

【表紙】

| | |
|---|---------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成28年10月12日 |
| 【発行者名】 | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 西 恵正 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 上野 圭子 |
| 【電話番号】 | 03-6774-5110 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | 投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 | 5,000億円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書の提出に伴い、平成28年3月28日付をもって提出した有価証券届出書（平成28年9月30日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済み。以下、「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

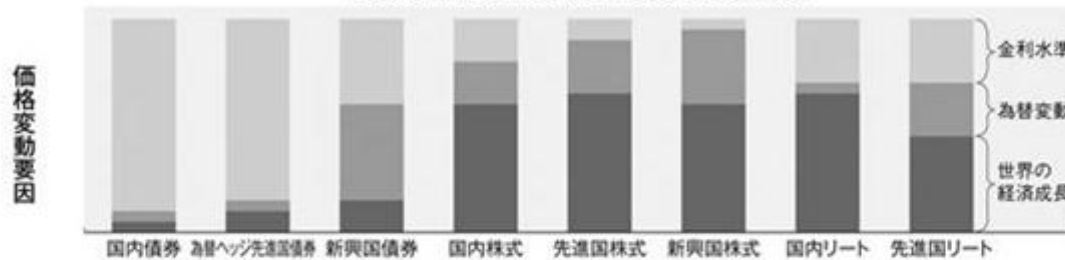
(略)

基本配分戦略 (月次戦略)

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

基本配分比率決定のイメージ

各資産における価格変動要因と要因の比率(例)

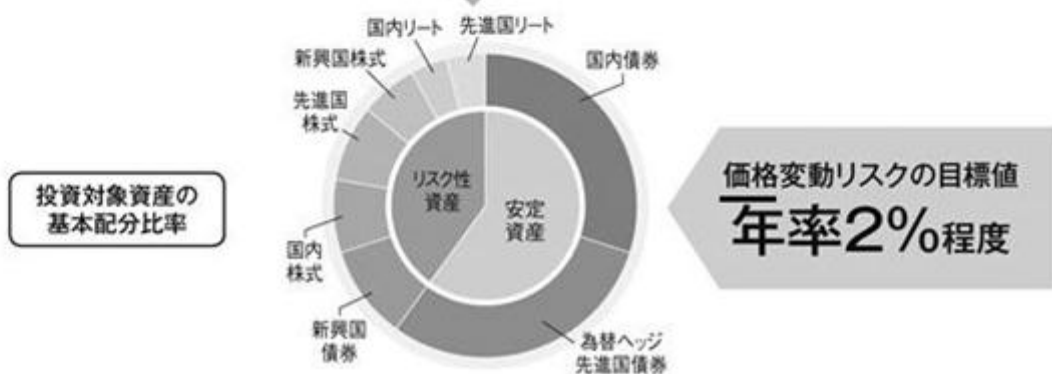


価格変動要因の比率を均等に配分



着目する価格変動要因は各時点において適宜変更します。

価格変動要因の分散から最適な資産配分の比率を決定



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

機動的配分戦略

(日次戦略)

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

*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等です。

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

※2015年12月末時点

※各投資行動は基本配分比率に対するものです。

(ご参考) 配分比率変更のイメージ



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

投資対象資産

| | 安定資産 | | | リスク性資産 |
|-----|-------|------------|-------|--------|
| | 国内 | 先進国 | 新興国 | |
| 債券 | 国内債券 | 為替ヘッジ先進国債券 | 新興国債券 | |
| 株式 | 国内株式 | 先進国株式 | 新興国株式 | |
| リート | 国内リート | 先進国リート | | |

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

(略)

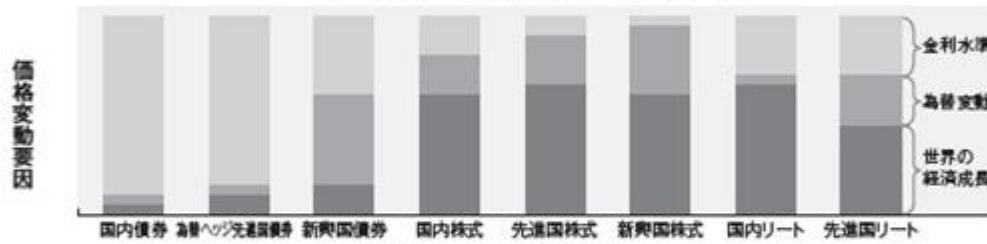
<訂正後>
(略)

基本配分戦略 (月次戦略)

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

基本配分比率決定のイメージ

各資産における価格変動要因と要因の比率(例)

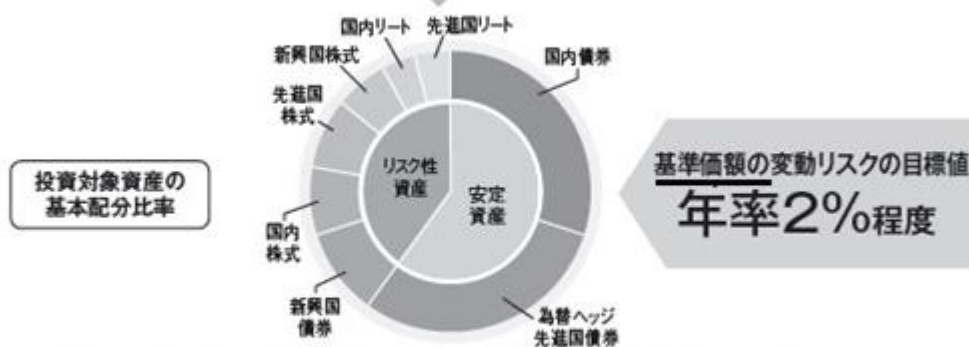


価格変動要因の比率を均等に配分



着目する価格変動要因は
各時点において適宜変更します。

価格変動要因の分散から最適な資産配分の比率を決定



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

機動的配分戦略

(日次戦略)

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

※現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等です。

投資行動

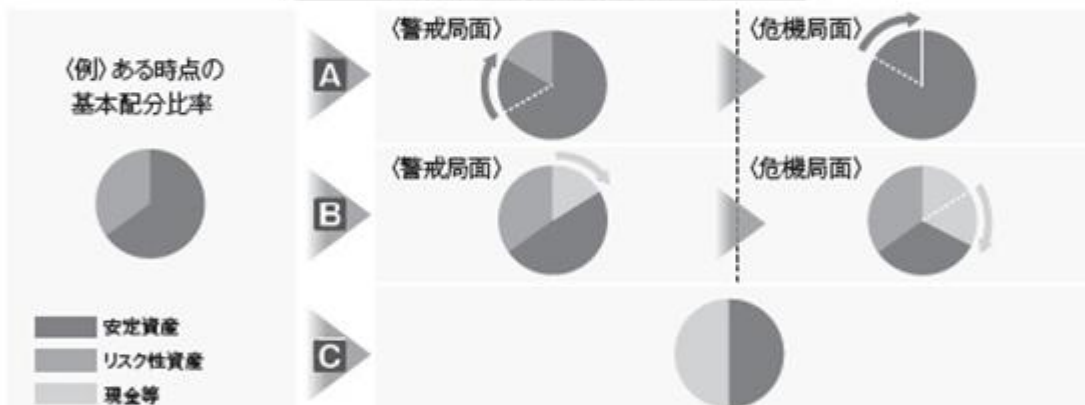
| | 警戒局面 | 危機局面 |
|------------------------------|---|-----------------------------------|
| A リスク性資産の下落時 | リスク性資産を 半分売却 | リスク性資産を 全て売却 (安定資産比率最大100%) |
| B 安定資産の下落時* | 安定資産を 4分の1売却 | 安定資産を 半分売却 |
| C 安定資産、 リスク性資産の下落時 | リスク性資産を全て売却し、基本配分比率の8資産の 合計額のうち半分を現金等に入れ替えます。 ※現金等の比率は50%を超える場合があります。 | |

※2016年4月末時点

※各投資行動は基本配分比率に対するものです。

*安定資産の下落時には、国内債券、為替ヘッジ先進国債券それぞれにおいて局面を判断して投資行動を決定します。

(ご参考)配分比率変更のイメージ



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

投資対象資産

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

リスク性資産

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

(略)

3【投資リスク】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク（参考情報）」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

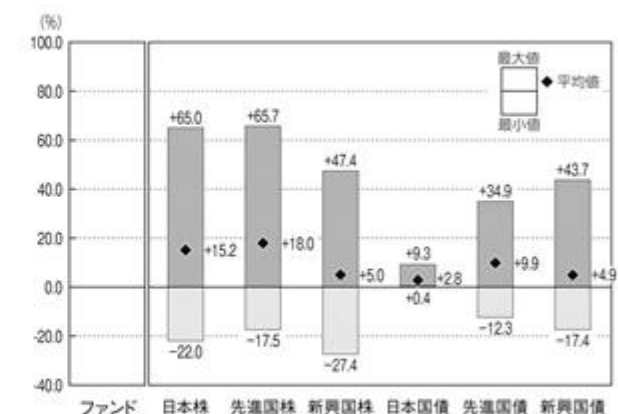
<更新・訂正後>

（参考情報）

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンド:2016年7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8月～2016年7月

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

*ファンドは2016年7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・ディバースィファイド(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・ディバースィファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

(略)

<訂正後>

(略)

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

(略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 191,167,226 | 82.62 |
| 内 日本 | 191,167,226 | 82.62 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 40,201,054 | 17.38 |
| 純資産総額 | 231,368,280 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|------------|------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 5,678,039 | 2.45 |
| - | 5,678,039 | 2.45 |
| 為替予約取引(売建) | 41,445,391 | 17.91 |
| - | 41,445,391 | 17.91 |

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

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式 | 277,175,488,620 | 97.94 |
| 内 日本 | 277,175,488,620 | 97.94 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 5,834,222,745 | 2.06 |
| 純資産総額 | 283,009,711,365 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 5,938,395,000 | 2.10 |
| 内 日本 | 5,938,395,000 | 2.10 |

(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7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 322,071,257,000 | 82.90 |
| 内 日本 | 322,071,257,000 | 82.90 |
| 地方債証券 | 24,707,867,774 | 6.36 |
| 内 日本 | 24,707,867,774 | 6.36 |
| 特殊債券 | 21,295,465,693 | 5.48 |
| 内 日本 | 21,295,465,693 | 5.48 |
| 社債券 | 18,726,857,290 | 4.82 |
| 内 日本 | 18,426,220,290 | 4.74 |
| 内 オランダ | 201,234,000 | 0.05 |
| 内 イギリス | 99,403,000 | 0.03 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,687,404,585 | 0.43 |
| 純資産総額 | 388,488,852,342 | 100.00 |

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

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資証券 | 24,259,833,100 | 99.15 |
| 内 日本 | 24,259,833,100 | 99.15 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 208,299,475 | 0.85 |
| 純資産総額 | 24,468,132,575 | 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7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式 | 249,682,972,832 | 96.13 |
| 内 アメリカ | 154,111,187,000 | 59.33 |
| 内 イギリス | 18,724,655,788 | 7.21 |
| 内 スイス | 10,068,470,156 | 3.88 |
| 内 カナダ | 9,892,199,020 | 3.81 |
| 内 フランス | 9,066,026,536 | 3.49 |
| 内 ドイツ | 9,063,982,216 | 3.49 |
| 内 オーストラリア | 6,843,559,192 | 2.63 |
| 内 オランダ | 4,457,508,022 | 1.72 |
| 内 アイルランド | 4,337,413,806 | 1.67 |
| 内 スペイン | 3,034,836,947 | 1.17 |
| 内 スウェーデン | 2,781,750,841 | 1.07 |
| 内 香港 | 2,478,799,804 | 0.95 |
| 内 デンマーク | 2,045,201,001 | 0.79 |
| 内 シンガポール | 1,810,313,593 | 0.70 |
| 内 イタリア | 1,769,740,271 | 0.68 |
| 内 ジャージー | 1,548,575,073 | 0.60 |
| 内 ベルギー | 1,354,809,745 | 0.52 |
| 内 バミューダ | 1,047,572,762 | 0.40 |
| 内 フィンランド | 1,013,210,882 | 0.39 |
| 内 オランダ領キュラソー | 934,571,535 | 0.36 |
| 内 イスラエル | 727,932,764 | 0.28 |
| 内 ケイマン諸島 | 690,127,971 | 0.27 |
| 内 ノルウェー | 625,155,558 | 0.24 |
| 内 ルクセンブルグ | 275,140,608 | 0.11 |
| 内 オーストリア | 182,536,908 | 0.07 |
| 内 ニュージーランド | 179,002,181 | 0.07 |
| 内 パナマ | 163,815,871 | 0.06 |
| 内 ポルトガル | 152,657,520 | 0.06 |
| 内 リベリア | 103,756,628 | 0.04 |
| 内 イギリス領バージン諸島 | 78,747,419 | 0.03 |
| 内 パプアニューギニア | 64,971,421 | 0.03 |
| 内 マン島 | 35,475,446 | 0.01 |
| 内 モーリシャス | 19,268,347 | 0.01 |
| 投資信託受益証券 | 909,304,945 | 0.35 |
| 内 オーストラリア | 786,816,070 | 0.30 |
| 内 シンガポール | 122,488,875 | 0.05 |
| 投資証券 | 6,525,691,430 | 2.51 |
| 内 アメリカ | 5,626,773,180 | 2.17 |
| 内 フランス | 403,122,982 | 0.16 |
| 内 イギリス | 297,763,218 | 0.11 |
| 内 香港 | 142,033,958 | 0.05 |
| 内 カナダ | 55,998,092 | 0.02 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 2,615,076,319 | 1.01 |
| 純資産総額 | 259,733,045,526 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|--------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 23,036,600 | 0.01 |
| - | 23,036,600 | 0.01 |
| 株価指数先物取引（買建） | 2,540,671,710 | 0.98 |
| 内 アメリカ | 1,695,284,805 | 0.65 |
| 内 ドイツ | 450,037,269 | 0.17 |
| 内 イギリス | 193,042,609 | 0.07 |
| 内 オーストラリア | 108,353,880 | 0.04 |
| 内 カナダ | 93,953,147 | 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。

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 3,971,604,878 | 11.37 |
| 内 オーストラリア | 2,963,399,862 | 8.48 |
| 内 シンガポール | 999,566,797 | 2.86 |
| 内 カナダ | 8,638,219 | 0.02 |
| 投資証券 | 30,795,076,650 | 88.15 |
| 内 アメリカ | 25,388,052,520 | 72.67 |
| 内 イギリス | 1,653,695,718 | 4.73 |
| 内 フランス | 1,477,782,066 | 4.23 |
| 内 カナダ | 651,663,461 | 1.87 |
| 内 香港 | 624,067,516 | 1.79 |
| 内 ベルギー | 228,738,600 | 0.65 |
| 内 ニュージーランド | 174,014,738 | 0.50 |
| 内 オランダ | 164,446,881 | 0.47 |
| 内 スペイン | 148,285,962 | 0.42 |
| 内 アイルランド | 78,442,953 | 0.22 |
| 内 ドイツ | 65,427,659 | 0.19 |
| 内 シンガポール | 53,624,640 | 0.15 |
| 内 イタリア | 29,008,990 | 0.08 |
| 内 マン島 | 21,133,295 | 0.06 |
| 内 ガーンジィ | 20,771,430 | 0.06 |
| 内 イスラエル | 15,920,221 | 0.05 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 167,599,111 | 0.48 |
| 純資産総額 | 34,934,280,639 | 100.00 |

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 156,807,892,079 | 98.75 |
| 内 アメリカ | 68,027,496,678 | 42.84 |
| 内 フランス | 15,821,250,716 | 9.96 |
| 内 イタリア | 15,198,073,980 | 9.57 |
| 内 イギリス | 12,280,363,482 | 7.73 |
| 内 ドイツ | 11,779,114,315 | 7.42 |
| 内 スペイン | 8,661,798,118 | 5.45 |
| 内 ベルギー | 4,026,345,363 | 2.54 |
| 内 オランダ | 3,797,466,703 | 2.39 |
| 内 カナダ | 3,183,000,133 | 2.00 |
| 内 オーストラリア | 3,100,137,203 | 1.95 |
| 内 オーストリア | 2,396,302,923 | 1.51 |
| 内 メキシコ | 1,343,105,584 | 0.85 |
| 内 アイルランド | 1,209,545,834 | 0.76 |
| 内 デンマーク | 1,079,510,706 | 0.68 |
| 内 フィンランド | 918,750,758 | 0.58 |
| 内 ポーランド | 905,822,466 | 0.57 |
| 内 スウェーデン | 760,633,289 | 0.48 |
| 内 南アフリカ | 724,694,731 | 0.46 |
| 内 マレーシア | 674,319,583 | 0.42 |
| 内 シンガポール | 546,708,950 | 0.34 |
| 内 ノルウェー | 373,450,564 | 0.24 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,984,300,837 | 1.25 |
| 純資産総額 | 158,792,192,916 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|-----------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 157,627,481,518 | 99.27 |
| - | 157,627,481,518 | 99.27 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 株式 | 36,214,391,467 | 95.45 |
| 内 韓国 | 5,405,388,625 | 14.25 |
| 内 台湾 | 4,455,404,004 | 11.74 |
| 内 ケイマン諸島 | 3,876,655,333 | 10.22 |
| 内 中国 | 3,718,323,657 | 9.80 |
| 内 インド | 3,093,209,062 | 8.15 |
| 内 ブラジル | 2,690,953,723 | 7.09 |
| 内 南アフリカ | 2,494,633,816 | 6.58 |
| 内 香港 | 1,591,946,926 | 4.20 |
| 内 ロシア | 1,293,905,758 | 3.41 |
| 内 メキシコ | 1,118,224,727 | 2.95 |
| 内 マレーシア | 1,030,385,938 | 2.72 |
| 内 インドネシア | 1,015,769,537 | 2.68 |
| 内 タイ | 842,697,207 | 2.22 |
| 内 フィリピン | 559,589,154 | 1.47 |
| 内 チリ | 438,913,877 | 1.16 |
| 内 トルコ | 423,160,795 | 1.12 |
| 内 ポーランド | 401,418,739 | 1.06 |
| 内 バミューダ | 393,678,221 | 1.04 |
| 内 カタール | 337,424,630 | 0.89 |
| 内 アラブ首長国連邦 | 324,101,245 | 0.85 |
| 内 オランダ | 169,081,472 | 0.45 |
| 内 コロンビア | 160,423,170 | 0.42 |
| 内 ハンガリー | 104,854,577 | 0.28 |
| 内 ギリシャ | 67,518,213 | 0.18 |
| 内 チェコ | 63,757,440 | 0.17 |
| 内 エジプト | 47,059,576 | 0.12 |
| 内 マルタ | 27,327,927 | 0.07 |
| 内 ペルー | 26,999,143 | 0.07 |
| 内 マン島 | 21,246,131 | 0.06 |
| 内 アメリカ | 20,338,844 | 0.05 |
| 投資信託受益証券 | 252,129,109 | 0.66 |
| 内 メキシコ | 252,129,109 | 0.66 |
| 投資証券 | 111,966,643 | 0.30 |
| 内 メキシコ | 49,407,919 | 0.13 |
| 内 南アフリカ | 47,442,559 | 0.13 |
| 内 トルコ | 15,116,165 | 0.04 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,361,201,821 | 3.59 |
| 純資産総額 | 37,939,689,040 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引（買建） | 1,353,938,957 | 3.57 |
| 内 アメリカ | 1,353,938,957 | 3.57 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券 | 52,084,043,044 | 96.60 |
| 内 トルコ | 7,260,409,784 | 13.47 |
| 内 メキシコ | 7,113,570,209 | 13.19 |
| 内 ロシア | 6,587,185,246 | 12.22 |
| 内 インドネシア | 5,608,935,225 | 10.40 |
| 内 ブラジル | 5,150,649,633 | 9.55 |
| 内 フィリピン | 4,433,900,204 | 8.22 |
| 内 コロンビア | 4,084,954,778 | 7.58 |
| 内 ハンガリー | 2,763,978,601 | 5.13 |
| 内 ベルギー | 2,271,172,590 | 4.21 |
| 内 パナマ | 2,000,610,973 | 3.71 |
| 内 南アフリカ | 1,905,828,415 | 3.53 |
| 内 クロアチア | 1,569,217,493 | 2.91 |
| 内 ルーマニア | 1,333,629,893 | 2.47 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,831,918,503 | 3.40 |
| 純資産総額 | 53,915,961,547 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|------------------------------------|-----------|------------|----------------------|----------------------|--------------|----------|
| 1 | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 48,744,051 | 1.3635 66,463,528 | 1.3868 67,598,249 | - - | 29.22% |
| 2 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 44,635,097 | 1.3100 58,473,730 | 1.3139 58,646,053 | - - | 25.35% |
| 3 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 16,888,818 | 1.7081 28,848,865 | 1.7168 28,994,722 | - - | 12.53% |
| 4 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 4,662,763 | 1.8809 8,770,484 | 1.9372 9,032,704 | - - | 3.90% |
| 5 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 7,773,966 | 1.1026 8,572,152 | 1.1487 8,929,954 | - - | 3.86% |
| 6 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 7,733,708 | 0.8191 6,335,451 | 0.8706 6,732,966 | - - | 2.91% |
| 7 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 2,622,904 | 2.4993 6,555,678 | 2.5595 6,713,322 | - - | 2.90% |
| 8 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 2,485,703 | 1.7886 4,446,028 | 1.8181 4,519,256 | - - | 1.95% |

(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7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 82.62% |
| 合計 | 82.62% |

(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7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|-----------------------------|--------------|------------|----------------------------|----------------------------|--------------|----------|
| 1 | トヨタ自動車 日本 | 株式 輸送用機器 | 1,761,400 | 6,486.54 11,425,399,245 | 5,894.00 10,381,691,600 | - - | 3.67% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本 | 株式 銀行業 | 11,214,900 | 534.86 5,998,455,918 | 522.00 5,854,177,800 | - - | 2.07% |
| 3 | 日本電信電話 日本 | 株式 情報・通信業 | 1,080,500 | 5,282.81 5,708,076,661 | 4,881.00 5,273,920,500 | - - | 1.86% |
| 4 | ソフトバンクグループ 日本 | 株式 情報・通信業 | 792,000 | 5,150.50 4,079,197,434 | 5,703.00 4,516,776,000 | - - | 1.60% |
| 5 | KDDI 日本 | 株式 情報・通信業 | 1,382,800 | 3,195.64 4,418,936,889 | 3,145.00 4,348,906,000 | - - | 1.54% |
| 6 | 三井住友フィナンシャルグ ループ 日本 | 株式 銀行業 | 1,119,200 | 3,397.39 3,802,363,731 | 3,308.00 3,702,313,600 | - - | 1.31% |
| 7 | 本田技研工業 日本 | 株式 輸送用機器 | 1,274,500 | 3,106.46 3,959,193,600 | 2,841.50 3,621,491,750 | - - | 1.28% |
| 8 | 日本たばこ産業 日本 | 株式 食料品 | 879,400 | 4,635.41 4,076,388,197 | 4,025.00 3,539,585,000 | - - | 1.25% |
| 9 | みずほフィナンシャルグル ープ 日本 | 株式 銀行業 | 19,881,200 | 180.16 3,581,862,284 | 167.10 3,322,148,520 | - - | 1.17% |
| 10 | ソニー 日本 | 株式 電気機器 | 999,400 | 2,584.05 2,582,507,576 | 3,282.00 3,280,030,800 | - - | 1.16% |
| 11 | NTTドコモ 日本 | 株式 情報・通信業 | 1,044,500 | 2,834.82 2,960,978,696 | 2,749.50 2,871,852,750 | - - | 1.01% |
| 12 | アステラス製薬 日本 | 株式 医薬品 | 1,609,900 | 1,658.53 2,670,073,678 | 1,721.50 2,771,442,850 | - - | 0.98% |
| 13 | 武田薬品工業 日本 | 株式 医薬品 | 590,800 | 5,780.65 3,415,209,710 | 4,588.00 2,710,590,400 | - - | 0.96% |
| 14 | セブン&アイ・ホールディ ングス 日本 | 株式 小売業 | 584,700 | 5,108.70 2,987,060,804 | 4,303.00 2,515,964,100 | - - | 0.89% |
| 15 | ファナック 日本 | 株式 電気機器 | 143,600 | 16,400.39 2,355,096,206 | 17,325.00 2,487,870,000 | - - | 0.88% |
| 16 | 東日本旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 258,900 | 10,802.28 2,796,710,396 | 9,485.00 2,455,666,500 | - - | 0.87% |
| 17 | 東海旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 126,800 | 22,228.54 2,818,579,524 | 19,220.00 2,437,096,000 | - - | 0.86% |
| 18 | キーエンス 日本 | 株式 電気機器 | 32,100 | 58,581.30 1,880,459,996 | 72,920.00 2,340,732,000 | - - | 0.83% |
| 19 | 東京海上ホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 566,300 | 3,927.24 2,224,001,260 | 4,040.00 2,287,852,000 | - - | 0.81% |
| 20 | キャノン 日本 | 株式 電気機器 | 762,400 | 3,349.96 2,554,014,116 | 2,935.00 2,237,644,000 | - - | 0.79% |

| | | | | | | | |
|----|--------------|-------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 21 | 花王 日本 | 株式 化学 | 376,700 | 6,189.12 2,331,444,652 | 5,553.00 2,091,815,100 | - - | 0.74% |
| 22 | 三菱地所 日本 | 株式 不動産業 | 1,039,000 | 2,236.36 2,323,583,200 | 1,929.00 2,004,231,000 | - - | 0.71% |
| 23 | 日産自動車 日本 | 株式 輸送用機器 | 1,930,500 | 1,075.90 2,077,026,483 | 1,012.00 1,953,666,000 | - - | 0.69% |
| 24 | 村田製作所 日本 | 株式 電気機器 | 149,400 | 13,863.72 2,071,239,782 | 12,825.00 1,916,055,000 | - - | 0.68% |
| 25 | 信越化学工業 日本 | 株式 化学 | 266,000 | 5,982.11 1,591,241,686 | 7,064.00 1,879,024,000 | - - | 0.66% |
| 26 | 任天堂 日本 | 株式 その他製品 | 87,200 | 17,229.54 1,502,416,552 | 21,505.00 1,875,236,000 | - - | 0.66% |
| 27 | 三菱商事 日本 | 株式 卸売業 | 1,048,800 | 1,871.61 1,962,954,713 | 1,778.50 1,865,290,800 | - - | 0.66% |
| 28 | ダイキン工業 日本 | 株式 機械 | 206,200 | 7,741.00 1,596,195,040 | 9,012.00 1,858,274,400 | - - | 0.66% |
| 29 | 三菱電機 日本 | 株式 電気機器 | 1,511,000 | 1,146.04 1,731,681,480 | 1,217.50 1,839,642,500 | - - | 0.65% |
| 30 | ブリヂストン 日本 | 株式 ゴム製品 | 500,600 | 4,104.80 2,054,863,140 | 3,601.00 1,802,660,600 | - - | 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7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----|--------|
| 株式 | 97.94% |
| 合計 | 97.94% |

(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7月29日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|------------|--------|--------|
| 電気機器 | 国内 | 11.73% |
| 輸送用機器 | | 9.39% |
| 情報・通信業 | | 8.25% |
| 銀行業 | | 7.37% |
| 化学 | | 6.12% |
| 医薬品 | | 5.64% |
| 食料品 | | 4.98% |
| 小売業 | | 4.79% |
| 機械 | | 4.72% |
| 陸運業 | | 4.49% |
| 卸売業 | | 3.98% |
| サービス業 | | 3.78% |
| 建設業 | | 3.25% |
| 不動産業 | | 2.56% |
| 保険業 | | 2.36% |
| 電気・ガス業 | | 1.85% |
| その他製品 | | 1.75% |
| 精密機器 | | 1.48% |
| その他金融業 | | 1.24% |
| 鉄鋼 | | 1.13% |
| 証券、商品先物取引業 | | 0.98% |
| ガラス・土石製品 | | 0.91% |
| 非鉄金属 | | 0.85% |
| ゴム製品 | | 0.85% |
| 繊維製品 | | 0.73% |
| 金属製品 | | 0.65% |
| 空運業 | | 0.58% |
| 石油・石炭製品 | | 0.46% |
| 鉱業 | | 0.28% |
| パルプ・紙 | | 0.26% |
| 海運業 | 0.21% | |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.20% | |
| 水産・農林業 | 0.10% | |
| 合計 | 97.94% | |

(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7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1 | 124回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 101.02 4,546,125,000 | 101.41 4,563,495,000 | 0.100000 2020/6/20 | 1.17% |
| 2 | 122回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 100.94 4,542,525,000 | 101.22 4,555,260,000 | 0.100000 2019/12/20 | 1.17% |
| 3 | 106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 | 100.53 4,524,030,000 | 0.200000 2017/9/20 | 1.16% |
| 4 | 116回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,200,000,000 | 101.02 4,243,092,000 | 101.11 4,246,830,000 | 0.200000 2018/12/20 | 1.09% |
| 5 | 340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 | 105.73 4,229,200,000 | 0.400000 2025/9/20 | 1.09% |
| 6 | 342回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 102.02 4,081,115,000 | 102.89 4,115,800,000 | 0.100000 2026/3/20 | 1.06% |
| 7 | 125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 | 101.48 4,059,320,000 | 0.100000 2020/9/20 | 1.04% |
| 8 | 117回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 101.10 4,044,000,000 | 101.23 4,049,240,000 | 0.200000 2019/3/20 | 1.04% |
| 9 | 343回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 103.36 3,617,600,000 | 102.81 3,598,595,000 | 0.100000 2026/6/20 | 0.93% |
| 10 | 118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 | 101.35 3,547,250,000 | 0.200000 2019/6/20 | 0.91% |
| 11 | 123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 | 101.31 3,546,165,000 | 0.100000 2020/3/20 | 0.91% |
| 12 | 114回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 101.19 3,541,825,000 | 101.21 3,542,420,000 | 0.300000 2018/9/20 | 0.91% |
| 13 | 107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 | 100.65 3,321,516,000 | 0.200000 2017/12/20 | 0.85% |
| 14 | 289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 | 102.45 3,278,400,000 | 1.500000 2017/12/20 | 0.84% |
| 15 | 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 | 101.57 3,250,336,000 | 0.100000 2020/12/20 | 0.84% |

| | | | | | | | | |
|----|------------------|----|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------|
| 16 | 313回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 107.26 3,217,920,000 | 107.26 3,217,800,000 | 1.300000 2021/3/20 | 0.83% |
| 17 | 339回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 103.25 3,097,560,000 | 105.71 3,171,360,000 | 0.400000 2025/6/20 | 0.82% |
| 18 | 341回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 103.34 3,100,200,000 | 104.83 3,144,930,000 | 0.300000 2025/12/20 | 0.81% |
| 19 | 127回 利付国庫債券(5年) | 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 101.57 3,047,255,000 | 101.66 3,049,890,000 | 0.100000 2021/3/20 | 0.79% |
| 20 | 301回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 2,900,000,000 | 105.55 3,060,979,000 | 105.09 3,047,755,000 | 1.500000 2019/6/20 | 0.78% |
| 21 | 310回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 2,800,000,000 | 105.16 2,944,704,000 | 105.22 2,946,188,000 | 1.000000 2020/9/20 | 0.76% |
| 22 | 325回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 106.22 2,655,660,000 | 106.67 2,666,850,000 | 0.800000 2022/9/20 | 0.69% |
| 23 | 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 | 125.56 2,636,844,000 | 1.600000 2033/3/20 | 0.68% |
| 24 | 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 | 105.30 2,632,675,000 | 1.300000 2019/12/20 | 0.68% |
| 25 | 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 | 124.70 2,618,784,000 | 1.500000 2034/6/20 | 0.67% |
| 26 | 365回 利付国庫債券(2年) | 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 100.84 2,521,025,000 | 100.67 2,516,875,000 | 0.100000 2018/6/15 | 0.65% |
| 27 | 334回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 2,300,000,000 | 105.26 2,421,080,000 | 106.96 2,460,149,000 | 0.600000 2024/6/20 | 0.63% |
| 28 | 141回 利付国庫債券(20年) | 日本 | 国債証券 | 1,900,000,000 | 117.81 2,238,435,000 | 126.91 2,411,404,000 | 1.700000 2032/12/20 | 0.62% |
| 29 | 297回 利付国庫債券(10年) | 日本 | 国債証券 | 2,300,000,000 | 104.41 2,401,614,000 | 103.95 2,390,988,000 | 1.400000 2018/12/20 | 0.62% |
| 30 | 125回 利付国庫債券(20年) | 日本 | 国債証券 | 1,800,000,000 | 125.51 2,259,324,000 | 132.37 2,382,822,000 | 2.200000 2031/3/20 | 0.61% |

(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7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-------|--------|
| 国債証券 | 82.90% |
| 地方債証券 | 6.36% |
| 特殊債券 | 5.48% |
| 社債券 | 4.82% |
| 合計 | 99.57% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--------------------------|------|-------|-----------------------------|-----------------------------|--------------|----------|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 2,902 | 651,478.08 1,890,589,401 | 630,000.00 1,828,260,000 | - - | 7.47% |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 日本 | 投資証券 | 2,691 | 638,118.30 1,717,176,360 | 619,000.00 1,665,729,000 | - - | 6.81% |
| 3 | 日本リテールファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 5,245 | 258,789.58 1,357,351,385 | 252,000.00 1,321,740,000 | - - | 5.40% |
| 4 | 野村不動産マスターファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 7,649 | 171,730.93 1,313,569,903 | 169,700.00 1,298,035,300 | - - | 5.31% |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 日本 | 投資証券 | 6,069 | 180,254.20 1,093,962,748 | 191,300.00 1,160,999,700 | - - | 4.74% |
| 6 | 日本プロロジスリート投資法人 日本 | 投資証券 | 3,785 | 240,395.35 909,896,408 | 254,700.00 964,039,500 | - - | 3.94% |
| 7 | オリックス不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 4,976 | 179,761.39 894,492,717 | 188,500.00 937,976,000 | - - | 3.83% |
| 8 | 日本プライムリアルティ投資法人 日本 | 投資証券 | 1,794 | 454,678.24 815,692,763 | 450,500.00 808,197,000 | - - | 3.30% |
| 9 | アドバンス・レジデンス投資法人 日本 | 投資証券 | 2,672 | 286,579.49 765,740,411 | 284,600.00 760,451,200 | - - | 3.11% |
| 10 | GLP投資法人 日本 | 投資証券 | 5,330 | 126,224.76 672,778,005 | 130,200.00 693,966,000 | - - | 2.84% |
| 11 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 7,707 | 94,270.37 726,541,802 | 86,200.00 664,343,400 | - - | 2.72% |
| 12 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本 | 投資証券 | 1,232 | 568,389.64 700,256,040 | 535,000.00 659,120,000 | - - | 2.69% |
| 13 | 大和証券オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 995 | 653,892.36 650,622,904 | 611,000.00 607,945,000 | - - | 2.48% |
| 14 | 森ヒルズリート投資法人 日本 | 投資証券 | 3,598 | 164,583.12 592,170,098 | 160,500.00 577,479,000 | - - | 2.36% |
| 15 | フロンティア不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 1,019 | 529,193.03 539,247,706 | 548,000.00 558,412,000 | - - | 2.28% |
| 16 | ケネディクス・オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 832 | 638,283.33 531,051,733 | 640,000.00 532,480,000 | - - | 2.18% |
| 17 | インヴィンシブル投資法人 日本 | 投資証券 | 7,554 | 75,233.18 568,311,479 | 69,000.00 521,226,000 | - - | 2.13% |
| 18 | 森トラスト総合リート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,713 | 204,332.68 554,354,569 | 189,700.00 514,656,100 | - - | 2.10% |

| | | | | | | | |
|----|--------------------------|------|-------|---------------------------|---------------------------|--------|-------|
| 19 | 日本アコモデーションファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 996 | 457,658.79 455,828,160 | 468,000.00 466,128,000 | - - | 1.91% |
| 20 | 大和ハウスリート投資法人 日本 | 投資証券 | 721 | 594,324.11 428,507,684 | 628,000.00 452,788,000 | - - | 1.85% |
| 21 | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本 | 投資証券 | 1,537 | 275,068.78 422,780,728 | 287,600.00 442,041,200 | - - | 1.81% |
| 22 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 1,808 | 245,757.95 444,330,375 | 239,500.00 433,016,000 | - - | 1.77% |
| 23 | 産業ファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 725 | 569,474.19 412,868,793 | 589,000.00 427,025,000 | - - | 1.75% |
| 24 | ジャパンエクセレント投資法人 日本 | 投資証券 | 2,676 | 149,814.62 400,903,940 | 145,000.00 388,020,000 | - - | 1.59% |
| 25 | プレミア投資法人 日本 | 投資証券 | 2,707 | 141,102.60 381,964,764 | 140,100.00 379,250,700 | - - | 1.55% |
| 26 | ヒューリックリート投資法人 日本 | 投資証券 | 1,967 | 187,860.30 369,521,221 | 181,200.00 356,420,400 | - - | 1.46% |
| 27 | イオンリート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,691 | 136,920.27 368,452,472 | 129,500.00 348,484,500 | - - | 1.42% |
| 28 | 福岡リート投資法人 日本 | 投資証券 | 1,535 | 205,206.04 314,991,277 | 212,000.00 325,420,000 | - - | 1.33% |
| 29 | 日本賃貸住宅投資法人 日本 | 投資証券 | 3,370 | 84,573.94 285,014,196 | 87,700.00 295,549,000 | - - | 1.21% |
| 30 | 東急リアル・エステート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,009 | 152,972.09 307,320,940 | 146,200.00 293,715,800 | - - | 1.20% |

(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7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 投資証券 | 99.15% |
| 合計 | 99.15% |

(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7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|---------|----------------------------|----------------------------|--------------|----------|
| 1 | APPLE INC アメリカ | 株式 コンピュータ・周辺機器 | 451,881 | 9,821.62 4,438,205,508 | 10,895.18 4,923,326,098 | - - | 1.90% |
| 2 | MICROSOFT CORP アメリカ | 株式 ソフトウェア | 612,102 | 5,275.61 3,229,216,344 | 5,869.44 3,592,700,982 | - - | 1.38% |
| 3 | EXXON MOBIL CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 338,336 | 8,511.88 2,879,877,928 | 9,418.68 3,186,679,869 | - - | 1.23% |
| 4 | JOHNSON & JOHNSON アメリカ | 株式 医薬品 | 224,831 | 10,701.59 2,406,051,031 | 12,996.11 2,921,929,126 | - - | 1.12% |
| 5 | AMAZON.COM INC アメリカ | 株式 インターネット 販売・カタ ログ販売 | 32,610 | 53,792.62 1,754,177,662 | 78,587.53 2,562,739,555 | - - | 0.99% |
| 6 | GENERAL ELECTRIC CO アメリカ | 株式 コングロマ リット | 759,940 | 2,962.01 2,250,950,848 | 3,263.12 2,479,779,212 | - - | 0.95% |
| 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 | 187,037 | 10,762.75 2,013,032,555 | 13,052.49 2,441,300,442 | - - | 0.94% |
| 8 | AT&T INC アメリカ | 株式 各種電気通信 サービス | 500,479 | 3,826.90 1,915,283,777 | 4,446.20 2,225,231,531 | - - | 0.86% |
| 9 | NESTLE SA-REGISTERED スイス | 株式 食品 | 259,635 | 7,679.49 1,993,866,245 | 8,231.83 2,137,272,739 | - - | 0.82% |
| 10 | JPMORGAN CHASE & CO アメリカ | 株式 商業銀行 | 298,701 | 6,019.21 1,797,946,284 | 6,693.32 1,999,301,974 | - - | 0.77% |
| 11 | ALPHABET INC-CL C アメリカ | 株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス | 25,346 | 71,369.06 1,808,920,323 | 77,887.92 1,974,147,276 | - - | 0.76% |
| 12 | WELLS FARGO & CO アメリカ | 株式 商業銀行 | 392,807 | 4,936.21 1,938,979,107 | 5,025.73 1,974,143,731 | - - | 0.76% |
| 13 | PROCTER & GAMBLE CO アメリカ | 株式 家庭用品 | 220,116 | 8,472.08 1,864,840,792 | 8,855.86 1,949,316,523 | - - | 0.75% |
| 14 | PFIZER INC アメリカ | 株式 医薬品 | 503,036 | 3,088.61 1,553,685,860 | 3,829.08 1,926,165,791 | - - | 0.74% |
| 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 | 23,841 | 73,886.71 1,761,533,291 | 79,969.01 1,906,541,234 | - - | 0.73% |
| 16 | VERIZON COMM INC アメリカ | 株式 各種電気通信 サービス | 331,408 | 5,253.10 1,740,922,599 | 5,728.48 1,898,464,497 | - - | 0.73% |

| | | | | | | | |
|----|---|-----------------------|---------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 17 | CHEVRON CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 153,421 | 9,006.19 1,381,738,987 | 10,628.91 1,630,698,277 | - - | 0.63% |
| 18 | NOVARTIS AG-REG SHS スイス | 株式 医薬品 | 185,580 | 7,619.75 1,414,073,974 | 8,562.38 1,589,008,150 | - - | 0.61% |
| 19 | COCA-COLA CO/THE アメリカ | 株式 飲料 | 334,562 | 4,507.19 1,507,936,522 | 4,557.93 1,524,911,180 | - - | 0.59% |
| 20 | ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス | 株式 医薬品 | 57,289 | 26,080.80 1,494,142,977 | 26,177.66 1,499,692,250 | - - | 0.58% |
| 21 | HOME DEPOT INC アメリカ | 株式 専門小売り | 103,213 | 12,251.37 1,264,501,010 | 14,405.78 1,486,864,101 | - - | 0.57% |
| 22 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ | 株式 各種金融サー ビス | 97,101 | 13,454.74 1,306,469,672 | 15,080.33 1,464,315,744 | - - | 0.56% |
| 23 | COMCAST CORP-CL A アメリカ | 株式 メディア | 198,378 | 5,957.75 1,181,887,827 | 7,085.94 1,405,694,843 | - - | 0.54% |
| 24 | INTEL CORP アメリカ | 株式 半導体・半導 体製造装置 | 385,003 | 3,011.90 1,159,591,866 | 3,630.68 1,397,824,001 | - - | 0.54% |
| 25 | MERCK & CO. INC. アメリカ | 株式 医薬品 | 226,173 | 5,152.35 1,165,322,988 | 6,101.26 1,379,940,413 | - - | 0.53% |
| 26 | PEPSICO INC アメリカ | 株式 飲料 | 117,564 | 10,309.65 1,212,044,488 | 11,290.93 1,327,407,435 | - - | 0.51% |
| 27 | CISCO SYSTEMS INC アメリカ | 株式 通信機器 | 410,147 | 2,633.15 1,079,981,609 | 3,186.89 1,307,096,818 | - - | 0.50% |
| 28 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ | 株式 タバコ | 125,945 | 9,340.03 1,176,331,051 | 10,348.02 1,303,281,630 | - - | 0.50% |
| 29 | VISA INC アメリカ | 株式 情報技術サー ビス | 156,281 | 7,365.73 1,151,124,634 | 8,269.01 1,292,290,683 | - - | 0.50% |
| 30 | BANK OF AMERICA CORP アメリカ | 株式 商業銀行 | 840,771 | 1,250.85 1,051,685,208 | 1,532.88 1,288,805,758 | - - | 0.50% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 株式 | 96.13% |
| 投資信託受益証券 | 0.35% |
| 投資証券 | 2.51% |
| 合計 | 98.99% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年7月29日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|-------------------------|-------|-------|
| 商業銀行 | 外国 | 7.90% |
| 医薬品 | | 6.75% |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 6.29% |
| 保険 | | 3.87% |
| ソフトウェア | | 3.34% |
| 各種電気通信サービス | | 2.90% |
| インターネットソフトウェア・サービス | | 2.87% |
| メディア | | 2.78% |
| 情報技術サービス | | 2.66% |
| 化学 | | 2.57% |
| バイオテクノロジー | | 2.53% |
| 飲料 | | 2.45% |
| 食品 | | 2.44% |
| コンピュータ・周辺機器 | | 2.39% |
| 半導体・半導体製造装置 | | 2.34% |
| 食品・生活必需品小売り | | 2.10% |
| 航空宇宙・防衛 | | 2.07% |
| ヘルスケア機器・用品 | | 2.03% |
| 電力 | | 1.99% |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | | 1.98% |
| 専門小売り | | 1.96% |
| コングロマリット | | 1.94% |
| 資本市場 | | 1.84% |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 1.83% |
| タバコ | | 1.64% |
| 家庭用品 | | 1.57% |
| 各種金融サービス | | 1.48% |
| インターネット販売・カタログ販売 | | 1.45% |
| 金属・鉱業 | | 1.44% |
| 機械 | | 1.36% |
| 総合公益事業 | | 1.21% |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 1.19% |
| 自動車 | | 0.95% |
| 通信機器 | | 0.85% |
| 陸運・鉄道 | | 0.85% |
| 電気設備 | | 0.74% |
| パーソナル用品 | | 0.71% |
| エネルギー設備・サービス | | 0.71% |
| 航空貨物・物流サービス | | 0.59% |
| 不動産管理・開発 | | 0.58% |
| 自動車部品 | | 0.54% |
| 消費者金融 | | 0.50% |
| 複合小売り | | 0.49% |
| ライフサイエンス・ツール/サービス | | 0.49% |
| 専門サービス | | 0.47% |
| 家庭用耐久財 | | 0.46% |
| 商業サービス・用品 | | 0.46% |

| | |
|--------------------|--------|
| 無線通信サービス | 0.39% |
| 電子装置・機器・部品 | 0.39% |
| 建設資材 | 0.35% |
| 建設・土木 | 0.33% |
| 商社・流通業 | 0.31% |
| 容器・包装 | 0.30% |
| 建設関連製品 | 0.28% |
| 運送インフラ | 0.24% |
| ガス | 0.23% |
| 旅客航空輸送業 | 0.13% |
| 水道 | 0.10% |
| 販売 | 0.10% |
| レジャー用品 | 0.09% |
| 紙製品・林産品 | 0.08% |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.08% |
| 海運業 | 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 | 0.02% |
| 各種消費者サービス | 0.02% |
| 合計 | 96.13% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--|--------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------------|----------|
| 1 | SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ | 投資証券 | 89,960 | 21,934.07 1,973,189,675 | 23,397.38 2,104,829,150 | - - | 6.03% |
| 2 | PUBLIC STORAGE アメリカ | 投資証券 | 42,860 | 25,451.39 1,090,846,999 | 24,916.70 1,067,929,779 | - - | 3.06% |
| 3 | PROLOGIS INC アメリカ | 投資証券 | 152,500 | 5,207.62 794,162,086 | 5,600.04 854,006,801 | - - | 2.44% |
| 4 | WELLTOWER INC アメリカ | 投資証券 | 103,630 | 7,712.44 799,240,259 | 8,183.39 848,045,265 | - - | 2.43% |
| 5 | UNIBAIL-RODAMCO SE フランス | 投資証券 | 28,520 | 27,612.92 787,520,562 | 28,003.70 798,665,723 | - - | 2.29% |
| 6 | VENTAS INC アメリカ | 投資証券 | 98,160 | 7,352.98 721,768,991 | 7,781.37 763,820,103 | - - | 2.19% |
| 7 | AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ | 投資証券 | 39,820 | 18,395.26 732,499,302 | 19,033.67 757,921,042 | - - | 2.17% |
| 8 | EQUITY RESIDENTIAL アメリカ | 投資証券 | 106,100 | 6,948.62 737,248,861 | 6,980.47 740,628,609 | - - | 2.12% |
| 9 | SCENTRE GROUP オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 1,546,635 | 374.40 579,067,406 | 421.86 652,474,576 | - - | 1.87% |
| 10 | BOSTON PROPERTIES INC アメリカ | 投資証券 | 44,600 | 13,402.17 597,737,133 | 14,560.32 649,390,486 | - - | 1.86% |
| 11 | VORNADO REALTY TRUST アメリカ | 投資証券 | 51,530 | 10,216.27 526,444,583 | 11,017.35 567,724,261 | - - | 1.63% |
| 12 | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ | 投資証券 | 169,260 | 3,022.10 511,522,119 | 3,305.93 559,562,930 | - - | 1.60% |
| 13 | HCP INC アメリカ | 投資証券 | 135,640 | 3,664.06 496,994,000 | 4,074.46 552,660,893 | - - | 1.58% |
| 14 | REALTY INCOME CORP アメリカ | 投資証券 | 74,810 | 6,821.48 510,315,554 | 7,380.40 552,128,142 | - - | 1.58% |
| 15 | LINK REIT 香港 | 投資証券 | 652,023 | 686.03 447,311,762 | 784.71 511,654,184 | - - | 1.46% |
| 16 | DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ | 投資証券 | 42,640 | 10,966.29 467,602,922 | 11,244.98 479,486,365 | - - | 1.37% |
| 17 | WESTFIELD CORP オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 555,516 | 844.06 468,889,616 | 838.23 465,653,065 | - - | 1.33% |
| 18 | ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ | 投資証券 | 19,010 | 23,126.01 439,625,480 | 23,034.00 437,876,488 | - - | 1.25% |
| 19 | KIMCO REALTY アメリカ | 投資証券 | 121,890 | 3,127.14 381,167,476 | 3,323.68 405,124,403 | - - | 1.16% |
| 20 | HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ | 投資証券 | 217,090 | 1,729.94 375,553,240 | 1,804.37 391,712,333 | - - | 1.12% |
| 21 | FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ | 投資証券 | 20,600 | 16,568.16 341,304,198 | 17,616.69 362,903,982 | - - | 1.04% |
| 22 | SL GREEN アメリカ | 投資証券 | 29,130 | 10,688.63 311,360,033 | 12,144.04 353,756,059 | - - | 1.01% |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------------------|--------------|---------|-------------------------|-------------------------|--------|-------|
| 23 | LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス | 投資証券 | 232,960 | 1,581.07 368,326,534 | 1,497.70 348,904,588 | - - | 1.00% |
| 24 | THE MACERICH COMPANY アメリカ | 投資証券 | 36,670 | 8,587.98 314,921,518 | 9,305.91 341,247,734 | - - | 0.98% |
| 25 | EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ | 投資証券 | 36,380 | 9,207.26 334,960,424 | 8,978.03 326,620,789 | - - | 0.93% |
| 26 | IRON MOUNTAIN INC アメリカ | 投資証券 | 69,460 | 4,021.61 279,341,104 | 4,306.28 299,114,264 | - - | 0.86% |
| 27 | UDR INC アメリカ | 投資証券 | 77,630 | 3,706.24 287,715,462 | 3,817.59 296,359,915 | - - | 0.85% |
| 28 | VEREIT INC アメリカ | 投資証券 | 262,950 | 1,033.83 271,847,184 | 1,125.64 295,989,036 | - - | 0.85% |
| 29 | DUKE REALTY TRUST アメリカ | 投資証券 | 100,540 | 2,694.07 270,862,061 | 2,940.46 295,634,572 | - - | 0.85% |
| 30 | STOCKLAND オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 691,897 | 370.52 256,364,815 | 395.94 273,951,358 | - - | 0.78% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 投資信託受益証券 | 11.37% |
| 投資証券 | 88.15% |
| 合計 | 99.52% |

(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

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|---------------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1 | US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ | 国債証券 | 2,036,190,000 | 103.64 2,110,307,316 | 103.96 2,116,986,019 | 2.000000 2020/7/31 | 1.33% |
| 2 | US T N/B 1.0 09/15/18 アメリカ | 国債証券 | 2,015,306,000 | 100.62 2,027,903,124 | 100.55 2,026,390,183 | 1.000000 2018/9/15 | 1.28% |
| 3 | US T N/B 0.625 08/31/17 アメリカ | 国債証券 | 1,983,980,000 | 99.98 1,983,583,204 | 100.00 1,984,039,519 | 0.625000 2017/8/31 | 1.25% |
| 4 | US T N/B 1.25 10/31/18 アメリカ | 国債証券 | 1,409,670,000 | 101.03 1,424,203,697 | 101.11 1,425,416,013 | 1.250000 2018/10/31 | 0.90% |
| 5 | US T N/B 0.75 03/31/18 アメリカ | 国債証券 | 1,420,112,000 | 99.99 1,419,998,391 | 100.06 1,421,106,078 | 0.750000 2018/3/31 | 0.89% |
| 6 | US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ | 国債証券 | 1,247,819,000 | 105.70 1,318,944,735 | 105.70 1,319,069,464 | 2.375000 2020/12/31 | 0.83% |
| 7 | US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ | 国債証券 | 1,179,946,000 | 103.24 1,218,239,737 | 103.19 1,217,598,076 | 2.375000 2018/6/30 | 0.77% |
| 8 | US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ | 国債証券 | 1,044,200,000 | 103.85 1,084,406,921 | 104.39 1,090,123,916 | 2.000000 2023/2/15 | 0.69% |
| 9 | US T N/B 0.875 05/31/18 アメリカ | 国債証券 | 1,044,200,000 | 100.60 1,050,527,852 | 100.30 1,047,332,600 | 0.875000 2018/5/31 | 0.66% |
| 10 | US T N/B 0.875 06/15/19 アメリカ | 国債証券 | 1,044,200,000 | 100.41 1,048,528,209 | 100.16 1,045,870,720 | 0.875000 2019/6/15 | 0.66% |
| 11 | US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ | 国債証券 | 1,044,200,000 | 99.86 1,042,811,214 | 99.91 1,043,260,220 | 0.500000 2017/7/31 | 0.66% |
| 12 | US T N/B 8.125 08/15/19 アメリカ | 国債証券 | 835,360,000 | 122.46 1,022,981,856 | 121.92 1,018,546,094 | 8.125000 2019/8/15 | 0.64% |
| 13 | US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ | 国債証券 | 979,459,600 | 101.14 990,703,796 | 102.05 999,577,700 | 1.625000 2022/11/15 | 0.63% |
| 14 | US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ | 国債証券 | 981,548,000 | 100.10 982,539,363 | 100.37 985,228,805 | 1.000000 2019/11/30 | 0.62% |
| 15 | US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ | 国債証券 | 903,233,000 | 106.17 959,007,637 | 106.45 961,554,754 | 2.625000 2020/8/15 | 0.61% |
| 16 | US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ | 国債証券 | 939,780,000 | 101.00 949,177,800 | 101.25 951,527,250 | 1.250000 2019/10/31 | 0.60% |
| 17 | US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ | 国債証券 | 939,780,000 | 100.03 940,108,923 | 100.10 940,766,769 | 0.750000 2017/12/31 | 0.59% |
| 18 | US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ | 国債証券 | 835,360,000 | 109.42 914,126,094 | 109.50 914,719,200 | 3.625000 2020/2/15 | 0.58% |
| 19 | US T N/B 3.625 08/15/19 アメリカ | 国債証券 | 835,360,000 | 108.42 905,705,665 | 108.40 905,546,947 | 3.625000 2019/8/15 | 0.57% |
| 20 | US T N/B 1.5 02/28/19 アメリカ | 国債証券 | 887,570,000 | 101.70 902,685,317 | 101.85 903,998,920 | 1.500000 2019/2/28 | 0.57% |
| 21 | US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ | 国債証券 | 825,962,200 | 109.28 902,652,790 | 109.42 903,842,175 | 3.500000 2020/5/15 | 0.57% |
| 22 | US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ | 国債証券 | 824,918,000 | 103.85 856,751,585 | 105.35 869,059,362 | 2.125000 2025/5/15 | 0.55% |
| 23 | US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ | 国債証券 | 835,360,000 | 101.45 847,482,117 | 101.37 846,846,200 | 1.375000 2021/1/31 | 0.53% |

| | | | | | | | |
|----|---------------------------------|------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|-------|
| 24 | US T N/B 1.125 03/31/20 アメリカ | 国債証券 | 835,360,000 | 100.35 838,325,528 | 100.71 841,291,056 | 1.125000 2020/3/31 | 0.53% |
| 25 | US T N/B 2.125 08/31/20 アメリカ | 国債証券 | 801,945,600 | 104.12 835,025,856 | 104.46 837,776,529 | 2.125000 2020/8/31 | 0.53% |
| 26 | US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ | 国債証券 | 783,150,000 | 102.71 804,436,017 | 104.31 816,919,428 | 2.000000 2025/8/15 | 0.51% |
| 27 | US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ | 国債証券 | 793,592,000 | 101.99 809,400,352 | 102.84 816,153,820 | 1.750000 2022/9/30 | 0.51% |
| 28 | US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ | 国債証券 | 741,382,000 | 108.79 806,593,960 | 109.78 813,896,573 | 2.750000 2023/11/15 | 0.51% |
| 29 | US T N/B 1.25 11/30/18 アメリカ | 国債証券 | 793,592,000 | 101.03 801,805,677 | 101.15 802,734,179 | 1.250000 2018/11/30 | 0.51% |
| 30 | ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア | 国債証券 | 738,205,940 | 107.24 791,696,342 | 106.89 789,120,003 | 4.500000 2018/2/1 | 0.50% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 98.75% |
| 合計 | 98.75% |

(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7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|---|------------------------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|--------------|----------|
| 1 | 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 | 503,800 | 2,236.18 1,126,591,510 | 2,543.94 1,281,636,972 | - - | 3.38% |
| 2 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国 | 株式 コンピュータ・周辺機器 | 9,061 | 121,480.88 1,100,738,289 | 140,301.69 1,271,273,703 | - - | 3.35% |
| 3 | TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾 | 株式 半導体・半導 体製造装置 | 2,197,083 | 520.84 1,144,334,965 | 575.38 1,264,179,587 | - - | 3.33% |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネット ソフトウェア・サービス | 88,400 | 8,398.08 742,390,279 | 8,679.39 767,258,111 | - - | 2.02% |
| 5 | CHINA MOBILE LIMITED 香港 | 株式 無線通信サー ビス | 548,000 | 1,208.92 662,492,915 | 1,313.02 719,536,604 | - - | 1.90% |
| 6 | NASPERS LTD 南アフリカ | 株式 メディア | 39,052 | 15,897.44 620,827,114 | 16,554.04 646,468,502 | - - | 1.70% |
| 7 | CHINA CONSTRUCTION BANK 中国 | 株式 商業銀行 | 7,506,530 | 68.22 512,152,952 | 70.93 532,469,700 | - - | 1.40% |
| 8 | BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネット ソフトウェア・サービス | 24,200 | 19,332.78 467,853,496 | 17,295.08 418,541,047 | - - | 1.10% |
| 9 | IND & COMM BK OF CHINA - H 中国 | 株式 商業銀行 | 6,582,235 | 58.42 384,567,853 | 59.62 392,484,192 | - - | 1.03% |
| 10 | HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾 | 株式 電子装置・機 器・部品 | 1,255,120 | 269.92 338,791,043 | 290.13 364,160,516 | - - | 0.96% |
| 11 | BANK OF CHINA LTD 中国 | 株式 商業銀行 | 7,098,200 | 43.50 308,781,582 | 43.34 307,644,505 | - - | 0.81% |
| 12 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド | 株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融 | 134,064 | 1,750.05 234,619,548 | 2,187.35 293,245,426 | - - | 0.77% |
| 13 | INFOSYS LTD インド | 株式 情報技術サー ビス | 164,374 | 1,832.14 301,157,566 | 1,680.89 276,296,256 | - - | 0.73% |
| 14 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル | 株式 商業銀行 | 257,808 | 1,042.17 268,680,602 | 1,051.14 270,992,919 | - - | 0.71% |
| 15 | AMBEV SA ブラジル | 株式 飲料 | 420,995 | 602.30 253,569,138 | 615.85 259,273,643 | - - | 0.68% |

| | | | | | | | |
|----|--|------------------------------|-----------|---------------------------|---------------------------|--------|-------|
| 16 | GAZPROM PAO ADR ロシア | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 539,379 | 458.72 247,428,106 | 429.68 231,764,845 | - - | 0.61% |
| 17 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国 | 株式 保険 | 466,500 | 506.76 236,406,005 | 496.67 231,698,421 | - - | 0.61% |
| 18 | SBERBANK ADR ロシア | 株式 商業銀行 | 246,884 | 792.67 195,699,653 | 891.74 220,158,016 | - - | 0.58% |
| 19 | BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル | 株式 商業銀行 | 249,015 | 830.40 206,782,752 | 871.20 216,941,868 | - - | 0.57% |
| 20 | CNOOC LTD 香港 | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 1,586,000 | 130.91 207,632,384 | 128.67 204,082,673 | - - | 0.54% |
| 21 | SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国 | 株式 コンピュー タ・周辺機器 | 1,637 | 100,341.00 164,258,229 | 114,699.19 187,762,590 | - - | 0.49% |
| 22 | RELIANCE INDUSTRIES LTD インド | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 116,614 | 1,656.67 193,191,810 | 1,601.10 186,711,375 | - - | 0.49% |
| 23 | LUKOIL SPON ADR ロシア | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 39,101 | 4,397.02 171,928,216 | 4,483.27 175,300,445 | - - | 0.46% |
| 24 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国 | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 2,293,200 | 71.58 164,168,013 | 76.31 175,012,896 | - - | 0.46% |
| 25 | TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド | 株式 情報技術サー ビス | 42,296 | 3,934.89 166,430,330 | 4,086.02 172,822,724 | - - | 0.46% |
| 26 | AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ | 株式 無線通信サー ビス | 2,807,678 | 74.26 208,515,276 | 60.99 171,257,127 | - - | 0.45% |
| 27 | STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV オランダ | 株式 家庭用耐久財 | 259,114 | 656.52 170,113,914 | 652.53 169,081,472 | - - | 0.45% |
| 28 | NAVER CORP 韓国 | 株式 インターネッ トソフトウェア・サービス | 2,510 | 62,888.49 157,850,121 | 66,101.00 165,913,510 | - - | 0.44% |
| 29 | HYUNDAI MOTOR CO 韓国 | 株式 自動車 | 12,836 | 14,014.31 179,887,789 | 12,661.59 162,524,297 | - - | 0.43% |
| 30 | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国 | 株式 保険 | 665,000 | 263.54 175,258,614 | 242.01 160,937,182 | - - | 0.42% |

(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7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 株式 | 95.45% |
| 投資信託受益証券 | 0.66% |
| 投資証券 | 0.30% |
| 合計 | 96.41% |

（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7月29日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|-------------------------|-------|--------|
| 商業銀行 | 外国 | 15.23% |
| インターネットソフトウェア・サービス | | 7.55% |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 6.90% |
| 半導体・半導体製造装置 | | 4.98% |
| コンピュータ・周辺機器 | | 4.98% |
| 無線通信サービス | | 4.35% |
| 保険 | | 3.19% |
| 金属・鉱業 | | 2.97% |
| 自動車 | | 2.57% |
| メディア | | 2.39% |
| 電子装置・機器・部品 | | 2.33% |
| 不動産管理・開発 | | 2.28% |
| 食品 | | 2.08% |
| コングロマリット | | 2.04% |
| 各種電気通信サービス | | 2.04% |
| 情報技術サービス | | 1.94% |
| 化学 | | 1.93% |
| 食品・生活必需品小売り | | 1.91% |
| 各種金融サービス | | 1.65% |
| 医薬品 | | 1.60% |
| 電力 | | 1.36% |
| 飲料 | | 1.14% |
| パーソナル用品 | | 1.09% |
| 資本市場 | | 1.06% |
| 運送インフラ | | 1.05% |
| 建設・土木 | | 0.93% |
| 貯蓄・抵当・不動産金融 | | 0.92% |
| インターネット販売・カタログ販売 | | 0.90% |
| 家庭用耐久財 | | 0.84% |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | | 0.83% |
| 建設資材 | | 0.82% |
| 自動車部品 | | 0.81% |
| タバコ | | 0.80% |
| 複合小売り | | 0.77% |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | | 0.62% |
| 機械 | | 0.57% |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 0.56% |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 0.48% |

| | |
|-------------------|--------|
| ガス | 0.46% |
| 家庭用品 | 0.44% |
| 専門小売り | 0.42% |
| 各種消費者サービス | 0.37% |
| 紙製品・林産品 | 0.31% |
| 水道 | 0.29% |
| バイオテクノロジー | 0.26% |
| 不動産投資信託 | 0.26% |
| 消費者金融 | 0.25% |
| 旅客航空輸送業 | 0.24% |
| 航空宇宙・防衛 | 0.23% |
| 電気設備 | 0.23% |
| ソフトウェア | 0.17% |
| 陸運・鉄道 | 0.17% |
| 商業サービス・用品 | 0.15% |
| 海運業 | 0.11% |
| 総合公益事業 | 0.10% |
| 航空貨物・物流サービス | 0.09% |
| レジャー用品 | 0.08% |
| 容器・包装 | 0.07% |
| 商社・流通業 | 0.07% |
| エネルギー設備・サービス | 0.07% |
| 建設関連製品 | 0.05% |
| ヘルスケア機器・用品 | 0.04% |
| 販売 | 0.04% |
| ライフサイエンス・ツール/サービス | 0.03% |
| 通信機器 | 0.02% |
| 合計 | 95.45% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1 | RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア | 国債証券 | 2,000,008,470 | 122.06 2,441,359,896 | 122.19 2,443,830,349 | 7.500000 2030/3/31 | 4.53% |
| 2 | BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル | 国債証券 | 950,222,000 | 94.77 900,583,342 | 98.37 934,780,892 | 4.250000 2025/1/7 | 1.73% |
| 3 | UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ | 国債証券 | 814,476,000 | 104.13 848,161,892 | 106.50 867,416,940 | 4.750000 2044/3/8 | 1.61% |
| 4 | UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ | 国債証券 | 574,310,000 | 122.10 701,271,667 | 125.87 722,912,712 | 6.050000 2040/1/11 | 1.34% |
| 5 | UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 メキシコ | 国債証券 | 647,404,000 | 103.83 672,208,971 | 104.75 678,155,690 | 3.600000 2025/1/30 | 1.26% |
| 6 | PERU 8.75 11/21/33 ペルー | 国債証券 | 428,122,000 | 153.92 658,994,620 | 158.11 676,946,506 | 8.750000 2033/11/21 | 1.26% |
| 7 | UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ | 国債証券 | 616,078,000 | 106.77 657,825,116 | 107.75 663,824,045 | 4.000000 2023/10/2 | 1.23% |
| 8 | RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア | 国債証券 | 365,470,000 | 171.29 626,045,933 | 178.16 651,121,352 | 12.750000 2028/6/24 | 1.21% |
| 9 | UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ | 国債証券 | 542,984,000 | 115.32 626,170,193 | 119.62 649,544,610 | 5.550000 2045/1/21 | 1.20% |
| 10 | TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ | 国債証券 | 532,542,000 | 121.45 646,790,010 | 119.61 637,026,740 | 7.375000 2025/2/5 | 1.18% |
| 11 | COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア | 国債証券 | 553,426,000 | 114.35 632,847,852 | 113.85 630,075,501 | 7.375000 2019/3/18 | 1.17% |
| 12 | HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー | 国債証券 | 542,984,000 | 113.85 618,196,681 | 114.60 622,286,813 | 6.375000 2021/3/29 | 1.15% |
| 13 | BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル | 国債証券 | 584,752,000 | 102.81 601,208,592 | 105.90 619,252,368 | 4.875000 2021/1/22 | 1.15% |
| 14 | PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン | 国債証券 | 355,028,000 | 173.49 615,965,644 | 173.32 615,355,831 | 9.500000 2030/2/2 | 1.14% |
| 15 | PERU 5.625 11/18/50 ペルー | 国債証券 | 480,332,000 | 119.41 573,589,502 | 126.60 608,100,312 | 5.625000 2050/11/18 | 1.13% |
| 16 | BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル | 国債証券 | 668,288,000 | 83.36 557,132,910 | 90.00 601,459,200 | 5.000000 2045/1/27 | 1.12% |
| 17 | RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア | 国債証券 | 563,868,000 | 105.15 592,947,716 | 106.42 600,119,073 | 4.500000 2022/4/4 | 1.11% |
| 18 | TURKEY 6.625 02/17/45 トルコ | 国債証券 | 511,658,000 | 118.04 604,000,260 | 116.81 597,713,759 | 6.625000 2045/2/17 | 1.11% |
| 19 | COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア | 国債証券 | 542,984,000 | 105.35 572,075,412 | 109.75 595,924,940 | 5.625000 2044/2/26 | 1.11% |

| | | | | | | | |
|----|--|------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|-------|
| 20 | RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア | 国債証券 | 501,216,000 | 117.36 588,265,733 | 117.69 589,886,122 | 11.000000 2018/7/24 | 1.09% |
| 21 | BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル | 国債証券 | 532,542,000 | 109.40 582,600,948 | 109.50 583,133,490 | 5.875000 2019/1/15 | 1.08% |
| 22 | ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア | 国債証券 | 469,890,000 | 118.80 558,240,388 | 119.57 561,847,473 | 6.750000 2022/2/7 | 1.04% |
| 23 | PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン | 国債証券 | 375,912,000 | 145.49 546,936,297 | 148.00 556,357,278 | 6.375000 2034/10/23 | 1.03% |
| 24 | RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 ロシア | 国債証券 | 542,984,000 | 101.42 550,721,730 | 102.44 556,238,239 | 3.500000 2019/1/16 | 1.03% |
| 25 | UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ | 国債証券 | 501,216,000 | 106.99 536,290,678 | 110.25 552,590,640 | 5.750000 2110/10/12 | 1.02% |
| 26 | TURKEY 6.75 04/03/18 トルコ | 国債証券 | 522,100,000 | 107.82 562,959,963 | 105.52 550,946,025 | 6.750000 2018/4/3 | 1.02% |
| 27 | INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア | 国債証券 | 438,564,000 | 124.91 547,813,425 | 123.91 543,446,580 | 11.625000 2019/3/4 | 1.01% |
| 28 | PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン | 国債証券 | 344,586,000 | 156.48 539,233,129 | 156.79 540,293,618 | 7.750000 2031/1/14 | 1.00% |
| 29 | PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ | 国債証券 | 396,796,000 | 129.69 514,613,086 | 135.08 536,031,716 | 6.700000 2036/1/26 | 0.99% |
| 30 | COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア | 国債証券 | 459,448,000 | 109.27 502,051,360 | 114.75 527,216,580 | 6.125000 2041/1/18 | 0.98% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 96.60% |
| 合計 | 96.60% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

平成28年7月29日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|--------------------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | - | イギリス・ポンド買/ 円売2016年09月 | 買建 | 33,200 | 4,476,562 | 4,560,684 | 1.97% |
| | | オーストラリア・ドル 買/円売2016年0 9月 | 買建 | 4,800 | 375,131 | 375,888 | 0.16% |
| | | アメリカ・ドル買/円 売2016年09月 | 買建 | 3,500 | 357,570 | 364,805 | 0.16% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2016年09月 | 買建 | 3,000 | 237,804 | 237,870 | 0.10% |
| | | ユーロ買/円売201 6年09月 | 買建 | 1,200 | 138,916 | 138,792 | 0.06% |
| | | イギリス・ポンド売/ 円買2016年09月 | 売建 | 114,500 | 16,187,318 | 15,728,865 | 6.80% |
| | | オーストラリア・ドル 売/円買2016年0 9月 | 売建 | 90,000 | 6,929,198 | 7,047,900 | 3.05% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2016年09月 | 売建 | 87,500 | 6,970,805 | 6,937,875 | 3.00% |
| | | ユーロ売/円買201 6年09月 | 売建 | 59,700 | 6,841,070 | 6,904,902 | 2.98% |
| | | アメリカ・ドル売/円 買2016年09月 | 売建 | 46,300 | 4,799,149 | 4,825,849 | 2.09% |

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------------|-------|-------------------|-----------|-----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物 取引 | 大阪取引所 | TOPIX 先物 2809月 | 買建 | 447 | 5,718,043,428 | 5,938,395,000 | 2.10% |

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------------|--------------------|---|-----------|---------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円 買2016年08月 | 売建 | 150,000 | 15,701,820 | 15,660,000 | 0.01% |
| | | ユーロ売/円買201 6年08月 | 売建 | 40,000 | 4,633,520 | 4,626,400 | 0.00% |
| | | イギリス・ポンド売/ 円買2016年08月 | 売建 | 20,000 | 2,769,200 | 2,750,200 | 0.00% |
| 株価指数先物 取引 | シカゴ商品 取引所 | S & P 5 0 0 F U T U R E S e p 1 6 | 買建 | 30 | 1,652,472,605 | 1,695,284,805 | 0.65% |
| | E U R E X 取引所 | D J E U R O S T O X X 5 0 S e p 1 6 | 買建 | 131 | 435,213,001 | 450,037,269 | 0.17% |
| | I C E - E U | F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 6 | 買建 | 21 | 189,973,627 | 193,042,609 | 0.07% |
| | シドニー先 物取引所 | S P I 2 0 0 F U T U R E S S e p 1 6 | 買建 | 10 | 103,394,780 | 108,353,880 | 0.04% |
| | モントリ オール取引 所 | S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 6 | 買建 | 7 | 92,093,365 | 93,953,147 | 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) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|------------------------|-----|--------------------------|-------------|-------------|----------------|----------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円買2016年08月 | 売建 | 656,019,300 | 67,287,952,179 | 68,481,854,727 | 43.13% |
| | | ユーロ売/円買2016年08月 | 売建 | 555,231,500 | 63,309,534,377 | 64,218,075,290 | 40.44% |
| | | イギリス・ポンド売/円買2016年08月 | 売建 | 88,441,200 | 12,111,745,076 | 12,160,665,000 | 7.66% |
| | | カナダ・ドル売/円買2016年08月 | 売建 | 40,262,900 | 3,178,824,744 | 3,196,471,631 | 2.01% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2016年08月 | 売建 | 39,466,200 | 3,013,539,034 | 3,098,886,024 | 1.95% |
| | | メキシコ・ペソ売/円買2016年08月 | 売建 | 245,387,500 | 1,355,969,521 | 1,352,085,125 | 0.85% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買2016年08月 | 売建 | 70,713,000 | 1,083,011,624 | 1,099,587,150 | 0.69% |
| | | ポーランド・ズロチ売/円買2016年08月 | 売建 | 35,098,700 | 907,211,222 | 929,062,589 | 0.59% |
| | | スウェーデン・クローナ売/円買2016年08月 | 売建 | 63,626,300 | 770,506,456 | 769,241,967 | 0.48% |
| | | 南アフリカ・ランド売/円買2016年08月 | 売建 | 101,339,500 | 704,694,615 | 746,872,115 | 0.47% |
| | | マレーシア・リングギット売/円買2016年08月 | 売建 | 25,370,000 | 652,201,812 | 652,770,100 | 0.41% |
| | | シンガポール・ドル売/円買2016年08月 | 売建 | 7,079,800 | 538,930,659 | 547,268,540 | 0.34% |
| ノルウェー・クローネ売/円買2016年08月 | 売建 | 30,708,300 | 376,034,632 | 374,641,260 | 0.24% | | |

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

(注2) 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7月29日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------------|--------|--------------------------------|-----------|-----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物 取引 | ICE-US | MINI MSCI EMG MKT Se p16 | 買建 | 296 | 1,305,397,232 | 1,353,938,957 | 3.57% |

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成28年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額 (分配落) (百万円) | 純資産総額 (分配付) (百万円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末 (平成28年1月12日) | 10 | 10 | 0.9890 | 0.9890 |
| 平成27年10月末日 | 10 | - | 1.0000 | - |
| 11月末日 | 10 | - | 1.0018 | - |
| 12月末日 | 9 | - | 0.9960 | - |
| 平成28年1月末日 | 45 | - | 0.9990 | - |
| 2月末日 | 48 | - | 1.0083 | - |
| 3月末日 | 89 | - | 1.0182 | - |
| 4月末日 | 94 | - | 1.0161 | - |
| 5月末日 | 109 | - | 1.0196 | - |
| 6月末日 | 149 | - | 1.0306 | - |
| 7月末日 | 231 | - | 1.0405 | - |

【分配の推移】

| | 1口当たりの分配金(円) |
|---------------------------|--------------|
| 第1計算期間 | 0.0000 |
| 平成28年1月13日～ 平成28年7月12日 | - |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|---------------------------|--------|
| 第1計算期間 | 1.1 |
| 平成28年1月13日～ 平成28年7月12日 | 5.4 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定口数 | 解約口数 |
|---------------------------|-------------|-----------|
| 第1計算期間 | 10,458,049 | 0 |
| 平成28年1月13日～ 平成28年7月12日 | 151,199,926 | 5,945,601 |

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年7月29日

基準価額・純資産の推移

《設定日(2015年10月30日)~2016年7月29日》



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年10月30日)
※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

| | |
|------------------|----|
| 第1期 (2016.01.12) | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

| 順位 | 銘柄名 | 投資比率 |
|----|------------------------------|--------|
| 1 | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 29.22% |
| 2 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 25.35% |
| 3 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 12.53% |
| 4 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 3.90% |
| 5 | 外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド | 3.86% |
| 6 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 2.91% |
| 7 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2.90% |
| 8 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 1.95% |

その他資産の投資状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 2.45 |
| 為替予約取引(売建) | △17.91 |

■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 | 82.90 |
| 内 日本 | 82.90 |
| 地方債証券 | 6.36 |
| 内 日本 | 6.36 |
| 特殊債券 | 5.48 |
| 内 日本 | 5.48 |
| 社債券 | 4.82 |
| 内 日本 | 4.74 |
| 内 オランダ | 0.05 |
| 内 イギリス | 0.03 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 0.43 |
| 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 | 1.17% |
| 2 | 122回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2019/12/20 | 1.17% |
| 3 | 106回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.200000 | 2017/9/20 | 1.16% |
| 4 | 116回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.200000 | 2018/12/20 | 1.09% |
| 5 | 340回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.400000 | 2025/9/20 | 1.09% |

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 株式 | 97.94 |
| 内 日本 | 97.94 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 2.06 |
| 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 | 3.67% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャルグループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 2.07% |
| 3 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.86% |
| 4 | ソフトバンクグループ | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.60% |
| 5 | KDDI | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.54% |

組入上位5業種(国内株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|--------|--------|
| 1 | 電気機器 | 11.73% |
| 2 | 輸送用機器 | 9.39% |
| 3 | 情報・通信業 | 8.25% |
| 4 | 銀行業 | 7.37% |
| 5 | 化学 | 6.12% |

その他資産の投資状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|--------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 2.10 |

○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7月29日

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 国債証券 | 98.75 |
| 内 アメリカ | 42.84 |
| 内 フランス | 9.96 |
| 内 イタリア | 9.57 |
| 内 イギリス | 7.73 |
| 内 ドイツ | 7.42 |
| 内 その他 | 21.23 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 1.25 |
| 純資産総額 | 100.00 |

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 発行体の国/地域 | 利率(%) | 償還日 | 投資比率 |
|----|-------------------------|------|----------|----------|------------|-------|
| 1 | US T N/B 2.0 07/31/20 | 国債証券 | アメリカ | 2.000000 | 2020/7/31 | 1.33% |
| 2 | US T N/B 1.0 09/15/18 | 国債証券 | アメリカ | 1.000000 | 2018/9/15 | 1.28% |
| 3 | US T N/B 0.625 08/31/17 | 国債証券 | アメリカ | 0.625000 | 2017/8/31 | 1.25% |
| 4 | US T N/B 1.25 10/31/18 | 国債証券 | アメリカ | 1.250000 | 2018/10/31 | 0.90% |
| 5 | US T N/B 0.75 03/31/18 | 国債証券 | アメリカ | 0.750000 | 2018/3/31 | 0.89% |

その他資産の投資状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|------------|---------|
| 為替予約取引(売建) | △99.27 |

■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 | 96.13 |
| 内 アメリカ | 59.33 |
| 内 イギリス | 7.21 |
| 内 スイス | 3.88 |
| 内 カナダ | 3.81 |
| 内 フランス | 3.49 |
| 内 その他 | 18.41 |
| 投資信託受益証券 | 0.35 |
| 内 オーストラリア | 0.30 |
| 内 シンガポール | 0.05 |
| 投資証券 | 2.51 |
| 内 アメリカ | 2.17 |
| 内 フランス | 0.16 |
| 内 イギリス | 0.11 |
| 内 香港 | 0.05 |
| 内 カナダ | 0.02 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 1.01 |
| 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 | 1.90% |
| 2 | MICROSOFT CORP | 株式 | アメリカ | ソフトウェア | 1.38% |
| 3 | EXXON MOBIL CORP | 株式 | アメリカ | 石油・ガス・消耗燃料 | 1.23% |
| 4 | JOHNSON & JOHNSON | 株式 | アメリカ | 医薬品 | 1.12% |
| 5 | AMAZON.COM INC | 株式 | アメリカ | インターネット販売・カタログ販売 | 0.99% |

組入上位5業種(外国株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|------------|-------|
| 1 | 商業銀行 | 7.90% |
| 2 | 医薬品 | 6.75% |
| 3 | 石油・ガス・消耗燃料 | 6.29% |
| 4 | 保険 | 3.87% |
| 5 | ソフトウェア | 3.34% |

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) | △0.01 |
| 株価指数先物取引(買建) | 0.98 |

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 投資証券 | 99.15 |
| 内 日本 | 99.15 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 0.85 |
| 純資産総額 | 100.00 |

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 発行体の国/地域 | 投資比率 |
|----|-------------------|----------|-------|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人 | 日本 | 7.47% |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 日本 | 6.81% |
| 3 | 日本リートリアルファンド投資法人 | 日本 | 5.40% |
| 4 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 日本 | 5.31% |
| 5 | ユナイテッドアーバン投資法人 | 日本 | 4.74% |

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 11.37 |
| 内 オーストラリア | 8.48 |
| 内 シンガポール | 2.86 |
| 内 カナダ | 0.02 |
| 投資証券 | 88.15 |
| 内 アメリカ | 72.67 |
| 内 イギリス | 4.73 |
| 内 フランス | 4.23 |
| 内 カナダ | 1.87 |
| 内 香港 | 1.79 |
| 内 その他 | 2.86 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 0.48 |
| 純資産総額 | 100.00 |

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 発行体の国/地域 | 投資比率 |
|----|--------------------------|----------|-------|
| 1 | SIMON PROPERTY GROUP INC | アメリカ | 6.03% |
| 2 | PUBLIC STORAGE | アメリカ | 3.06% |
| 3 | PROLOGIS INC | アメリカ | 2.44% |
| 4 | WELLTOWER INC | アメリカ | 2.43% |
| 5 | UNIBAIL-RODAMCO SE | フランス | 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7月29日

■エマーシング債券バシフ・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 | 96.60 |
| 内 トルコ | 13.47 |
| 内 メキシコ | 13.19 |
| 内 ロシア | 12.22 |
| 内 インドネシア | 10.40 |
| 内 ブラジル | 9.55 |
| 内 その他 | 37.77 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 3.40 |
| 純資産総額 | 100.00 |

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 発行体の国/地域 | 利率(%) | 償還日 | 投資比率 |
|----|-------------------------------------|------|----------|----------|-----------|-------|
| 1 | RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 | 国債証券 | ロシア | 7.500000 | 2030/3/31 | 4.53% |
| 2 | BRAZIL 4.25 01/07/25 | 国債証券 | ブラジル | 4.250000 | 2025/1/7 | 1.73% |
| 3 | UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 | 国債証券 | メキシコ | 4.750000 | 2044/3/8 | 1.61% |
| 4 | UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 | 国債証券 | メキシコ | 6.050000 | 2040/1/11 | 1.34% |
| 5 | UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 | 国債証券 | メキシコ | 3.600000 | 2025/1/30 | 1.26% |

■エマーシング株式バシフ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 株式 | 95.45 |
| 内 韓国 | 14.25 |
| 内 台湾 | 11.74 |
| 内 ケイマン諸島 | 10.22 |
| 内 中国 | 9.80 |
| 内 インド | 8.15 |
| 内 その他 | 41.29 |
| 投資信託受益証券 | 0.66 |
| 内 メキシコ | 0.66 |
| 投資証券 | 0.30 |
| 内 メキシコ | 0.13 |
| 内 南アフリカ | 0.13 |
| 内 トルコ | 0.04 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 3.59 |
| 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 | TENCENT HOLDINGS LTD | 株式 | ケイマン諸島 | インターネットソフトウェアサービス | 3.38% |
| 2 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 株式 | 韓国 | コンピュータ周辺機器 | 3.35% |
| 3 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 株式 | 台湾 | 半導体・半導体製造装置 | 3.33% |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 株式 | ケイマン諸島 | インターネットソフトウェアサービス | 2.02% |
| 5 | CHINA MOBILE LIMITED | 株式 | 香港 | 無線通信サービス | 1.90% |

組入上位5業種(外国株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|-------------------|--------|
| 1 | 商業銀行 | 15.23% |
| 2 | インターネットソフトウェアサービス | 7.55% |
| 3 | 石油・ガス・消耗燃料 | 6.90% |
| 4 | 半導体・半導体製造装置 | 4.98% |
| 5 | コンピュータ・周辺機器 | 4.98% |

その他資産の投資状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|--------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 3.57 |

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、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。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」につきましては、以下の内容を追加いたします。

<追加>

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは当中間計算期間より中間財務諸表を作成しているため、中間損益及び剰余金計算書に係る比較情報は記載しておりません。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年1月13日から平成28年7月12日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | 第1期 平成28年1月12日現在 | 第2期中間計算期間末 平成28年7月12日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 627,343 | 8,510,722 |
| 親投資信託受益証券 | 9,683,698 | 153,094,494 |
| 派生商品評価勘定 | - | 1,186,655 |
| 未収入金 | 113,814 | - |
| 流動資産合計 | 10,424,855 | 162,791,871 |
| 資産合計 | 10,424,855 | 162,791,871 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 40 | 280,201 |
| 未払金 | 69,057 | - |
| 未払受託者報酬 | 639 | 12,783 |
| 未払委託者報酬 | 12,273 | 239,385 |
| その他未払費用 | 74 | 1,856 |
| 流動負債合計 | 82,083 | 534,225 |
| 負債合計 | 82,083 | 534,225 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 10,458,049 | 1 155,712,374 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 2 115,277 | 2 6,545,272 |
| (分配準備積立金) | 24,530 | 23,306 |
| 元本等合計 | 10,342,772 | 162,257,646 |
| 純資産合計 | 10,342,772 | 162,257,646 |
| 負債純資産合計 | 10,424,855 | 162,791,871 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

| | 第2期中間計算期間 自 平成28年1月13日 至 平成28年7月12日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 受取利息 | 104 |
| 有価証券売買等損益 | 2,680,796 |
| 為替差損益 | 2,112,117 |
| 営業収益合計 | 4,793,017 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 2,001 |
| 受託者報酬 | 12,783 |
| 委託者報酬 | 239,385 |
| その他費用 | 1,862 |
| 営業費用合計 | 256,031 |
| 営業利益又は営業損失() | 4,536,986 |
| 経常利益又は経常損失() | 4,536,986 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 4,536,986 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額() | 85,185 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 115,277 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 2,259,483 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 2,259,483 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 50,735 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 50,735 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 6,545,272 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第1期 平成28年1月12日現在 | 第2期中間計算期間末 平成28年7月12日現在 |
|------------|---|----------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 10,000,000円 | 10,458,049円 |
| 期中追加設定元本額 | 458,049円 | 151,199,926円 |
| 期中一部解約元本額 | - 円 | 5,945,601円 |
| 2. 受益権の総数 | 10,458,049口 | 155,712,374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115,277円であります。 | |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

| 種類 | 第1期 平成28年1月12日現在 | | | | 第2期中間計算期間末 平成28年7月12日現在 | | | |
|------------|---------------------|-----------|-----------|-------------|----------------------------|-----------|------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 498,620 | - | 498,660 | 40 | 31,527,064 | - | 30,602,779 | 924,285 |
| アメリカ・ドル | 47,010 | - | 47,016 | 6 | 3,581,845 | - | 3,555,362 | 26,483 |
| イギリス・ポンド | 188,164 | - | 188,188 | 24 | 12,904,727 | - | 12,093,938 | 810,789 |
| オーストラリア・ドル | 131,083 | - | 131,088 | 5 | 5,003,180 | - | 5,052,015 | 48,835 |
| カナダ・ドル | 132,363 | - | 132,368 | 5 | 5,067,601 | - | 4,963,344 | 104,257 |
| ユーロ | - | - | - | - | 4,969,711 | - | 4,938,120 | 31,591 |
| 買 建 | - | - | - | - | 4,239,496 | - | 4,221,665 | 17,831 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 263,562 | - | 266,396 | 2,834 |
| イギリス・ポンド | - | - | - | - | 3,824,301 | - | 3,800,190 | 24,111 |
| オーストラリア・ドル | - | - | - | - | 81,803 | - | 84,843 | 3,040 |
| カナダ・ドル | - | - | - | - | 69,830 | - | 70,236 | 406 |
| 合計 | 498,620 | - | 498,660 | 40 | 35,766,560 | - | 34,824,444 | 906,454 |

(注) 時価の算定方法

- 中間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。

中間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。

中間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。

 - ・中間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。
 - ・中間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。
- 中間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、中間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。
- 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。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 第1期 平成28年1月12日現在 | 第2期中間計算期間末 平成28年7月12日現在 |
|--------------|---------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 0.9890円 | 1.0420円 |
| (1万口当たり純資産額) | (9,890円) | (10,420円) |

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 3,393,222,349 | 3,295,677,894 |
| 株式 | 2 | 276,342,361,426 | 275,829,654,590 |
| 派生商品評価勘定 | | - | 144,735,900 |
| 未収入金 | | - | 758,704 |
| 未収配当金 | | 375,847,721 | 377,071,737 |
| 前払金 | | 167,729,000 | - |
| 流動資産合計 | | 280,279,160,496 | 279,647,898,825 |
| 資産合計 | | 280,279,160,496 | 279,647,898,825 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 260,639,956 | - |
| 前受金 | | - | 50,180,000 |
| 未払金 | | 37,223,144 | - |
| 未払解約金 | | 173,697,000 | 155,451,000 |
| 流動負債合計 | | 471,560,100 | 205,631,000 |
| 負債合計 | | 471,560,100 | 205,631,000 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 137,895,802,136 | 148,415,661,869 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 141,911,798,260 | 131,026,605,956 |
| 元本等合計 | | 279,807,600,396 | 279,442,267,825 |
| 純資産合計 | | 279,807,600,396 | 279,442,267,825 |
| 負債純資産合計 | | 280,279,160,496 | 279,647,898,825 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--|------------------|------------------|
| 1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 141,129,959,539円 | 137,895,802,136円 |
| 同期中追加設定元本額 | 5,896,465,995円 | 30,552,232,484円 |
| 同期中一部解約元本額 | 9,130,623,398円 | 20,032,372,751円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| DIAM DC 国内株式インデックスファンド | 5,243,119,200円 | 6,375,520,105円 |
| DIAM国内株式パッシブ・ファンド | 1,434,903,894円 | 1,517,074,465円 |
| MITO ラップ型ファンド（安定型） | 6,372,306円 | 9,129,781円 |
| MITO ラップ型ファンド（中立型） | 13,241,995円 | 18,120,418円 |
| MITO ラップ型ファンド（積極型） | 33,085,052円 | 38,387,875円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 15,617,096円 | 19,030,231円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 10,949,401円 | 16,030,252円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 11,175,343円 | 15,535,935円 |
| DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金> | 37,229,466,103円 | 38,872,857,208円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 753,957,603円 | 919,699,441円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 2,677,160,685円 | 3,081,394,557円 |

| | | |
|-----------------------------------|----------------|----------------|
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 2,838,691,583円 | 3,099,880,644円 |
| DIAM DC バランス30インデックスファンド | 360,300,606円 | 408,716,759円 |
| DIAM DC バランス50インデックスファンド | 1,205,856,079円 | 1,309,764,939円 |
| DIAM DC バランス70インデックスファンド | 1,077,747,976円 | 1,144,691,409円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 59,990,854円 | 64,244,342円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 1,225,789,571円 | 1,348,137,318円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 26,328,141円 | 30,643,797円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 23,879,309円 | 30,983,724円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 46,943,703円 | 64,287,197円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 101,897,155円 | 125,237,009円 |
| 投資のソムリエ | 1,437,588,833円 | 1,071,677,253円 |
| クルーズコントロール | 411,063,743円 | 1,082,505,190円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 25,711,338円 | 24,728,210円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 68,146,669円 | 107,114,949円 |
| DIAM DC バランス・F(成長型) | 50,706,467円 | 78,510,194円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 65,644円 | 294,314円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(堅実型) | 5,635,268円 | 13,048,526円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(積極型) | 7,643,548円 | 32,481,566円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 378,598円 | 3,612,277円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | -円 | 475,439円 |
| DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定) | 290,705,619円 | 250,610,082円 |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) | 106,160,395円 | 124,900,758円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 576,396,892円 | 295,019,238円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 464,365,370円 | 479,199,961円 |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 40,121,091円 | 37,607,363円 |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 164,133,734円 | 149,398,370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) | 39,392,533円 | 39,191,992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) | 59,164,711円 | 53,768,869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) | 5,310,699,991円 | 3,932,407,510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) | 2,014,996,367円 | 1,387,516,225円 |
| D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定) | 1,925,294,426円 | 1,986,458,914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) | 1,534,659,208円 | 1,621,942,721円 |
| D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定) | 4,028,185,938円 | 4,256,737,317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) | 313,152,279円 | 351,862,082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) | 814,928,278円 | 890,989,010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) | 953,342,133円 | 1,034,171,932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) | 3,906,961,067円 | 4,231,721,310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) | 1,304,865,632円 | 1,490,614,509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) | 5,298,661,400円 | 5,637,233,765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) | 19,928,952,130円 | 22,795,736,028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) | 764,217,632円 | 834,560,866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) | 2,257,945,180円 | 2,618,584,387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) | 12,639,527,962円 | 14,363,871,126円 |
| D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定) | 34,355円 | 8,463,623円 |

| | | | |
|-----|--|-------------------|-------------------|
| | D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定) | 9,206,801円 | 3,687,271円 |
| | D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定) | 15,369,659円 | 1,287,419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) | 11,341,448,728円 | 12,951,006,433円 |
| | D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定) | 106,482,768円 | 117,577,546円 |
| | D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定) | 40,013,403円 | 46,345,852円 |
| | D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定) | 23,270,239円 | 49,518,456円 |
| | D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定) | 38,722,783円 | 85,470円 |
| | D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定) | 117,038円 | 134,219円 |
| | D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定) | 670,998,289円 | 729,123,003円 |
| | D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定) | 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7 V A (1 3 0 6) (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7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定) | 94,839,111円 | 105,546,296円 |
| | 計 | 137,895,802,136円 | 148,415,661,869円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 137,895,802,136口 | 148,415,661,869口 |
| 3 . | 2 差入代用有価証券 | 株式 3,377,500,000円 | 株式 2,721,500,000円 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

| 種類 | 平成28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12日 現在 | | | |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | | |
| 買 建 | 3,312,334,000 | - | 3,051,765,000 | 260,569,000 | 3,408,175,000 | - | 3,553,000,000 | 144,825,000 |
| 合計 | 3,312,334,000 | - | 3,051,765,000 | 260,569,000 | 3,408,175,000 | - | 3,553,000,000 | 144,825,000 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.0291円 | 1.8828円 |
| (1万口当たり純資産額) | (20,291円) | (18,828円) |

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 3,378,512,489 | 4,311,453,474 |
| 国債証券 | | 339,001,056,200 | 322,124,996,600 |
| 地方債証券 | | 27,726,101,297 | 24,865,502,878 |
| 特殊債券 | | 23,820,724,355 | 21,390,621,441 |
| 社債券 | | 21,974,406,920 | 18,809,990,520 |
| 未収利息 | | 1,017,983,517 | 882,367,222 |
| 前払費用 | | 20,720,985 | 7,312,311 |
| 流動資産合計 | | 416,939,505,763 | 392,392,244,446 |
| 資産合計 | | 416,939,505,763 | 392,392,244,446 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 851,602,400 | 2,553,334,000 |
| 未払解約金 | | 227,765,000 | 282,886,000 |
| 流動負債合計 | | 1,079,367,400 | 2,836,220,000 |
| 負債合計 | | 1,079,367,400 | 2,836,220,000 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 332,334,674,604 | 293,429,460,781 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 83,525,463,759 | 96,126,563,665 |
| 元本等合計 | | 415,860,138,363 | 389,556,024,446 |
| 純資産合計 | | 415,860,138,363 | 389,556,024,446 |
| 負債純資産合計 | | 416,939,505,763 | 392,392,244,446 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|---|--|--|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額 | 335,555,318,992円 16,883,959,527円 20,104,603,915円 | 332,334,674,604円 29,692,297,488円 68,597,511,311円 |
| 元本の内訳 ファンド名 | | |
| DIAM国内債券パッシブ・ファンド | 10,422,340,439円 | 9,939,629,834円 |
| MITO ラップ型ファンド（安定型） | 179,996,085円 | 172,180,702円 |
| MITO ラップ型ファンド（中立型） | 134,619,110円 | 123,653,996円 |
| MITO ラップ型ファンド（積極型） | 58,341,657円 | 36,694,771円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 441,457,931円 | 358,912,607円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 110,920,540円 | 109,095,285円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 19,733,972円 | 14,849,516円 |
| たわらノーロード 国内債券 | 145,101,455円 | 867,835,410円 |
| たわらノーロード 国内債券<ラップ向け> | - 円 | 755,274円 |
| DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金> | 11,440,979,213円 | 12,122,084,328円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型 | 4,607,514,076円 | 4,455,584,454円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型 | 6,981,550,379円 | 6,480,666,778円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型 | 2,859,964,156円 | 2,577,558,464円 |
| DIAM DC バランス30インデックスファンド | 1,702,593,088円 | 1,632,857,136円 |
| DIAM DC バランス50インデックスファンド | 1,868,821,247円 | 1,751,975,900円 |
| DIAM DC バランス70インデックスファンド | 277,399,912円 | 244,957,185円 |

| | | |
|-----------------------------------|-----------------|-----------------|
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 116,791,587円 | 106,713,310円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 2,431,182,324円 | 2,235,435,942円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 9,416,069円 | 8,622,472円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 238,570,350円 | 241,658,986円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 171,177,768円 | 180,929,656円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 45,802,577円 | 42,599,566円 |
| 投資のソムリエ | 7,838,572,612円 | 8,397,162,509円 |
| クルーズコントロール | 909,261,368円 | 1,849,980,078円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 140,353,064円 | 193,382,273円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 696,372,772円 | 830,691,516円 |
| DIAM DC バランス・F(成長型) | 48,959,007円 | 60,028,288円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 144,945円 | 503,215円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(堅実型) | 3,304,061円 | 5,984,109円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(積極型) | 4,498,216円 | 14,854,699円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 2,924,563円 | 42,386,066円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | - 円 | 1,290,856円 |
| みずほエマージング債券オープン | 10,801,911円 | 10,801,911円 |
| DIAM高金利通貨ファンド | 9,608,918円 | 9,608,918円 |
| DIAMエマージング債券ファンド | 9,450,010円 | 9,450,010円 |
| DIAM国内債券バッシブファンド(適格機関投資家向け) | 31,119,371,814円 | 31,069,835,454円 |
| DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定) | 775,948,701円 | 1,017,679,760円 |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) | 627,350,416円 | 565,187,887円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 1,243,748,653円 | 487,442,086円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 333,618,744円 | 263,811,800円 |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 168,338,894円 | 120,775,930円 |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 442,409,232円 | 308,333,672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) | 177,024,127円 | 134,933,432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) | 141,749,531円 | 98,616,394円 |
| D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定) | 14,319,323,771円 | 8,118,962,428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) | 5,433,174,282円 | 2,864,915,809円 |
| D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定) | 9,230,597,150円 | 7,291,975,868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) | 4,137,017,580円 | 3,347,753,977円 |
| D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定) | 7,238,748,293円 | 5,855,748,971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) | 844,399,916円 | 726,773,720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) | 3,663,128,444円 | 3,065,894,724円 |
| D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 5,142,793,879円 | 4,268,643,026円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け) | 7,021,084,542円 | 5,822,179,052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 55VA(適格機関投資家限 定) | 7,038,621,101円 | 6,155,191,528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) | 7,564,188,784円 | 6,389,387,464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) | 95,566,153,088円 | 83,634,375,559円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定) | 1,372,854,302円 | 1,148,667,373円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定) | 8,115,982,356円 | 7,203,461,902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) | 30,286,852,009円 | 26,338,733,812円 |
| D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定) | 495,530円 | 93,379,444円 |

| | | | |
|----|-------------------------------------|------------------|------------------|
| | D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定) | 41,401,133円 | 12,695,134円 |
| | D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定) | 27,629,632円 | 1,771,365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) | 33,976,620,681円 | 29,685,358,819円 |
| | D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定) | 630,558,152円 | 532,331,561円 |
| | D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定) | 167,965,929円 | 149,060,577円 |
| | D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定) | 418,821,258円 | 684,215,766円 |
| | D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定) | 243,744,056円 | 414,302円 |
| | D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定) | 351,001円 | 308,265円 |
| | 計 | 332,334,674,604円 | 293,429,460,781円 |
| 2. | 受益権の総数 | 332,334,674,604口 | 293,429,460,781口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,2513円 | 1,3276円 |
| （1万口当たり純資産額） | （12,513円） | （13,276円） |

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 64,656,718 | 882,564,332 |
| 投資証券 | | 22,044,521,100 | 23,952,942,300 |
| 未収入金 | | 1,934,442,837 | - |
| 未収配当金 | | 196,965,222 | 165,028,773 |
| 流動資産合計 | | 24,240,585,877 | 25,000,535,405 |
| 資産合計 | | 24,240,585,877 | 25,000,535,405 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 490,278 | 807,398,140 |
| 未払解約金 | | 104,733,000 | 187,000 |
| 流動負債合計 | | 105,223,278 | 807,585,140 |
| 負債合計 | | 105,223,278 | 807,585,140 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 15,337,732,833 | 13,435,861,348 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 8,797,629,766 | 10,757,088,917 |
| 元本等合計 | | 24,135,362,599 | 24,192,950,265 |
| 純資産合計 | | 24,135,362,599 | 24,192,950,265 |
| 負債純資産合計 | | 24,240,585,877 | 25,000,535,405 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 13,859,106,230円 | 15,337,732,833円 |
| 同期中追加設定元本額 | 3,863,497,585円 | 7,386,306,766円 |
| 同期中一部解約元本額 | 2,384,870,982円 | 9,288,178,251円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| MITO ラップ型ファンド(安定型) | 397,486円 | 770,094円 |
| MITO ラップ型ファンド(中立型) | 1,218,861円 | 1,796,596円 |
| MITO ラップ型ファンド(積極型) | 3,050,633円 | 4,124,246円 |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 971,903円 | 1,604,893円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 1,001,579円 | 1,589,159円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 1,030,011円 | 1,669,466円 |
| たわらノーロード 国内リート | 67,911,873円 | 454,389,186円 |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ向け> | -円 | 5,448,856円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 18,438,842円 | 16,021,050円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 375,068,015円 | 341,601,580円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 4,469,392円 | 4,609,929円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 9,721,510円 | 9,473,646円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 25,042,951円 | 27,212,976円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 61,581,809円 | 58,441,189円 |
| 投資のソムリエ | 577,590,467円 | 360,195,576円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| 投資のソムリエ<DC年金> | 10,300,179円 | 8,275,506円 |
| DIAM 8資産バランスファン ドN<DC年金> | 27,363,706円 | 32,820,619円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 254,694円 | 1,819,886円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | -円 | 383,417円 |
| DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 10(適格機関投資家限定) | 2,017,708,759円 | 993,509,510円 |
| DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定) | 1,090,204,032円 | 1,072,040,993円 |
| DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定) | 2,124,936,873円 | 2,091,078,459円 |
| DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け) | 6,951,010,304円 | 7,366,841,007円 |
| DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け) | 57,261,963円 | 59,812,821円 |
| DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定) | 834,883,747円 | 231,706,681円 |
| DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定) | 1,038,835,576円 | 251,146,339円 |
| DIAM リスクコントロール J-REITファンド(適格機 関投資家限定) | 37,477,668円 | 37,477,668円 |
| 計 | 15,337,732,833円 | 13,435,861,348円 |
| 2. 受益権の総数 | 15,337,732,833口 | 13,435,861,348口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,5736円 | 1,8006円 |
| （1万口当たり純資産額） | （15,736円） | （18,006円） |

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 3,843,175,851 | 2,482,691,968 |
| コール・ローン | | 99,622,215 | 831,783,347 |
| 株式 | | 239,368,397,850 | 240,877,083,386 |
| 投資信託受益証券 | | 710,818,356 | 881,187,225 |
| 投資証券 | | 5,843,780,192 | 6,347,144,213 |
| 派生商品評価勘定 | | 214,385 | 214,206,748 |
| 未収入金 | | 1,939,313 | 25,112,960 |
| 未収配当金 | | 344,637,908 | 315,083,668 |
| 差入委託証拠金 | | 1,662,902,378 | 1,777,093,124 |
| 流動資産合計 | | 251,875,488,448 | 253,751,386,639 |
| 資産合計 | | 251,875,488,448 | 253,751,386,639 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 344,558,300 | 16 |
| 未払金 | | - | 11,092,249 |
| 未払解約金 | | 100,968,000 | 153,234,000 |
| 流動負債合計 | | 445,526,300 | 164,326,265 |
| 負債合計 | | 445,526,300 | 164,326,265 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 97,735,137,391 | 102,743,119,077 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 153,694,824,757 | 150,843,941,297 |
| 元本等合計 | | 251,429,962,148 | 253,587,060,374 |
| 純資産合計 | | 251,429,962,148 | 253,587,060,374 |
| 負債純資産合計 | | 251,875,488,448 | 253,751,386,639 |

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28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|---|------------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 101,368,879,486円 | 97,735,137,391円 |
| 同期中追加設定元本額 | 2,832,069,596円 | 15,556,223,841円 |
| 同期中一部解約元本額 | 6,465,811,691円 | 10,548,242,155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 | 1,152,620,379円 | 1,860,070,953円 |
| M I T O ラップ型ファンド(安定型) | 4,948,687円 | 7,070,818円 |
| M I T O ラップ型ファンド(中立型) | 10,286,868円 | 16,314,685円 |
| M I T O ラップ型ファンド(積極型) | 25,891,522円 | 37,700,196円 |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 12,127,549円 | 14,738,824円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 8,505,193円 | 14,433,689円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 8,744,923円 | 15,258,200円 |
| たわらノーロード 先進国株式 | 271,389,618円 | 1,626,782,483円 |
| たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け> | - 円 | 426,031円 |
| D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金> | 34,267,965,537円 | 35,153,246,632円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 | 156,636,797円 | 175,410,587円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 | 836,424,717円 | 919,847,850円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型 | 1,060,659,656円 | 1,122,290,696円 |
| D I A M DC バランス30インデックスファンド | 140,986,314円 | 145,919,659円 |
| D I A M DC バランス50インデックスファンド | 406,671,520円 | 406,699,674円 |
| D I A M DC バランス70インデックスファンド | 338,651,848円 | 343,433,795円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 42,663,525円 | 45,778,536円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 872,208,370円 | 951,244,965円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 231,794,603円 | 231,426,141円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 18,857,253円 | 23,489,567円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 36,754,707円 | 49,505,505円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 80,148,275円 | 95,169,676円 |

| | | |
|---|----------------|----------------|
| 投資のソムリエ | 339,757,071円 | 401,696,368円 |
| クルーズコントロール | 159,910,174円 | 410,352,661円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 6,043,950円 | 9,319,256円 |
| DIAM 8資産バランスファン ドN<DC年金> | 53,767,391円 | 83,698,246円 |
| DIAM DC バランス・F (成長型) | 18,740,201円 | 28,675,864円 |
| クルーズコントロール<DC年 金> | 25,159円 | 111,489円 |
| DIAMコア資産設計ファンド (堅実型) | 1,464,834円 | 3,313,185円 |
| DIAMコア資産設計ファンド (積極型) | 1,957,062円 | 8,249,488円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 73,969円 | 2,039,677円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | - 円 | 634,103円 |
| DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用) | 251,105,219円 | 208,696,593円 |
| DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け) | 3,401,821,371円 | 3,250,363,008円 |
| DIAMアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定) | 174,358,190円 | 145,609,101円 |
| DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定) | - 円 | 392,381円 |
| DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定) | 35,597,952円 | 40,539,307円 |
| DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定) | 451,682,842円 | 223,630,974円 |
| DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定) | 363,764,256円 | 363,341,022円 |
| DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定) | 31,437,072円 | 28,499,478円 |
| DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定) | 192,853,625円 | 169,807,939円 |
| DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定) | 15,423,325円 | 14,847,320円 |
| DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定) | 30,887,628円 | 27,147,646円 |
| DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定) | 4,160,443,133円 | 2,980,691,956円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定) | 2,368,277,596円 | 1,578,073,421円 |
| D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定) | 1,005,184,802円 | 1,003,410,109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) | 1,051,917,126円 | 1,075,482,053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) | 3,155,528,740円 | 3,225,614,018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) | 1,233,229,496円 | 1,334,768,278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) | 1,925,332,257円 | 2,026,788,286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) | 1,492,762,853円 | 1,567,593,129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) | 1,018,540,451円 | 1,066,158,344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 5 5 V A (適格機関投資家限 定) | 4,623,912,268円 | 5,086,524,668円 |
| D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定) | 1,693,059,024円 | 1,739,502,696円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定) | 10,410,355,488円 | 11,517,500,979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) | 598,466,354円 | 632,413,399円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定) | 1,768,131,803円 | 1,984,427,572円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定) | 6,600,216,428円 | 7,259,619,136円 |
| D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定) | 133,759円 | 32,096,738円 |
| D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定) | 28,727,295円 | 11,009,666円 |
| D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定) | 43,970,103円 | 3,528,117円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定) | 8,884,320,454円 | 9,814,474,097円 |
| D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定) | 54,572,307円 | 113,400,844円 |

| | | | |
|----|--------------------------------|-----------------|------------------|
| | D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定) | 91,043,052円 | 187,990円 |
| | D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定) | 273,217円 | 295,614円 |
| | 計 | 97,735,137,391円 | 102,743,119,077円 |
| 2. | 受益権の総数 | 97,735,137,391口 | 102,743,119,077口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

| 種類 | 平成28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12日 現在 | | | |
|------------|---------------|-----------|-------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 122,124,485 | - | 121,910,100 | 214,385 | 18,512,747 | - | 18,512,600 | 147 |
| アメリカ・ドル | 67,145,430 | - | 67,140,300 | 5,130 | - | - | - | - |
| イギリス・ポンド | 15,445,830 | - | 15,427,800 | 18,030 | 14,686,155 | - | 14,686,100 | 55 |
| オーストラリア・ドル | 2,473,620 | - | 2,473,200 | 420 | 774,370 | - | 774,300 | 70 |
| カナダ・ドル | 7,493,510 | - | 7,461,000 | 32,510 | 782,038 | - | 782,000 | 38 |
| ユーロ | 29,566,095 | - | 29,407,800 | 158,295 | 2,270,184 | - | 2,270,200 | 16 |
| 買 建 | - | - | - | - | 656,516,465 | - | 668,944,200 | 12,427,735 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 448,578,690 | - | 456,837,000 | 8,258,310 |
| イギリス・ポンド | - | - | - | - | 50,849,448 | - | 52,068,900 | 1,219,452 |
| オーストラリア・ドル | - | - | - | - | 26,649,000 | - | 27,104,000 | 455,000 |
| カナダ・ドル | - | - | - | - | 27,001,100 | - | 27,370,000 | 368,900 |
| ユーロ | - | - | - | - | 103,438,227 | - | 105,564,300 | 2,126,073 |
| 合計 | 122,124,485 | - | 121,910,100 | 214,385 | 675,029,212 | - | 687,456,800 | 12,427,882 |

(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28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12日 現在 | | | |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | | |
| 買 建 | 5,666,776,185 | - | 5,322,217,885 | 344,558,300 | 5,204,120,381 | - | 5,405,899,231 | 201,778,850 |
| 合計 | 5,666,776,185 | - | 5,322,217,885 | 344,558,300 | 5,204,120,381 | - | 5,405,899,231 | 201,778,850 |

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.5726円 | 2.4682円 |
| (1万口当たり純資産額) | (25,726円) | (24,682円) |

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 70,002,610 | 884,678,726 |
| コール・ローン | | 76,993,840 | 46,162,071 |
| 投資信託受益証券 | | 2,607,796,512 | 3,847,993,381 |
| 投資証券 | | 22,646,538,651 | 29,792,500,300 |
| 派生商品評価勘定 | | 230,738 | 7,520 |
| 未収入金 | | 3,783,993,877 | - |
| 未収配当金 | | 115,614,586 | 104,133,978 |
| 流動資産合計 | | 29,301,170,814 | 34,675,475,976 |
| 資産合計 | | 29,301,170,814 | 34,675,475,976 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | - | 1,898 |
| 未払金 | | - | 807,257,409 |
| 未払解約金 | | 11,000,000 | 22,000,000 |
| 流動負債合計 | | 11,000,000 | 829,259,307 |
| 負債合計 | | 11,000,000 | 829,259,307 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 26,797,491,574 | 30,432,201,770 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 2,492,679,240 | 3,414,014,899 |
| 元本等合計 | | 29,290,170,814 | 33,846,216,669 |
| 純資産合計 | | 29,290,170,814 | 33,846,216,669 |
| 負債純資産合計 | | 29,301,170,814 | 34,675,475,976 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資信託受益証券 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> |
| 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 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 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28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--|-----------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 24,581,575,756円 | 26,797,491,574円 |
| 同期中追加設定元本額 | 11,388,885,149円 | 14,768,972,344円 |
| 同期中一部解約元本額 | 9,172,969,331円 | 11,134,262,148円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ） | 12,611,597円 | 85,146,602円 |
| D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ） | 12,656,404円 | 31,624,429円 |
| M I T O ラップ型ファンド（安定型） | 7,026,995円 | 13,199,640円 |
| M I T O ラップ型ファンド（中立型） | 21,123,438円 | 30,478,935円 |
| M I T O ラップ型ファンド（積極型） | 53,331,821円 | 70,478,490円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 17,211,192円 | 27,512,661円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 17,333,148円 | 26,962,207円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 17,993,861円 | 28,522,170円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 137,172,128円 | 860,500,318円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | - 円 | 8,288,672円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | - 円 | 26,181,578円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | - 円 | 543,841,270円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | - 円 | 80,620,116円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 13,941,746円 | 15,564,819円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 35,855,071円 | 43,803,050円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 88,055,265円 | 94,210,786円 |
| 投資のソムリエ | 815,172,778円 | 1,786,627,593円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 14,675,192円 | 41,327,733円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 39,421,540円 | 55,490,458円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 277,120円 | 6,032,939円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | - 円 | 613,211円 |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド | - 円 | 1,447,767,054円 |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> | 1,586,314円 | 4,891,687円 |
| 為替フルヘッジ型外国リート・パッシブ・ファンド(適格機関投資家限定) | 641,640,313円 | 235,476,312円 |
| DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定) | 134,590,667円 | 105,114,015円 |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け) | 4,975,148,032円 | 4,746,502,433円 |
| DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け) | - 円 | 50,484,750円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定) | 12,695,405,659円 | 12,778,876,412円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 2,895,193,944円 | 3,036,946,149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) | 3,587,011,770円 | 3,586,745,115円 |
| | D I A M海外リートインデック スファンド(適格機関投資家限 定) | 563,055,579円 | 562,370,166円 |
| | 計 | 26,797,491,574円 | 30,432,201,770円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 26,797,491,574口 | 30,432,201,770口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

| 種類 | 平成28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12日 現在 | | | |
|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 3,796,381,438 | - | 3,796,150,700 | 230,738 | 26,247,789 | - | 26,240,380 | 7,409 |
| アメリカ・ドル | 2,759,955,594 | - | 2,759,819,700 | 135,894 | - | - | - | - |
| イギリス・ポンド | 250,283,128 | - | 250,273,200 | 9,928 | - | - | - | - |
| オーストラリア・ドル | 280,324,560 | - | 280,296,000 | 28,560 | - | - | - | - |
| カナダ・ドル | 59,692,896 | - | 59,688,000 | 4,896 | - | - | - | - |
| シンガポール・ドル | 105,075,840 | - | 105,075,200 | 640 | - | - | - | - |
| ニュージーランド・ドル | 17,773,710 | - | 17,772,100 | 1,610 | - | - | - | - |
| ユーロ | 255,725,600 | - | 255,720,000 | 5,600 | 15,664,269 | - | 15,664,380 | 111 |
| 香港・ドル | 67,550,110 | - | 67,506,500 | 43,610 | 10,583,520 | - | 10,576,000 | 7,520 |
| 買 建 | - | - | - | - | 33,366,287 | - | 33,364,500 | 1,787 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 33,366,287 | - | 33,364,500 | 1,787 |
| 合計 | 3,796,381,438 | - | 3,796,150,700 | 230,738 | 59,614,076 | - | 59,604,880 | 5,622 |

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0930円 | 1.1122円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,930円) | (11,122円) |

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 44,926,152 | 26,144,186 |
| コール・ローン | | 3,031,892,875 | 2,611,656,928 |
| 国債証券 | | 171,450,791,029 | 154,261,965,502 |
| 派生商品評価勘定 | | 4,220,200,203 | 620,946,894 |
| 未収利息 | | 1,612,739,797 | 1,146,911,914 |
| 前払費用 | | 89,178,573 | 152,414,825 |
| 流動資産合計 | | 180,449,728,629 | 158,820,040,249 |
| 資産合計 | | 180,449,728,629 | 158,820,040,249 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | - | 223,689,401 |
| 未払解約金 | | 35,755,000 | 52,951,000 |
| 流動負債合計 | | 35,755,000 | 276,640,401 |
| 負債合計 | | 35,755,000 | 276,640,401 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 136,783,689,294 | 114,129,660,565 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 43,630,284,335 | 44,413,739,283 |
| 元本等合計 | | 180,413,973,629 | 158,543,399,848 |
| 純資産合計 | | 180,413,973,629 | 158,543,399,848 |
| 負債純資産合計 | | 180,449,728,629 | 158,820,040,249 |

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28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|---|------------------|------------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 134,756,382,531円 | 136,783,689,294円 |
| 同期中追加設定元本額 | 8,890,181,839円 | 21,008,699,280円 |
| 同期中一部解約元本額 | 6,862,875,076円 | 43,662,728,009円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| 投資のソムリエ | 8,891,870,834円 | 6,101,488,111円 |
| 投資のソムリエ＜DC年金＞ | 158,922,634円 | 140,525,350円 |
| 投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型 | 2,703,138円 | 34,857,922円 |
| 外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定） | 2,686,498,877円 | 2,683,487,500円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定） | 22,703,268,954円 | 20,053,879,409円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定） | 1,305,762,161円 | 1,102,177,379円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定） | 7,719,331,345円 | 6,911,576,106円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定） | 36,009,496,664円 | 31,591,005,969円 |
| DIAMバランス30VA（適格機関投資家限定） | 176,428円 | 33,588,488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) | 32,316,010,251円 | 28,482,554,704円 |
| | D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定) | 119,449,381円 | 196,739,908円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定) | 3,411,082,738円 | 3,090,156,932円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定) | 9,050,768,997円 | 2,759,009,770円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定) | 11,925,143,688円 | 10,482,487,331円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定) | 483,203,204円 | 466,125,686円 |
| | 計 | 136,783,689,294円 | 114,129,660,565円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 136,783,689,294口 | 114,129,660,565口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

| 種類 | 平成28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12日 現在 | | | |
|-------------|-----------------|-----------|-----------------|---------------|-----------------|-----------|-----------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 176,492,246,521 | - | 172,272,046,318 | 4,220,200,203 | 155,118,548,565 | - | 154,721,291,072 | 397,257,493 |
| アメリカ・ドル | 76,458,061,997 | - | 74,890,483,650 | 1,567,578,347 | 67,235,047,173 | - | 67,331,901,494 | 96,854,321 |
| イギリス・ポンド | 14,597,860,221 | - | 14,116,910,976 | 480,949,245 | 12,089,475,961 | - | 11,796,122,688 | 293,353,273 |
| オーストラリア・ドル | 3,228,257,404 | - | 3,043,740,100 | 184,517,304 | 3,002,298,145 | - | 3,046,972,436 | 44,674,291 |
| カナダ・ドル | 3,570,519,928 | - | 3,419,050,460 | 151,469,468 | 3,171,652,118 | - | 3,142,337,588 | 29,314,530 |
| シンガポール・ドル | 604,541,770 | - | 585,474,192 | 19,067,578 | 538,930,659 | - | 537,569,214 | 1,361,445 |
| スウェーデン・クローナ | 808,510,027 | - | 781,224,185 | 27,285,842 | 770,506,456 | - | 760,970,548 | 9,535,908 |
| デンマーク・クローネ | 1,095,429,760 | - | 1,072,055,580 | 23,374,180 | 1,083,011,624 | - | 1,079,080,380 | 3,931,244 |
| ノルウェー・クローネ | 449,906,094 | - | 436,601,998 | 13,304,096 | 376,034,632 | - | 370,342,098 | 5,692,534 |
| ポーランド・ズロチ | 945,190,963 | - | 911,039,836 | 34,151,127 | 907,211,222 | - | 898,526,720 | 8,684,502 |
| マレーシア・リンギット | 694,021,720 | - | 680,677,100 | 13,344,620 | 652,201,812 | - | 651,755,300 | 446,512 |
| メキシコ・ペソ | 1,740,865,289 | - | 1,647,179,154 | 93,686,135 | 1,355,969,521 | - | 1,359,446,750 | 3,477,229 |
| ユーロ | 71,587,297,452 | - | 70,044,743,683 | 1,542,553,769 | 63,231,514,627 | - | 63,030,808,986 | 200,705,641 |
| 南アフリカ・ランド | 711,783,896 | - | 642,865,404 | 68,918,492 | 704,694,615 | - | 715,456,870 | 10,762,255 |
| 合計 | 176,492,246,521 | - | 172,272,046,318 | 4,220,200,203 | 155,118,548,565 | - | 154,721,291,072 | 397,257,493 |

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.3190円 | 1.3892円 |
| （1万口当たり純資産額） | （13,190円） | （13,892円） |

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 504,593,573 | 1,913,540,021 |
| コール・ローン | | 39,386,400 | 165,821,823 |
| 株式 | | 30,903,849,398 | 34,364,026,070 |
| 投資信託受益証券 | | 213,344,522 | 238,713,333 |
| 投資証券 | | 99,523,361 | 112,514,755 |
| 派生商品評価勘定 | | - | 75,339,411 |
| 未収入金 | | - | 779,327 |
| 未収配当金 | | 15,714,978 | 213,239,791 |
| 差入委託証拠金 | | 296,519,211 | 370,605,641 |
| 流動資産合計 | | 32,072,931,443 | 37,454,580,172 |
| 資産合計 | | 32,072,931,443 | 37,454,580,172 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 50,458,335 | 3,573,072 |
| 未払金 | | 126,028,250 | 863,610,121 |
| 未払解約金 | | 16,871,000 | 13,690,000 |
| 流動負債合計 | | 193,357,585 | 880,873,193 |
| 負債合計 | | 193,357,585 | 880,873,193 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 39,843,963,916 | 44,260,154,983 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | 2 | 7,964,390,058 | 7,686,448,004 |
| 元本等合計 | | 31,879,573,858 | 36,573,706,979 |
| 純資産合計 | | 31,879,573,858 | 36,573,706,979 |
| 負債純資産合計 | | 32,072,931,443 | 37,454,580,172 |

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28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--|-----------------|-----------------|
| 1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額 | 40,747,420,132円 | 39,843,963,916円 |
| 同期中追加設定元本額 | 3,684,100,163円 | 14,378,345,545円 |
| 同期中一部解約元本額 | 4,587,556,379円 | 9,962,154,478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 > | 870,537,540円 | 1,288,572,678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) | 19,979,163円 | 109,971,037円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 8,599,925円 | 9,493,872円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 25,440,862円 | 25,710,953円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 81,231,193円 | 39,215,095円 |
| グローバル8資産ラップファン ド(安定型) | 21,077,324円 | 19,789,538円 |
| グローバル8資産ラップファン ド(中立型) | 21,035,717円 | 22,745,716円 |
| グローバル8資産ラップファン ド(積極型) | 27,436,748円 | 15,870,387円 |
| たわらノーロード 新興国株式 | - 円 | 428,760,326円 |
| たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け> | - 円 | 12,626,903円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 510,196,135円 | 534,755,049円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10) | 29,658,485円 | 35,045,169円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20) | 76,889,791円 | 98,599,627円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30) | 188,143,542円 | 212,453,833円 |
| 投資のソムリエ | 1,077,540,227円 | 1,812,394,970円 |
| クルーズコントロール | 462,865,911円 | 1,236,123,712円 |
| 投資のソムリエ< D C 年金 > | 19,208,691円 | 41,920,471円 |
| D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C 年金 > | 84,150,830円 | 124,852,987円 |
| クルーズコントロール< D C 年 金 > | 72,955円 | 335,983円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 8,415,198円 | 19,941,295円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 11,161,515円 | 49,625,147円 |
| 投資のソムリエ< D C 年金 >リ スク抑制型 | 234,481円 | 6,129,158円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | - 円 | 545,601円 |

| | | | |
|-----|--|---|---|
| | エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用) | 7,098,394,804円 | 7,655,896,389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) | 2,145,904,763円 | 2,193,601,345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) | 16,439,453,886円 | 17,211,263,822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) | 10,425,305,887円 | 10,863,480,254円 |
| | 計 | 39,843,963,916円 | 44,260,154,983円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 39,843,963,916口 | 44,260,154,983口 |
| 3 . | 2 元本の欠損 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,964,390,058円であります。 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,686,448,004円であります。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

| 種類 | 平成28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12日 現在 | | | |
|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | - | - | - | - | 212,547,798 | - | 216,119,132 | 3,571,334 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 212,547,798 | - | 216,119,132 | 3,571,334 |
| 買 建 | 153,134,540 | - | 153,127,000 | 7,540 | 329,266,388 | - | 335,057,456 | 5,791,068 |
| アメリカ・ドル | 153,134,540 | - | 153,127,000 | 7,540 | - | - | - | - |
| インドネシア・ルピア | - | - | - | - | 17,844,335 | - | 18,034,910 | 190,575 |
| コロンビア・ペソ | - | - | - | - | 6,044,824 | - | 6,132,580 | 87,756 |
| タイ・バーツ | - | - | - | - | 23,548,743 | - | 23,891,100 | 342,357 |
| フィリピン・ペソ | - | - | - | - | 8,025,375 | - | 8,137,500 | 112,125 |
| ブラジル・リアル | - | - | - | - | 72,249,141 | - | 73,265,646 | 1,016,505 |
| マレーシア・リンギット | - | - | - | - | 28,225,705 | - | 28,824,180 | 598,475 |
| メキシコ・ペソ | - | - | - | - | 38,895,150 | - | 39,627,000 | 731,850 |
| 台湾・ドル | - | - | - | - | 116,409,498 | - | 118,668,000 | 2,258,502 |
| 南アフリカ・ランド | - | - | - | - | 18,023,617 | - | 18,476,540 | 452,923 |
| 合計 | 153,134,540 | - | 153,127,000 | 7,540 | 541,814,186 | - | 551,176,588 | 2,219,734 |

(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28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12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 | 854,188,415 | - | 803,737,620 | 50,450,795 | 1,772,295,700 | - | 1,841,842,305 | 69,546,605 |
| 合計 | 854,188,415 | - | 803,737,620 | 50,450,795 | 1,772,295,700 | - | 1,841,842,305 | 69,546,605 |

(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。

- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 0.8001円 | 0.8263円 |
| (1万口当たり純資産額) | (8,001円) | (8,263円) |

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 1,681,575,183 | 3,570,541,099 |
| コール・ローン | | 25,347,818 | 723,278,214 |
| 国債証券 | | 45,261,801,641 | 51,366,112,029 |
| 派生商品評価勘定 | | 290,000 | 12,619,440 |
| 未収入金 | | 7,879,336,545 | - |
| 未収利息 | | 689,019,990 | 683,319,278 |
| 前払費用 | | 340,566,713 | 138,750,189 |
| 流動資産合計 | | 55,877,937,890 | 56,494,620,249 |
| 資産合計 | | 55,877,937,890 | 56,494,620,249 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 2,951,000 | - |
| 未払金 | | 252,327,600 | 2,886,677,215 |
| 未払解約金 | | 12,725,000 | 10,146,000 |
| 流動負債合計 | | 268,003,600 | 2,896,823,215 |
| 負債合計 | | 268,003,600 | 2,896,823,215 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 32,117,451,125 | 31,262,426,139 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 23,492,483,165 | 22,335,370,895 |
| 元本等合計 | | 55,609,934,290 | 53,597,797,034 |
| 純資産合計 | | 55,609,934,290 | 53,597,797,034 |
| 負債純資産合計 | | 55,877,937,890 | 56,494,620,249 |

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28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|---|--|---|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額 | 33,612,660,964円 9,349,272,948円 10,844,482,787円 | 32,117,451,125円 15,989,325,978円 16,844,350,964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） | 13,743,994円 | 94,766,105円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 62,230,620円 | 66,007,340円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10） | 15,001,959円 | 16,757,240円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20） | 38,845,125円 | 46,563,531円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30） | 95,788,554円 | 101,573,970円 |
| 投資のソムリエ | 1,426,851,882円 | 2,864,387,945円 |
| クルーズコントロール | 249,216,579円 | 587,740,770円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 25,542,585円 | 66,121,012円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 42,875,511円 | 58,760,088円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 39,295円 | 159,825円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型） | 2,268,568円 | 4,714,367円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 3,061,585円 | 11,801,452円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 351,697円 | 12,547,457円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | - 円 | 390,666円 |
| エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定) | 5,714,487,906円 | 3,120,641,050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) | 436,148,271円 | 503,111,358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) | 3,685,046,795円 | 3,663,571,532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) | 8,357,358,025円 | 8,220,355,918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) | 5,300,140,113円 | 5,178,166,088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) | 2,965,384,800円 | 3,037,431,770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) | 3,683,067,261円 | 3,606,856,655円 |
| 計 | 32,117,451,125円 | 31,262,426,139円 |
| 2 . 受益権の総数 | 32,117,451,125口 | 31,262,426,139口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

| 種類 | 平成28年1月12日 現在 | | | | 平成28年7月12日 現在 | | | |
|-----------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 8,560,672,000 | - | 8,563,333,000 | 2,661,000 | - | - | - | - |
| アメリカ・ドル | 8,560,672,000 | - | 8,563,333,000 | 2,661,000 | - | - | - | - |
| 買 建 | - | - | - | - | 685,468,560 | - | 698,088,000 | 12,619,440 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 685,468,560 | - | 698,088,000 | 12,619,440 |
| 合計 | 8,560,672,000 | - | 8,563,333,000 | 2,661,000 | 685,468,560 | - | 698,088,000 | 12,619,440 |

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成28年1月12日現在 | 平成28年7月12日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.7315円 (17,315円) | 1.7144円 (17,144円) |

2【ファンドの現況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 232,082,709円 |
| 負債総額 | 714,429円 |
| 純資産総額（ - ） | 231,368,280円 |
| 発行済数量 | 222,370,614口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0405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7月29日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 283,753,919,033円 |
| 負債総額 | 744,207,668円 |
| 純資産総額（ - ） | 283,009,711,365円 |
| 発行済数量 | 146,094,339,413口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.9372円 |

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 398,735,456,342円 |
| 負債総額 | 10,246,604,000円 |
| 純資産総額（ - ） | 388,488,852,342円 |
| 発行済数量 | 295,667,334,525口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3139円 |

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 24,553,451,575円 |
| 負債総額 | 85,319,000円 |
| 純資産総額（ - ） | 24,468,132,575円 |
| 発行済数量 | 13,458,318,935口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.8181円 |

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 259,987,986,034円 |
| 負債総額 | 254,940,508円 |
| 純資産総額（ - ） | 259,733,045,526円 |
| 発行済数量 | 101,479,245,363口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.5595円 |

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 34,948,764,639円 |
| 負債総額 | 14,484,000円 |
| 純資産総額(-) | 34,934,280,639円 |
| 発行済数量 | 30,411,475,690口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.1487円 |

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 161,351,994,619円 |
| 負債総額 | 2,559,801,703円 |
| 純資産総額(-) | 158,792,192,916円 |
| 発行済数量 | 114,499,572,438口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.3868円 |

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 38,268,118,676円 |
| 負債総額 | 328,429,636円 |
| 純資産総額(-) | 37,939,689,040円 |
| 発行済数量 | 43,579,576,666口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.8706円 |

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 53,948,501,547円 |
| 負債総額 | 32,540,000円 |
| 純資産総額(-) | 53,915,961,547円 |
| 発行済数量 | 31,404,166,557口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.7168円 |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。

平成28年7月29日現在、D I A Mアセットマネジメント株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額（単位：円） |
|------------|-----|-------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 追加型株式投資信託 | 389 | 5,918,600,293,964 |
| 単位型公社債投資信託 | 48 | 353,027,465,726 |
| 単位型株式投資信託 | 7 | 79,600,055,072 |
| 合計 | 444 | 6,351,227,814,762 |

（ご参考）

平成28年7月29日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

・みずほ投信投資顧問株式会社

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額(円) |
|------------|-----|-------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 13 | 250,148,557,515 |
| 追加型株式投資信託 | 234 | 2,260,638,584,910 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 3 | 1,491,433,486 |
| 合計 | 250 | 2,512,278,575,911 |

・新光投信株式会社

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額(円) |
|-------|----|----------|
|-------|----|----------|

| | | |
|------------|-----|-------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 25 | 622,747,870,142 |
| 追加型株式投資信託 | 244 | 3,210,390,488,192 |
| 単位型公社債投資信託 | 6 | 40,614,819,596 |
| 単位型株式投資信託 | 75 | 269,539,047,169 |
| 合計 | 350 | 4,143,292,225,099 |

独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月25日

DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型の平成28年1月13日から平成28年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型の平成28年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年1月13日から平成28年7月12日まで）の損益の状況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

DIAM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。

XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。