIELD CORP	140,072.000	1,392,315.680		
	オーストラリア・ドル	小計	1,769,597.000	8,323,836.480 (678,892,103)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	276,306.000	657,608.280	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	302,785.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	423,870.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	316,004.500	
	シンガポール・ドル	小計	878,406.000	1,700,267.780 (136,293,466)	
投資信託受益証券	合計	2,648,003	815,185,569 (815,185,569)		
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,741.000	481,099.290	
		AMERICAN TOWER CORP	33,923.000	3,586,000.330	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	807,066.480	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,455.000	1,978,086.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,437.000	1,453,871.440	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,569.000	343,702.770	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	521,026.500	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,026.000	2,291,589.300	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	982,721.160	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	650,127.940	
		EQUINIX INC	5,413.000	1,764,583.870	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,730.000	2,049,524.300	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	1,116,649.750	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,578.000	802,729.240	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	896,227.510	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	48,619.000	1,405,575.290	
		HCP INC	36,231.000	1,255,404.150	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	887,307.960	
	IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	454,448.080	
	KIMCO REALTY	32,980.000	929,376.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	347,900.220	
	MID AMERICA	3,228.000	331,644.720	
	PROLOGIS INC	40,935.000	1,806,052.200	
	PUBLIC STORAGE	11,398.000	3,123,621.900	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	1,055,943.000	
	REGENCY CENTERS CORP	9,409.000	702,852.300	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,449.000	5,063,387.900	
	SL GREEN	7,116.000	689,753.880	
	THE MACERICH COMPANY	10,631.000	843,569.850	
	UDR INC	21,797.000	821,092.990	
	VENTAS INC	24,973.000	1,559,314.120	
	VEREIT INC	65,404.000	582,749.640	
	VORNADO REALTY TRUST	13,114.000	1,241,764.660	
	WELLTOWER INC	26,264.000	1,819,832.560	
	WEYERHAEUSER CO	59,852.000	1,869,776.480	
アメリカ・ドル 小計		832,371.000	46,516,374.180 (5,028,885,212)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	90,641.000	641,738.280	
	HAMMERSON PLC	79,855.000	471,144.500	
	INTU PROPERTIES PLC	59,605.000	188,292.190	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	708,819.510	
	SEGRO PLC	82,229.000	346,595.230	
イギリス・ポンド 小計		375,561.000	2,356,589.710 (359,615,589)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	230,007.200	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	423,263.400	
カナダ・ドル 小計		26,512.000	653,270.600 (54,306,385)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	218,479.680	
	GECINA SA	2,710.000	333,465.500	
	ICADE	3,001.000	202,327.420	
	KLEPIERRE	15,834.000	660,198.630	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,773.000	1,841,035.050	
ユーロ 小計		31,910.000	3,255,506.280 (401,143,484)	
香港・ドル	LINK REIT	172,500.000	7,943,625.000	
香港・ドル 小計		172,500.000	7,943,625.000 (110,734,133)	
投資証券 合計		1,438,854	5,954,684,803 (5,954,684,803)	
合計			6,769,870,372 (6,769,870,372)	

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 599銘柄	61.72%	-%	-%	65.12%
	投資証券 35銘柄	-%	-%	2.00%	
イギリス・ポンド	株式 108銘柄	7.52%	-%	-%	7.83%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
イスラエル・シェケル	株式 6銘柄	0.26%	-%	-%	0.26%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.49%	-%	-%	2.82%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.27%	-%	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.63%	-%	-%	3.73%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.48%	-%	-%	0.54%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.66%	-%	-%	3.74%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.17%	-%	-%	1.20%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.81%	-%	-%	0.83%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.23%	-%	-%	0.23%
ユーロ	株式 232銘柄	11.93%	-%	-%	12.36%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.16%	
香港・ドル	株式 36銘柄	1.20%	-%	-%	1.27%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.04%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,192,664,115	4,538,410,156
金銭信託		-	411,436,772
コール・ローン		280,053,643	-
国債証券		290,376,877,875	254,658,625,113
派生商品評価勘定		232,845	93,000
未収利息		2,958,510,849	2,492,025,936
前払費用		82,345,510	71,912,977
流動資産合計		297,890,684,837	262,172,503,954
資産合計		297,890,684,837	262,172,503,954
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		73,519	68,958
未払解約金		145,631,000	229,398,000
流動負債合計		145,704,519	229,466,958
負債合計		145,704,519	229,466,958
純資産の部			
元本等			
元本	1	157,491,708,151	149,590,964,021
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		140,253,272,167	112,352,072,975
元本等合計		297,744,980,318	261,943,036,996
純資産合計		297,744,980,318	261,943,036,996
負債純資産合計		297,890,684,837	262,172,503,954

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4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	162,443,611,157円	157,491,708,151円
同期中追加設定元本額	1,744,392,602円	15,541,807,871円
同期中一部解約元本額	6,696,295,608円	23,442,552,001円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・	3,903,904,317円	4,467,733,343円
ファンド		
M I T O ラップ型ファンド	- 円	17,073,172円
(安定型)		
M I T O ラップ型ファンド	- 円	47,073,483円
(中立型)		
M I T O ラップ型ファンド	- 円	77,897,821円
(積極型)		
グローバル8資産ラップファン	- 円	39,271,378円
ド(安定型)		
グローバル8資産ラップファン	- 円	39,012,866円
ド(中立型)		
グローバル8資産ラップファン	- 円	29,033,326円
ド(積極型)		
たわらノーロード 先進国債券	- 円	228,714,432円
D I A M外国債券インデックス	4,605,590,296円	4,623,354,276円
ファンド< D C年金>		
D I A Mバランス・ファンド<	363,028,975円	387,203,440円
D C年金> 1 安定型		
D I A Mバランス・ファンド<	1,283,132,992円	1,283,530,211円
D C年金> 2 安定・成長型		

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	1,349,247,904円	1,364,029,519円
D I A M D C バランス30 インデックスファンド	320,520,300円	325,115,189円
D I A M D C バランス50 インデックスファンド	692,958,260円	702,091,373円
D I A M D C バランス70 インデックスファンド	512,307,933円	505,339,054円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	28,810,864円	27,911,659円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	556,245,221円	569,197,515円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,866,604円	15,607,824円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	7,813,173円	8,397,679円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	13,563,372円	16,068,978円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	28,482,561円	31,699,285円
クルーズコントロール D I A M 8資産バランスマ ンドN<D C年金>	249,741,420円 20,197,611円	416,028,978円 29,006,506円
D I A M D C バランス・F (成長型)	13,382,213円	29,384,931円
クルーズコントロール<D C年 金>	79,796円	104,666円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	7,262,933円	2,723,108円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	17,016,298円	4,757,811円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	1,737,601円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,905,263,462円	1,769,550,717円
D I A M為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド(適 格機関投資家向け)	6,900,400,637円	7,093,365,461円
D I A M外国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	4,603,276,133円	4,550,944,527円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	2,391,636,066円	2,389,669,712円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	206,445,296円	228,405,756円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	128,624,721円	128,801,967円
D I A Mグローバル・バラン スファンド25VA(適格機関投 資家限定)	4,844,356,857円	1,670,150,576円
D I A Mグローバル・バラン スファンド50VA(適格機関投 資家限定)	878,302,881円	836,819,825円

D I A M国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家 限定)	116,810,411円	103,359,754円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	204,932,739円	171,606,862円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家 限定)	51,133,174円	42,365,459円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	24,834,608円	21,355,260円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	10,741,530,983円	7,611,301,051円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	2,712,616,646円	1,971,847,478円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,980,013,092円	5,101,789,763円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	2,961,454,154円	2,888,680,230円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,723,428,206円	4,613,963,172円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	923,820,713円	922,285,389円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	3,464,031,851円	3,342,929,487円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,570,725,958円	4,453,713,217円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	17,473,278,505円	16,564,079,178円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	54,973,620円	56,954,254円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	2,319,329,601円	2,308,160,800円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	11,227,357,288円	11,017,834,259円
D I A Mグローバル分散ファン ドVA(適格機関投資家限定)	2,488,405円	- 円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	15,715,725,760円	15,888,639,734円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	20,020,966,930円	20,107,119,904円

D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	120,099円	127,694円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	45,608,428円	46,189,380円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	7,033,038円	6,863,952円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	17,969,859,528円	18,070,681,911円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	128,975,043円	126,040,511円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	84,396,421円	96,530,008円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	116,671,521円	99,598,303円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	132,333円	139,046円
計	157,491,708,151円	149,590,964,021円
2. 受益権の総数	157,491,708,151口	149,590,964,021口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	4,439,541,613	1,318,280,183
合計	4,439,541,613	1,318,280,183

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年2月24日から平成27年10月13日まで及び平成28年2月23日から平成28年4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27年10月13日 現在				平成28年4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	66,512,445	-	66,279,600	232,845	13,605,500	-	13,512,500	93,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	13,605,500	-	13,512,500	93,000
イギリス・債券	66,512,445	-	66,279,600	232,845	-	-	-	-
買 建	1,544,013,119	-	1,543,939,600	73,519	976,234,248	-	976,165,290	68,958
アメリカ・ドル	772,472,848	-	772,413,600	59,248	390,695,084	-	390,673,400	21,684
イギリス・債券	154,045,601	-	154,040,400	5,201	195,170,284	-	195,162,610	7,674
ユーロ	617,494,670	-	617,485,600	9,070	390,368,880	-	390,329,280	39,600
合計	1,610,525,564	-	1,610,219,200	159,326	989,839,748	-	989,677,790	24,042

(注) 時価の算定方法

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.8905円	1.7511円
（1万口当たり純資産額）	（18,905円）	（17,511円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.5 07/31/17	18,000,000.000	17,964,000.000	
		US T N/B 0.625 04/30/18	10,500,000.000	10,477,845.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	18,000,000.000	18,000,540.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	11,500,000.000	11,509,430.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	19,000,000.000	19,012,540.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	2,700,000.000	2,707,884.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	6,992,860.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	10,000,000.000	10,052,300.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	3,500,000.000	3,509,695.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	5,012,100.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	15,500,000.000	15,520,460.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	11,088,880.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,897,848.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	7,074,340.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,000,000.000	8,113,680.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	1,000,000.000	1,015,420.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,384,609.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	12,155,520.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	13,500,000.000	13,671,855.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	18,500,000.000	18,770,100.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	9,700,000.000	9,868,974.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,317,390.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	8,000,000.000	8,182,480.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,000,000.000	3,042,870.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,593,450.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	5,092,550.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	3,000,000.000	3,066,780.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	15,000,000.000	15,324,600.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	8,000,000.000	8,150,000.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	5,099,200.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,165,900.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,366,850.000	
		US T N/B 1.875 08/31/17	14,000,000.000	14,232,400.000	
		US T N/B 1.875 09/30/17	10,000,000.000	10,173,400.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	7,500,000.000	7,789,425.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,839,150.000			
US T N/B 2.0 02/15/25	18,800,000.000	19,309,480.000			
US T N/B 2.0 02/28/21	3,000,000.000	3,119,040.000			
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,474,840.000			
US T N/B 2.0 08/15/25	12,000,000.000	12,302,760.000			

US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,232,920.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,800,504.000	
US T N/B 2.0 11/30/20	3,500,000.000	3,636,430.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,366,800.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	10,890,390.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,914,865.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,499,290.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,130,770.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	20,700,000.000	21,623,220.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,348,080.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	500,000.000	525,895.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,500,000.000	11,010,195.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	8,000,000.000	8,376,800.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	10,000,000.000	10,250,300.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	15,000,000.000	15,540,150.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,425,634.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,766,875.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,000,000.000	6,916,280.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	2,000,000.000	1,976,400.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	4,000,000.000	4,277,800.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	8,000,000.000	8,180,880.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,566,800.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,573,655.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,398,880.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	9,000,000.000	9,491,130.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	7,000,000.000	7,620,130.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,890,000.000	4,072,946.700	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,886,700.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,552,184.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,423,000.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	6,070,000.000	6,483,488.400	
US T N/B 2.875 08/15/45	8,000,000.000	8,530,000.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,498,044.200	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,500,000.000	7,103,785.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,800,000.000	7,436,956.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	4,500,000.000	4,923,270.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	3,000,000.000	3,378,960.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	7,600,000.000	8,526,820.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	18,000,000.000	18,476,640.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,903,890.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,761,840.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	7,100,000.000	7,960,307.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,000,000.000	3,380,130.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,800,000.000	8,001,630.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,090,000.000	7,152,887.700	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,343,720.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	14,711,480.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,000,000.000	2,409,060.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	15,359,400.000	

US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	19,788,660.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	6,137,615.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	6,143,750.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	9,000,000.000	9,806,400.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	6,397,612.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,480,000.000	4,342,239.600	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	7,169,973.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,537,760.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,570,000.000	3,260,867.400	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	12,936,480.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,181,135.600	
US T N/B 4.25 11/15/17	9,000,000.000	9,496,710.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,679,840.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,450,000.000	1,981,062.500	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,799,170.900	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,450,000.000	1,981,512.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,860,000.000	3,894,719.400	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,800,000.000	3,882,788.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,986,241.400	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,200,000.000	3,047,000.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	5,212,930.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	4,311,780.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.000	15,820,200.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	2,114,827.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	2,066,355.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,766,685.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,520,702.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,447,616.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	2,029,720.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	2,150,960.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,332,500.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	8,183,400.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,949,040.000	
US T N/B 8.75 05/15/17	12,000,000.000	13,064,520.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,912,000.000	
アメリカ・ドル 小計	946,910,000.000 (102,370,440,100)	1,008,396,428.800 (109,017,737,918)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	2,400,000.000	2,421,360.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	5,500,000.000	5,608,350.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	700,000.000	724,192.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	5,000,000.000	5,198,400.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,463,020.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,100,000.000	3,272,329.000	

UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,200,000.000	3,454,016.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	400,000.000	448,288.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	3,700,000.000	4,135,305.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,500,000.000	4,218,550.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	3,500,000.000	4,420,500.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,650,000.000	3,808,580.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,600,000.000	3,643,380.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,446,620.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	4,400,000.000	5,003,680.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,200,000.000	3,702,080.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,000,000.000	3,083,200.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,800,000.000	3,314,920.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,350,000.000	4,515,465.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,950,000.000	3,902,260.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,050,000.000	2,817,110.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,160,000.000	2,780,352.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,500,000.000	3,470,750.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,700,000.000	3,912,300.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,094,236.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,490,000.000	3,918,264.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,400,000.000	2,689,440.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,200,000.000	4,407,040.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,750,000.000	4,009,225.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.000	7,562,100.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,900,000.000	3,995,910.000	

	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,500,000.000	3,652,500.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	1,800,000.000	1,962,540.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,880,000.000	3,787,776.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,750,000.000	2,640,225.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	2,000,000.000	2,734,600.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	800,000.000	893,600.000	
	イギリス・ポンド 小計	103,900,000.000 (15,855,140,000)	129,112,463.000 (19,702,561,854)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,844,840.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,500,000.000	4,937,805.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,368,294.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	1,000,000.000	990,820.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	4,029,948.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	871,173.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,000,000.000	1,030,570.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,000,000.000	1,020,490.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,000,000.000	4,288,000.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	2,029,181.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	200,000.000	204,928.000	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	1,500,000.000	1,552,575.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	1,838,364.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,100,000.000	3,607,501.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,800,000.000	1,852,668.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,206,620.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,400,000.000	4,146,878.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	5,200,000.000	5,529,316.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,641,490.000	

	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.000	3,632,430.000	
オーストラリア・ドル 小計		50,950,000.000 (4,155,482,000)	56,623,891.000 (4,618,244,550)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	600,000.000	1,006,116.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	1,400,000.000	1,405,824.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,600,000.000	1,620,704.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	3,250,000.000	3,303,462.500	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,859,292.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,000,000.000	1,016,440.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	4,900,000.000	4,963,259.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,958,490.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,500,000.000	2,763,450.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,400,000.000	2,665,176.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	594,690.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	500,000.000	630,125.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,200,000.000	2,476,958.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,300,000.000	4,800,391.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,050,000.000	4,115,975.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	5,700,000.000	6,258,543.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	5,200,000.000	5,402,072.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,500,000.000	3,506,900.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,500,000.000	1,617,015.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,860,000.000	2,847,343.800	
CANADA 5.75 06/01/29	1,800,000.000	2,679,318.000		
CANADA 5.75 06/01/33	2,000,000.000	3,161,860.000		
カナダ・ドル 小計		52,360,000.000 (4,352,686,800)	60,653,404.300 (5,042,117,499)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	1,430,000.000	1,419,832.700	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	810,000.000	859,410.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	432,600.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	495,203.800	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	710,000.000	771,770.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,740,000.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,451,890.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	550,108.800	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,143,000.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,150,000.000	2,305,875.000	
シンガポール・ドル 小計		10,380,000.000 (832,060,800)	11,169,690.300 (895,362,374)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,553,988.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,800,000.000	13,917,746.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,900,000.000	9,406,287.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	15,370,000.000	18,526,075.800	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	7,780,000.000	8,241,042.800	

	SWEDEN 4.25 03/12/19	13,300,000.000	15,143,380.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	9,410,000.000	11,671,411.200	
スウェーデン・クローナ	小計	74,260,000.000 (984,687,600)	87,459,930.800 (1,159,718,682)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	8,500,000.000	9,439,250.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,970,000.000	11,303,886.300	
	DENMARK 3.0 11/15/21	12,000,000.000	14,136,600.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	9,780,000.000	10,491,006.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	13,900,000.000	16,093,420.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	18,000,000.000	32,009,040.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	3,700,000.000	5,889,290.000	
デンマーク・クローネ	小計	75,850,000.000 (1,256,076,000)	99,362,492.300 (1,645,442,872)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	4,012,952.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	8,178,360.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	10,400,000.000	12,004,200.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	9,100,000.000	10,497,760.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	7,000,000.000	7,295,750.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	9,560,000.000	10,762,648.000	
ノルウェー・クローネ	小計	47,460,000.000 (624,099,000)	52,751,670.000 (693,684,461)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,941,950.000	
	POLAND 2.5 07/25/18	1,500,000.000	1,533,750.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	1,000,000.000	965,750.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,218,588.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,498,379.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	7,000,000.000	7,321,300.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,394,345.000	
	POLAND 4.75 04/25/17	2,280,000.000	2,359,344.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	4,000,000.000	4,232,960.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	3,890,000.000	4,411,260.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	3,020,870.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,336,984.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,790,840.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,336,880.000	
ポーランド・ズロチ	小計	46,350,000.000 (1,329,781,500)	50,363,200.000 (1,444,920,208)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	2,000,000.000	1,961,380.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,199,760.200	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,201,430.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	3,270,000.000	3,069,483.600	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	4,700,000.000	4,743,146.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,138,186.500	
	MALAYSIA 4.012 09/15/17	3,500,000.000	3,558,485.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	2,450,000.000	2,454,067.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,654,385.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,460,230.200	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	4,300,000.000	4,391,289.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,803,059.200	

	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,147,578.900	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	800,000.000	839,664.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,754,512.000	
マレーシア・リングgit	小計	40,930,000.000 (1,136,626,100)	41,376,656.600 (1,149,029,754)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	17,000,000.000	23,569,140.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	41,000,000.000	52,811,280.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	41,500,000.000	41,757,715.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	10,000,000.000	10,507,900.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	22,000,000.000	23,154,560.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,347,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	22,628,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	3,000,000.000	3,409,290.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	60,000,000.000	63,544,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	33,187,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,969,940.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	39,000,000.000	47,170,890.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	19,000,000.000	23,143,710.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	10,000,000.000	10,947,800.000	
	メキシコ・ペソ	小計	336,500,000.000 (2,045,920,000)	383,149,425.000 (2,329,548,504)
ユーロ	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,700,000.000	1,843,429.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,408,725.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,583,540.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,506,736.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	800,000.000	1,002,768.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	970,000.000	1,450,188.800	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,848,105.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,600,000.000	3,129,880.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,600,000.000	1,967,680.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	570,000.000	1,081,728.900	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,500,000.000	2,954,500.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,800,000.000	2,880,540.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	1,200,000.000	1,281,960.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	2,300,000.000	2,622,460.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,700,000.000	1,853,510.000	

AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,500,000.000	2,162,100.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,885,367.500	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,082,340.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,000,000.000	1,051,460.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	600,000.000	604,320.000	
BELGIUM 1.25 06/22/18	2,000,000.000	2,077,380.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	500,000.000	562,460.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,600,000.000	1,858,160.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,113,552.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,122,790.500	
BELGIUM 3.0 09/28/19	2,100,000.000	2,347,506.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,500,000.000	2,360,175.000	
BELGIUM 3.75 09/28/20	3,000,000.000	3,547,920.000	
BELGIUM 4.0 03/28/18	1,500,000.000	1,632,810.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	2,350,000.000	2,661,633.500	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,300,000.000	2,873,528.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,400,000.000	2,036,566.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,500,000.000	4,108,500.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,677,610.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,600,000.000	3,331,874.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,244,576.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,000,000.000	5,034,150.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,050,000.000	4,762,941.000	
BELGIUM 5.5 09/28/17	1,300,000.000	1,413,685.000	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,031,520.000	
BUNDESUBL 0.5 02/23/18	2,600,000.000	2,649,660.000	
BUNDESUBL 0.5 04/07/17	2,600,000.000	2,625,766.000	
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	4,300,000.000	4,432,655.000	
BUNDESUBL 0.5 10/13/17	4,100,000.000	4,162,525.000	
BUNDESUBL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,869,264.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,900,000.000	4,081,935.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,000,000.000	1,039,050.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,385,231.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,486,560.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,000,000.000	1,122,260.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,274,848.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	3,800,000.000	4,305,742.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,797,800.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,726,500.000	

DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,500,000.000	3,957,170.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.000	2,841,375.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,700,000.000	4,307,799.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	2,700,000.000	3,026,295.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,500,000.000	2,860,125.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,700,000.000	3,078,270.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,600,000.000	3,776,370.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,180,000.000	3,210,093.600	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	4,500,000.000	5,165,550.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	7,700,000.000	8,787,240.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,800,000.000	4,531,880.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,150,000.000	3,463,392.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	5,900,000.000	6,669,950.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	4,900,000.000	5,474,280.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,100,000.000	3,344,125.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,500,000.000	5,814,235.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	4,800,000.000	5,082,144.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	6,000,000.000	6,642,300.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,050,000.000	3,636,392.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,600,000.000	2,479,520.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,100,000.000	5,388,482.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,600,000.000	4,975,620.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,700,000.000	4,676,670.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,360,000.000	3,856,594.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,400,000.000	2,101,750.000	

DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,300,000.000	2,347,605.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,550,000.000	2,651,430.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	451,890.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	315,735.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	900,000.000	934,830.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	770,000.000	851,312.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	900,000.000	1,000,620.000	
FINLAND 1.875 04/15/17	470,000.000	481,233.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	800,000.000	920,048.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	610,000.000	850,218.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,080,000.000	1,364,202.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,130,000.000	1,299,613.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,000,000.000	1,189,100.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	700,000.000	743,400.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,010,000.000	1,358,046.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	810,000.000	936,036.000	
FR TREASURY 1.0 07/25/17	3,000,000.000	3,056,850.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	2,200,000.000	3,525,852.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,300,000.000	4,381,055.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	4,300,000.000	4,431,924.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,773,695.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	500,000.000	518,755.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,300,000.000	2,438,000.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	1,200,000.000	1,302,720.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,945,380.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	6,460,000.000	7,307,552.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,100,000.000	3,632,859.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	5,411,345.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,800,000.000	5,889,840.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,200,000.000	10,363,340.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,440,000.000	6,756,969.600	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,305,410.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,250,000.000	3,270,555.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,300,000.000	7,502,355.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	7,500,000.000	8,663,400.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,940,000.000	9,065,722.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	3,300,000.000	3,444,705.000	

FRANCE OAT 3.75 04/25/21	6,400,000.000	7,696,128.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,567,296.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	6,200,000.000	6,764,572.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,600,000.000	4,495,920.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	3,253,322.400	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,710,000.000	5,755,916.600	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	7,600,000.000	8,678,972.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	6,800,000.000	7,295,856.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,724,895.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,600,000.000	8,695,962.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,300,000.000	7,313,225.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,600,000.000	5,891,040.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,800,000.000	7,683,216.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,600,000.000	8,020,560.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,526,266.500	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.000	3,945,600.000	
IRISH 0.8 03/15/22	800,000.000	829,840.000	
IRISH 1.0 05/15/26	500,000.000	510,700.000	
IRISH 2.0 02/18/45	790,000.000	843,301.300	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,277,837.000	
IRISH 3.4 03/18/24	1,230,000.000	1,503,035.400	
IRISH 3.9 03/20/23	800,000.000	995,280.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,430,000.000	1,639,781.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,750,000.000	2,075,500.000	
IRISH 4.5 10/18/18	1,540,000.000	1,728,111.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,400,000.000	1,716,820.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,800,000.000	2,530,422.000	
IRISH 5.5 10/18/17	300,000.000	326,775.000	
IRISH 5.9 10/18/19	750,000.000	909,525.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	1,500,000.000	1,521,000.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	500,000.000	520,495.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,557,225.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,300,000.000	2,262,050.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,500,000.000	1,593,255.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,000,000.000	1,089,000.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,430,960.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,300,000.000	3,873,375.000	

ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,700,000.000	3,301,587.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,100,000.000	2,290,659.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,800,000.000	4,412,940.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,677,430.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	4,500,000.000	5,270,400.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,292,483.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,350,000.000	5,684,145.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	5,109,720.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,358,250.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,200,000.000	6,013,280.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	7,284,480.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	11,700,000.000	12,647,700.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,233,950.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,908,040.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,661,297.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,654,800.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,100,000.000	3,873,605.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	6,200,000.000	6,838,600.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	3,000,000.000	3,817,800.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,781,010.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,230,000.000	4,365,183.500	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,548,016.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	7,200,000.000	9,018,720.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,430,000.000	5,836,170.600	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,300,000.000	4,813,050.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,700,000.000	4,034,070.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	5,148,090.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,800,000.000	9,402,976.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,700,000.000	6,720,530.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	5,000,000.000	6,485,150.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,252,525.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,470,000.000	3,829,488.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,400,000.000	6,812,520.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	4,200,000.000	6,379,800.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,700,000.000	2,669,510.000	

ITALY BTPS 9.0 11/01/23	2,400,000.000	3,797,040.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	850,000.000	871,692.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,708,840.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	3,500,000.000	3,607,940.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	2,460,000.000	2,577,342.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,400,000.000	2,716,968.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,500,000.000	2,899,000.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,789,506.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,251,507.800	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,450,000.000	2,169,562.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,880,000.000	3,421,440.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	3,270,000.000	3,816,907.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,500,000.000	3,162,250.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,470,000.000	4,169,952.800	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,150,000.000	3,512,885.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	2,931,320.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,517,759.500	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	3,090,000.000	3,283,743.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,300,000.000	3,663,900.000	
SPAIN 0.5 10/31/17	2,000,000.000	2,015,600.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	1,200,000.000	1,238,016.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,800,000.000	1,835,334.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,000,000.000	1,039,470.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,700,000.000	1,706,732.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,760,056.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,155,400.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	3,900,000.000	4,343,937.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	2,400,000.000	2,624,520.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	3,400,000.000	4,059,634.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	5,000,000.000	5,731,250.000	
SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,697,535.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,372,798.000	

	SPAIN 4.3 10/31/19	5,600,000.000	6,400,240.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,593,680.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	5,700,000.000	6,159,705.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	4,700,000.000	5,375,155.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,600,000.000	4,608,540.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,300,000.000	3,219,885.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,200,000.000	4,069,440.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,475,650.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,200,000.000	3,133,900.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	2,996,840.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	2,200,000.000	3,313,706.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,200,000.000	4,150,176.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	4,200,000.000	5,243,070.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	4,300,000.000	4,609,170.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,000,000.000	4,542,570.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,793,794.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,528,625.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,168,730.000	
	ユーロ 小計	696,350,000.000 (85,804,247,000)	860,095,419.300 (105,980,957,566)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,208,250.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,186,806.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,058,540.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	19,660,000.000	18,113,741.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,079,320.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	10,110,000.000	8,891,947.200	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	14,000,000.000	13,852,440.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	8,000,000.000	7,046,960.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	3,270,000.000	3,277,422.900	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,585,635.100	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	7,000,000.000	6,194,440.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	15,000,000.000	13,228,950.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	1,000,000.000	912,510.000	
	南アフリカ・ランド 小計	152,010,000.000 (1,097,512,200)	135,636,962.200 (979,298,867)	
国債証券 合計		221,844,759,100 (221,844,759,100)	254,658,625,113 (254,658,625,113)	

合計	221,844,759,100 (221,844,759,100)	254,658,625,113 (254,658,625,113)	
----	--------------------------------------	--------------------------------------	--

- (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 124銘柄	41.62%	42.81%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.52%	7.74%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	1.76%	1.81%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	1.92%	1.98%
シンガポール・ドル	国債証券 10銘柄	0.34%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.44%	0.46%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.63%	0.65%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.26%	0.27%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.55%	0.57%
マレーシア・リングgit	国債証券 15銘柄	0.44%	0.45%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.89%	0.91%
ユーロ	国債証券 238銘柄	40.46%	41.62%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.37%	0.38%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,376,474,935	1,094,262,062
金銭信託		-	30,915,923
コール・ローン		30,129,460	-
株式		36,343,065,024	32,538,776,045
投資信託受益証券		279,458,555	241,702,710
投資証券		96,678,260	109,131,123
派生商品評価勘定		139,317,127	14,061,868
未収入金		2,164,389	34,463,007
未収配当金		58,580,469	91,880,315
差入委託証拠金		412,116,175	389,456,546
流動資産合計		38,737,984,394	34,544,649,599
資産合計		38,737,984,394	34,544,649,599
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	12,086,133
未払金		523,177	399,247,683
未払解約金		14,000,000	9,466,000
流動負債合計		14,523,177	420,799,816
負債合計		14,523,177	420,799,816
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,882,719,542	40,987,197,477
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	1,159,258,325	6,863,347,694
元本等合計		38,723,461,217	34,123,849,783
純資産合計		38,723,461,217	34,123,849,783
負債純資産合計		38,737,984,394	34,544,649,599

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4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	35,401,260,270円	39,882,719,542円
同期中追加設定元本額	4,675,686,409円	12,051,719,505円
同期中一部解約元本額	194,227,137円	10,947,241,570円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデック スファンド< D C 年金 >	707,122,438円	1,078,555,522円
D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	- 円	102,779,454円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	- 円	8,768,715円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	- 円	24,120,072円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	- 円	39,319,073円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	- 円	20,159,808円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	- 円	19,993,998円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	- 円	14,660,263円
たわらノーロード 新興国株式 マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	127,573,181円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	493,502,641円	546,365,294円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	27,370,129円	30,730,003円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	71,002,656円	84,681,755円
投資のソムリエ	176,284,159円	196,116,080円
クルーズコントロール	1,009,002,208円	1,637,562,653円
投資のソムリエ< D C 年金 >	153,927,909円	389,159,015円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C 年金 >	16,530,292円	32,611,578円
クルーズコントロール< D C 年 金 >	72,382,243円	100,653,854円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	49,518円	98,133円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	14,738,011円	6,092,755円
投資のソムリエ< D C 年金 >リ スク抑制型	34,745,610円	10,784,555円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	2,023,995円
エマージング株式パッシブファ ンドV A (適格機関投資家専 用)	- 円	1,803,630円
	7,154,666,073円	7,529,560,179円

	新興国株式パッシブ私募ファン ド（適格機関投資家限定）	191,028,343円	190,433,666円
	エマージング株式パッシブファ ンド（適格機関投資家限定）	2,148,456,348円	2,195,970,340円
	D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資 家限定）	16,853,215,021円	16,283,056,519円
	D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定）	10,758,695,943円	10,313,563,387円
	計	39,882,719,542円	40,987,197,477円
2 .	受益権の総数	39,882,719,542口	40,987,197,477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1,159,258,325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6,863,347,694円でありま す。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年10月13日現在	平成28年4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	4,378,768,296	3,998,196,168
投資信託受益証券	1,285,209	8,136,192
投資証券	4,796,044	7,868,272
合計	4,384,849,549	3,982,191,704

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年4月21日から平成27年10月13日まで及び平成27年4月21日から平成28年4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27年10月13日 現在				平成28年4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								
買 建	-	-	-	-	437,829,300	-	437,805,000	24,300
アメリカ・ドル	-	-	-	-	437,829,300	-	437,805,000	24,300
合計	-	-	-	-	437,829,300	-	437,805,000	24,300

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成27年10月13日 現在				平成28年4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	1,849,225,968	-	1,988,543,095	139,317,127	1,653,364,609	-	1,655,364,644	2,000,035
合計	1,849,225,968	-	1,988,543,095	139,317,127	1,653,364,609	-	1,655,364,644	2,000,035

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	0.9709円	0.8325円
(1万口当たり純資産額)	(9,709円)	(8,325円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年4月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	11,200	44.430	497,616.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,273	7.860	143,625.780	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	65,400	6.650	434,910.000	
	CREDICORP LTD	5,649	125.620	709,627.380	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	46,825	8.560	400,822.000	
	NETEASE INC-ADR	3,300	143.250	472,725.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	13,480	25.920	349,401.600	
	LUKOIL SPON ADR	44,939	41.145	1,849,015.150	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	48,121	1.680	80,843.280	
	GAZPROM PAO ADR	518,151	4.299	2,227,531.140	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	96,568	3.710	358,267.280	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	38,100	3.336	127,101.600	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	69,241	5.490	380,133.090	
	SISTEMA JSFC GDR	15,837	6.080	96,288.960	
	NOVATEK OAO GDR	8,065	87.250	703,671.250	
	BAIDU INC -SPON ADR	11,500	183.980	2,115,770.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	50,794	12.830	651,687.020	
	ROSTELECOM SPON ADR	16,154	8.710	140,701.340	
	ROSNEFT OIL CO GDR	110,287	4.678	515,922.580	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	5,500	35.890	197,395.000	
	SEVERSTAL GDR	21,971	10.970	241,021.870	
	TATNEFT ADR	20,855	32.180	671,113.900	
	VTB BANK OJSC GDR	239,366	2.182	522,296.610	
	DP WORLD LTD	14,393	19.000	273,467.000	
	MAGNIT PJSC GDR	22,955	39.000	895,245.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	15,900	12.950	205,905.000	
	SOUFUN HOLDINGS LTD ADR	11,000	5.630	61,930.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	129,759	1.000	129,759.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,600	51.520	82,432.000	
	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO LTD ADR	4,200	75.740	318,108.000	
SBERBANK ADR	238,564	7.120	1,698,575.680		
YY INC-ADR	1,300	63.010	81,913.000		
MEGAFON PJSC GDR	11,719	10.150	118,947.850		
58.COM INC ADR	3,500	57.680	201,880.000		

	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	2,300	43.300	99,590.000	
	JD.COM INC ADR	14,600	26.860	392,156.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	42,400	77.470	3,284,728.000	
アメリカ・ドル 小計		1,993,766		21,732,124.360 (2,349,459,964)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	74,823	11.750	879,170.250	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	88,156	6.100	537,751.600	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	147,491	18.200	2,684,336.200	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	175,877	6.490	1,141,441.730	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	55,579	8.750	486,316.250	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	298,755	6.150	1,837,343.250	
	ARABTEC HOLDING CO	190,922	1.800	343,659.600	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	265,978	2.770	736,759.060	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	174,604	1.440	251,429.760	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	178,166	2.880	513,118.080	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,650,351		9,411,325.780 (277,445,884)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	111,203	1,036.350	115,245,229.050	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,259	899.650	6,530,559.350	
	ASIAN PAINTS LTD	23,671	851.550	20,157,040.050	
	EICHER MOTORS LTD	1,038	19,181.200	19,910,085.600	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,625	1,232.250	38,969,906.250	
	SHREE CEMENT LTD	777	12,231.100	9,503,564.700	
	ICICI BANK LTD	94,024	221.250	20,802,810.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	123,307	183.100	22,577,511.700	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,923	1,268.150	3,706,802.450	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	23,672	476.800	11,286,809.600	
	TATA STEEL LTD	25,639	322.100	8,258,321.900	
	TATA MOTORS LTD	67,619	371.450	25,117,077.550	
	JSW STEEL LTD	5,060	1,273.400	6,443,404.000	
	TATA POWER CO LTD	83,703	65.800	5,507,657.400	
	NESTLE INDIA LTD	2,134	5,975.650	12,752,037.100	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	122.800	6,029,357.200	
	GAIL INDIA LTD	33,181	347.350	11,525,420.350	
	VEDANTA LTD	81,588	87.450	7,134,870.600	
	AXIS BANK LTD	46,701	421.600	19,689,141.600	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	78,975	206.150	16,280,696.250	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	881	6,011.300	5,295,955.300		

LUPIN LTD	18,592	1,540.100	28,633,539.200	
ACC LTD	3,300	1,441.850	4,758,105.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	128,340	1,079.550	138,549,447.000	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	48,150	389.100	18,735,165.000	
INFOSYS LTD	157,465	1,165.750	183,564,823.750	
WIPRO LTD	52,275	549.550	28,727,726.250	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	64,447	850.400	54,805,728.800	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,999	1,370.650	9,593,179.350	
HCL TECHNOLOGIES LTD	48,052	833.100	40,032,121.200	
DABUR INDIA LTD	44,319	250.050	11,081,965.950	
HERO MOTOCORP LTD	4,116	2,915.700	12,001,021.200	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,965	3,039.150	30,285,129.750	
BHARTI AIRTEL LTD	102,173	334.600	34,187,085.800	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	2,355.300	12,822,253.200	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	82,160	811.750	66,693,380.000	
DIVI'S LABORATORIES LTD	6,922	1,013.450	7,015,100.900	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,953	3,430.650	30,714,609.450	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,754	766.150	9,771,477.100	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,762	758.050	16,496,684.100	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	27,798	243.950	6,781,322.100	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,711	945.950	12,969,920.450	
CIPLA LTD/INDIA	30,629	504.450	15,450,799.050	
LARSEN & TOUBRO LTD	27,151	1,192.250	32,370,779.750	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,015	3,158.850	9,523,932.750	
ASHOK LEYLAND LTD	103,421	107.050	11,071,218.050	
BOSCH LTD	705	18,993.350	13,390,311.750	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	40,484	2,432.050	98,459,112.200	
NTPC LTD	105,410	131.550	13,866,685.500	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,629	1,060.300	7,028,728.700	
AMBUJA CEMENTS LTD	61,876	225.750	13,968,507.000	
BHARAT FORGE LTD	9,622	769.900	7,407,977.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	110,967	87.700	9,731,805.900	
ITC LTD	191,425	321.200	61,485,710.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	23,573	460.000	10,843,580.000	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	84,596	50.400	4,263,638.400	
SIEMENS INDIA LTD	3,547	1,132.200	4,015,913.400	
UNITED BREWERIES LTD	6,705	821.200	5,506,146.000	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,946	1,376.650	15,068,810.900	

	TECH MAHINDRA LTD	21,631	455.850	9,860,491.350	
	CAIRN INDIA LTD	43,218	148.850	6,432,999.300	
	IDEA CELLULAR LTD	103,591	109.050	11,296,598.550	
	MARICO LTD	38,600	252.100	9,731,060.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	168.050	4,329,808.250	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	70,134	219.250	15,376,879.500	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	25,236	161.050	4,064,257.800	
	BAJAJ AUTO LTD	6,953	2,389.450	16,613,845.850	
	COAL INDIA LTD	65,944	279.600	18,437,942.400	
	TATA MOTORS LTD	35,104	277.000	9,723,808.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	247.950	5,880,134.250	
	BHARTI INFRA TEL LTD	44,143	369.550	16,313,045.650	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,789	607.750	16,281,014.750	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	321.600	5,835,753.600	
	インド・ルピー 小計	3,131,446		1,634,575,339.950 (2,680,703,558)	
インドネシア・ル ピア	AKR CORPORINDO TBK PT	184,100	6,750.000	1,242,675,000.000	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	16,850.000	589,750,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	144,301	15,650.000	2,258,310,650.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	343,200	7,225.000	2,479,620,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	128,100	43,000.000	5,508,300,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,728,700	7,200.000	12,446,640,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,285,700	3,445.000	14,764,236,500.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	704,700	3,620.000	2,551,014,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	43,500	66,000.000	2,871,000,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	33,000	99,000.000	3,267,000,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	113,500	20,200.000	2,292,700,000.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	1,000,800	1,585.000	1,586,268,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	3,750.000	1,089,060,000.000	
	BANK MANDIRI	793,100	9,850.000	7,812,035,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	196,000	18,325.000	3,591,700,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	946,800	10,800.000	10,225,440,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	838,500	2,690.000	2,255,565,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	703,100	5,200.000	3,656,120,000.000	

	KALBE FARMA TBK PT	1,728,800	1,440.000	2,489,472,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	279,700	10,425.000	2,915,872,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,049,100	13,075.000	13,716,982,500.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	3,900.000	1,133,730,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,600	1,060.000	1,286,416,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	625,200	1,110.000	693,972,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,045.000	958,082,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	5,350.000	1,003,125,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	1,850.000	1,096,680,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	705.000	768,802,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	119,800	15,125.000	1,811,975,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	148,500	5,800.000	861,300,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	535,800	3,250.000	1,741,350,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	20,843,017		110,965,194,150.000 (921,011,112)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	8,895	83.000	738,285.000	
	QATAR NATIONAL BANK	17,679	138.600	2,450,309.400	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	13,439	39.500	530,840.500	
	OOREDOO QSC	6,737	91.700	617,782.900	
	DOHA BANK QSC	10,788	36.700	395,919.600	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,398	206.000	493,988.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,763	105.200	1,342,667.600	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,187	100.200	519,737.400	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	21,930	23.410	513,381.300	
	MASRAF AL RAYAN	32,030	34.600	1,108,238.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	34.350	271,914.600	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	73,441	17.720	1,301,374.520	
	VODAFONE QATAR	31,747	12.110	384,456.170	
	QATAR INSURANCE CO SAQ-RTS	1,779	31.000	55,149.000	
カタール・リアル 小計	246,729		10,724,043.990 (318,825,828)		
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	35,125	8,380.000	294,347,500.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	8,788	38,940.000	342,204,720.000	
	ECOPETROL SA	366,698	1,280.000	469,373,440.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	5,872	38,580.000	226,541,760.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	362,757	1,170.000	424,425,690.000	

	CEMENTOS ARGOS SA	38,592	11,560.000	446,123,520.000	
	GRUPO ARGOS SA	26,973	19,980.000	538,920,540.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	33,434	26,020.000	869,952,680.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	18,444	39,480.000	728,169,120.000	
コロンビア・ペソ	小計	896,683		4,340,058,970.000 (151,902,064)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	164.500	3,240,650.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	27.500	2,370,500.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	258,800	17.600	4,554,880.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	132,400	130.000	17,212,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	865,225	7.250	6,272,881.250	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	49,300	158.000	7,789,400.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,307,700	2.360	3,086,172.000	
	IRPC PCL NVDR	697,700	5.000	3,488,500.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	100,000	17.200	1,720,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	276,800	24.700	6,836,960.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	88,600	157.000	13,910,200.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	361,920	8.250	2,985,840.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	45,500	84.250	3,833,375.000	
	PTT PCL	86,000	280.000	24,080,000.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	164,100	21.600	3,544,560.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,050	454.000	5,016,700.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	35,700	390.000	13,923,000.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	22,700	454.000	10,305,800.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	99,400	159.000	15,804,600.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	105,300	52.250	5,501,925.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	308,200	23.700	7,304,340.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	30,300	198.500	6,014,550.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	139,810	36.250	5,068,112.500	
	THAI OIL PCL NVDR	75,100	69.250	5,200,675.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	88.000	3,660,800.000	
	CP ALL PCL NVDR	394,100	44.500	17,537,450.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	9.000	4,637,700.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	131,945	68.750	9,071,218.750	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	75,722	22.900	1,734,033.800	

	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	22.900	1,257,965.700	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	170,808	58.250	9,949,566.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	129,100	22.300	2,878,930.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	578,400	5.450	3,152,280.000	
タイ・パーツ 小計		7,459,413		232,945,565.000 (717,472,340)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,340	5,198.000	6,965,320.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	250.000	1,419,250.000	
	CEZ	13,430	401.900	5,397,517.000	
チェコ・コルナ 小計		20,447		13,782,087.000 (62,846,316)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,829,922	33.280	194,019,804.160	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,022	27,133.000	81,995,926.000	
	BANCO DE CHILE	2,124,153	72.320	153,618,744.960	
	EMPRESAS CMPC SA	114,623	1,556.600	178,422,161.800	
	EMPRESAS COPEC SA	39,358	6,393.800	251,647,180.400	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	7,459.900	98,396,081.000	
	ENTEL CHILE SA	12,381	5,931.900	73,442,853.900	
	ENDESA CHILE	274,605	913.870	250,953,271.350	
	ENERSIS SA	1,664,838	184.990	307,978,381.620	
	COLBUN SA	748,274	180.410	134,996,112.340	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	379.860	85,132,703.760	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,110.500	45,122,490.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	25,767	4,641.400	119,594,953.800	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,243	13,520.000	111,445,360.000	
	SACI FALABELLA	38,293	4,692.100	179,674,585.300	
	ITAU CORPBANCA	12,337,769	6.100	75,260,390.900	
	CENCOSUD SA	96,360	1,721.500	165,883,740.000	
	SONDA SA	39,110	1,289.800	50,444,078.000	
	AES GENER SA	209,506	342.390	71,732,759.340	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES RTS	293	1,544.400	452,509.200		
チリ・ペソ 小計		23,825,203		2,630,214,087.830 (416,362,891)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	191,935	7.960	1,527,802.600	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	20,373	21.700	442,094.100	
	ARCELIK	20,283	19.160	388,622.280	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	46,865	4.720	221,202.800	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	132,172	4.500	594,774.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	36.440	203,480.960	
	KOC HOLDING AS	47,656	14.210	677,191.760	

	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	47,602	4.030	191,836.060	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	52,710	3.750	197,662.500	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	13,047	21.600	281,815.200	
	TURK HAVA YOLLARI	38,365	7.550	289,655.750	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	81,365	11.430	930,001.950	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	202,941	8.200	1,664,116.200	
	TURKIYE IS BANKASI	119,206	4.550	542,387.300	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,218	72.950	745,403.100	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	14,893	20.800	309,774.400	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	78,404	4.050	317,536.200	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	89,021	9.590	853,711.390	
	COCA-COLA ICECEK AS	3,988	39.300	156,728.400	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,600	61.550	1,206,380.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	46,986	4.630	217,545.180	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	15,347	17.730	272,102.310	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	58,286	9.920	578,197.120	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	24,099	6.660	160,499.340	
	トルコ・リラ 小計	1,380,946		12,970,520.900 (491,582,741)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	12,643	5,435.000	68,714,705.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,094	16,330.000	50,525,020.000	
	OTP BANK NYRT	21,675	7,050.000	152,808,750.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	37,412		272,048,475.000 (107,268,714)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	626,700	36.000	22,561,200.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	151,590	64.700	9,807,873.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	61,046	89.750	5,478,878.500	
	AYALA CORP	19,283	745.500	14,375,476.500	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	169,800	16.760	2,845,848.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.700	4,468,495.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,960	2,076.000	6,144,960.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	66.200	2,693,016.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	208,080	80.900	16,833,672.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	37,710	230.600	8,695,926.000	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	22,601	85.000	1,921,085.000	
	BDO UNIBANK INC	134,288	102.000	13,697,376.000	
	MEGAWORLD CORP	1,126,000	3.950	4,447,700.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	8,175	1,828.000	14,943,900.000	
	ROBINSONS LAND CORP	175,600	29.000	5,092,400.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	700,275	22.000	15,406,050.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	72,740	219.000	15,930,060.000	
	SM INVESTMENTS CORP	14,032	960.000	13,470,720.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	876,500	5.630	4,934,695.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,180,800	5.820	6,872,256.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	43.100	5,296,990.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	7,425	1,356.000	10,068,300.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,111,035		205,986,877.000 (482,009,292)	
ブラジル・レアル	BRF SA	56,292	49.650	2,794,897.800	
	VALE SA	114,527	16.240	1,859,918.480	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	27.860	223,381.480	
	VALE SA-PREF A	161,096	12.190	1,963,760.240	
	RAIA DROGASIL SA	18,200	54.020	983,164.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	7.530	524,841.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	10.290	239,242.500	
	BANCO DO BRASIL SA	74,200	20.900	1,550,780.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	307,617	8.220	2,528,611.740	
	LOJAS AMERICANAS SA	56,874	16.050	912,827.700	
	LOJAS AMERICANAS SA	14,670	11.200	164,304.000	
	GERDAU SA	71,130	6.810	484,395.300	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	11,606	47.370	549,776.220	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	266,310	10.490	2,793,591.900	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	324,012	8.260	2,676,339.120	
	KROTON EDUCACIONAL SA	128,268	11.910	1,527,671.880	
	CCR SA	81,820	13.700	1,120,934.000	
	WEG SA	50,340	13.880	698,719.200	
	BANCO BRADESCO SA PREF	212,378	27.410	5,821,280.980	
	BANCO BRADESCO SA	63,492	30.700	1,949,204.400	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	27.840	412,032.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	23,506	8.250	193,924.500	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	10.990	345,086.000	
	CPFL ENERGIA SA	17,047	19.050	324,745.350	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	261,708	31.700	8,296,143.600	
	PORTO SEGURO SA	9,400	28.700	269,780.000	

FIBRIA CELULOSE SA	21,490	28.250	607,092.500	
B2W CIA DIGITAL	10,300	12.770	131,531.000	
BRASKEM SA	14,130	23.200	327,816.000	
TRACTEBEL ENERGIA SA	13,970	36.150	505,015.500	
LOCALIZA RENT A CAR	11,805	32.350	381,891.750	
TELEFONICA BRASIL S.A.	33,928	43.000	1,458,904.000	
LOJAS RENNER SA	55,300	21.200	1,172,360.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	12.360	223,716.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,352	71.600	2,244,803.200	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,000	30.110	331,210.000	
TOTVS SA	8,000	28.350	226,800.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	15,100	39.800	600,980.000	
EMBRAER SA	61,560	22.190	1,366,016.400	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,000	15.380	261,460.000	
M DIAS BRANCO SA	3,300	71.450	235,785.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	8,200	19.900	163,180.000	
ODONTOPREV SA	22,300	12.210	272,283.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	38,000	15.090	573,420.000	
JBS SA	61,100	9.620	587,782.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	42,349	7.100	300,677.900	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	30,398	23.800	723,472.400	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,000	55.990	391,930.000	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	12.280	297,176.000	
DURATEX SA	27,037	7.900	213,592.300	
SUL AMERICA SA	15,448	16.300	251,802.400	
HYPERMARCAS SA	29,900	28.050	838,695.000	
BM&FBOVESPA SA	146,900	15.900	2,335,710.000	
QUALICORP SA	17,800	16.180	288,004.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	25,900	16.870	436,933.000	
CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,259	42.110	853,106.490	
CIELO SA	73,436	38.100	2,797,911.600	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,700	30.880	1,812,656.000	
DURATEX SA-RCT	697	7.690	5,359.930	
AMBEV SA	405,495	18.570	7,530,042.150	
KLABIN SA	49,200	16.500	811,800.000	
ブラジル・リアル 小計	3,902,315		72,770,268.910 (2,191,112,797)	

ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	59,382	5.600	332,539.200	
	MBANK	1,260	336.000	423,360.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1,359	84.000	114,156.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,926	66.900	730,949.400	
	BANK PEKAO SA	12,189	152.950	1,864,307.550	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	6.290	368,594.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	27,324	70.860	1,936,178.640	
	LPP SA	94	5,458.950	513,141.300	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,637	297.350	784,111.950	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,110	26.890	2,073,487.900	
	CCC SA	1,127	154.200	173,783.400	
	SYNTHOS SA	46,508	3.900	181,381.200	
	EUROCASH SA	7,580	54.100	410,078.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	27.450	218,968.650	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	173,156	4.880	845,001.280	
	CYFROWY POLSAT SA	16,740	23.470	392,887.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	90.570	348,966.210	
	ENEA SA	18,176	11.290	205,207.040	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,259	13.300	987,644.700	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	2.970	245,096.280	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	49,966	35.450	1,771,294.700		
ALIOR BANK SA	4,463	70.000	312,410.000		
ENERGA SA	16,930	12.330	208,746.900		
ポーランド・ズロチ 小計	754,140		15,442,292.100 (443,039,360)		
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	170,200	4.400	748,880.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	11.060	249,956.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	440,100	4.820	2,121,282.000	
	DIGI.COM BHD	283,900	4.770	1,354,203.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	6.430	444,441.600	
	RHB CAPITAL BHD	46,680	6.100	284,748.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	45,000	7.630	343,350.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	69,235	3.240	224,321.400	
	GAMUDA BHD	159,300	4.970	791,721.000	
	GENTING BHD	187,300	9.170	1,717,541.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.660	614,216.600	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	16,656	15.340	255,503.040	

HONG LEONG BANK BHD	46,008	13.500	621,108.000		
IJM CORP BHD	254,060	3.630	922,237.800		
IOI CORP BHD	238,713	4.510	1,076,595.630		
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,000	24.020	840,700.000		
MALAYAN BANKING BHD	432,875	9.130	3,952,148.750		
LAFARGE MALAYSIA BHD	20,400	9.200	187,680.000		
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	86,100	4.130	355,593.000		
MISC BHD	103,880	8.880	922,454.400		
PPB GROUP BHD	36,900	16.440	606,636.000		
PETRONAS DAGANGAN BHD	23,600	23.860	563,096.000		
PETRONAS GAS BHD	63,900	21.900	1,399,410.000		
GENTING MALAYSIA BHD	279,900	4.600	1,287,540.000		
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	55.120	628,368.000		
TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.710	637,450.000		
TENAGA NASIONAL BHD	289,850	14.380	4,168,043.000		
UMW HOLDINGS BHD	47,900	6.880	329,552.000		
DIALOG GROUP BHD	375,644	1.600	601,030.400		
PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	217,630	19.200	4,178,496.000		
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.490	217,335.870		
AIRASIA BHD	83,400	1.890	157,626.000		
SIME DARBY BERHAD	267,600	7.850	2,100,660.000		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	63,700	4.760	303,212.000		
AXIATA GROUP BERHAD	222,000	5.860	1,300,920.000		
BUMI ARMADA BHD	195,350	0.740	144,559.000		
MAXIS BHD	142,700	6.130	874,751.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	239,700	6.700	1,605,990.000		
SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	319,200	1.820	580,944.000		
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	125,500	2.920	366,460.000		
IHH HEALTHCARE BHD	206,600	6.690	1,382,154.000		
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	1.500	178,800.000		
WESTPORTS HOLDINGS BHD	99,600	4.250	423,300.000		
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	139,639	2.340	326,755.260		
マレーシア・リンギット 小計	6,908,913		42,391,769.750 (1,177,219,446)		
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	240,400	32.440	7,798,576.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	44,600	144.120	6,427,752.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	17,800	197.970	3,523,866.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	172,600	29.870	5,155,562.000	

	GRUPO TELEVISA SAB	209,100	91.320	19,095,012.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	147,300	49.110	7,233,903.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,145	277.730	4,483,950.850	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,400	222.090	4,974,816.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	46,900	80.200	3,761,380.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	214,100	93.360	19,988,376.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	79,588	41.460	3,299,718.480	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,115	216.680	3,058,438.200	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	128,000	42.090	5,387,520.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	16,995	261.560	4,445,212.200	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	330,552	38.610	12,762,612.720	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,703,178	13.520	36,546,966.560	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,300	33.890	6,720,387.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,200	116.990	3,650,088.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	443,500	40.220	17,837,570.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	23,200	162.280	3,764,896.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	25.300	1,776,060.000	
	GENTERA SAB DE CV	95,000	33.740	3,205,300.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	29,000	52.420	1,520,180.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	56,500	45.920	2,594,480.000	
メキシコ・ペソ 小計		5,350,673		189,012,623.010 (1,149,196,747)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	500,000	0.209	104,500.000	
	ALPHA BANK A.E.	100,000	1.790	179,000.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.239	955.520	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	18.000	63,324.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	7.640	76,430.560	
	FF GROUP	3,130	17.800	55,714.000	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	0.740	1,206.200	
	OPAP SA	8,501	6.330	53,811.330	
	JUMBO SA	5,623	11.450	64,383.350	
PUBLIC POWER CORP	8,000	2.920	23,360.000		
ユーロ 小計		644,404		622,684.960 (76,727,242)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,090	16,400.000	116,276,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	1,068	154,000.000	164,472,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,205	102,000.000	326,910,000.000	

SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,015	287,000.000	865,305,000.000	
DONGBU INSURANCE CO LTD	3,482	74,200.000	258,364,400.000	
COWAY CO LTD	4,549	93,600.000	425,786,400.000	
KT&G CORP	9,311	115,500.000	1,075,420,500.000	
S-1 CORPORATION	1,763	94,400.000	166,427,200.000	
KOREA GAS CORP	2,659	38,000.000	101,042,000.000	
CJ CORP	1,369	202,500.000	277,222,500.000	
KAKAO CORP	2,808	98,800.000	277,430,400.000	
SK TELECOM CO LTD	1,614	202,500.000	326,835,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,400	88,200.000	211,680,000.000	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	15,692	7,750.000	121,613,000.000	
NCSOFT CORPORATION	1,480	249,500.000	369,260,000.000	
LG UPLUS CORP	18,179	10,950.000	199,060,050.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	21,700.000	87,885,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	6,539	5,930.000	38,776,270.000	
POSCO DAEWOO CORP	4,351	23,200.000	100,943,200.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	796	1,019,000.000	811,124,000.000	
LG CHEM LTD	3,930	319,500.000	1,255,635,000.000	
LG CHEM LTD	726	222,000.000	161,172,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	36,345	39,450.000	1,433,810,250.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	3,860	46,200.000	178,332,000.000	
S-OIL CORP	3,822	96,600.000	369,205,200.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	9,297	23,000.000	213,831,000.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,874	38,250.000	186,430,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,310	329,000.000	430,990,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,253	69,000.000	155,457,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,546	106,500.000	377,649,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,810	236,000.000	1,371,160,000.000	
SK HYNIX INC	49,783	27,800.000	1,383,967,400.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,330	40,000.000	293,200,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,667	100,000.000	166,700,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,404	146,000.000	1,956,984,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,811	55,900.000	380,734,900.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,220	11,750.000	272,835,000.000	
KCC CORP	483	397,500.000	191,992,500.000	
KIA MOTORS CORP	23,045	45,400.000	1,046,243,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	772	472,000.000	364,384,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,829	58,700.000	1,281,362,300.000	
HANWHA CORP	3,785	34,550.000	130,771,750.000	

KOREAN AIR CO LTD	3,845	31,100.000	119,579,500.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	101,500.000	152,250,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	630	193,000.000	121,590,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,423	61,000.000	86,803,000.000	
KT CORP	3,085	30,450.000	93,938,250.000	
LG ELECTRONICS INC	9,022	63,700.000	574,701,400.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	43	2,499,000.000	107,457,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	60	1,965,000.000	117,900,000.000	
HANSSEM CO LTD	869	217,500.000	189,007,500.000	
LG CORP	7,994	68,000.000	543,592,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	9,550.000	110,684,500.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	26,550.000	104,739,750.000	
NAVER CORP	2,391	663,000.000	1,585,233,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	16,000.000	52,336,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,243	138,000.000	171,534,000.000	
DONGSUH CO INC	3,429	33,850.000	116,071,650.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,287	42,400.000	139,368,800.000	
OTTOGI CORP	112	914,000.000	102,368,000.000	
DOOSAN CORP	662	87,900.000	58,189,800.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,571	153,500.000	394,648,500.000	
KANGWON LAND INC	10,592	41,000.000	434,272,000.000	
POSCO	5,980	232,500.000	1,390,350,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,671	99,700.000	465,698,700.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,000	54,800.000	274,000,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	9,469	1,246,000.000	11,798,374,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	12,525	10,500.000	131,512,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,762	1,042,000.000	1,836,004,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	202,000.000	135,138,000.000	
HYOSUNG CORP	2,040	134,000.000	273,360,000.000	
ORION CORP	298	930,000.000	277,140,000.000	
YUHAN CORP	699	294,000.000	205,506,000.000	
HANON SYSTEMS	16,843	9,260.000	155,966,180.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	34,500.000	196,995,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,241	58,400.000	247,674,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	19,682	27,400.000	539,286,800.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	6,250.000	64,250,000.000	
CELLTRION INC	5,894	110,900.000	653,644,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,109	23,050.000	578,762,450.000	

	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,731	187,000.000	323,697,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	4,483	23,100.000	103,557,300.000	
	LOTTE SHOPPING CO	1,045	259,500.000	271,177,500.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,832	117,000.000	799,344,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,706	404,000.000	1,093,224,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	853	228,000.000	194,484,000.000	
	SAMSUNG CARD CO	2,877	39,450.000	113,497,650.000	
	SK INNOVATION CO LTD	5,533	171,000.000	946,143,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	710	357,500.000	253,825,000.000	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,117	66,500.000	140,780,500.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,196	78,500.000	93,886,000.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,000	218,500.000	655,500,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	32,842	32,750.000	1,075,575,500.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,454	100,000.000	145,400,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	4,964	65,500.000	325,142,000.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	23,598	9,030.000	213,089,940.000	
	HANMI PHARM CO LTD	471	683,000.000	321,693,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,801	6,220.000	73,402,220.000	
	O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,833	65,600.000	120,244,800.000	
	E-MART CO LTD	1,929	171,000.000	329,859,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	8,950.000	121,174,050.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	49,000.000	121,618,000.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,577	50,000.000	328,850,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	797	191,500.000	152,625,500.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,643	162,000.000	428,166,000.000	
	WOORI BANK	27,802	9,250.000	257,168,500.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,491	138,500.000	899,003,500.000	
	韓国・ウォン 小計	698,064		54,426,734,960.000 (5,110,670,413)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	80,000	9.070	725,600.000	
	JIANGSU EXPRESS	110,000	10.100	1,111,000.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	5.240	848,880.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	525,500	86.350	45,376,925.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	116,000	20.650	2,395,400.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	256,000	2.330	596,480.000	
	BEIJING ENTERPRISES	44,500	39.950	1,777,775.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	6.850	2,452,300.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	212,000	4.400	932,800.000	

YANZHOU COAL MINING CO LTD	176,000	3.960	696,960.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	61,500	68.250	4,197,375.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	128,000	4.910	628,480.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	78,320	13.750	1,076,900.000	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	244,000	7.750	1,891,000.000	
CNOOC LTD	1,517,000	8.950	13,577,150.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	282,000	7.020	1,979,640.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	378,000	7.260	2,744,280.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	337,120	24.050	8,107,736.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	234,888	19.560	4,594,409.280	
CITIC LTD	371,000	11.580	4,296,180.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	148,000	8.530	1,262,440.000	
LENOVO GROUP LTD	618,000	5.910	3,652,380.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,816,000	4.880	8,862,080.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	508,742	9.920	5,046,720.640	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	136,790	15.600	2,133,924.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,193,200	5.060	11,097,592.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	14.260	1,098,020.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	70,000	44.000	3,080,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	248,000	6.750	1,674,000.000	
COSCO PACIFIC LTD	168,000	9.690	1,627,920.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	636,180	1.100	699,798.000	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	96,000	22.700	2,179,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	362,000	2.570	930,340.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	70,000	15.220	1,065,400.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	134,000	11.480	1,538,320.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	400,000	3.900	1,560,000.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	78,000	22.850	1,782,300.000	
BYD CO LTD	59,500	41.350	2,460,325.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,180,000	4.240	5,003,200.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	5.790	926,400.000	

ALIBABA PICTURES GROUP LTD	760,000	1.760	1,337,600.000	
SINOTRANS LTD	147,000	3.240	476,280.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	233,000	8.440	1,966,520.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	333,192	13.540	4,511,419.680	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	132,000	5.830	769,560.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	179,200	14.660	2,627,072.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	224,500	5.860	1,315,570.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	638,000	18.060	11,522,280.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	535,000	2.350	1,257,250.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	4.910	785,600.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,059,000	0.670	1,379,530.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	84,720	9.520	806,534.400	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	3.920	1,164,240.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	17.060	784,760.000	
TINGYI HOLDING CORP	186,000	8.900	1,655,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	26.950	808,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	232,000	9.750	2,262,000.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	112,000	14.640	1,639,680.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	7.970	924,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	373,000	5.880	2,193,240.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.790	506,570.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	230,000	12.220	2,810,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	443,000	160.000	70,880,000.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	446,500	35.050	15,649,825.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	338,000	4.980	1,683,240.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,097,240	1.080	1,185,019.200	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	3.880	1,055,360.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	6.080	984,960.000	
ZTE CORP	86,888	12.040	1,046,131.520	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	190,000	3.470	659,300.000	

CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	293,000	11.780	3,451,540.000	
COSCO HOLDINGS	133,000	3.100	412,300.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	742,205	4.860	3,607,116.300	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	142,000	11.580	1,644,360.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	62,000	58.000	3,596,000.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,209,530	4.880	35,182,506.400	
SHENZHO INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	46,000	40.600	1,867,600.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	8.900	2,029,200.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	141,000	5.630	793,830.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	284,000	3.790	1,076,360.000	
BANK OF CHINA LTD	6,810,200	3.080	20,975,416.000	
SHUI ON LAND LTD	338,100	2.090	706,629.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	117,500	11.020	1,294,850.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	90,800	10.980	996,984.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	393,470	15.980	6,287,650.600	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,326,235	4.110	26,000,825.850	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	3.550	744,080.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	358,000	9.470	3,390,260.000	
CHINA COAL ENERGY CO	256,000	3.200	819,200.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	13.160	710,640.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	48,500	45.700	2,216,450.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	13.420	1,409,100.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	489,142	3.100	1,516,340.200	
CHINA CITIC BANK-H	697,800	4.620	3,223,836.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	377,000	4.400	1,658,800.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	93,000	19.600	1,822,800.000	
FOSUN INTERNATIONAL	203,028	10.740	2,180,520.720	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	396,000	2.150	851,400.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	3.630	1,041,810.000	
SOHO CHINA LTD	196,000	3.840	752,640.000	

KINGSOFT CORP LTD	71,000	18.180	1,290,780.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,239,000	1.190	1,474,410.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	372,000	5.900	2,194,800.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	172,000	9.450	1,625,400.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	487,000	6.140	2,990,180.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	225,600	27.600	6,226,560.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	373,000	5.670	2,114,910.000	
CRRG CORP LTD - H	402,450	7.680	3,090,816.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	110,000	10.420	1,146,200.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235,500	5.180	1,219,890.000	
SINOPHARM GROUP CO	100,800	35.250	3,553,200.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	195,805	8.570	1,678,048.850	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	250,000	3.960	990,000.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	239,000	5.670	1,355,130.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	56,800	15.460	878,128.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	2.350	803,700.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	178,000	5.200	925,600.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	126,500	11.240	1,421,860.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	67,100	25.950	1,741,245.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	503,880	7.080	3,567,470.400	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	306,000	3.550	1,086,300.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,976,000	2.750	5,434,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	159,000	6.000	954,000.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	187,500	17.620	3,303,750.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	280,000	12.700	3,556,000.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	49,400	12.480	616,512.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	553,000	3.180	1,758,540.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	20.650	691,775.000	

	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	114,000	6.590	751,260.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	256,000	7.410	1,896,960.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	2.960	956,080.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	833,000	2.590	2,157,470.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	113,000	15.360	1,735,680.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	112,561	18.660	2,100,388.260	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	80,000	5.810	464,800.000	
	CAR INC	72,000	8.870	638,640.000	
	CGN POWER CO LTD	838,000	2.520	2,111,760.000	
	DALIAN WANDA COMMERCIAL PROPERTIES CO LTD	50,200	46.400	2,329,280.000	
	GF SECURITIES CO LTD	118,200	18.340	2,167,788.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	114,800	17.200	1,974,560.000	
香港・ドル	小計	65,687,186		507,426,368.300 (7,073,523,574)	
台湾・ドル	ACER INC	274,532	11.950	3,280,657.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	60,554	283.500	17,167,059.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	47,616	86.800	4,133,068.800	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	536,729	34.700	18,624,496.300	
	ASIA CEMENT CORP	204,928	27.550	5,645,766.400	
	TAIWAN BUSINESS BANK	393,839	8.380	3,300,370.820	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	71,000	45.850	3,255,350.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	49.000	3,822,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,082	80.200	3,695,776.400	
	QUANTA COMPUTER INC	228,858	55.500	12,701,619.000	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	63,070	47.600	3,002,132.000	
	EVA AIRWAYS CORP	111,624	17.800	1,986,907.200	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	255.500	14,246,680.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	364,393	16.300	5,939,605.900	
	CHINA AIRLINES	232,156	11.050	2,565,323.800	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	136,169	63.000	8,578,647.000	
	CHINA STEEL CORP	1,018,058	21.200	21,582,829.600	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	242,695	23.250	5,642,658.750	
	ADVANTECH CO LTD	30,264	226.000	6,839,664.000	

COMPAL ELECTRONICS INC	330,304	19.650	6,490,473.600	
DELTA ELECTRONICS INC	166,663	140.000	23,332,820.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	322,327	108.500	34,972,479.500	
AU OPTRONICS CORP	731,194	9.710	7,099,893.740	
TAIWAN MOBILE CO LTD	139,800	104.000	14,539,200.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	11.800	1,892,625.600	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	265,824	24.250	6,446,232.000	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	26,630	165.500	4,407,265.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	17,022	409.500	6,970,509.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,285	120.000	6,394,200.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	352,633	78.900	27,822,743.700	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	36,000	29.100	1,047,600.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	274,594	80.100	21,994,979.400	
TRANSCEND INFORMATION INC	19,897	95.800	1,906,132.600	
GIANT MANUFACTURING	26,151	186.000	4,864,086.000	
MEDIATEK INC	127,507	229.500	29,262,856.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	582,936	39.600	23,084,265.600	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	505,189	15.450	7,805,170.050	
HOTAI MOTOR CO LTD	19,000	325.500	6,184,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	130,000	70.700	9,191,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	27,088	111.000	3,006,768.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	792,141	10.850	8,594,729.850	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	701,920	36.300	25,479,696.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,150,403	8.200	9,433,304.600	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	603,128	17.650	10,645,209.200	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,233,120	81.900	100,992,528.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	931,495	22.250	20,725,763.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	2,445.000	20,097,900.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	639,751	11.250	7,197,198.750	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	739,724	6.270	4,638,069.480	
INVENTEC CO LTD	231,005	20.950	4,839,554.750	
HTC CORPORATION	65,832	76.500	5,036,148.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	172,893	39.250	6,786,050.250	

RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	37,496	60.400	2,264,758.400	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	833,650	9.670	8,061,395.500	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,315,452	16.300	21,441,867.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	765,323	15.600	11,939,038.800	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	21,950	130.000	2,853,500.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	62,560	71.000	4,441,760.000	
NAN YA PLASTICS CORP	406,828	65.600	26,687,916.800	
WISTRON CORP	160,601	19.250	3,091,569.250	
POU CHEN CORP	208,990	40.100	8,380,499.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	407,297	55.600	22,645,713.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,392	228.000	10,577,376.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	101,480	89.900	9,123,052.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	10,658	265.000	2,824,370.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	38.650	2,919,891.550	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	45,715	47.500	2,171,462.500	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	79,791	71.100	5,673,140.100	
SILICONWARE PRECISION INDS	181,743	50.600	9,196,195.800	
STANDARD FOODS CORP	32,120	79.800	2,563,176.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	124,666	32.850	4,095,278.100	
TAIWAN CEMENT CORP	264,874	30.200	7,999,194.800	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	156,000	25.450	3,970,200.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,111,083	157.500	332,495,572.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,019,525	12.750	12,998,943.750	
YULON MOTOR CO	65,149	29.500	1,921,895.500	
INOTERA MEMORIES INC	202,000	29.000	5,858,000.000	
INNOLUX CORPORATION	794,345	11.100	8,817,229.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	137,526	33.050	4,545,234.300	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,879	147.500	2,489,652.500	
HERMES MICROVISION INC	3,000	781.000	2,343,000.000	
PEGATRON CORP	176,554	72.900	12,870,786.600	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	90,076	54.800	4,936,164.800	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.750	2,021,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	69.100	2,376,003.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	685,424	14.200	9,733,020.800	

	OBI PHARMA INC	9,000	417.500	3,757,500.000	
	CASETEK HOLDINGS LTD	6,000	169.000	1,014,000.000	
台湾・ドル 小計		26,658,474		1,200,291,924.440 (3,996,972,109)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	BARLOWORLD LTD	18,561	72.430	1,344,373.230	
	BIDVEST GROUP LTD	27,000	361.500	9,760,500.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	40,339	95.590	3,856,005.010	
	DISCOVERY LTD	29,704	118.440	3,518,141.760	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	370,520	11.840	4,386,956.800	
	MASSMART HOLDINGS LTD	9,965	129.320	1,288,673.800	
	GOLD FIELDS LTD	73,055	60.670	4,432,246.850	
	REMGRO LTD	41,677	248.690	10,364,653.130	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	140.400	2,429,060.400	
	MMI HOLDINGS LTD	96,226	24.250	2,333,480.500	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	210,782	24.100	5,079,846.200	
	EXXARO RESOURCES LTD	12,410	70.250	871,802.500	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	592.810	1,887,507.040	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	10,532	137.240	1,445,411.680	
	MTN GROUP LTD	142,331	129.580	18,443,250.980	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	34,529	214.270	7,398,528.830	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	56.400	1,140,802.800	
	FIRSTRAND LTD	291,232	45.240	13,175,335.680	
	PSG GROUP LTD	8,154	204.200	1,665,046.800	
	NASPERS LTD	34,175	2,100.850	71,796,548.750	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	21,138	70.000	1,479,660.000	
	NEDBANK GROUP LTD	18,686	180.000	3,363,480.000	
	NETCARE LTD	84,426	35.620	3,007,254.120	
	PICK'N PAY STORES LTD	23,031	70.930	1,633,588.830	
	RMB HOLDINGS LTD	66,732	57.060	3,807,727.920	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	364.000	1,911,364.000	
	SAPPI LTD	38,531	63.690	2,454,039.390	
	SASOL LTD	47,530	419.350	19,931,705.500	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	38,220	167.750	6,411,405.000	
	MR PRICE GROUP LTD	21,087	171.220	3,610,516.140	
	BRAIT SE	28,931	160.390	4,640,243.090	
STANDARD BANK GROUP LTD	103,856	122.820	12,755,593.920		
SPAR GROUP LTD/THE	12,805	210.700	2,698,013.500		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	84,012	85.800	7,208,229.600		
IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,901	150.000	1,935,150.000		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	29,069	320.990	9,330,858.310		

BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	28,200	135.750	3,828,150.000	
TIGER BRANDS LTD	13,168	328.660	4,327,794.880	
SANLAM LTD	147,862	63.530	9,393,672.860	
INVESTEC LTD	23,104	106.000	2,449,024.000	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	66,179	44.500	2,944,965.500	
PIONEER FOODS LTD	12,824	140.000	1,795,360.000	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	18,394	191.220	3,517,300.680	
MONDI LTD	9,069	274.460	2,489,077.740	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	71,611	36.000	2,577,996.000	
RMI HOLDINGS	59,287	40.000	2,371,480.000	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	32,270	23.860	769,962.200	
VODACOM GROUP PTY LTD	30,582	159.680	4,883,333.760	
SIBANYE GOLD LTD	64,504	55.280	3,565,781.120	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	15.780	1,245,783.660	
FORTRESS INCOME FUND LTD	57,017	36.080	2,057,173.360	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	247,425	95.080	23,525,169.000	
南アフリカ・ランド 小計	3,201,089		324,573,912.980 (2,343,423,653)	
合計	181,401,706		32,538,776,045 (32,538,776,045)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28年4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	1,158,953.000	14,324,659.080	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	156,400.000	25,429,076.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,315,353.000	39,753,735.080 (241,702,710)	
投資信託受益証券 合計			1,315,353	241,702,710 (241,702,710)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	467,046.580	
	トルコ・リラ 小計		162,734.000	467,046.580 (17,701,066)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,900.000	8,303,775.000	
	メキシコ・ペソ 小計		208,900.000	8,303,775.000 (50,486,952)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,966.000	2,510,678.500	
		RESILIENT REIT LTD	22,906.000	3,160,111.760	
南アフリカ・ランド 小計		43,872.000	5,670,790.260 (40,943,105)		
投資証券 合計			415,506	109,131,123	

		(109,131,123)	
合計		350,833,833	
		(350,833,833)	

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 37銘柄	6.89%	-%	-%	7.14%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.81%	-%	-%	0.84%
インド・ルピー	株式 73銘柄	7.86%	-%	-%	8.15%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.70%	-%	-%	2.80%
カタール・リアル	株式 14銘柄	0.93%	-%	-%	0.97%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.45%	-%	-%	0.46%
タイ・バーツ	株式 33銘柄	2.10%	-%	-%	2.18%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.18%	-%	-%	0.19%
チリ・ペソ	株式 20銘柄	1.22%	-%	-%	1.27%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.44% -%	-% -%	-% 0.05%	1.55%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.31%	-%	-%	0.33%
フィリピン・ペソ	株式 22銘柄	1.41%	-%	-%	1.47%
ブラジル・レアル	株式 61銘柄	6.42%	-%	-%	6.66%
ポーランド・ズロチ	株式 23銘柄	1.30%	-%	-%	1.35%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	3.45%	-%	-%	3.58%
メキシコ・ペソ	株式 24銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	3.37% -% -%	-% 0.71% -%	-% -% 0.15%	4.38%
ユーロ	株式 10銘柄	0.22%	-%	-%	0.23%
韓国・ウォン	株式 107銘柄	14.98%	-%	-%	15.54%
香港・ドル	株式 141銘柄	20.73%	-%	-%	21.51%
台湾・ドル	株式 88銘柄	11.71%	-%	-%	12.15%
南アフリカ・ランド	株式 53銘柄 投資証券 2銘柄	6.87% -%	-% -%	-% 0.12%	7.25%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,465,154,234	960,238,652
金銭信託		-	25,101,817
コール・ローン		42,269,036	-
国債証券		54,037,504,409	48,496,198,371
未収利息		443,375,820	475,364,054
前払費用		165,055,876	57,179,414
流動資産合計		57,153,359,375	50,014,082,308
資産合計		57,153,359,375	50,014,082,308
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		50,600	24,000
未払金		1,723,139,026	67,428,207
未払解約金		11,823,000	7,302,000
流動負債合計		1,735,012,626	74,754,207
負債合計		1,735,012,626	74,754,207
純資産の部			
元本等			
元本	1	30,668,857,776	29,537,750,912
剰余金			
剰余金又は欠損金()		24,749,488,973	20,401,577,189
元本等合計		55,418,346,749	49,939,328,101
純資産合計		55,418,346,749	49,939,328,101
負債純資産合計		57,153,359,375	50,014,082,308

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4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	22,419,838,885円	30,668,857,776円
同期中追加設定元本額	9,308,032,258円	20,129,850,589円
同期中一部解約元本額	1,059,013,367円	21,260,957,453円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	- 円	93,751,284円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	61,203,823円	56,208,374円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	13,873,130円	14,633,077円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	35,487,956円	41,466,096円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	89,541,489円	97,775,468円
投資のソムリエ	2,266,342,191円	2,080,907,742円
クルーズコントロール	97,097,650円	173,806,581円
投資のソムリエ<DC年金>	37,259,855円	41,245,626円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	36,217,099円	49,701,789円
クルーズコントロール<DC年金>	31,026円	43,453円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	3,779,615円	1,414,359円

D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	8,880,392円	2,520,221円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	- 円	5,133,965円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	535,593円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	3,578,173,597円	2,863,565,944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)	438,672,169円	464,613,388円
エマージング債券パッシブファ ンドV A(適格機関投資家専 用)	3,772,448,284円	3,669,522,451円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A(適格機関投資 家限定)	8,449,789,250円	8,218,411,401円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A(適格機関投資 家限定)	5,380,692,810円	5,198,877,851円
D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	2,776,032,177円	3,027,519,029円
D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドI I(適格機関投資家限 定)	3,623,335,263円	3,436,097,220円
計	30,668,857,776円	29,537,750,912円
2 . 受益権の総数	30,668,857,776口	29,537,750,912口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年8月28日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,134,264,342	924,829,914
合計	1,134,264,342	924,829,914

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年4月21日から平成27年10月13日まで及び平成27年4月21日から平成28年4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27年10月13日 現在				平成28年4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								
買 建	659,720,600	-	659,670,000	50,600	432,424,000	-	432,400,000	24,000
アメリカ・ドル	659,720,600	-	659,670,000	50,600	432,424,000	-	432,400,000	24,000
合計	659,720,600	-	659,670,000	50,600	432,424,000	-	432,400,000	24,000

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.8070円	1.6907円
(1万口当たり純資産額)	(18,070円)	(16,907円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 10.125 05/15/27	2,100,000.000	2,810,010.000	
		BRAZIL 2.625 01/05/23	3,600,000.000	3,031,200.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	8,500,000.000	7,596,875.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	5,600,000.000	5,600,000.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	6,000,000.000	4,620,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	4,300,000.000	3,612,000.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	4,100,000.000	4,417,750.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	3,500,000.000	3,473,750.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	2,800,000.000	3,034,640.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	1,200,000.000	1,427,040.000	
		BRAZIL 8.875 04/15/24	1,600,000.000	1,916,320.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	1,200,000.000	1,413,600.000	
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,170,810.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,700,000.000	1,579,300.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	3,100,000.000	3,103,100.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	4,200,000.000	4,372,200.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	4,400,000.000	4,048,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	4,800,000.000	4,752,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	4,600,000.000	4,807,000.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	4,300,000.000	4,874,050.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	3,000,000.000	3,540,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,500,000.000	3,127,000.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	2,600,000.000	2,772,068.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	2,400,000.000	2,637,720.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	2,300,000.000	2,517,350.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	2,400,000.000	2,648,520.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	2,800,000.000	3,085,180.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	800,000.000	831,464.000	
		HUNGARY 4.125 02/19/18	1,900,000.000	1,971,288.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	2,900,000.000	3,219,087.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	2,600,000.000	2,914,054.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	3,600,000.000	4,109,364.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	3,300,000.000	3,675,012.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	4,600,000.000	5,238,802.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	1,900,000.000	2,718,064.000			
INDONESIA 11.625 03/04/19	3,600,000.000	4,518,180.000			
INDONESIA 3.375 04/15/23	2,900,000.000	2,844,871.000			
INDONESIA 3.75 04/25/22	2,200,000.000	2,235,772.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	3,200,000.000	3,236,832.000			

INDONESIA 4.625 04/15/43	1,600,000.000	1,520,144.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	4,500,000.000	4,859,820.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	2,800,000.000	2,788,996.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	3,100,000.000	3,136,549.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,700,000.000	1,870,918.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	2,200,000.000	2,485,912.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,100,000.000	2,336,775.000	
INDONESIA 6.625 02/17/37	1,900,000.000	2,213,690.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	3,100,000.000	3,724,991.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	2,200,000.000	2,385,570.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,500,000.000	3,216,375.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	2,500,000.000	3,409,875.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	2,000,000.000	2,068,000.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	2,800,000.000	3,094,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	3,600,000.000	4,528,440.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,600,000.000	2,056,000.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	2,000,000.000	2,862,700.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,100,000.000	1,641,750.000	
PERU 5.625 11/18/50	4,200,000.000	4,704,210.000	
PERU 6.55 03/14/37	1,800,000.000	2,226,780.000	
PERU 7.125 03/30/19	1,000,000.000	1,150,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	3,800,000.000	4,957,860.000	
PERU 8.75 11/21/33	3,700,000.000	5,447,140.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	2,200,000.000	3,657,302.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	2,600,000.000	2,928,484.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	2,400,000.000	2,638,872.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	2,200,000.000	2,513,412.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	2,400,000.000	3,070,656.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	2,000,000.000	2,562,500.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,000,000.000	2,830,800.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,600,000.000	5,216,400.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	946,016.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	2,900,000.000	4,535,948.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	1,300,000.000	1,582,152.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	3,000,000.000	5,196,900.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	2,100,000.000	2,588,313.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	2,000,000.000	2,137,700.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,200,000.000	2,433,288.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	1,600,000.000	1,977,616.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	4,100,000.000	4,875,966.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	4,800,000.000	5,054,640.000	

RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	18,362,500.000	22,385,723.750	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	4,800,000.000	5,617,680.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	3,100,000.000	5,185,370.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	3,600,000.000	3,630,528.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	2,400,000.000	2,478,624.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	4,600,000.000	4,840,396.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	4,200,000.000	4,262,160.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	2,200,000.000	2,277,000.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	2,400,000.000	2,400,960.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	1,600,000.000	1,584,000.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	3,600,000.000	3,808,692.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,200,000.000	1,304,784.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	2,800,000.000	3,018,092.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	1,000,000.000	1,088,750.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,500,000.000	2,746,925.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	1,500,000.000	2,548,800.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	3,500,000.000	3,308,480.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	3,000,000.000	2,932,920.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	4,500,000.000	4,155,705.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,573,875.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	4,900,000.000	5,296,753.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	3,100,000.000	3,359,098.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	4,300,000.000	4,641,592.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,000,000.000	2,222,980.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	1,900,000.000	2,265,750.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	2,200,000.000	2,367,134.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	2,900,000.000	3,404,861.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	4,000,000.000	4,744,000.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	3,100,000.000	3,441,124.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	2,900,000.000	3,285,729.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,400,000.000	1,727,628.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	4,700,000.000	5,644,700.000	
TURKEY 7.5 07/14/17	4,200,000.000	4,484,214.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	1,800,000.000	2,055,780.000	
TURKEY 8.0 02/14/34	2,100,000.000	2,745,309.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	600,000.000	621,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	5,000,000.000	5,112,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	4,700,000.000	4,855,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	5,300,000.000	5,565,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	5,000,000.000	4,911,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	7,000,000.000	7,000,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	4,400,000.000	4,846,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	5,000,000.000	5,556,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	4,400,000.000	4,499,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	3,200,000.000	3,564,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,100,000.000	5,998,875.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	2,800,000.000	3,585,960.000	
	UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	800,000.000	1,084,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	2,400,000.000	3,612,000.000	
	アメリカ・ドル 小計	399,562,500.000 (43,196,701,875)	448,581,984.750 (48,496,198,371)	
国債証券	合計	43,196,701,875 (43,196,701,875)	48,496,198,371 (48,496,198,371)	
合計		43,196,701,875 (43,196,701,875)	48,496,198,371 (48,496,198,371)	

- (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 129銘柄	97.11%	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】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

平成28年4月28日現在

資産総額	244,383,354円
負債総額	1,091,445円
純資産総額（ - ）	243,291,909円
発行済数量	254,925,063口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9544円

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

平成28年4月28日現在

資産総額	424,200,915円
負債総額	425,783円
純資産総額（ - ）	423,775,132円
発行済数量	453,603,314口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9342円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	282,821,406,980円
負債総額	1,479,528,792円
純資産総額（ - ）	281,341,878,188円
発行済数量	143,600,565,854口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9592円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	404,374,771,751円
負債総額	2,080,677,616円
純資産総額（ - ）	402,294,094,135円
発行済数量	308,374,295,443口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3046円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	264,974,198,293円
負債総額	268,264,257円
純資産総額（ - ）	264,705,934,036円
発行済数量	100,558,113,820口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6324円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	267,635,625,643円
負債総額	63,353,898円
純資産総額（ - ）	267,572,271,745円
発行済数量	152,107,467,902口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7591円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	38,075,073,716円
負債総額	1,136,206,516円
純資産総額（ - ）	36,938,867,200円
発行済数量	42,274,266,907口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8738円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	54,068,305,179円
負債総額	815,730,534円
純資産総額（ - ）	53,252,574,645円
発行済数量	30,758,350,660口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7313円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

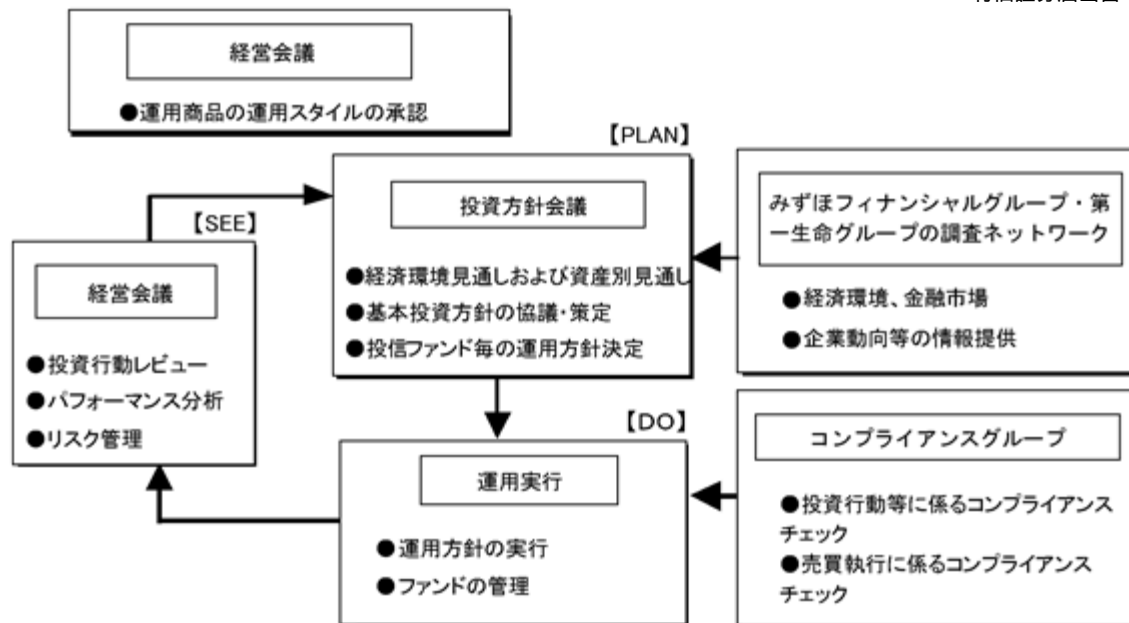
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成28年4月28日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年4月28日現在、委託会社の運用する投資信託は421本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単体型株式投資信託	6	74,284,971,539
追加型株式投資信託	372	5,825,192,212,947
単体型公社債投資信託	43	314,580,388,571
追加型公社債投資信託	0	0
合計	421	6,214,057,573,057

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

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

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

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

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

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

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

重要な会計方針

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

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: right;">...</td> <td style="width: 40%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: right;">...</td> <td style="width: 60%; text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

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

（有価証券関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）			
1．満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2．子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,316,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
3．その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	493,805	159,101	334,703
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

（金銭の信託関係）

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

（セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

第31期中間会計期間
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

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

1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28年3月末現在

(3) 投資顧問会社

a. 名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末現在 200百万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況 には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されま
す。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
（ファンドの略称（堅実型）：まもラップ堅、（積極型）：まもラップ積）

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年5月18日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）の平成27年10月14日から平成28年4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、D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）の平成28年4月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年5月18日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mコア資産設計ファンド（積極型）の平成27年10月14日から平成28年4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、D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）の平成28年4月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。