

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年1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 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	MITO ラップ型ファンド(安定型) MITO ラップ型ファンド(中立型) MITO ラップ型ファンド(積極型) MITO ラップ型ファンド(安定型) 5,000億円を上限とします。
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	MITO ラップ型ファンド(中立型) 5,000億円を上限とします。 MITO ラップ型ファンド(積極型) 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

MITO ラップ型ファンド（安定型）

MITO ラップ型ファンド（中立型）

MITO ラップ型ファンド（積極型）

（以下、総称して「MITO ラップ型ファンド」、「MITO ラップ型ファンド（安定型／中立型／積極型）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「MITO ラップ型ファンド（安定型）」は「安定型」、「MITO ラップ型ファンド（中立型）」は「中立型」、「MITO ラップ型ファンド（積極型）」は「積極型」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「グッドラップ」または「グッドラップ（安定型／中立型／積極型）」という名称を用いる場合があります。また、「MITO ラップ型ファンド（安定型）」の愛称として「グッドラップ（安定型）」、「MITO ラップ型ファンド（中立型）」の愛称として「グッドラップ（中立型）」、「MITO ラップ型ファンド（積極型）」の愛称として「グッドラップ（積極型）」を用いる場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
(ファンドの略称 安定型：グッドラ安定、中立型：グッドツ中立、積極型：グッドプ積極)

(5) 【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成29年1月13日から平成30年1月12日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は以下の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

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

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

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

<スイッチングについて>

「安定型」「中立型」「積極型」の3つのファンド間でスイッチングを行うことができます。

スイッチングとは、すでに保有しているファンドを解約すると同時に他のファンドの取得の申込みを行うことをいい、ファンドの解約代金が買付代金に充当されます。

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

販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドは、別に定める投資信託証券を投資対象とする「ファンド・オブ・ファンズ方式」で運用します。

別に定める投資信託証券とは、以下の投資信託証券をいいます。

国内株式	親投資信託	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
国内債券	親投資信託	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
先進国株式	親投資信託	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
先進国債券	親投資信託	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
新興国株式	親投資信託	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
新興国債券	外国投資信託証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
世界リート	親投資信託	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
	親投資信託	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
コモディティ	親投資信託	コモディティインデックス・マザーファンド

上記の投資信託証券のうち親投資信託のことを以下「マザーファンド」という場合があります。

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

< ファンドの特色 >

1

世界の様々な資産に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。

- ・主として、投資信託証券への投資を通じて、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、世界リート、コモディティ^(*)等の資産に実質的に投資します。なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。
- ・投資対象となる投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、必要な場合は追加、除外、入替えを行う場合があります。
- ・実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円で為替ヘッジを行いません。

(*) コモディティ(商品)への投資に際しては、投資信託証券への投資を通じて、商品指数の動きに概ね連動する投資成果をめざす債券等に実質的に投資を行います。

2

「安定型」、「中立型」、「積極型」の3つのファンドから選択できます。

- ・お客さまのリスク許容度に応じて、目標リスク水準の異なる以下の3つのファンドがあります。

<各ファンドの目標リスク水準>

「安定型」:年率標準偏差 2.5~5.0%程度

「中立型」:年率標準偏差 5.0~8.0%程度

「積極型」:年率標準偏差 8.0~12.0%程度

- ・各ファンド間でスイッチングが可能です。

※目標リスク水準は、各ファンドの基準価額の変動リスクの目安を示したものであり、ポートフォリオを構築する際の目標値として使用します。なお、市場環境等によっては、実際の基準価額の変動が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

※スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

3

各資産への投資割合の決定にあたっては、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

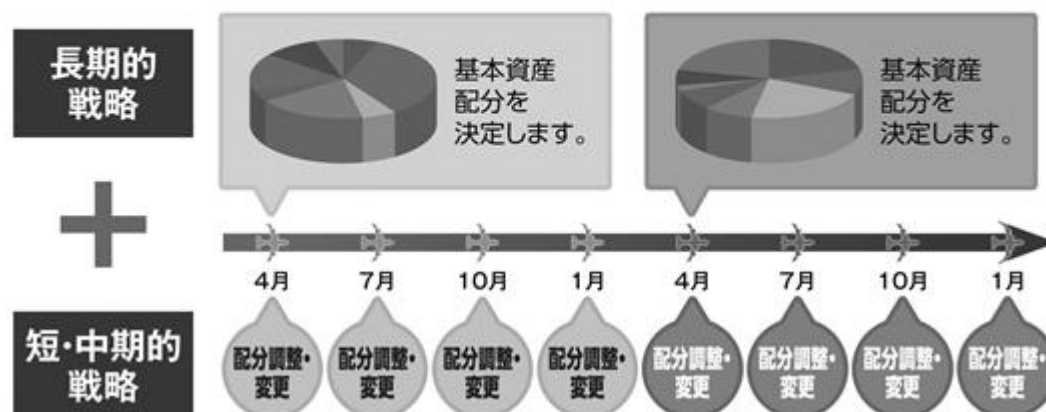
- ・各ファンドの目標リスク水準に応じて、長期的見通しと短・中期的見通しを組み合わせ、市場環境の変化に対応した適切な資産配分をめざします。
- ・長期的視点に基づく資産配分戦略により、基本資産配分を決定します(長期的戦略)。当該戦略は、原則として年1回見直しを行います。
- ・上記に加え、短・中期的視点に基づく資産配分戦略により、市場環境の変化に対応した資産配分を行います(短・中期的戦略)。当該戦略は、原則として四半期毎に見直しを行います。
- ・なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合等には、適宜、資産配分の見直しを行う場合があります。

※市場環境等によっては、一部の資産への投資割合がゼロとなる場合があります。

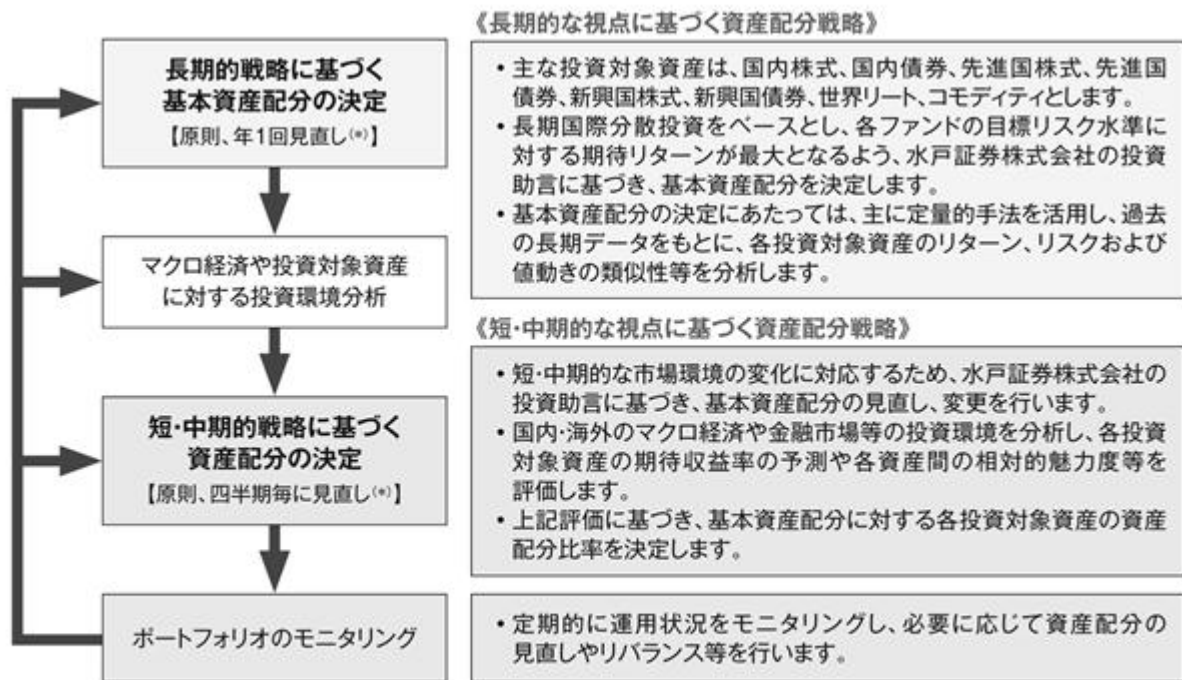
※コモディティへの投資割合は、原則として、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

✦ 資産配分のイメージ

年に1回、長期的戦略に基づき基本資産配分を決定し、それに対して、四半期毎に、短・中期的戦略に基づき機動的な資産配分の調整・変更を行います。



<運用プロセス>



※各資産への投資割合の決定にあたっては、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

(*)市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合等には、適宜、資産配分の見直しを行う場合があります。

商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

属性区分表

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型）」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。

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

決算頻度

「年1回」とは目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域

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

投資形態

「ファンド・オブ・ファンズ」とは「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

為替ヘッジ

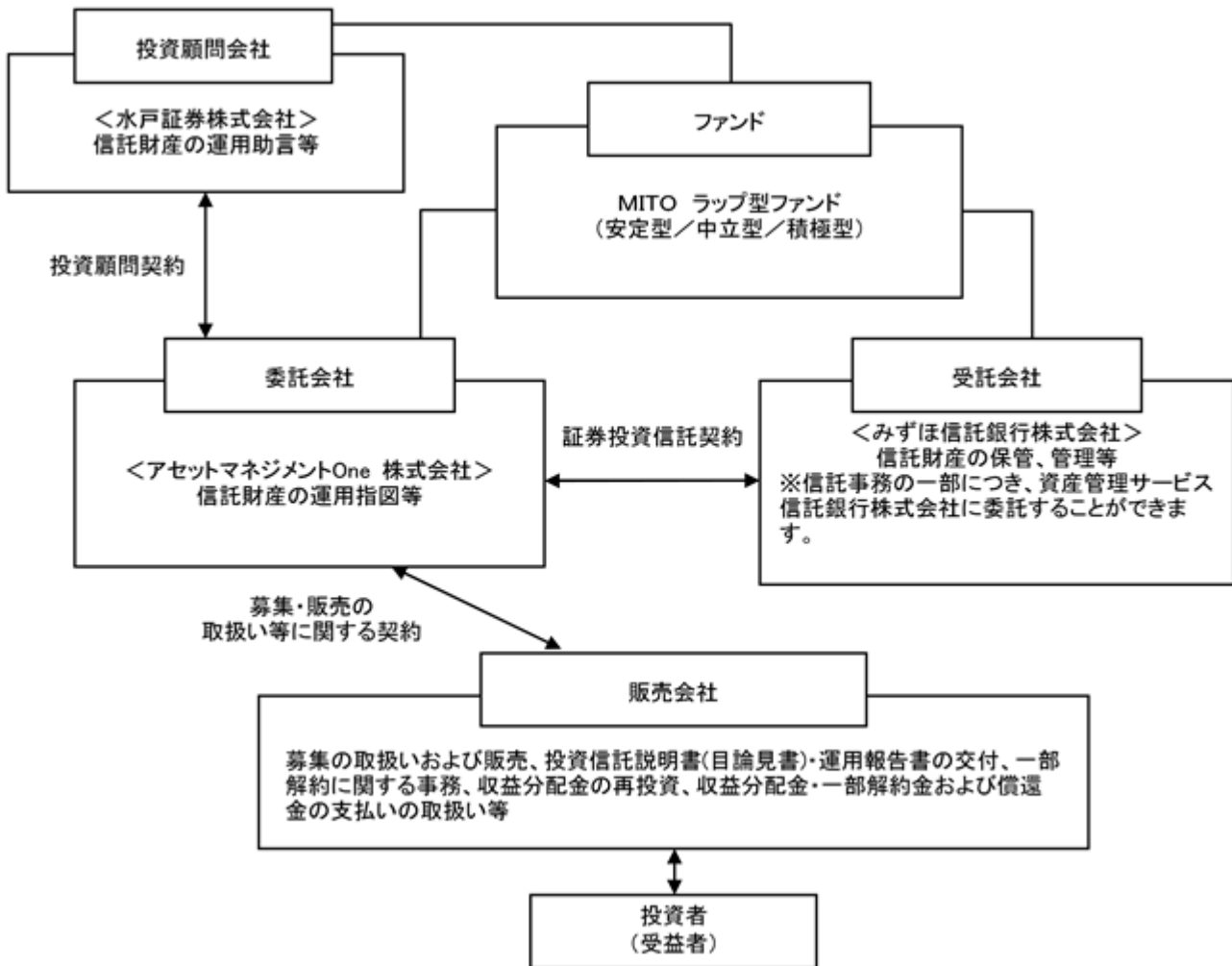
「なし」とは目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

(2)【ファンドの沿革】

平成27年12月1日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

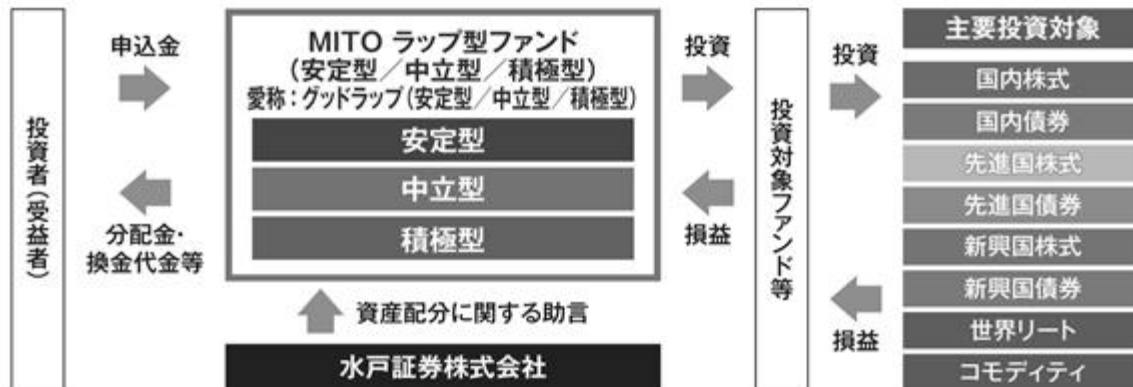
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（水戸証券株式会社）の間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

ファンド・オブ・ファンズ方式とは

各ファンドは、「ファンド・オブ・ファンズ方式」により運用を行います。「ファンド・オブ・ファンズ方式」とは、複数のファンドを投資対象とし、それらを組み合わせて運用する仕組みです。



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

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

資本金の額

20億円（平成28年10月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、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）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（平成28年10月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。

<投資態度>

主として、別に定める投資信託証券への投資を通じて、実質的に、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、世界リート、コモディティ^(*)等の各資産へ投資を行い、世界の様々な資産に分散投資を行います。なお、上記のほか、短期金融資産等に直接投資する場合があります。

(*)コモディティ（商品）への投資に際しては、投資信託証券への投資を通じて、商品指数の動きに概ね連動する投資成果をめざす債券等を実質的に投資を行います。

各資産への投資割合は、目標リスク水準に応じて、長期的見通しに基づく基本資産配分と短・中期的見通しに基づく資産配分を組み合わせで決定します。上記投資割合は定期的に見直しを行うほか、市場環境等によっては不定期に見直しを行う場合があります。なお、市場環境等によっては、一部の資産への投資割合がゼロとなる場合があります。

コモディティへの投資割合は、原則として、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

各資産への投資割合について、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、必要な場合は追加、除外、入替えを行う場合があります。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．金銭債権
 - ハ．約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

運用の指図範囲等（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.の証券の性質を有するもの
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

運用の指図範囲等（約款第16条第2項）

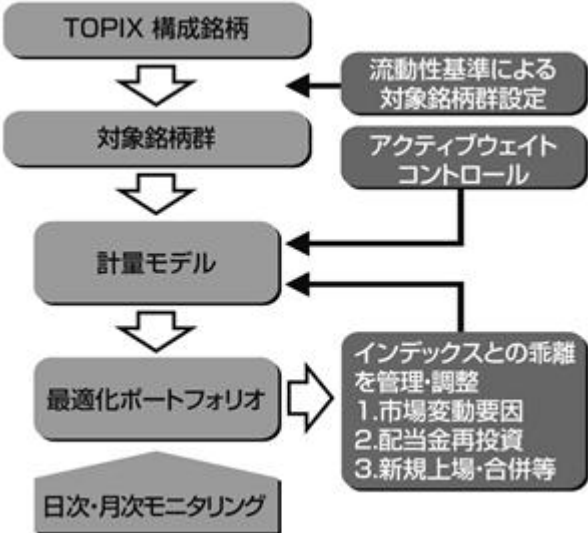
委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

（参考）各ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p><p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p><p>株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p><p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p><p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p><p>株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p></div>
------	---

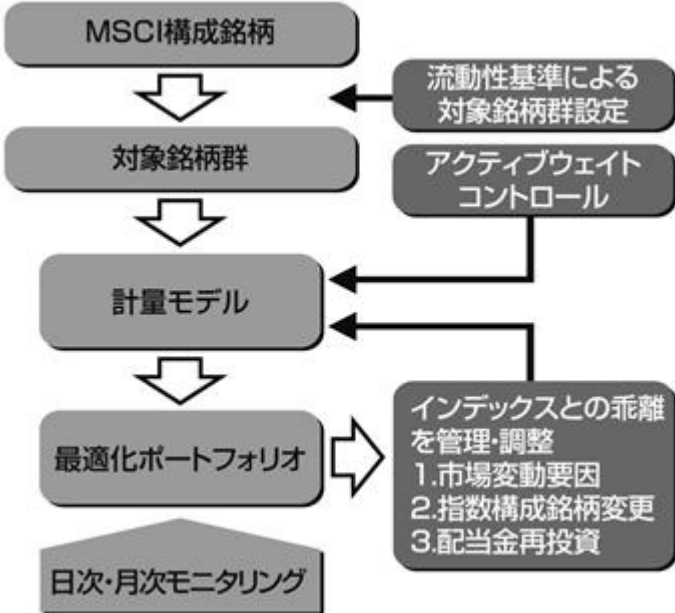
運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> 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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

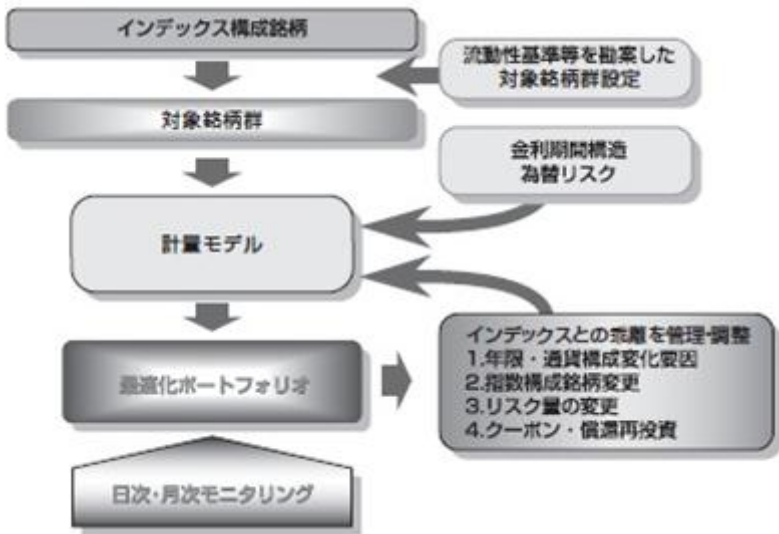
<p>投資態度</p>	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p> </div>
<p>運用プロセス</p>	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p> <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre> graph TD A[NOMURA-BPI総合構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利の期間構造・スプレッド変動リスク] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] --> D </pre> </div>

主な投資制限	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>
運用会社 (委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

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

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

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[金利期間構造 為替リスク] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理調整 1.年限・通貨構成変化要因 2.指数構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
主な投資制限	<p>1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2.同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>
運用会社 (委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。

信託報酬	ありません。
------	--------

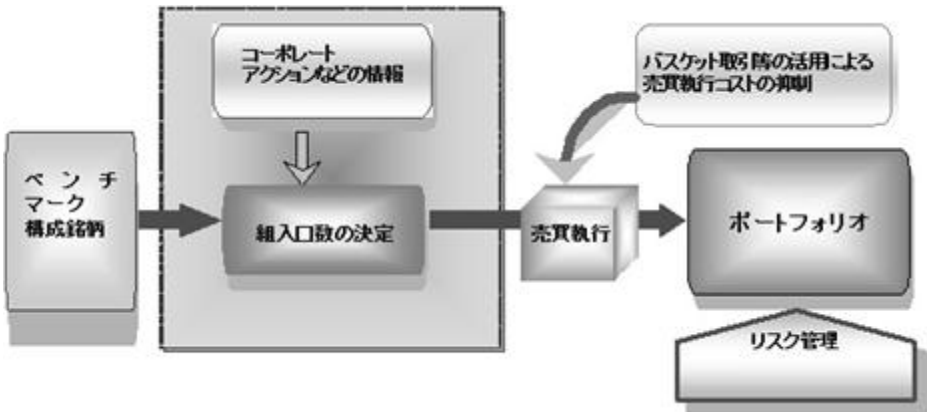
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式 ^(*) に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 (*)DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配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

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
ファンドの形態等	オープンエンド型の外国投資信託（契約型）

表示通貨	米ドル										
ファンドの目的および基本的性格	J.P. モルガン EMBI グローバル・コア・インデックス（以下「対象指数」といいます。）の価格および利回りの実績に概ね対応する投資成果（手数料および経費控除前）をあげることがを目標としています。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>J.P. モルガン EMBI グローバル・コア・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ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>										
主要関係法人	運用会社 ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ(BFA) 受託者 ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー										
投資の基本方針	対象指数は、幅広く多様な米ドル建て新興国債券市場を表す指数であり、新興国で活発に取引されている対外債券商品のトータル・リターンを測定します。債務残高が高い国の構成比率を制限し、制限からの超過分を債務残高が低い国に割り当てることで構成国の比率を調整しています。当ファンドは、サンプリング手法を利用して対象指数への連動を試みます。										
主な投資制限	当ファンドは、原則として以下を行いません。 <ul style="list-style-type: none"> ・投資の集中（総資産の25%以上を特定の産業または産業グループの証券に投資すること）。但し、当ファンドは、対象指数とほぼ同程度に特定の産業または産業グループの証券に投資を集中する。 ・借入れ（例外的に借入れを行う場合でも、総資産の3分の1を超えてはならない） ・優先証券の発行 ・貸付け ・不動産、商品、商品契約の売買（但し、当ファンドは不動産業を営む企業の証券や、不動産や不動産抵当権により担保されている証券やその他金融商品に投資することができる。） ・証券の引受業務 ・経営権または支配権を行使するために会社の有価証券に投資すること ・流動性のない有価証券を純資産総額の15%超保有すること など										
運用報酬等	運用会社は、運用報酬として、当該ETFの属するファンドグループの純資産総額の日々平均残高の合計額に対して以下の料率にしたがって計算される運用報酬の合計額のうち、当該ETFにかかる割当額を受領します。 ただし、平成30年2月28日までの期間については、運用報酬の一時引き下げが適用され、年間総経費率が0.40%を超えないこととしております。（終了日は変更される可能性があります）。 <table border="1" style="width: 100%; margin-top: 10px;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">ファンドグループの純資産総額の合計額</th> <th style="text-align: center;">左記の残高レンジに適用される運用報酬率（年率）</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">190億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.6000%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">190億ドル超330億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.5700%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">330億ドル超470億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.5415%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">470億ドル超</td> <td style="text-align: center;">0.5145%</td> </tr> </tbody> </table>	ファンドグループの純資産総額の合計額	左記の残高レンジに適用される運用報酬率（年率）	190億ドル以下	0.6000%	190億ドル超330億ドル以下	0.5700%	330億ドル超470億ドル以下	0.5415%	470億ドル超	0.5145%
ファンドグループの純資産総額の合計額	左記の残高レンジに適用される運用報酬率（年率）										
190億ドル以下	0.6000%										
190億ドル超330億ドル以下	0.5700%										
330億ドル超470億ドル以下	0.5415%										
470億ドル超	0.5145%										

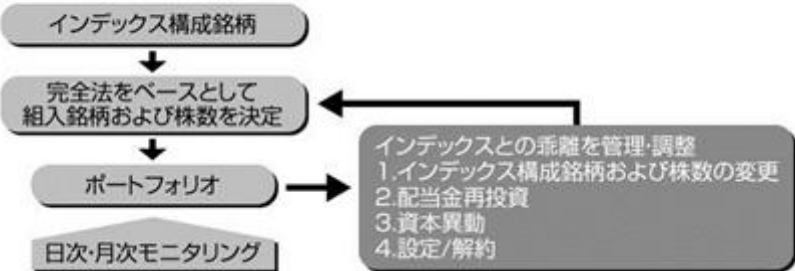
ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数(配当込み)が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>

運用プロセス	<p>1.原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>2.新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</p> <p>3.配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</p> 
主な投資制限	<p>1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>2.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>3.株式への投資は行いません。</p> <p>4.外貨建資産への投資は行いません。</p>
運用会社 (委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

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

投資態度	<p>1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</p> <p>Standard & Poor's®並びに S&P®は、スタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、委託会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P 先進国 REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、委託会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、委託会社の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追従する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの委託会社に対するS&P 先進国 REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。</p> <p>S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、委託会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、委託会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。</p>
------	--

	<p>S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくは委託会社を得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害（利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む）について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスと委託会社間での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] D --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
運用会社 （委託会社）	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

ファンド名	コモディティインデックス・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主としてS&P GSCI商品指数に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	S&P GSCI商品指数に連動するユーロドル債（証券を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として、S&P GSCI商品指数 に連動するユーロドル債（証券を含みます。）等に投資することにより、S&P GSCI商品指数の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.ユーロドル債（証券を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向、資金動向、信託財産の規模等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いませんが、金利、為替状況によっては為替ヘッジを行う場合があります。</p> <p>4.ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき、ならびにS&P GSCI商品指数が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>S&P GSCI商品指数（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、それを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones TrademarkHoldings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに付与されています。S&P®、S&P GSCI®およびS&P GSCI商品指数はS&Pの商標であり、これらを利用するライセンスがSPDJIとその関連会社に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。S&P GSCI商品指数は、Goldman Sachs & Co.またはその関連会社によって所有、保証、または承認されたものではなく、これら会社とは一切関係がありません。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、SPDJI、Dow Jones、S&P、それぞれの関連会社、または第三者のライセンサーのいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行いません。</p> </div>
運用プロセス	<p>主にコモディティインデックスに連動するユーロドル債(証券を含む)等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目標に運用を行います。</p> <pre> graph TD Index[インデックス] --> Bonds[ユーロドル債等 (証券を含む)] Bonds --> Fund[ファンド] Monitor1[連動性モニタリング 信用リスクモニタリング] --> Index Monitor2[組み入れ比率管理 資金管理] --> Fund Monitor3[日々・月次モニタリング] --> Fund </pre>

主な投資制限	1.株式への投資は行いません。 2.外貨建資産の投資割合には、制限を設けません。
運用会社 (委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

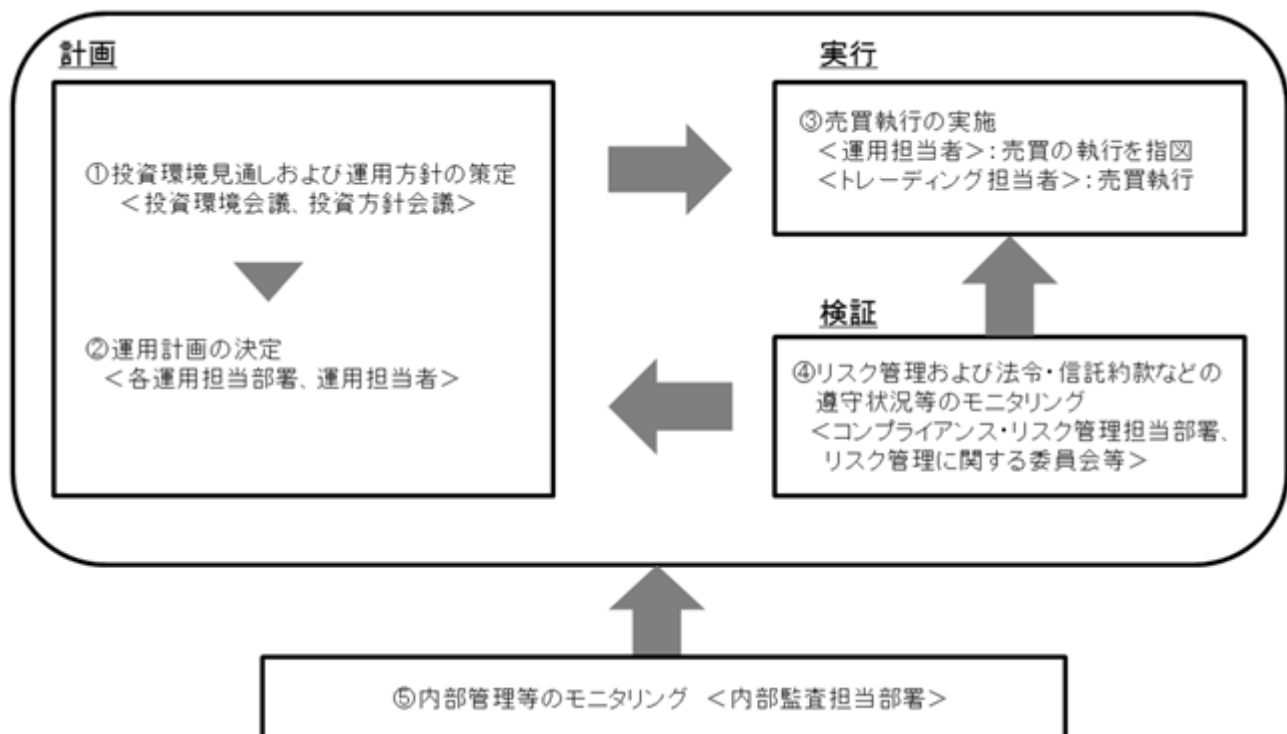
(注1) 上記内容は原則として、平成28年10月末時点の情報をもとに作成したものであり、今後、投資信託証券は追加・除外・入替等が行われることがあります。

(注2) 「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF」はブラックロック・ジャパン株式会社提供の資料を基に作成し、同社の確認のもと掲載したものです。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的開催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b. ファンドの関係法人に関する管理

当ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c. 運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は平成28年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（4）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

1. 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

株式への直接投資は行いません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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

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

デリバティブ取引の直接利用は行いません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第19条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第20条)

(1)委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額と別に定める投資信託証券のうち親投資信託(以下「マザーファンド」といいます。)に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(2)上記(1)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

資金の借入れ(約款第26条)

(1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

(4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

となる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

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

株価変動リスク

ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。新興国株式に投資する場合、先進国株式に比べ株価変動リスクが大きくなる傾向があります。

金利リスク

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。新興国債券に投資する場合、先進国債券に比べ金利リスクが大きくなる傾向があります。

リートの価格変動リスク

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

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

為替リスク

ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。新興国通貨に投資する場合、先進国通貨に比べ為替リスクが大きくなる傾向があります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

コモディティ市況の変動リスク

一般にコモディティ価格は商品の需給関係の変化、為替、金利の変化など様々な要因で変動します。需給関係は、天候、作況、生産国の政治、経済の変化、貿易動向等の影響を大きく受けます。ファンドは、実質的にコモディティに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

<その他の留意点>

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

ファンドは、一部マザーファンドに投資を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

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

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

「安定型」「中立型」「積極型」の3つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

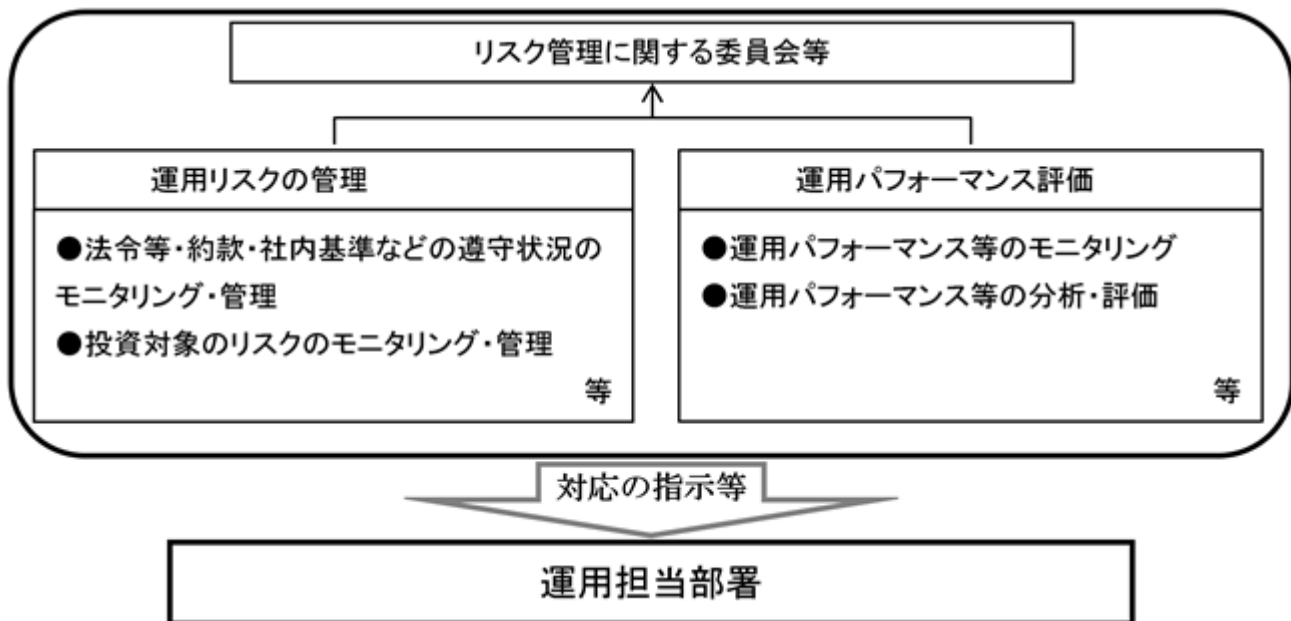
注意事項

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

< リスク管理体制 >

委託会社における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下の通りです。

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

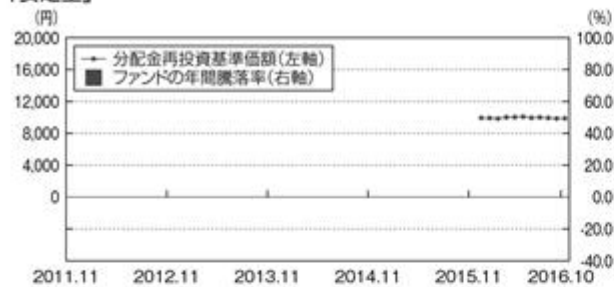


上記体制は平成28年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

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

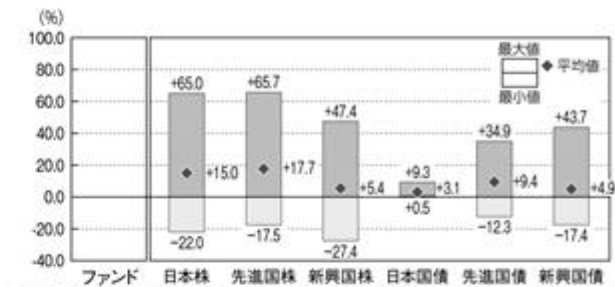
「安定型」



「中立型」

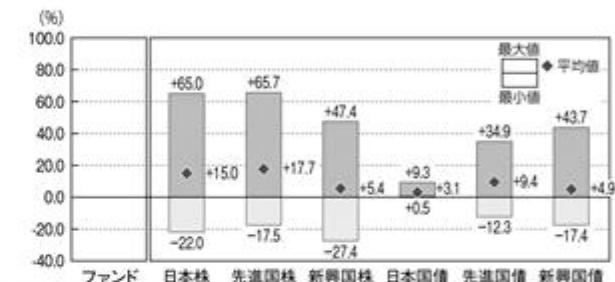


「積極型」

ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

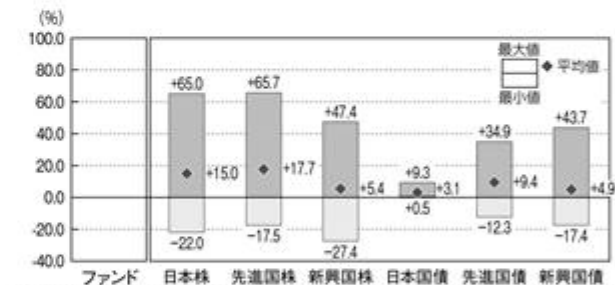
ファンド:2016年10月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2011年11月～2016年10月



ファンド:2016年10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11月～2016年10月



ファンド:2016年10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11月～2016年10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10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・レディバース・シファイド(円ベース)
(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンド	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.3284%（税抜1.23%） 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。 委託会社の信託報酬には、各ファンドにかかる投資顧問報酬が含まれます。</p>		
	支払先	内訳（税抜）	主な役務
	委託会社	年率0.69%	委託した資金の運用の対価
	販売会社	年率0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
	受託会社	年率0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
投資対象とする 外国投資信託	<p>iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETFの純資産総額に対して年率0.40%程度 （注）ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。</p>		

実質的な負担	<p>各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.344744%～1.421864%程度 (税抜1.246344%～1.323464%程度)(概算)</p> <p>上記の概算は、各ファンドの信託報酬率と投資対象とする投資信託証券の信託報酬率を合わせた実質的な信託報酬率であり、各ファンドの長期的戦略および短・中期的戦略に基づいて決定される資産配分に基づき算出したものです(平成28年9月末時点の資産配分に基づき算出)。この値は目安であり、投資対象とする投資信託証券の実際の組入比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることなどから、実質的な信託報酬率は変動することがあり、あらかじめ上限額等を記載することができません。そのため、実質的な信託報酬率は概算で表示しています。</p>
--------	---

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額
ありません。

- ・ その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

投資対象とする投資信託証券でかかる費用等は、間接的にファンドで負担します。当該費用は以下の通りです。

各ファンドが投資対象とする 投資信託証券	主な費用
iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	信託財産に関する租税、組入資産の売買時の売買手数料、信託事務の処理に要する費用、信託財産の監査に要する費用、法律関係の費用、資産の保管などに要する費用、借入金の利息および立替金の利息、ファンドの設立にかかる費用等
マザーファンド	有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用等

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

上記は、平成28年10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	22,946,377	7.20
内 アメリカ	22,946,377	7.20
親投資信託受益証券	278,638,026	87.46
内 日本	278,638,026	87.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16,988,249	5.33
純資産総額	318,572,652	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。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	68,298,510	14.68
内 アメリカ	68,298,510	14.68
親投資信託受益証券	377,250,954	81.06
内 日本	377,250,954	81.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	19,852,647	4.27
純資産総額	465,402,111	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。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	97,311,862	17.59
内 アメリカ	97,311,862	17.59
親投資信託受益証券	423,376,098	76.53
内 日本	423,376,098	76.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	32,561,223	5.89
純資産総額	553,249,183	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	276,746,604,070	96.17
内 日本	276,746,604,070	96.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,007,958,697	3.83
純資産総額	287,754,562,767	100.00

その他資産の投資状況

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,950,750,000	3.81
内 日本	10,950,750,000	3.81

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

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

(注3) 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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	315,370,484,600	83.08
内 日本	315,370,484,600	83.08
地方債証券	23,885,914,662	6.29
内 日本	23,885,914,662	6.29
特殊債券	20,107,276,596	5.30
内 日本	20,107,276,596	5.30
社債券	18,350,846,720	4.83
内 日本	18,050,216,720	4.76
内 オランダ	200,704,000	0.05
内 イギリス	99,926,000	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,880,718,416	0.50
純資産総額	379,595,240,994	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	26,773,611,200	98.91
内 日本	26,773,611,200	98.91
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	293,947,499	1.09
純資産総額	27,067,558,699	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	241,962,492,343	94.91
内 アメリカ	148,700,963,259	58.33
内 イギリス	17,173,979,481	6.74
内 カナダ	9,879,669,754	3.88
内 スイス	9,674,390,895	3.79
内 フランス	9,225,286,730	3.62
内 ドイツ	9,224,854,600	3.62
内 オーストラリア	6,569,946,761	2.58
内 オランダ	4,525,673,587	1.78
内 アイルランド	4,236,654,267	1.66
内 スペイン	3,278,346,089	1.29
内 スウェーデン	2,778,922,968	1.09
内 香港	2,514,673,693	0.99
内 イタリア	1,794,388,634	0.70
内 デンマーク	1,706,623,355	0.67
内 シンガポール	1,699,288,751	0.67
内 ジャージー	1,517,230,253	0.60
内 ベルギー	1,317,382,700	0.52
内 パミュダ	1,066,995,090	0.42
内 フィンランド	970,869,475	0.38
内 オランダ領キュラソー	919,511,551	0.36
内 ケイマン諸島	659,325,633	0.26
内 ノルウェー	639,219,068	0.25
内 イスラエル	633,439,497	0.25
内 ルクセンブルグ	287,350,933	0.11
内 オーストリア	212,462,349	0.08
内 ニューゼーランド	173,324,079	0.07
内 ポルトガル	155,911,368	0.06
内 パナマ	127,184,410	0.05
内 リベリア	105,943,674	0.04
内 イギリス領バージン諸島	76,132,378	0.03
内 パプアニューギニア	62,949,288	0.02
内 マン島	33,008,373	0.01
内 モーリシャス	20,589,400	0.01
投資信託受益証券	790,717,250	0.31

	内 オーストラリア	674,061,966	0.26
	内 シンガポール	116,655,284	0.05
投資証券		5,745,562,235	2.25
	内 アメリカ	4,955,620,061	1.94
	内 フランス	337,848,526	0.13
	内 イギリス	230,725,601	0.09
	内 香港	134,591,600	0.05
	内 カナダ	86,776,447	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,432,710,212	2.52
純資産総額		254,931,482,040	100.00

その他資産の投資状況

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	20,970,000	0.01
-	20,970,000	0.01
為替予約取引(売建)	18,279,000	0.01
-	18,279,000	0.01
株価指数先物取引(買建)	6,359,825,083	2.49
内 アメリカ	4,197,827,611	1.65
内 ドイツ	1,158,507,480	0.45
内 イギリス	498,529,740	0.20
内 オーストラリア	261,303,918	0.10
内 カナダ	243,656,334	0.10

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	247,684,801,869	97.18
内 アメリカ	109,446,369,345	42.94
内 フランス	25,414,939,200	9.97
内 イタリア	24,061,981,224	9.44
内 ドイツ	18,729,006,040	7.35
内 イギリス	17,280,521,438	6.78
内 スペイン	13,918,949,405	5.46
内 ベルギー	6,287,349,205	2.47
内 オランダ	5,839,295,910	2.29
内 カナダ	5,033,368,412	1.97
内 オーストラリア	4,948,115,944	1.94
内 オーストリア	3,695,820,013	1.45
内 メキシコ	2,090,929,049	0.82
内 アイルランド	1,924,097,243	0.75
内 デンマーク	1,651,219,105	0.65
内 ポーランド	1,445,439,964	0.57
内 フィンランド	1,361,234,857	0.53
内 南アフリカ	1,118,801,928	0.44
内 マレーシア	1,053,283,560	0.41
内 スウェーデン	987,699,402	0.39
内 シンガポール	836,498,751	0.33
内 ノルウェー	559,881,874	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,194,925,479	2.82
純資産総額	254,879,727,348	100.00

その他資産の投資状況

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	203,241,100	0.08
-	203,241,100	0.08
為替予約取引（売建）	35,550,450	0.01
-	35,550,450	0.01

（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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,696,464,629	11.16
内 オーストラリア	2,654,036,795	8.01
内 シンガポール	1,033,102,906	3.12
内 カナダ	9,324,928	0.03
投資証券	29,298,101,479	88.44
内 アメリカ	23,859,837,355	72.02
内 イギリス	1,599,106,700	4.83
内 フランス	1,505,431,744	4.54
内 カナダ	624,193,355	1.88
内 香港	618,950,273	1.87
内 ベルギー	246,321,389	0.74
内 スペイン	207,477,492	0.63
内 ニュージーランド	173,694,150	0.52
内 オランダ	164,095,801	0.50
内 アイルランド	78,799,692	0.24
内 シンガポール	69,769,199	0.21
内 ドイツ	66,904,093	0.20
内 イタリア	27,626,895	0.08
内 マン島	20,668,987	0.06
内 ガーンジー	20,228,598	0.06
内 イスラエル	14,995,756	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	133,364,553	0.40
純資産総額	33,127,930,661	100.00

その他資産の投資状況

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	35,586,250	0.11
-	35,586,250	0.11

（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。

コモディティインデックス・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	2,471,816,796	99.87
内 イギリス	2,471,816,796	99.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,183,377	0.13
純資産総額	2,475,000,173	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	36,167,483,697	95.77
内 韓国	5,231,243,271	13.85
内 台湾	4,465,698,864	11.83
内 ケイマン諸島	4,300,229,982	11.39
内 中国	3,723,367,673	9.86
内 インド	3,093,208,563	8.19
内 ブラジル	3,003,339,494	7.95
内 南アフリカ	2,296,454,721	6.08
内 香港	1,476,015,169	3.91
内 ロシア	1,335,723,733	3.54
内 メキシコ	1,087,548,311	2.88
内 インドネシア	991,381,994	2.63
内 マレーシア	970,592,081	2.57
内 タイ	789,709,241	2.09
内 フィリピン	475,016,179	1.26
内 チリ	449,584,866	1.19
内 トルコ	403,412,481	1.07
内 ポーランド	403,050,715	1.07
内 バミューダ	378,859,190	1.00
内 カタール	314,547,607	0.83
内 アラブ首長国連邦	297,923,819	0.79
内 コロンビア	162,383,615	0.43
内 オランダ	137,580,425	0.36
内 ハンガリー	108,951,533	0.29
内 ギリシャ	67,766,446	0.18
内 チェコ	58,465,641	0.15
内 エジプト	52,856,381	0.14
内 マン島	25,410,775	0.07
内 ペルー	24,736,938	0.07
内 アメリカ	21,812,851	0.06
内 マルタ	20,611,138	0.05
投資信託受益証券	264,578,814	0.70
内 メキシコ	264,578,814	0.70
投資証券	101,922,751	0.27
内 メキシコ	44,037,814	0.12
内 南アフリカ	40,429,861	0.11
内 トルコ	17,455,076	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,230,392,075	3.26
純資産総額	37,764,377,337	100.00

その他資産の投資状況

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	5,032,500	0.01
-	5,032,500	0.01
株価指数先物取引(買建)	1,225,362,502	3.24
内 アメリカ	1,225,362,502	3.24

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

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

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

(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。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	153,652,404	1.2984 199,502,304	1.2987 199,548,377	- -	62.64%
2	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	16,386,377	1.6618 27,230,884	1.6623 27,239,074	- -	8.55%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	1,910	12,148.03 23,202,739	12,013.80 22,946,377	- -	7.20%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	6,072,274	2.5266 15,342,209	2.5430 15,441,792	- -	4.85%
5	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	5,612,530	1.9827 11,127,964	2.0576 11,548,341	- -	3.63%
6	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	10,262,803	1.0332 10,603,529	1.0260 10,529,635	- -	3.31%
7	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	19,989,336	0.3673 7,344,082	0.3653 7,302,104	- -	2.29%
8	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	6,638,832	0.8970 5,955,034	0.9033 5,996,856	- -	1.88%
9	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	588,450	1.7484 1,028,847	1.7535 1,031,847	- -	0.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	7.20%
親投資信託受益証券	87.46%
合計	94.67%

(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。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	123,483,010	1.2983 160,330,340	1.2987 160,367,385	- -	34.46%
2	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	49,342,716	1.6617 81,997,725	1.6623 82,022,396	- -	17.62%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	5,685	12,148.03 69,061,556	12,013.81 68,298,510	- -	14.68%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	15,668,735	2.5266 39,588,626	2.5430 39,845,593	- -	8.56%
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	26,428,223	1.0331 27,305,640	1.0260 27,115,356	- -	5.83%
6	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	12,448,091	1.9826 24,680,830	2.0576 25,613,192	- -	5.50%
7	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	58,983,541	0.3673 21,670,552	0.3653 21,546,687	- -	4.63%
8	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	19,989,958	0.8969 17,930,992	0.9033 18,056,929	- -	3.88%
9	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,530,320	1.7483 2,675,611	1.7535 2,683,416	- -	0.58%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	14.68%
親投資信託受益証券	81.06%
合計	95.73%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	68,882,501	1.6618 114,468,948	1.6623 114,503,381	- -	20.70%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	8,100	12,148.03 98,399,051	12,013.81 97,311,862	- -	17.59%
3	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	33,271,600	2.5266 84,064,026	2.5430 84,609,678	- -	15.29%
4	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	56,163,486	1.0332 58,028,115	1.0260 57,623,736	- -	10.42%
5	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	42,225,700	1.2984 54,825,850	1.2987 54,838,516	- -	9.91%
6	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	24,220,899	1.9827 48,022,780	2.0576 49,836,921	- -	9.01%
7	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	84,913,094	0.3673 31,197,070	0.3653 31,018,753	- -	5.61%
8	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	27,980,445	0.8970 25,098,463	0.9033 25,274,735	- -	4.57%
9	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	3,233,749	1.7484 5,653,888	1.7535 5,670,378	- -	1.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	17.59%
親投資信託受益証券	76.53%
合計	94.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,692,400	6,489.85 10,983,432,771	6,079.00 10,288,099,600	- -	3.58%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	10,177,000	534.86 5,443,324,724	544.60 5,542,394,200	- -	1.93%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,078,100	5,258.96 5,669,685,958	4,660.00 5,023,946,000	- -	1.75%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	659,500	5,150.50 3,396,756,184	6,602.00 4,354,019,000	- -	1.51%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,328,800	3,195.64 4,246,372,329	3,192.00 4,241,529,600	- -	1.47%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,075,400	3,397.39 3,653,558,049	3,653.00 3,928,436,200	- -	1.37%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,224,700	3,106.46 3,804,491,892	3,144.00 3,850,456,800	- -	1.34%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	845,100	4,635.42 3,917,393,634	3,994.00 3,375,329,400	- -	1.17%
9	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	18,234,000	180.08 3,283,747,000	177.10 3,229,241,400	- -	1.12%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	960,500	2,584.05 2,481,988,031	3,361.00 3,228,240,500	- -	1.12%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	138,000	16,400.39 2,263,254,022	19,680.00 2,715,840,000	- -	0.94%
12	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,003,700	2,834.82 2,845,318,040	2,640.50 2,650,269,850	- -	0.92%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	534,300	5,780.65 3,088,602,985	4,700.00 2,511,210,000	- -	0.87%
14	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	561,800	5,108.70 2,870,071,574	4,383.00 2,462,369,400	- -	0.86%
15	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	263,200	10,712.34 2,819,490,408	9,257.00 2,436,442,400	- -	0.85%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	30,800	58,581.30 1,804,304,306	77,060.00 2,373,448,000	- -	0.82%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,007,800	1,871.62 1,886,218,703	2,291.00 2,308,869,800	- -	0.80%
18	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,456,000	1,658.53 2,414,825,911	1,559.50 2,270,632,000	- -	0.79%
19	東京海上ホールディング ス 日本	株式 保険業	544,100	3,927.24 2,136,816,532	4,149.00 2,257,470,900	- -	0.78%
20	キヤノン 日本	株式 電気機器	732,600	3,349.96 2,454,185,308	3,017.00 2,210,254,200	- -	0.77%

21	任天堂 日本	株式 その他製品	83,800	17,229.54 1,443,836,116	25,440.00 2,131,872,000	- -	0.74%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	142,800	13,863.72 1,979,739,230	14,670.00 2,094,876,000	- -	0.73%
23	三菱地所 日本	株式 不動産業	999,000	2,236.36 2,234,128,800	2,081.50 2,079,418,500	- -	0.72%
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,451,600	1,146.05 1,663,606,704	1,422.50 2,064,901,000	- -	0.72%
25	信越化学工業 日本	株式 化学	255,600	5,982.11 1,529,027,742	7,971.00 2,037,387,600	- -	0.71%
26	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	113,100	22,228.54 2,514,048,526	17,865.00 2,020,531,500	- -	0.70%
27	花王 日本	株式 化学	362,100	6,189.12 2,241,083,500	5,405.00 1,957,150,500	- -	0.68%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	481,000	4,104.80 1,974,409,060	3,915.00 1,883,115,000	- -	0.65%
29	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,800	7,741.00 1,438,278,640	10,080.00 1,872,864,000	- -	0.65%
30	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,267,000	492.56 1,609,212,800	559.20 1,826,906,400	- -	0.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
株式	96.17%
合計	96.17%

(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10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.16%
輸送用機器		9.24%
情報・通信業		7.85%
銀行業		7.33%
化学		6.27%
医薬品		4.89%
機械		4.81%
小売業		4.69%
食料品		4.66%
卸売業		4.20%
陸運業		4.04%
サービス業		3.67%
建設業		2.98%
不動産業		2.49%
保険業		2.32%
その他製品		1.86%
電気・ガス業		1.78%
精密機器		1.48%
その他金融業		1.26%
鉄鋼		1.11%
証券、商品先物取引業		1.04%
ゴム製品		0.90%
ガラス・土石製品		0.88%
非鉄金属		0.86%
繊維製品		0.71%
金属製品		0.67%
空運業		0.52%
石油・石炭製品		0.45%
鋳業		0.32%
パルプ・紙		0.24%
海運業	0.22%	
倉庫・運輸関連業	0.19%	
水産・農林業	0.11%	
合計		96.17%

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	103.47 4,656,285,000	103.63 4,663,710,000	0.300000 2025/12/20	1.23%
2	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	102.99 4,634,870,000	101.64 4,574,160,000	0.100000 2026/6/20	1.21%
3	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	101.05 4,547,520,000	0.100000 2019/12/20	1.20%
4	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.37 4,257,714,000	101.29 4,254,222,000	0.100000 2020/12/20	1.12%
5	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	100.99 4,241,832,000	0.200000 2018/12/20	1.12%
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	101.74 4,069,920,000	0.100000 2026/3/20	1.07%
7	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.62 4,065,155,000	101.40 4,056,080,000	0.100000 2021/6/20	1.07%
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	101.10 4,044,000,000	0.200000 2019/3/20	1.07%
9	366回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.57 4,023,110,000	100.62 4,024,880,000	0.100000 2018/7/15	1.06%
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	101.20 3,542,140,000	0.200000 2019/6/20	0.93%
11	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.02 3,535,825,000	101.18 3,541,615,000	0.100000 2020/6/20	0.93%
12	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	101.10 3,538,710,000	0.100000 2020/3/20	0.93%
13	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.06 3,537,380,000	0.300000 2018/9/20	0.93%
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	102.03 3,265,184,000	1.500000 2017/12/20	0.86%
15	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	106.62 3,198,750,000	1.300000 2021/3/20	0.84%

16	340回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	3,000,000,000	103.19 3,095,720,000	104.52 3,135,810,000	0.400000 2025/9/20	0.83%
17	127回 年)	利付国庫債券(5 日本)	国債証券	3,000,000,000	101.57 3,047,255,000	101.34 3,040,410,000	0.100000 2021/3/20	0.80%
18	125回 年)	利付国庫債券(5 日本)	国債証券	3,000,000,000	101.06 3,031,815,000	101.23 3,036,990,000	0.100000 2020/9/20	0.80%
19	301回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	104.60 3,033,545,000	1.500000 2019/6/20	0.80%
20	310回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	104.73 2,932,608,000	1.000000 2020/9/20	0.77%
21	321回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,500,000,000	106.82 2,670,535,000	106.43 2,660,925,000	1.000000 2022/3/20	0.70%
22	305回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	104.80 2,620,225,000	1.300000 2019/12/20	0.69%
23	143回 0年)	利付国庫債券(2 日本)	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	122.68 2,576,448,000	1.600000 2033/3/20	0.68%
24	365回 年)	利付国庫債券(2 日本)	国債証券	2,500,000,000	100.84 2,521,025,000	100.58 2,514,600,000	0.100000 2018/6/15	0.66%
25	334回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,300,000,000	105.26 2,421,080,000	105.78 2,433,124,000	0.600000 2024/6/20	0.64%
26	339回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,300,000,000	103.25 2,374,780,000	104.48 2,403,247,000	0.400000 2025/6/20	0.63%
27	297回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,300,000,000	104.41 2,401,614,000	103.53 2,381,305,000	1.400000 2018/12/20	0.63%
28	141回 0年)	利付国庫債券(2 日本)	国債証券	1,900,000,000	117.81 2,238,435,000	124.21 2,360,123,000	1.700000 2032/12/20	0.62%
29	125回 0年)	利付国庫債券(2 日本)	国債証券	1,800,000,000	125.51 2,259,324,000	129.95 2,339,100,000	2.200000 2031/3/20	0.62%
30	312回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,200,000,000	106.42 2,341,306,000	105.85 2,328,788,000	1.200000 2020/12/20	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10月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.08%
地方債証券	6.29%
特殊債券	5.30%
社債券	4.83%
合計	99.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,276	647,970.32 2,122,750,787	623,000.00 2,040,948,000	- -	7.54%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,038	632,156.85 1,920,492,525	607,000.00 1,844,066,000	- -	6.81%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	9,705	170,780.82 1,657,492,809	170,000.00 1,649,914,600	- -	6.10%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	5,922	256,352.44 1,518,119,204	237,900.00 1,408,843,800	- -	5.20%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,852	180,839.63 1,239,113,156	176,900.00 1,212,118,800	- -	4.48%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,858	180,023.74 1,054,579,087	179,700.00 1,052,682,600	- -	3.89%
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,274	242,157.85 1,034,982,693	237,300.00 1,014,220,200	- -	3.75%
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	3,524	275,296.04 970,363,505	283,500.00 999,280,800	- -	3.69%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,132	285,771.14 895,035,232	293,400.00 918,928,800	- -	3.39%
10	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,026	453,793.74 919,386,132	452,500.00 916,765,000	- -	3.39%
11	GLP投資法人 日本	投資証券	6,620	126,768.03 839,204,402	131,500.00 870,530,000	- -	3.22%
12	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,391	563,192.08 783,400,191	510,000.00 709,410,000	- -	2.62%

13	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,155	644,114.52 743,952,282	592,000.00 683,760,000	- -	2.53%
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	8,728	92,321.26 805,780,008	70,900.00 618,815,200	- -	2.29%
15	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,062	162,951.18 661,907,722	147,800.00 600,363,600	- -	2.22%
16	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,151	527,097.34 606,689,043	494,000.00 568,594,000	- -	2.10%
17	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	939	635,827.16 597,041,711	590,000.00 554,010,000	- -	2.05%
18	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,124	458,977.39 515,890,595	475,500.00 534,462,000	- -	1.97%
19	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	3,063	200,150.72 613,061,683	168,900.00 517,340,700	- -	1.91%
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,042	243,613.62 497,459,026	228,100.00 465,780,200	- -	1.72%
21	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	818	564,832.46 462,032,958	553,000.00 452,354,000	- -	1.67%
22	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,415	186,358.88 450,056,719	183,800.00 443,877,000	- -	1.64%
23	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,029	148,771.24 450,628,116	146,500.00 443,748,500	- -	1.64%
24	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	8,529	73,034.87 622,914,421	51,000.00 434,979,000	- -	1.61%
25	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,056	140,415.79 429,110,680	135,100.00 412,865,600	- -	1.53%
26	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,038	135,475.10 411,573,379	127,300.00 386,737,400	- -	1.43%
27	福岡リート投資法人 日本	投資証券	1,733	204,032.79 353,588,832	181,800.00 315,059,400	- -	1.16%
28	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,268	151,068.35 342,623,036	138,400.00 313,891,200	- -	1.16%
29	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	2,555	118,970.12 303,968,682	121,400.00 310,177,000	- -	1.15%
30	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	3,805	84,613.70 321,955,155	81,100.00 308,585,500	- -	1.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.91%
合計	98.91%

（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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・ 周辺機器	437,670	9,863.01 4,316,745,024	11,924.67 5,219,074,345	- -	2.05%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	601,435	5,297.84 3,186,311,383	6,277.96 3,775,789,804	- -	1.48%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消 耗燃料	332,419	8,547.75 2,841,436,499	8,890.03 2,955,215,148	- -	1.16%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	221,142	10,746.69 2,376,545,024	12,093.50 2,674,381,617	- -	1.05%
5	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・通信販売	32,021	54,019.29 1,729,751,989	81,404.91 2,606,666,789	- -	1.02%
6	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	183,929	10,813.54 1,988,924,785	13,767.06 2,532,163,307	- -	0.99%
7	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリッ ト	731,501	2,974.49 2,175,845,165	3,064.00 2,241,325,793	- -	0.88%
8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	293,456	6,044.58 1,773,818,720	7,246.87 2,126,638,832	- -	0.83%
9	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・ サービス	24,944	71,669.79 1,787,731,440	83,402.49 2,080,391,915	- -	0.82%
10	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	23,367	74,198.06 1,733,786,108	85,939.06 2,008,138,052	- -	0.79%
11	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	255,377	7,640.60 1,951,235,144	7,723.35 1,972,366,463	- -	0.77%
12	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	492,775	3,843.02 1,893,747,728	3,828.43 1,886,558,831	- -	0.74%

13	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	386,036	4,957.01 1,913,586,031	4,847.67 1,871,378,147	- -	0.73%
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	202,905	8,507.78 1,726,272,552	9,106.04 1,847,661,533	- -	0.72%
15	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	494,350	3,101.63 1,533,292,653	3,348.17 1,655,172,684	- -	0.65%
16	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	325,987	5,275.24 1,719,661,600	5,055.30 1,647,962,276	- -	0.65%
17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消 耗燃料	150,426	9,044.14 1,360,474,303	10,886.56 1,637,622,456	- -	0.64%
18	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	329,545	4,526.18 1,491,582,763	4,428.23 1,459,303,625	- -	0.57%
19	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービ ス	95,531	13,511.44 1,290,761,881	15,099.83 1,442,502,815	- -	0.57%
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	824,162	1,256.12 1,035,253,886	1,749.06 1,441,512,743	- -	0.57%
21	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	377,945	3,024.59 1,143,130,601	3,642.83 1,376,791,803	- -	0.54%
22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	222,237	5,174.06 1,149,868,498	6,169.96 1,371,193,933	- -	0.54%
23	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	56,214	25,948.72 1,458,681,469	24,379.48 1,370,468,201	- -	0.54%
24	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	180,180	7,581.16 1,365,974,903	7,542.99 1,359,097,559	- -	0.53%
25	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービ ス	153,349	7,396.77 1,134,288,007	8,621.58 1,322,112,082	- -	0.52%
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	115,706	10,353.10 1,197,915,800	11,227.36 1,299,072,939	- -	0.51%
27	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	401,169	2,644.25 1,060,793,208	3,207.66 1,286,816,723	- -	0.50%
28	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	98,336	12,303.00 1,209,828,017	12,958.59 1,274,296,771	- -	0.50%
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	194,702	5,982.86 1,164,875,284	6,488.73 1,263,370,032	- -	0.50%
30	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,571,934	564.26 886,983,744	797.86 1,254,185,147	- -	0.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
株式	94.91%
投資信託受益証券	0.31%
投資証券	2.25%
合計	97.48%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.64%
石油・ガス・消耗燃料		6.52%
医薬品		5.93%
保険		4.04%
ソフトウェア		3.47%
インターネットソフトウェア・サービス		3.04%
情報技術サービス		2.67%
各種電気通信サービス		2.65%
資本市場		2.64%
化学		2.60%
メディア		2.51%
コンピュータ・周辺機器		2.39%
半導体・半導体製造装置		2.35%
食品		2.34%
バイオテクノロジー		2.26%
飲料		2.22%
コングロマリット		2.13%
食品・生活必需品小売り		2.02%
電力		1.92%
ヘルスケア機器・用品		1.91%
航空宇宙・防衛		1.81%
専門小売り		1.80%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.79%
ホテル・レストラン・レジャー		1.74%
タバコ		1.60%
インターネット販売・通信販売		1.56%
家庭用品		1.52%
金属・鉱業		1.46%
機械		1.38%
繊維・アパレル・贅沢品		1.20%
総合公益事業		1.13%
自動車		0.97%
陸運・鉄道		0.83%
通信機器		0.83%
各種金融サービス		0.82%
エネルギー設備・サービス		0.75%
電気設備		0.73%
パーソナル用品		0.70%

専門サービス	0.61%
航空貨物・物流サービス	0.60%
自動車部品	0.59%
不動産管理・開発	0.56%
消費者金融	0.53%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.47%
複合小売り	0.44%
家庭用耐久財	0.41%
電子装置・機器・部品	0.40%
商業サービス・用品	0.37%
無線通信サービス	0.37%
建設資材	0.35%
建設・土木	0.33%
容器・包装	0.31%
商社・流通業	0.29%
建設関連製品	0.27%
運送インフラ	0.22%
ガス	0.20%
旅客航空輸送業	0.14%
水道	0.09%
紙製品・林産品	0.09%
販売	0.09%
レジャー用品	0.08%
海運業	0.08%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
ヘルスケア・テクノロジー	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	94.91%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	3,722,530,000	101.32 3,772,038,076	100.93 3,757,410,106	1.375000 2018/9/30	1.47%
2	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	2,202,060,000	104.25 2,295,758,701	103.60 2,281,356,180	2.125000 2021/8/15	0.90%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,887,480,000	109.69 2,070,471,186	108.22 2,042,744,104	3.625000 2020/2/15	0.80%
4	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,992,340,000	99.98 1,991,941,532	100.01 1,992,638,851	0.750000 2017/12/31	0.78%
5	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	1,887,480,000	101.71 1,919,894,323	101.09 1,908,185,655	1.875000 2017/9/30	0.75%
6	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,730,190,000	106.17 1,836,960,024	105.31 1,822,097,692	2.625000 2020/8/15	0.71%
7	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,782,620,000	101.72 1,813,388,021	101.25 1,804,902,750	1.500000 2018/12/31	0.71%
8	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,572,900,000	103.65 1,630,351,745	102.55 1,613,134,782	2.375000 2018/6/30	0.63%
9	US T N/B 1.625 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,572,900,000	102.01 1,604,617,004	101.61 1,598,333,793	1.625000 2019/3/31	0.63%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,572,900,000	101.82 1,601,526,780	101.54 1,597,217,034	1.750000 2022/5/15	0.63%
11	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,572,900,000	102.58 1,613,621,332	101.00 1,588,739,103	1.750000 2023/5/15	0.62%
12	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,468,040,000	109.57 1,608,531,428	108.17 1,587,993,548	3.500000 2020/5/15	0.62%
13	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,572,900,000	100.54 1,581,443,992	100.78 1,585,184,349	1.625000 2022/8/15	0.62%
14	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,468,040,000	105.34 1,546,536,098	103.48 1,519,245,235	3.500000 2018/2/15	0.60%
15	US T N/B 1.375 06/30/23 アメリカ	国債証券	1,468,040,000	99.72 1,464,055,320	98.60 1,447,502,120	1.375000 2023/6/30	0.57%
16	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,363,180,000	106.89 1,457,212,156	105.48 1,437,991,318	3.125000 2019/5/15	0.56%
17	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,415,610,000	100.85 1,427,656,841	100.82 1,427,331,250	1.375000 2020/5/31	0.56%
18	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,415,610,000	99.95 1,415,001,812	99.98 1,415,440,126	0.750000 2018/2/28	0.56%
19	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,363,180,000	104.20 1,420,456,629	103.64 1,412,799,752	2.250000 2025/11/15	0.55%
20	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,331,722,000	104.09 1,386,229,381	103.63 1,380,090,143	2.125000 2021/12/31	0.54%
21	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,363,180,000	101.06 1,377,738,762	101.01 1,377,016,277	1.375000 2019/2/28	0.54%
22	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,331,722,000	101.79 1,355,618,964	101.16 1,347,223,244	1.500000 2018/8/31	0.53%
23	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,258,320,000	108.00 1,358,985,600	105.71 1,330,270,737	4.000000 2018/8/15	0.52%

24	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,258,320,000	105.27 1,324,753,004	104.16 1,310,716,444	2.750000 2019/2/15	0.51%
25	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,258,320,000	103.48 1,302,210,201	103.04 1,296,648,427	2.000000 2021/5/31	0.51%
26	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,258,320,000	101.92 1,282,567,826	101.64 1,279,057,113	2.000000 2025/8/15	0.50%
27	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,208,025,000	108.28 1,308,076,966	105.70 1,276,882,425	4.500000 2018/2/1	0.50%
28	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,258,320,000	100.88 1,269,405,799	100.88 1,269,418,382	1.375000 2020/4/30	0.50%
29	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,205,890,000	104.38 1,258,732,624	104.11 1,255,536,491	2.250000 2021/3/31	0.49%
30	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,115,985,000	112.57 1,256,370,160	111.57 1,245,137,944	2.500000 2020/10/25	0.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.18%
合計	97.18%

(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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	95,620	22,062.71 2,109,636,814	19,176.79 1,833,685,310	- -	5.54%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	45,340	25,351.90 1,149,455,472	21,784.66 987,716,711	- -	2.98%
3	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	160,200	5,266.02 843,617,195	5,355.20 857,903,072	- -	2.59%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	108,900	7,766.14 845,732,950	7,177.66 781,647,936	- -	2.36%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	30,210	27,505.75 830,948,896	25,040.63 756,477,507	- -	2.28%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	107,100	7,395.09 792,014,496	7,004.64 750,197,800	- -	2.26%
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	41,900	18,486.08 774,566,983	17,559.85 735,757,949	- -	2.22%
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	111,390	6,961.09 775,396,867	6,310.47 702,923,787	- -	2.12%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	46,690	13,570.75 633,618,532	12,472.04 582,319,939	- -	1.76%
10	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,621,400	380.41 616,801,773	331.09 536,836,460	- -	1.62%
11	HCP INC アメリカ	投資証券	142,060	3,715.93 527,885,129	3,579.92 508,563,492	- -	1.54%
12	LINK REIT 香港	投資証券	682,023	697.11 475,449,956	743.59 507,152,302	- -	1.53%
13	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	52,210	10,312.57 538,419,534	9,564.28 499,351,090	- -	1.51%
14	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	78,560	6,872.18 539,878,996	6,137.45 482,158,527	- -	1.46%
15	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	177,430	3,036.40 538,749,403	2,579.55 457,690,621	- -	1.38%
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	19,900	23,273.13 463,135,458	21,943.00 436,665,771	- -	1.32%
17	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	44,630	10,950.59 488,725,086	9,711.08 433,405,705	- -	1.31%
18	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	580,700	850.16 493,693,652	700.39 406,717,634	- -	1.23%
19	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	225,730	1,740.95 392,986,420	1,572.90 355,050,717	- -	1.07%
20	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	127,700	3,141.31 401,145,387	2,758.86 352,307,264	- -	1.06%
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	21,560	16,642.81 358,819,033	15,069.43 324,896,923	- -	0.98%
22	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	243,670	1,458.49 355,392,133	1,267.37 308,822,289	- -	0.93%

23	SL GREEN アメリカ	投資証券	30,500	10,854.86 331,073,382	10,046.63 306,422,416	- -	0.92%
24	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	38,260	9,169.62 350,829,708	7,559.35 289,221,014	- -	0.87%
25	UDR INC アメリカ	投資証券	81,230	3,729.15 302,918,905	3,549.51 288,326,778	- -	0.87%
26	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	106,680	2,726.83 290,898,974	2,662.39 284,024,341	- -	0.86%
27	VEREIT INC アメリカ	投資証券	293,530	1,047.88 307,585,036	965.76 283,479,708	- -	0.86%
28	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	36,690	8,633.07 316,747,557	7,405.21 271,697,272	- -	0.82%
29	KLEPIERRE フランス	投資証券	63,030	4,624.52 291,483,818	4,299.41 270,992,348	- -	0.82%
30	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	23,720	10,546.03 250,152,066	11,000.86 260,940,460	- -	0.79%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	11.16%
投資証券	88.44%
合計	99.60%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

コモディティインデックス・マザーファンド

平成28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	GS Commodity Index Certificate 06/08/2017 イギリス	社債券	106,480	24,172.88 2,573,929,224	23,213.90 2,471,816,796	- 2017/6/8	99.87%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年10月31日現在

種類	投資比率
社債券	99.87%
合計	99.87%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	483,100	2,246.15 1,085,118,257	2,812.16 1,358,554,496	- -	3.60%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体 製造装置	2,108,083	528.83 1,114,820,354	627.24 1,322,284,521	- -	3.50%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・ 周辺機器	8,566	119,393.13 1,022,721,595	147,681.00 1,265,035,446	- -	3.35%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・ サービス	96,000	8,605.69 826,146,955	10,688.37 1,026,084,460	- -	2.72%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	37,435	16,349.20 612,032,371	17,603.42 658,984,177	- -	1.74%
6	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービ ス	525,000	1,214.31 637,516,895	1,192.46 626,043,600	- -	1.66%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,195,530	68.53 493,126,431	75.71 544,787,967	- -	1.44%
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	23,200	19,414.25 450,410,715	18,831.80 436,897,931	- -	1.16%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,307,235	58.68 370,146,002	62.59 394,817,773	- -	1.05%
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,324,532	249.15 330,009,926	280.68 371,780,238	- -	0.98%
11	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	277,098	978.83 271,233,288	1,214.61 336,566,084	- -	0.89%
12	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,786,200	43.69 296,528,890	46.50 315,618,018	- -	0.84%

13	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不 動産金融	128,439	1,761.27 226,216,359	2,184.96 280,635,233	- -	0.74%
14	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	403,695	622.27 251,208,272	625.14 252,367,103	- -	0.67%
15	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	237,515	857.92 203,770,282	1,061.10 252,028,734	- -	0.67%
16	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	157,741	1,843.89 290,857,522	1,566.07 247,034,236	- -	0.65%
17	PING AN INSURANCE GROUP CO- H 中国	株式 保険	445,000	509.02 226,516,009	548.91 244,265,840	- -	0.65%
18	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	236,766	796.01 188,470,434	1,008.75 238,838,460	- -	0.63%
19	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消 耗燃料	518,954	460.66 239,061,932	445.44 231,165,609	- -	0.61%
20	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消 耗燃料	1,519,000	131.49 199,747,737	135.74 206,190,275	- -	0.55%
21	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消 耗燃料	335,512	317.31 106,461,620	592.08 198,651,857	- -	0.53%
22	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体 製造装置	49,806	2,534.09 126,213,071	3,884.17 193,455,220	- -	0.51%
23	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消 耗燃料	37,512	4,415.55 165,636,371	5,152.82 193,292,598	- -	0.51%
24	NAVER CORP 韓国	株式 インターネット ソフトウェア・ サービス	2,399	61,807.70 148,276,682	78,690.00 188,777,310	- -	0.50%
25	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,729,878	74.26 202,737,375	68.77 187,758,824	- -	0.50%
26	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・ サービス	6,700	16,649.32 111,550,508	27,784.75 186,157,853	- -	0.49%
27	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消 耗燃料	111,140	1,667.29 185,303,441	1,656.27 184,078,014	- -	0.49%
28	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・ 周辺機器	1,531	98,616.56 150,981,960	119,682.00 183,233,142	- -	0.49%

29	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式	2,177,200	71.90	76.52	-	0.44%
		石油・ガス・消耗燃料		156,559,491	166,606,311	-	
30	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式	635,000	264.72	260.66	-	0.44%
		保険		168,098,613	165,522,656	-	

(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10月31日現在

種類	投資比率
株式	95.77%
投資信託受益証券	0.70%
投資証券	0.27%
合計	96.74%

(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10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	16.02%
インターネットソフトウェア・サービス		8.65%
石油・ガス・消耗燃料		7.38%
半導体・半導体製造装置		5.23%
コンピュータ・周辺機器		4.95%
無線通信サービス		3.88%
保険		3.30%
金属・鉱業		2.89%
自動車		2.58%
メディア		2.37%
電子装置・機器・部品		2.29%
食品		1.99%
化学		1.98%
コングロマリット		1.97%
不動産管理・開発		1.97%
各種電気通信サービス		1.89%
食品・生活必需品小売り		1.85%
情報技術サービス		1.76%
医薬品		1.49%
各種金融サービス		1.30%
資本市場		1.29%
電力		1.23%
飲料		1.12%
運送インフラ		1.01%
インターネット販売・通信販売		0.97%
パーソナル用品		0.97%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.89%
建設・土木		0.88%
建設資材		0.79%
自動車部品		0.77%

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.77%
複合小売り	0.74%
タバコ	0.73%
家庭用耐久財	0.73%
機械	0.62%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.61%
繊維・アパレル・贅沢品	0.55%
ホテル・レストラン・レジャー	0.44%
ガス	0.43%
各種消費者サービス	0.41%
家庭用品	0.40%
専門小売り	0.38%
紙製品・林産品	0.32%
水道	0.31%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.25%
バイオテクノロジー	0.24%
消費者金融	0.24%
旅客航空輸送業	0.23%
電気設備	0.23%
航空宇宙・防衛	0.20%
ソフトウェア	0.17%
陸運・鉄道	0.17%
商業サービス・用品	0.13%
海運業	0.10%
総合公益事業	0.09%
航空貨物・物流サービス	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.08%
容器・包装	0.07%
レジャー用品	0.07%
商社・流通業	0.06%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
建設関連製品	0.05%
販売	0.05%
ヘルスケア・テクノロジー	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.04%
通信機器	0.02%
合計	95.77%

(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】

MITO ラップ型ファンド（安定型）

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド（中立型）

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2812月	買建	785	10,662,306,940	10,950,750,000	3.81%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年11月	買建	200,000	20,969,600	20,970,000	0.01%
		ユーロ売/円買201 6年11月	売建	80,000	9,175,280	9,204,000	0.00%
		アメリカ・ドル売/円 買2016年11月	売建	50,000	5,259,550	5,242,500	0.00%
		イギリス・ポンド売/ 円買2016年11月	売建	30,000	3,842,880	3,832,500	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Dec 16	買建	377	4,249,617,965	4,197,827,611	1.65%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Dec 16	買建	328	1,128,156,139	1,158,507,480	0.45%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Dec16	買建	56	485,316,801	498,529,740	0.20%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Dec1 6	買建	25	266,389,719	261,303,918	0.10%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT D ec16	買建	18	237,616,868	243,656,334	0.10%

(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。

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年11月	買建	1,356,000	142,638,996	142,176,600	0.06%
		イギリス・ポンド買/ 円売2016年11月	買建	478,000	61,229,888	61,064,500	0.02%
		ユーロ売/円買201 6年11月	売建	309,000	35,550,388	35,550,450	0.01%

(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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年11月	買建	140,000	14,678,720	14,679,000	0.04%
		イギリス・ポンド買/ 円売2016年11月	買建	105,000	13,414,695	13,413,750	0.04%
		オーストラリア・ドル 買/円売2016年1 1月	買建	50,000	3,979,050	3,979,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2016年11月	買建	45,000	3,514,833	3,514,500	0.01%

(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。

コモディティインデックス・マザーファンド

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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	韓国・ウォン買/円売 2016年11月	買建	55,000,000	5,024,800	5,032,500	0.01%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Dec 16	買建	260	1,224,921,565	1,225,362,502	3.24%

(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) 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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成28年10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。

MITO ラップ型ファンド(安定型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年10月12日)	328	328	0.9865	0.9865
平成27年12月末日	276	-	0.9927	-
平成28年1月末日	362	-	0.9903	-
2月末日	342	-	0.9846	-
3月末日	359	-	1.0005	-
4月末日	372	-	1.0024	-
5月末日	384	-	1.0074	-
6月末日	362	-	0.9944	-
7月末日	358	-	0.9997	-
8月末日	350	-	0.9922	-
9月末日	330	-	0.9856	-
10月末日	318	-	0.9874	-

MITO ラップ型ファンド(中立型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年10月12日)	478	478	0.9443	0.9443
平成27年12月末日	356	-	0.9824	-
平成28年1月末日	479	-	0.9707	-
2月末日	470	-	0.9453	-
3月末日	489	-	0.9697	-
4月末日	488	-	0.9660	-
5月末日	496	-	0.9730	-
6月末日	479	-	0.9409	-
7月末日	484	-	0.9566	-
8月末日	478	-	0.9518	-
9月末日	477	-	0.9402	-
10月末日	465	-	0.9458	-

MITO ラップ型ファンド（積極型）

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）(円)	1口当たりの 純資産額 （分配付）(円)
第1計算期間末 （平成28年10月12日）	574	574	0.9056	0.9056
平成27年12月末日	611	-	0.9732	-
平成28年1月末日	672	-	0.9456	-
2月末日	649	-	0.9042	-
3月末日	676	-	0.9404	-
4月末日	693	-	0.9322	-
5月末日	638	-	0.9414	-
6月末日	606	-	0.8916	-
7月末日	613	-	0.9190	-
8月末日	607	-	0.9153	-
9月末日	570	-	0.9000	-
10月末日	553	-	0.9084	-

【分配の推移】

MITO ラップ型ファンド（安定型）

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

MITO ラップ型ファンド（中立型）

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

MITO ラップ型ファンド（積極型）

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

MITO ラップ型ファンド（安定型）

	収益率(%)
第1計算期間	1.4

（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。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

	収益率(%)
第1計算期間	5.6

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

	収益率(%)
第1計算期間	9.4

(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】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	450,526,549	117,670,883

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	549,915,397	42,826,059

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	813,482,460	179,473,590

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

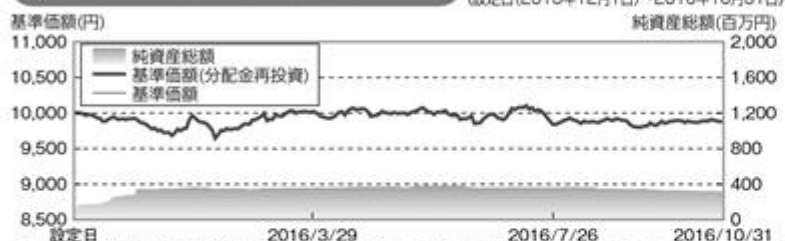
<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年10月31日

MITO ラップ型ファンド(安定型)

➤ 基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年12月1日)~2016年10月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1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 (2016.10.12)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万口当たりです。

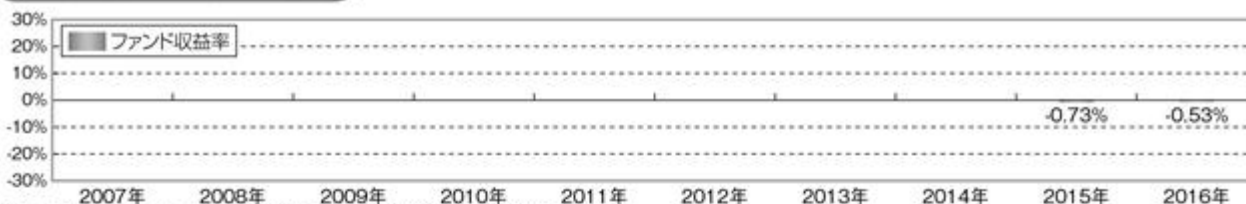
➤ 主要な資産の状況

(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	国内債券バシブ・ファンド・マザーファンド	62.64%
2	外国債券バシブ・ファンド・マザーファンド	8.55%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	7.20%
4	外国株式バシブ・ファンド・マザーファンド	4.85%
5	国内株式バシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.63%
6	外国リートバシブ・ファンド・マザーファンド	3.31%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	2.29%
8	エマージング株式バシブ・マザーファンド	1.88%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.32%

➤ 年間収益率の推移

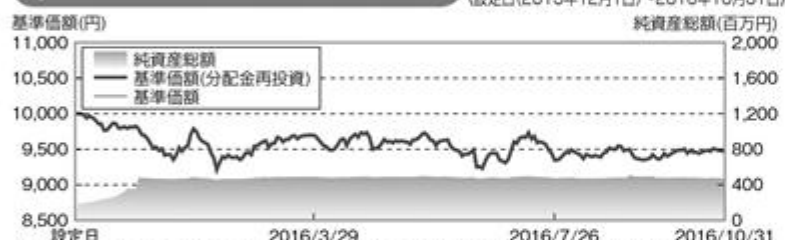


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

➤ 基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年12月1日)~2016年10月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1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 (2016.10.12)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万口当たりです。

○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10月31日

✈ 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	34.46%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.62%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	14.68%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.56%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.83%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	5.50%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	4.63%
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3.88%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.58%

✈ 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。

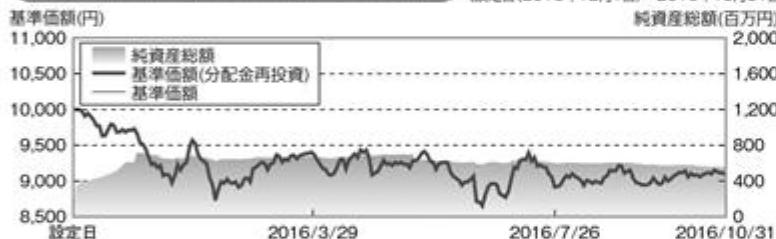
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

✈ 基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年12月1日)~2016年10月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1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(2016.10.12)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万口当たりです。

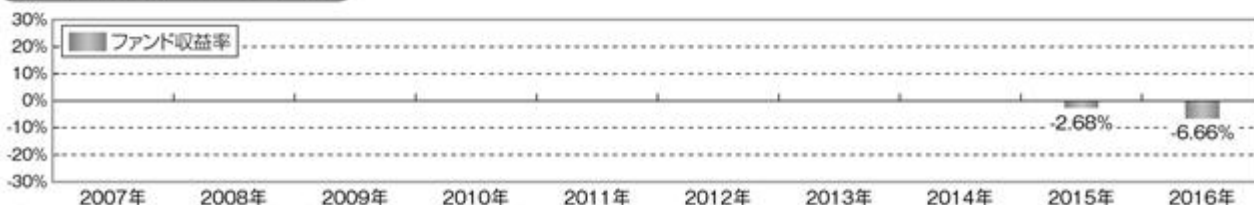
✈ 主要な資産の状況

(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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.70%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	17.59%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.29%
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.42%
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.91%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.01%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	5.61%
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.57%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1.02%

✈ 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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

- ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・ お申込手数料

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

て当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場 で評価します。 外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

信託期間は、平成27年12月1日から原則として平成37年10月10日までです。

下記(5)イ・償還規定の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。

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

(5)【その他】

イ・償還規定

- 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回るようになった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ・償還規定 c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は「ロ．信託約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の

- 口数に応じて、議決権を有し、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。
- j. 上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

八．関係法人との契約の更改

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

また、投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヶ月前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。
（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金受領権

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

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

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

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

(2)償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

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

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

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

1【財務諸表】

【MITO ラップ型ファンド(安定型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		731,513
コール・ローン		19,973,276
投資信託受益証券		22,932,786
親投資信託受益証券		288,479,489
流動資産合計		332,117,064
資産合計		
		332,117,064
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,999,999
未払受託者報酬		56,758
未払委託者報酬		1,689,341
その他未払費用		6,316
流動負債合計		3,752,414
負債合計		
		3,752,414
純資産の部		
元本等		
元本	1	332,855,666
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2	4,491,016
(分配準備積立金)		641,909
元本等合計		328,364,650
純資産合計		
		328,364,650
負債純資産合計		
		332,117,064

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
営業収益	
受取配当金	849,988
受取利息	3,039
有価証券売買等損益	3,346,903
為替差損益	3,796,972
営業収益合計	402,958
営業費用	
支払利息	6,459
受託者報酬	128,633
委託者報酬	3,829,003
その他費用	56,434
営業費用合計	4,020,529
営業利益又は営業損失()	3,617,571
経常利益又は経常損失()	3,617,571
当期純利益又は当期純損失()	3,617,571
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	670,864
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	533,331
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	533,331
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,077,640
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,077,640
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	4,491,016

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. 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>
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	第1期 平成28年10月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>167,312,285円</p> <p>283,214,264円</p> <p>117,670,883円</p>
2. 受益権の総数	332,855,666口
3. 2 元本の欠損	<p>貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,491,016円であります。</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（641,909円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（149,371円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は791,280円（1万口当たり23.77円）ではありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期
	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	1,623,710
親投資信託受益証券	869,250
合計	2,492,960

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期
	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9865円 (9,865円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	1,910.000	221,273.500	
	アメリカ・ドル	小計	1,910.000	221,273.500 (22,932,786)	
投資信託受益証券 合計			1,910	22,932,786 (22,932,786)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	5,822,033	11,543,344	
		国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	159,532,734	207,137,301	
		J-REITインデックス ファンド・マザーファンド	610,789	1,067,903	
		外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	6,302,436	15,923,734	
		外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	17,010,648	28,268,294	
		外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	10,655,424	11,009,184	
		コモディティインデックス・ マザーファンド	19,989,336	7,344,082	
		エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	6,895,928	6,185,647	
日本円 小計			226,819,328	288,479,489	
親投資信託受益証券 合計			226,819,328	288,479,489	
合計				311,412,275 (22,932,786)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	6.98%	7.36%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

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

【MITO ラップ型ファンド(中立型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,172,752
コール・ローン		31,116,562
投資信託受益証券		68,258,055
親投資信託受益証券		381,120,544
流動資産合計		481,667,913
資産合計		481,667,913
負債の部		
流動負債		
未払解約金		478,858
未払受託者報酬		76,392
未払委託者報酬		2,273,389
その他未払費用		8,525
流動負債合計		2,837,164
負債合計		2,837,164
純資産の部		
元本等		
元本	1	507,089,338
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2	28,258,589
(分配準備積立金)		3,343,679
元本等合計		478,830,749
純資産合計		478,830,749
負債純資産合計		481,667,913

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
営業収益	
受取配当金	2,359,461
受取利息	4,290
有価証券売買等損益	9,085,336
為替差損益	10,746,611
営業収益合計	17,468,196
営業費用	
支払利息	8,049
受託者報酬	171,146
委託者報酬	5,093,832
その他費用	68,739
営業費用合計	5,341,766
営業利益又は営業損失()	22,809,962
経常利益又は経常損失()	22,809,962
当期純利益又は当期純損失()	22,809,962
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,723,460
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	567,430
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	567,430
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,739,517
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,739,517
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	28,258,589

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2 . 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>
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	第1期 平成28年10月12日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>189,882,036円</p> <p>360,033,361円</p> <p>42,826,059円</p>
2 . 受益権の総数	507,089,338口
3 . 2 元本の欠損	<p>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28,258,589円であります。</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,343,679円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（212,349円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は3,556,028円（1万口当たり70.13円）であります。分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期
	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	5,085,670
親投資信託受益証券	12,366,479
合計	7,280,809

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期
	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9443円 (9,443円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	5,685.000	658,607.250	
	アメリカ・ドル	小計	5,685.000	658,607.250 (68,258,055)	
投資信託受益証券 合計			5,685	68,258,055 (68,258,055)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	12,618,708	25,019,112	
		国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	125,209,751	162,572,340	
		J-REITインデックス ファンド・マザーファンド	1,551,539	2,712,710	
		外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,885,054	40,135,177	
		外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	50,032,973	83,144,794	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	26,796,979	27,686,638	
		コモディティインデックス・マザーファンド	58,983,541	21,670,552	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	20,266,691	18,179,221	
	日本円 小計	311,345,236	381,120,544		
親投資信託受益証券 合計			311,345,236	381,120,544	
合計				449,378,599 (68,258,055)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	14.26%	15.19%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

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

【MITO ラップ型ファンド(積極型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,577,817
コール・ローン		41,747,620
投資信託受益証券		97,254,221
親投資信託受益証券		436,521,336
流動資産合計		577,100,994
資産合計		577,100,994
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		95,541
未払委託者報酬		2,843,337
その他未払費用		10,687
流動負債合計		2,949,565
負債合計		2,949,565
純資産の部		
元本等		
元本	1	634,008,870
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2	59,857,441
(分配準備積立金)		6,443,537
元本等合計		574,151,429
純資産合計		574,151,429
負債純資産合計		577,100,994

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
営業収益	
受取配当金	3,991,890
受取利息	6,429
有価証券売買等損益	37,900,023
為替差損益	19,003,285
営業収益合計	52,904,989
営業費用	
支払利息	9,858
受託者報酬	232,252
委託者報酬	6,911,725
その他費用	79,851
営業費用合計	7,233,686
営業利益又は営業損失()	60,138,675
経常利益又は経常損失()	60,138,675
当期純利益又は当期純損失()	60,138,675
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	11,625,133
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,782,973
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,782,973
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,126,872
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,126,872
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	59,857,441

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. 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>
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	第1期 平成28年10月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>355,418,559円</p> <p>458,063,901円</p> <p>179,473,590円</p>
2. 受益権の総数	634,008,870口
3. 2 元本の欠損	<p>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59,857,441円であります。</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,443,537円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（381,778円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は6,825,315円（1万口当たり107.65円）であります。分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期
	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	7,014,688
親投資信託受益証券	33,262,058
合計	26,247,370

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期
	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9056円 (9,056円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	8,100.000	938,385.000	
	アメリカ・ドル	小計	8,100.000	938,385.000 (97,254,221)	
投資信託受益証券 合計			8,100	97,254,221 (97,254,221)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	25,144,181	49,853,367	
		国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	43,871,381	56,962,601	
		J-REITインデックス ファンド・マザーファンド	3,359,219	5,873,258	
		外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	34,557,068	87,311,888	
		外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	71,577,949	118,948,235	
		外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	58,355,776	60,293,187	
		コモディティインデックス・ マザーファンド	84,913,094	31,197,070	
		エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	29,076,623	26,081,730	
	日本円	小計	350,855,291	436,521,336	
親投資信託受益証券 合計			350,855,291	436,521,336	
合計				533,775,557 (97,254,221)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	16.94%	18.22%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「MITO ラップ型ファンド(安定型)」、「MITO ラップ型ファンド(中立型)」、「MITO ラップ型ファンド(積極型)」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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、「外国債券パッシブ・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、「コモディティインデックス・マザーファンド」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,889,323,978
株式	2	274,144,773,250
派生商品評価勘定		90,428,948
未収入金		4,319,728
未収配当金		2,350,262,725
流動資産合計		282,479,108,629
資産合計		282,479,108,629
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		182,916
前受金		136,187,200
未払解約金		828,535,000
流動負債合計		964,905,116
負債合計		964,905,116
純資産の部		
元本等		
元本	1	141,984,682,751
剰余金		
剰余金又は欠損金()		139,529,520,762
元本等合計		281,514,203,513
純資産合計		281,514,203,513
負債純資産合計		282,479,108,629

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	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10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	138,472,968,255円
同期中追加設定元本額	37,509,003,652円
同期中一部解約元本額	33,997,289,156円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	6,549,280,589円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,575,376,249円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,822,033円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,618,708円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	25,144,181円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,903,705円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,101,393円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	12,262,597円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	39,026,844,057円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	892,175,848円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,085,053,451円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,110,638,487円

DIAM DC バランス30イン デックスファンド	406,578,514円
DIAM DC バランス50イン デックスファンド	1,299,706,406円
DIAM DC バランス70イン デックスファンド	1,135,404,057円
マネックス資産設計ファンド<隔月分 配型>	63,391,188円
マネックス資産設計ファンド<育成型 >	1,361,434,988円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	29,855,862円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド(新興国10)	34,618,530円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド(新興国20)	70,908,730円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド(新興国30)	134,667,581円
投資のソムリエ	1,532,512,647円
クルーズコントロール	1,361,224,064円
投資のソムリエ<DC年金>	42,045,295円
DIAM 8資産バランスファンドN <DC年金>	111,572,421円
DIAM DC バランス・F(成長 型)	107,729,591円
クルーズコントロール<DC年金>	435,072円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実 型)	16,553,351円
DIAMコア資産設計ファンド(積極 型)	41,655,765円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑 制型	13,516,086円
ダイナミック・ナビゲーション	2,259,439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)	249,214,122円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	108,351,515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)	256,516,116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)	448,843,778円
DIAM国際分散バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	32,496,190円
DIAM国際分散バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	138,048,923円
DIAM国内重視バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	35,339,487円
DIAM国内重視バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	44,104,951円
DIAM世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	2,613,101,420円
DIAM世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	921,644,988円

D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,759,630,851円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,488,934,009円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,941,172,402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)	332,873,979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)	731,561,485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)	937,888,973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)	3,833,571,575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)	51,147,517円
D I A M世界バランスファンド55V A(適格機関投資家限定)	1,360,969,610円
D I A M世界バランスファンド35V A(適格機関投資家限定)	5,436,117,474円
D I A M世界アセットバランスファン ド2VA(適格機関投資家限定)	21,190,612,731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)	778,556,088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)	2,431,224,796円
D I A M世界アセットバランスファン ド3VA(適格機関投資家限定)	13,422,317,174円
D I A Mバランス30VA(適格機関 投資家限定)	7,865,270円
D I A Mバランス50VA(適格機関 投資家限定)	3,381,053円
D I A Mバランス70VA(適格機関 投資家限定)	1,215,517円
D I A M世界アセットバランスファン ド4VA(適格機関投資家限定)	12,044,427,017円
D I A M世界バランス25VA(適格 機関投資家限定)	109,073,229円
D I A M国内バランス30VA(適格 機関投資家限定)	38,767,272円
D I A Mバランス20VA(適格機関 投資家限定)	43,596,204円
D I A Mバランス40VA(適格機関 投資家限定)	81,496円
D I A Mバランス60VA(適格機関 投資家限定)	128,550円
D I A M世界アセットバランスファン ド7VA(1212)(適格機関投資 家限定)	693,705,071円
D I A M世界アセットバランスファン ド7VA(1303)(適格機関投資 家限定)	1,859,845,103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)		2,451,073,369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)		100,992,561円
	計		141,984,682,751円
2 .	受益権の総数		141,984,682,751口
3 .	2 差入代用有価証券	株式	2,978,500,000円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	6,416,796,421	
合計	6,416,796,421	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年2月9日から平成28年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成28年10月12日 現在			
	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	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400
合計	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.9827円
(1万口当たり純資産額)	(19,827円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	6,600	2,712.00	17,899,200	
日本水産	197,800	444.00	87,823,200	
マルハニチロ	31,600	2,712.00	85,699,200	
ハウスイ	12,000	108.00	1,296,000	
カネコ種苗	5,400	1,466.00	7,916,400	
サカタのタネ	22,900	2,900.00	66,410,000	
ホクト	15,800	1,856.00	29,324,800	
ホクリヨウ	1,800	793.00	1,427,400	
ショーボンドホールディングス	16,200	4,855.00	78,651,000	
ミライト・ホールディングス	47,600	878.00	41,792,800	
タマホーム	11,800	523.00	6,171,400	
サンヨーホームズ	3,400	517.00	1,757,800	
住石ホールディングス	46,300	87.00	4,028,100	
日鉄鉱業	4,300	3,945.00	16,963,500	
三井松島産業	10,100	1,165.00	11,766,500	
国際石油開発帝石	814,900	992.20	808,543,780	
日本海洋掘削	4,600	2,431.00	11,182,600	
石油資源開発	24,500	2,527.00	61,911,500	
K&Oエナジーグループ	10,400	1,453.00	15,111,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,700	1,385.00	5,124,500	
安藤・間	103,300	599.00	61,876,700	
東急建設	50,300	999.00	50,249,700	
コムシスホールディングス	66,500	1,774.00	117,971,000	
ミサワホーム	18,200	760.00	13,832,000	
ピーアールホールディングス	13,200	222.00	2,930,400	
高松コンストラクショングループ	11,700	2,368.00	27,705,600	
東建コーポレーション	6,400	7,410.00	47,424,000	
ヤマウラ	7,700	515.00	3,965,500	
大成建設	803,000	763.00	612,689,000	
大林組	464,000	985.00	457,040,000	
清水建設	473,000	895.00	423,335,000	
飛島建設	124,400	175.00	21,770,000	
長谷工コーポレーション	180,500	942.00	170,031,000	
松井建設	17,100	1,160.00	19,836,000	
銭高組	22,000	345.00	7,590,000	
鹿島建設	725,000	702.00	508,950,000	
不動テトラ	109,800	181.00	19,873,800	
大末建設	6,100	842.00	5,136,200	
鉄建建設	94,000	319.00	29,986,000	
西松建設	179,000	460.00	82,340,000	
三井住友建設	592,300	94.00	55,676,200	
大豊建設	60,000	557.00	33,420,000	
前田建設工業	95,000	860.00	81,700,000	

佐田建設	11,100	387.00	4,295,700
ナカノフドー建設	12,200	399.00	4,867,800
奥村組	147,000	565.00	83,055,000
東鉄工業	18,600	2,823.00	52,507,800
イチケン	17,000	299.00	5,083,000
浅沼組	50,000	220.00	11,000,000
戸田建設	180,000	543.00	97,740,000
熊谷組	226,000	259.00	58,534,000
青木あすなる建設	10,400	675.00	7,020,000
北野建設	33,000	262.00	8,646,000
植木組	19,000	214.00	4,066,000
三井ホーム	20,000	464.00	9,280,000
矢作建設工業	21,100	921.00	19,433,100
ピーエス三菱	18,500	351.00	6,493,500
日本ハウスホールディングス	31,600	433.00	13,682,800
大東建託	56,900	15,900.00	904,710,000
新日本建設	18,500	913.00	16,890,500
N I P P O	36,000	1,960.00	70,560,000
東亜道路工業	30,000	256.00	7,680,000
前田道路	48,000	1,810.00	86,880,000
日本道路	46,000	403.00	18,538,000
東亜建設工業	13,500	1,905.00	25,717,500
若築建設	91,000	145.00	13,195,000
東洋建設	48,800	423.00	20,642,400
五洋建設	171,800	596.00	102,392,800
大林道路	18,200	629.00	11,447,800
世紀東急工業	24,400	488.00	11,907,200
福田組	25,000	1,114.00	27,850,000
日本ドライケミカル	1,900	2,269.00	4,311,100
住友林業	106,400	1,359.00	144,597,600
日本基礎技術	17,800	334.00	5,945,200
日成ビルド工業	43,000	500.00	21,500,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	72.00	5,760,000
巴コーポレーション	19,800	330.00	6,534,000
パナホーム	58,000	786.00	45,588,000
大和ハウス工業	457,000	2,657.50	1,214,477,500
ライト工業	29,800	1,206.00	35,938,800
積水ハウス	517,200	1,623.50	839,674,200
日特建設	17,300	459.00	7,940,700
北陸電気工事	7,600	695.00	5,282,000
ユアテック	25,000	583.00	14,575,000
西部電気工業	2,400	2,000.00	4,800,000
四電工	6,000	391.00	2,346,000
中電工	22,400	2,080.00	46,592,000
関電工	62,000	945.00	58,590,000
きんでん	93,600	1,207.00	112,975,200
東京エネシス	18,000	1,031.00	18,558,000
トーエネック	22,000	510.00	11,220,000
住友電設	12,300	1,115.00	13,714,500
日本電設工業	25,300	1,909.00	48,297,700

協和エクシオ	60,600	1,482.00	89,809,200
新日本空調	13,200	1,134.00	14,968,800
日本工営	48,000	486.00	23,328,000
N D S	2,500	2,476.00	6,190,000
九電工	28,300	3,605.00	102,021,500
三機工業	34,400	905.00	31,132,000
日揮	155,400	1,834.00	285,003,600
中外炉工業	47,000	199.00	9,353,000
ヤマト	14,400	556.00	8,006,400
太平電業	23,000	981.00	22,563,000
高砂熱学工業	46,200	1,514.00	69,946,800
三晃金属工業	1,600	2,818.00	4,508,800
N E C ネットズエスアイ	17,100	1,744.00	29,822,400
朝日工業社	3,200	2,850.00	9,120,000
明星工業	28,200	472.00	13,310,400
大気社	19,000	2,541.00	48,279,000
ダイダン	20,000	798.00	15,960,000
日比谷総合設備	18,700	1,664.00	31,116,800
東芝プラントシステム	25,100	1,612.00	40,461,200
日本製粉	49,500	1,550.00	76,725,000
日清製粉グループ本社	169,700	1,542.00	261,677,400
日東富士製粉	800	3,595.00	2,876,000
昭和産業	64,000	554.00	35,456,000
鳥越製粉	12,800	727.00	9,305,600
中部飼料	14,500	754.00	10,933,000
フィード・ワン	94,500	122.00	11,529,000
東洋精糖	26,000	109.00	2,834,000
日本甜菜製糖	8,000	1,959.00	15,672,000
三井製糖	12,200	2,503.00	30,536,600
塩水港精糖	17,700	246.00	4,354,200
日新製糖	6,600	1,409.00	9,299,400
ネクスト	40,800	829.00	33,823,200
ジェイエイシーリクルートメント	8,900	1,156.00	10,288,400
日本M & A センター	45,200	3,045.00	137,634,000
ノバレーゼ	4,000	1,942.00	7,768,000
アコーディア・ゴルフ	40,000	1,023.00	40,920,000
中広	1,400	658.00	921,200
タケエイ	12,700	813.00	10,325,100
トラスト・テック	5,900	1,587.00	9,363,300
パソナグループ	12,600	792.00	9,979,200
C D S	3,500	923.00	3,230,500
リンクアンドモチベーション	29,800	274.00	8,165,200
G C A	12,900	750.00	9,675,000
エス・エム・エス	18,000	2,791.00	50,238,000
テンブホールディングス	101,200	1,749.00	176,998,800
リニカル	8,500	1,395.00	11,857,500
クックパッド	32,200	974.00	31,362,800
エスクリ	6,400	535.00	3,424,000
アイ・ケイ・ケイ	6,800	632.00	4,297,600
森永製菓	28,000	4,765.00	133,420,000

中村屋	3,500	4,660.00	16,310,000
江崎グリコ	35,700	5,830.00	208,131,000
名糖産業	7,100	1,372.00	9,741,200
不二家	89,000	203.00	18,067,000
山崎製パン	113,400	2,478.00	281,005,200
第一屋製パン	25,000	130.00	3,250,000
モロゾフ	24,000	443.00	10,632,000
亀田製菓	8,600	5,420.00	46,612,000
寿スピリッツ	11,100	2,422.00	26,884,200
カルビー	57,400	3,830.00	219,842,000
森永乳業	139,000	785.00	109,115,000
六甲バター	6,900	2,782.00	19,195,800
ヤクルト本社	83,000	4,545.00	377,235,000
明治ホールディングス	91,700	10,100.00	926,170,000
雪印メグミルク	36,400	3,510.00	127,764,000
プリマハム	98,000	375.00	36,750,000
日本ハム	114,000	2,414.00	275,196,000
林兼産業	5,200	902.00	4,690,400
丸大食品	80,000	492.00	39,360,000
S Foods	9,700	2,743.00	26,607,100
伊藤ハム米久ホールディングス	92,500	992.00	91,760,000
学情	5,500	1,117.00	6,143,500
スタジオアリス	5,900	2,132.00	12,578,800
シミックホールディングス	7,400	1,500.00	11,100,000
システナ	13,300	1,939.00	25,788,700
N J S	3,100	1,161.00	3,599,100
デジタルアーツ	6,700	2,586.00	17,326,200
新日鉄住金ソリューションズ	22,800	1,784.00	40,675,200
総合警備保障	48,100	5,260.00	253,006,000
キューブシステム	6,200	620.00	3,844,000
いちご	150,900	443.00	66,848,700
日本駐車場開発	164,500	139.00	22,865,500
コア	5,900	1,022.00	6,029,800
カカクコム	103,600	1,790.00	185,444,000
アイロムグループ	4,200	1,039.00	4,363,800
ルネサンス	7,600	1,303.00	9,902,800
ディップ	16,000	2,998.00	47,968,000
S B Sホールディングス	13,700	873.00	11,960,100
オプトホールディング	9,300	728.00	6,770,400
新日本科学	13,900	614.00	8,534,600
ツクイ	34,300	666.00	22,843,800
キャリアデザインセンター	3,100	915.00	2,836,500
エムスリー	125,000	3,505.00	438,125,000
ツカダ・グローバルホールディング	10,900	710.00	7,739,000
アウトソーシング	8,200	4,045.00	33,169,000
ウェルネット	10,900	1,270.00	13,843,000
ワールドホールディングス	3,300	1,654.00	5,458,200
ディー・エヌ・エー	64,700	3,295.00	213,186,500
博報堂D Yホールディングス	200,000	1,180.00	236,000,000
ぐるなび	16,700	2,830.00	47,261,000

エスアールジータカミヤ	15,800	556.00	8,784,800
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	217.00	3,927,700
ファンコミュニケーションズ	36,700	753.00	27,635,100
ジェイコムホールディングス	3,000	1,902.00	5,706,000
WDBホールディングス	5,300	1,076.00	5,702,800
ティア	7,300	617.00	4,504,100
パリュコマース	13,700	351.00	4,808,700
インフォマート	30,700	1,248.00	38,313,600
サッポロホールディングス	50,700	2,901.00	147,080,700
アサヒグループホールディングス	290,300	3,672.00	1,065,981,600
麒麟ホールディングス	666,200	1,684.50	1,122,213,900
宝ホールディングス	112,100	977.00	109,521,700
オエノンホールディングス	41,000	238.00	9,758,000
養命酒製造	4,900	1,835.00	8,991,500
コカ・コーラウエスト	52,400	2,908.00	152,379,200
コカ・コーライーストジャパン	60,300	2,191.00	132,117,300
サントリー食品インターナショナル	106,000	4,425.00	469,050,000
ダイドードリンコ	7,900	5,670.00	44,793,000
伊藤園	45,900	3,640.00	167,076,000
キーコーヒー	13,700	1,905.00	26,098,500
ユニカフェ	4,500	905.00	4,072,500
ジャパンフーズ	2,300	1,155.00	2,656,500
日清オイリオグループ	82,000	479.00	39,278,000
不二製油グループ本社	41,300	2,034.00	84,004,200
J-オイルミルズ	6,500	3,635.00	23,627,500
ローソン	51,600	7,670.00	395,772,000
サンエー	9,300	5,300.00	49,290,000
カワチ薬品	10,500	2,501.00	26,260,500
エービーシー・マート	17,700	6,340.00	112,218,000
ハードオフコーポレーション	6,700	1,131.00	7,577,700
高千穂交易	5,500	903.00	4,966,500
アスクル	16,600	4,250.00	70,550,000
ゲオホールディングス	22,800	1,281.00	29,206,800
アダストリア	25,100	2,474.00	62,097,400
ジーフット	8,200	724.00	5,936,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	798.00	1,596,000
伊藤忠食品	3,300	4,080.00	13,464,000
くらコーポレーション	8,900	4,895.00	43,565,500
キャンドウ	7,200	1,652.00	11,894,400
エレマテック	6,400	1,955.00	12,512,000
パルグループホールディングス	8,000	2,213.00	17,704,000
JALUX	4,400	1,830.00	8,052,000
エディオン	57,600	884.00	50,918,400
あらた	6,100	2,335.00	14,243,500
サーラコーポレーション	17,200	608.00	10,457,600
ワッツ	5,900	1,010.00	5,959,000
トーメンデバイス	1,900	1,824.00	3,465,600
ハローズ	4,500	2,194.00	9,873,000
J Pホールディングス	36,000	263.00	9,468,000
あみやき亭	2,700	3,690.00	9,963,000

東京エレクトロン デバイス	5,000	1,493.00	7,465,000
ひらまつ	18,800	594.00	11,167,200
フィールズ	11,900	1,208.00	14,375,200
双日	858,100	264.00	226,538,400
ゲンキー	2,700	4,100.00	11,070,000
アルフレッサ ホールディングス	171,300	2,162.00	370,350,600
大黒天物産	3,300	4,630.00	15,279,000
ハニーズ	12,000	1,176.00	14,112,000
ファーマライズホールディングス	3,300	539.00	1,778,700
キッコーマン	117,000	3,295.00	385,515,000
味の素	318,700	2,287.50	729,026,250
キューピー	78,700	2,912.00	229,174,400
ハウス食品グループ本社	52,900	2,324.00	122,939,600
カゴメ	55,600	2,629.00	146,172,400
焼津水産化学工業	7,700	1,002.00	7,715,400
アリアケジャパン	12,700	5,400.00	68,580,000
ピエトロ	1,700	1,549.00	2,633,300
エバラ食品工業	3,900	1,968.00	7,675,200
ニチレイ	82,500	2,214.00	182,655,000
横浜冷凍	33,900	1,078.00	36,544,200
東洋水産	76,100	4,360.00	331,796,000
イトアンド	1,800	2,050.00	3,690,000
日清食品ホールディングス	65,500	6,070.00	397,585,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,287.00	9,009,000
一正蒲鉾	5,500	1,116.00	6,138,000
フジッコ	15,100	2,260.00	34,126,000
ロック・フィールド	16,200	1,474.00	23,878,800
日本たばこ産業	857,400	4,165.00	3,571,071,000
ケンコーマヨネーズ	5,100	3,525.00	17,977,500
わらべや日洋ホールディングス	8,400	2,386.00	20,042,400
なとり	7,900	1,725.00	13,627,500
北の達人コーポレーション	3,100	449.00	1,391,900
ユーグレナ	49,600	1,412.00	70,035,200
片倉工業	18,100	1,255.00	22,715,500
グンゼ	117,000	328.00	38,376,000
ヒューリック	284,200	982.00	279,084,400
神栄	19,000	117.00	2,223,000
山下医科器械	1,200	1,721.00	2,065,200
ラサ商事	6,800	525.00	3,570,000
アルペン	12,200	1,880.00	22,936,000
ラクーン	5,900	522.00	3,079,800
クオール	13,900	1,502.00	20,877,800
アルコニックス	7,800	1,414.00	11,029,200
神戸物産	7,300	3,045.00	22,228,500
ジェイアイエヌ	9,300	4,975.00	46,267,500
ビックカメラ	78,200	892.00	69,754,400
DCMホールディングス	67,000	885.00	59,295,000
MonotaRO	48,200	2,760.00	133,032,000
東京一番フーズ	2,400	558.00	1,339,200
ダイヤモンドダイニング	3,000	1,040.00	3,120,000

あい ホールディングス	24,300	2,362.00	57,396,600
ディービーエックス	4,900	1,377.00	6,747,300
きちり	3,900	675.00	2,632,500
アークランドサービスホールディングス	4,300	3,130.00	13,459,000
J.フロント リテイリング	172,400	1,377.00	237,394,800
ドトール・日レスホールディングス	23,900	1,902.00	45,457,800
マツモトキヨシホールディングス	28,100	5,270.00	148,087,000
ブロンコピリー	7,100	2,991.00	21,236,100
スタートトゥデイ	124,500	1,754.00	218,373,000
トレジャー・ファクトリー	4,000	896.00	3,584,000
物語コーポレーション	3,600	4,545.00	16,362,000
ココカラファイン	14,200	3,810.00	54,102,000
三越伊勢丹ホールディングス	271,000	1,043.00	282,653,000
東洋紡	572,000	166.00	94,952,000
ユニチカ	421,000	62.00	26,102,000
富士紡ホールディングス	7,000	2,987.00	20,909,000
日清紡ホールディングス	76,600	1,021.00	78,208,600
倉敷紡績	146,000	194.00	28,324,000
ダイワボウホールディングス	124,000	242.00	30,008,000
シキボウ	90,000	112.00	10,080,000
日東紡績	96,000	343.00	32,928,000
トヨタ紡織	48,300	2,350.00	113,505,000
マクニカ・富士エレホールディングス	24,500	1,201.00	29,424,500
H a m e e	1,000	2,077.00	2,077,000
ウエルシアホールディングス	11,800	7,090.00	83,662,000
クリエイトSDホールディングス	20,100	2,165.00	43,516,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,700	1,065.00	25,240,500
八洲電機	10,800	560.00	6,048,000
U K Cホールディングス	8,700	1,692.00	14,720,400
丸善C H Iホールディングス	16,500	376.00	6,204,000
O C H Iホールディングス	3,300	1,047.00	3,455,100
T O K A Iホールディングス	60,100	663.00	39,846,300
ミサワ	1,800	446.00	802,800
エー・ピーカンパニー	2,300	675.00	1,552,500
三洋貿易	7,600	1,261.00	9,583,600
チムニー	3,400	2,855.00	9,707,000
シュッピン	5,200	1,079.00	5,610,800
ビューティガレージ	1,200	1,220.00	1,464,000
ウイン・パートナーズ	5,000	1,713.00	8,565,000
ネクステージ	2,200	1,827.00	4,019,400
ジョイフル本田	22,100	2,689.00	59,426,900
鳥貴族	3,400	2,671.00	9,081,400
キリン堂ホールディングス	4,600	751.00	3,454,600
ホットランド	4,900	1,000.00	4,900,000
すかいらく	58,400	1,386.00	80,942,400
綿半ホールディングス	5,100	1,748.00	8,914,800
日本毛織	40,700	739.00	30,077,300
ダイトウボウ	24,000	69.00	1,656,000

トーア紡コーポレーション	6,300	506.00	3,187,800
ダイドーリミテッド	16,700	405.00	6,763,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,100	942.00	42,484,200
三栄建築設計	5,600	1,399.00	7,834,400
野村不動産ホールディングス	90,400	1,596.00	144,278,400
三重交通グループホールディングス	24,400	391.00	9,540,400
サムティ	10,100	1,000.00	10,100,000
ディア・ライフ	9,600	332.00	3,187,200
エー・ディー・ワークス	130,000	38.00	4,940,000
日本商業開発	6,100	1,726.00	10,528,600
プレサンスコーポレーション	18,800	1,119.00	21,037,200
ユニゾホールディングス	8,900	2,711.00	24,127,900
THEグローバル社	4,900	438.00	2,146,200
日本管理センター	9,200	1,278.00	11,757,600
サンセイランディック	3,100	642.00	1,990,200
エストラスト	2,400	526.00	1,262,400
フージャースホールディングス	19,200	507.00	9,734,400
オープンハウス	19,700	2,030.00	39,991,000
東急不動産ホールディングス	329,500	533.00	175,623,500
飯田グループホールディングス	126,200	1,943.00	245,206,600
ムゲンエステート	4,000	732.00	2,928,000
帝国繊維	15,200	1,565.00	23,788,000
ブックオフコーポレーション	8,100	808.00	6,544,800
日本コークス工業	118,100	83.00	9,802,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	739.00	2,882,100
ミタチ産業	3,800	594.00	2,257,200
あさひ	10,200	1,219.00	12,433,800
日本調剤	3,500	4,345.00	15,207,500
コスモス薬品	6,900	21,840.00	150,696,000
シップヘルスケアホールディングス	27,700	3,030.00	83,931,000
トーエル	6,800	930.00	6,324,000
一六堂	3,600	347.00	1,249,200
ソフトクリエイトホールディングス	6,700	1,106.00	7,410,200
セブン&アイ・ホールディングス	570,000	4,423.00	2,521,110,000
薬王堂	2,600	6,570.00	17,082,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	36,600	1,035.00	37,881,000
明治電機工業	4,300	1,009.00	4,338,700
ツルハホールディングス	31,400	11,170.00	350,738,000
デリカフーズ	3,100	973.00	3,016,300
スターティア	2,600	516.00	1,341,600
サンマルクホールディングス	10,800	2,779.00	30,013,200
フェリシモ	3,900	996.00	3,884,400
トリドールホールディングス	16,700	2,475.00	41,332,500
クスリのアオキ	12,100	4,975.00	60,197,500
帝人	118,200	1,928.00	227,889,600
東レ	1,049,000	945.00	991,305,000
クラレ	243,300	1,498.00	364,463,400
旭化成	902,000	822.20	741,624,400

サカイオーベックス	3,800	1,964.00	7,463,200
稲葉製作所	7,900	1,283.00	10,135,700
宮地エンジニアリンググループ	45,000	153.00	6,885,000
トーカロ	10,200	2,229.00	22,735,800
アルファ	5,100	975.00	4,972,500
SUMCO	150,800	915.00	137,982,000
川田テクノロジーズ	2,700	4,435.00	11,974,500
シーアールイー	1,000	3,425.00	3,425,000
住江織物	37,000	234.00	8,658,000
日本フェルト	8,100	487.00	3,944,700
イチカワ	10,000	257.00	2,570,000
エコナックホールディングス	46,000	47.00	2,162,000
日東製網	16,000	161.00	2,576,000
芦森工業	32,000	157.00	5,024,000
アツギ	111,000	107.00	11,877,000
コメダホールディングス	18,300	1,690.00	30,927,000
サツドラホールディングス	1,900	1,916.00	3,640,400
ダイユー・リックホールディングス	4,400	625.00	2,750,000
ダイニック	29,000	161.00	4,669,000
共和レザー	9,600	751.00	7,209,600
セーレン	36,100	1,216.00	43,897,600
ソトー	5,500	1,160.00	6,380,000
東海染工	21,000	122.00	2,562,000
小松精練	22,400	650.00	14,560,000
ワコールホールディングス	86,000	1,147.00	98,642,000
ホギメディカル	9,100	7,090.00	64,519,000
レナウン	39,100	103.00	4,027,300
クラウドディア	3,600	485.00	1,746,000
T S Iホールディングス	64,300	579.00	37,229,700
T I S	45,200	2,714.00	122,672,800
ネオス	4,200	510.00	2,142,000
電算システム	4,800	1,632.00	7,833,600
グリー	82,900	549.00	45,512,100
コーエーテックモホールディングス	32,400	1,942.00	62,920,800
三菱総合研究所	5,300	3,215.00	17,039,500
ボルテージ	2,700	1,051.00	2,837,700
電算	1,600	1,980.00	3,168,000
A G S	2,600	1,103.00	2,867,800
ファインデックス	9,200	1,457.00	13,404,400
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	1,546.00	4,792,600
ブレインパッド	2,100	1,092.00	2,293,200
K L a b	26,000	616.00	16,016,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	9,200	885.00	8,142,000
イーブックイニシアティブジャパン	3,000	915.00	2,745,000
ネクソン	149,700	1,591.00	238,172,700
アイスタイル	20,800	795.00	16,536,000
エムアップ	3,700	606.00	2,242,200
エイチーム	7,500	2,227.00	16,702,500
テクノスジャパン	4,000	2,107.00	8,428,000

e n i s h	4,200	513.00	2,154,600	
コロブラ	37,900	1,533.00	58,100,700	
モバイルクリエイト	9,300	303.00	2,817,900	
オルトプラス	5,300	334.00	1,770,200	
ブロードリーフ	16,800	1,076.00	18,076,800	
ハーツユナイテッドグループ	8,200	1,981.00	16,244,200	
メディアドゥ	2,900	1,567.00	4,544,300	
ブイキューブ	7,500	885.00	6,637,500	
サイバーリンクス	2,100	907.00	1,904,700	
ディー・エル・イー	3,800	623.00	2,367,400	
VOYAGE GROUP	4,700	994.00	4,671,800	
オブティム	1,100	5,400.00	5,940,000	
特種東海製紙	8,400	3,520.00	29,568,000	
ベリサーブ	1,600	3,480.00	5,568,000	
ティーガイア	13,600	1,530.00	20,808,000	
日本アジアグループ	15,500	386.00	5,983,000	
豆蔵ホールディングス	10,900	1,113.00	12,131,700	
テクマトリックス	5,900	2,126.00	12,543,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	317,200	237.00	75,176,400	
GMOペイメントゲートウェイ	11,200	5,250.00	58,800,000	
ザッパラス	8,100	357.00	2,891,700	
インターネットイニシアティブ	22,000	1,850.00	40,700,000	
さくらインターネット	9,000	1,029.00	9,261,000	
GMOクラウド	3,100	1,044.00	3,236,400	
SRAホールディングス	7,900	2,396.00	18,928,400	
MINORIソリューションズ	2,800	929.00	2,601,200	
システムインテグレータ	2,000	576.00	1,152,000	
朝日ネット	13,000	405.00	5,265,000	
フリービット	7,700	847.00	6,521,900	
コムチュア	2,300	3,660.00	8,418,000	
サイバーコム	1,600	884.00	1,414,400	
王子ホールディングス	565,000	410.00	231,650,000	
日本製紙	74,700	1,828.00	136,551,600	
三菱製紙	22,100	697.00	15,403,700	
北越紀州製紙	89,600	626.00	56,089,600	
中越パルプ工業	57,000	225.00	12,825,000	
巴川製紙所	23,000	255.00	5,865,000	
大王製紙	64,100	1,206.00	77,304,600	
g u m i	14,100	757.00	10,673,700	
パイブドHD	1,800	1,090.00	1,962,000	
L I N E	22,600	4,905.00	110,853,000	
レンゴー	128,000	639.00	81,792,000	
トーモク	46,000	290.00	13,340,000	
ザ・バック	10,200	2,766.00	28,213,200	
昭和電工	96,300	1,362.00	131,160,600	
住友化学	1,064,000	479.00	509,656,000	
日本化成	28,000	134.00	3,752,000	
住友精化	6,000	3,660.00	21,960,000	
日産化学工業	86,400	3,190.00	275,616,000	

ラサ工業	55,000	115.00	6,325,000
クレハ	10,900	3,820.00	41,638,000
多木化学	8,000	726.00	5,808,000
テイカ	24,000	540.00	12,960,000
石原産業	26,000	713.00	18,538,000
片倉コープアグリ	18,000	214.00	3,852,000
日東エフシー	8,600	822.00	7,069,200
日本曹達	93,000	436.00	40,548,000
東ソー	390,000	658.00	256,620,000
トクヤマ	240,000	481.00	115,440,000
セントラル硝子	157,000	406.00	63,742,000
東亜合成	90,400	1,117.00	100,976,800
大阪ソーダ	62,000	423.00	26,226,000
関東電化工業	35,000	907.00	31,745,000
デンカ	300,000	412.00	123,600,000
イビデン	84,500	1,482.00	125,229,000
信越化学工業	259,300	7,376.00	1,912,596,800
日本カーバイド工業	50,000	140.00	7,000,000
堺化学工業	58,000	339.00	19,662,000
エア・ウォーター	119,000	1,872.00	222,768,000
大陽日酸	111,400	1,050.00	116,970,000
日本化学工業	54,000	251.00	13,554,000
日本パーカライズン	73,900	1,416.00	104,642,400
高圧ガス工業	20,000	683.00	13,660,000
チタン工業	18,000	185.00	3,330,000
四国化成工業	21,000	944.00	19,824,000
戸田工業	29,000	287.00	8,323,000
ステラ ケミファ	7,400	3,765.00	27,861,000
保土谷化学工業	4,300	2,764.00	11,885,200
日本触媒	21,000	6,550.00	137,550,000
大日精化工業	56,000	521.00	29,176,000
カネカ	195,000	808.00	157,560,000
協和発酵キリン	173,000	1,578.00	272,994,000
三菱瓦斯化学	124,500	1,485.00	184,882,500
三井化学	613,000	502.00	307,726,000
J S R	135,600	1,655.00	224,418,000
東京応化工業	29,000	3,140.00	91,060,000
大阪有機化学工業	9,900	728.00	7,207,200
三菱ケミカルホールディングス	968,500	644.40	624,101,400
ダイセル	195,100	1,227.00	239,387,700
住友ベークライト	127,000	550.00	69,850,000
積水化学工業	328,200	1,483.00	486,720,600
日本ゼオン	122,000	924.00	112,728,000
アイカ工業	43,400	2,716.00	117,874,400
宇部興産	774,000	199.00	154,026,000
積水樹脂	22,400	1,661.00	37,206,400
タキロン	34,000	470.00	15,980,000
旭有機材	47,000	194.00	9,118,000
日立化成	71,400	2,413.00	172,288,200
ニチバン	14,000	835.00	11,690,000

リケンテクノス	31,400	493.00	15,480,200
大倉工業	35,000	378.00	13,230,000
積水化成成品工業	18,500	729.00	13,486,500
群栄化学工業	3,800	2,983.00	11,335,400
タイガースポリマー	7,400	678.00	5,017,200
ミライアル	5,300	707.00	3,747,100
ダイキアクシス	2,600	938.00	2,438,800
ダイキョーニシカワ	18,700	1,270.00	23,749,000
日本化薬	94,000	1,138.00	106,972,000
カーリットホールディングス	13,500	521.00	7,033,500
E P Sホールディングス	17,900	1,375.00	24,612,500
レグス	3,000	800.00	2,400,000
プレステージ・インターナショナル	24,600	792.00	19,483,200
フェイス	3,700	1,123.00	4,155,100
アミューズ	8,000	1,783.00	14,264,000
野村総合研究所	92,600	3,540.00	327,804,000
ドリームインキュベータ	4,800	2,168.00	10,406,400
サイバネットシステム	11,200	730.00	8,176,000
クイック	7,500	1,026.00	7,695,000
T A C	8,200	200.00	1,640,000
C Eホールディングス	1,800	1,002.00	1,803,600
ケネディクス	193,600	429.00	83,054,400
電通	160,700	5,110.00	821,177,000
インテージホールディングス	7,200	1,746.00	12,571,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	467.00	3,175,600
東邦システムサイエンス	4,300	600.00	2,580,000
ぴあ	4,500	2,300.00	10,350,000
イオンファンタジー	5,100	2,994.00	15,269,400
ソースネクスト	7,100	502.00	3,564,200
シーティーエス	4,700	869.00	4,084,300
ネクシィーズグループ	5,200	1,418.00	7,373,600
メディカルシステムネットワーク	15,800	463.00	7,315,400
ティー・ワイ・オー	27,800	143.00	3,975,400
日本精化	12,100	780.00	9,438,000
扶桑化学工業	9,200	2,225.00	20,470,000
A D E K A	71,100	1,418.00	100,819,800
日油	108,000	1,066.00	115,128,000
ミヨシ油脂	54,000	128.00	6,912,000
新日本理化	23,100	144.00	3,326,400
ハリマ化成グループ	12,600	530.00	6,678,000
花王	367,300	5,651.00	2,075,612,300
第一工業製薬	32,000	343.00	10,976,000
三洋化成工業	9,000	4,430.00	39,870,000
武田薬品工業	576,000	4,851.00	2,794,176,000
アステラス製薬	1,569,700	1,550.00	2,433,035,000
大日本住友製薬	102,400	1,910.00	195,584,000
塩野義製薬	210,800	5,250.00	1,106,700,000
田辺三菱製薬	168,500	2,176.00	366,656,000
わかもと製薬	7,000	236.00	1,652,000
あすか製薬	18,400	1,771.00	32,586,400

日本新薬	33,100	5,360.00	177,416,000
ビオフェルミン製薬	2,400	2,649.00	6,357,600
中外製薬	144,000	3,660.00	527,040,000
科研製薬	24,900	6,360.00	158,364,000
エーザイ	178,000	6,641.00	1,182,098,000
理研ビタミン	3,900	4,945.00	19,285,500
ロート製薬	70,800	1,713.00	121,280,400
小野薬品工業	328,400	2,814.50	924,281,800
久光製薬	44,900	5,250.00	235,725,000
有機合成薬品工業	10,400	219.00	2,277,600
持田製薬	9,900	8,080.00	79,992,000
参天製薬	266,500	1,502.00	400,283,000
扶桑薬品工業	4,900	2,713.00	13,293,700
日本ケミファ	1,800	4,385.00	7,893,000
ツムラ	45,500	2,933.00	133,451,500
日医工	33,800	1,961.00	66,281,800
テルモ	211,600	3,960.00	837,936,000
みらかホールディングス	36,800	5,090.00	187,312,000
キッセイ薬品工業	25,600	2,768.00	70,860,800
生化学工業	26,800	1,660.00	44,488,000
栄研化学	12,200	3,015.00	36,783,000
日水製薬	6,000	1,150.00	6,900,000
鳥居薬品	9,900	2,164.00	21,423,600
JCRファーマ	11,200	2,520.00	28,224,000
東和薬品	6,600	4,145.00	27,357,000
富士製薬工業	4,700	2,623.00	12,328,100
沢井製薬	24,500	7,090.00	173,705,000
ゼリア新薬工業	29,600	1,746.00	51,681,600
第一三共	486,300	2,457.50	1,195,082,250
キョーリン製薬ホールディングス	38,600	2,291.00	88,432,600
大幸薬品	7,100	1,597.00	11,338,700
ダイト	8,100	2,263.00	18,330,300
大塚ホールディングス	310,900	4,573.00	1,421,745,700
大正製薬ホールディングス	34,800	10,230.00	356,004,000
ペプチドリーム	24,200	5,340.00	129,228,000
大日本塗料	83,000	214.00	17,762,000
日本ペイントホールディングス	111,600	3,525.00	393,390,000
関西ペイント	163,600	2,205.00	360,738,000
神東塗料	11,000	198.00	2,178,000
中国塗料	41,000	719.00	29,479,000
日本特殊塗料	10,200	1,325.00	13,515,000
藤倉化成	19,800	591.00	11,701,800
太陽ホールディングス	10,600	3,650.00	38,690,000
DIC	57,100	3,240.00	185,004,000
サカタインクス	29,500	1,281.00	37,789,500
東洋インキSCホールディングス	143,000	470.00	67,210,000
T&K TOKA	10,500	944.00	9,912,000
アルプス技研	5,500	2,226.00	12,243,000
サニックス	23,400	159.00	3,720,600
ダイオーズ	2,700	960.00	2,592,000

日本空調サービス	13,000	560.00	7,280,000
オリエンタルランド	155,900	6,062.00	945,065,800
フォーカスシステムズ	5,600	507.00	2,839,200
ダスキン	37,000	1,934.00	71,558,000
パーク24	68,900	3,240.00	223,236,000
明光ネットワークジャパン	18,000	988.00	17,784,000
ファルコホールディングス	6,500	1,328.00	8,632,000
クレスコ	3,100	2,331.00	7,226,100
フジ・メディア・ホールディングス	141,800	1,410.00	199,938,000
秀英予備校	2,900	346.00	1,003,400
田谷	3,000	651.00	1,953,000
ラウンドワン	45,100	690.00	31,119,000
リゾートトラスト	60,500	1,995.00	120,697,500
オービック	47,000	5,290.00	248,630,000
ジャストシステム	24,800	897.00	22,245,600
TDCソフトウェアエンジニアリング	6,200	1,004.00	6,224,800
ヤフー	977,000	407.00	397,639,000
ビー・エム・エル	17,000	2,810.00	47,770,000
ワタベウェディング	4,300	458.00	1,969,400
トレンドマイクロ	72,200	3,540.00	255,588,000
りらいあコミュニケーションズ	23,800	933.00	22,205,400
インフォメーション・ディベロプメント	2,700	970.00	2,619,000
リソー教育	26,900	524.00	14,095,600
日本オラクル	21,900	5,500.00	120,450,000
早稲田アカデミー	2,100	851.00	1,787,100
アルファシステムズ	4,600	1,741.00	8,008,600
フューチャー	16,800	751.00	12,616,800
CAC Holdings	10,300	896.00	9,228,800
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	3,100.00	11,470,000
トーセ	3,800	790.00	3,002,000
ユー・エス・エス	174,600	1,709.00	298,391,400
オービックビジネスコンサルタント	6,900	4,840.00	33,396,000
伊藤忠テクノソリューションズ	30,900	2,613.00	80,741,700
アイティフォー	18,000	652.00	11,736,000
東京個別指導学院	7,200	551.00	3,967,200
東計電算	2,500	1,947.00	4,867,500
サイバーエージェント	76,000	3,010.00	228,760,000
楽天	736,700	1,302.00	959,183,400
エクスネット	1,400	1,525.00	2,135,000
クリーク・アンド・リバー社	5,800	741.00	4,297,800
テー・オー・ダブリュー	11,700	652.00	7,628,400
大塚商会	36,700	4,945.00	181,481,500
総合メディカル	6,600	3,215.00	21,219,000
サイボウズ	18,400	433.00	7,967,200
ソフトブレーン	18,700	407.00	7,610,900
セントラルスポーツ	5,000	2,427.00	12,135,000
パラカ	4,000	1,741.00	6,964,000
電通国際情報サービス	8,400	1,858.00	15,607,200
デジタルガレージ	21,300	1,943.00	41,385,900

イーエムシステムズ	4,700	1,608.00	7,557,600
ウェザーニューズ	4,600	3,115.00	14,329,000
C I J	12,900	483.00	6,230,700
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,417.00	2,125,500
日本エンタープライズ	14,300	288.00	4,118,400
WOWOW	6,500	2,763.00	17,959,500
フュージョンパートナー	8,700	961.00	8,360,700
フルキャストホールディングス	13,500	876.00	11,826,000
富士フイルムホールディングス	330,900	3,874.00	1,281,906,600
コニカミノルタ	344,700	886.00	305,404,200
資生堂	274,400	2,571.50	705,619,600
ライオン	180,000	1,643.00	295,740,000
高砂香料工業	9,500	2,733.00	25,963,500
マンダム	13,500	4,640.00	62,640,000
ミルボン	7,800	4,630.00	36,114,000
ファンケル	33,500	1,711.00	57,318,500
コーセー	23,400	9,880.00	231,192,000
コタ	5,000	1,170.00	5,850,000
シーズ・ホールディングス	18,700	2,991.00	55,931,700
シーボン	1,600	2,161.00	3,457,600
ポーラ・オルビスホールディングス	14,700	8,850.00	130,095,000
ノエビアホールディングス	9,200	3,090.00	28,428,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	859.00	2,577,000
エステー	10,000	1,202.00	12,020,000
アグロ カネショウ	5,700	1,115.00	6,355,500
コニシ	22,700	1,245.00	28,261,500
長谷川香料	18,300	1,823.00	33,360,900
星光P M C	7,900	1,114.00	8,800,600
小林製薬	43,800	5,270.00	230,826,000
荒川化学工業	12,400	1,307.00	16,206,800
メック	11,200	1,048.00	11,737,600
日本高純度化学	4,100	2,391.00	9,803,100
タカラバイオ	31,000	1,510.00	46,810,000
J C U	4,300	3,880.00	16,684,000
新田ゼラチン	9,700	730.00	7,081,000
O A T アグリオ	1,700	1,272.00	2,162,400
デクセリアルズ	43,200	873.00	37,713,600
アース製薬	10,400	4,780.00	49,712,000
イハラケミカル工業	20,100	915.00	18,391,500
北興化学工業	14,000	318.00	4,452,000
大成ラミック	4,200	2,864.00	12,028,800
クミアイ化学工業	29,900	552.00	16,504,800
日本農薬	33,100	525.00	17,377,500
昭和シェル石油	129,200	990.00	127,908,000
富士興産	5,500	420.00	2,310,000
ニチレキ	17,900	756.00	13,532,400
東燃ゼネラル石油	235,000	1,029.00	241,815,000
ユシロ化学工業	7,800	1,418.00	11,060,400
ビーピー・カストロール	6,000	1,323.00	7,938,000
富士石油	33,700	337.00	11,356,900

MORESCO	4,600	1,275.00	5,865,000
出光興産	75,400	2,310.00	174,174,000
JXホールディングス	1,710,800	414.70	709,468,760
コスモエネルギーホールディングス	43,600	1,315.00	57,334,000
横浜ゴム	87,200	1,682.00	146,670,400
東洋ゴム工業	76,300	1,494.00	113,992,200
ブリヂストン	488,000	3,884.00	1,895,392,000
住友ゴム工業	135,200	1,610.00	217,672,000
藤倉ゴム工業	12,500	600.00	7,500,000
オカモト	44,000	1,129.00	49,676,000
アキレス	11,800	1,484.00	17,511,200
フコク	5,500	802.00	4,411,000
ニッタ	15,600	2,521.00	39,327,600
クリエートメディック	4,700	922.00	4,333,400
住友理工	31,200	993.00	30,981,600
三ツ星ベルト	35,000	855.00	29,925,000
バンドー化学	26,500	990.00	26,235,000
旭硝子	712,000	661.00	470,632,000
日本板硝子	69,900	835.00	58,366,500
石塚硝子	21,000	154.00	3,234,000
有沢製作所	21,300	543.00	11,565,900
日本山村硝子	58,000	178.00	10,324,000
日本電気硝子	299,000	543.00	162,357,000
オハラ	5,700	600.00	3,420,000
住友大阪セメント	286,000	437.00	124,982,000
太平洋セメント	921,000	283.00	260,643,000
リソルホールディングス	14,000	314.00	4,396,000
日本ヒューム	14,100	629.00	8,868,900
日本コンクリート工業	30,000	366.00	10,980,000
三谷セキサン	7,300	2,381.00	17,381,300
アジアパイルホールディングス	18,100	420.00	7,602,000
東海カーボン	129,000	298.00	38,442,000
日本カーボン	71,000	201.00	14,271,000
東洋炭素	8,000	1,419.00	11,352,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,200	2,423.00	19,868,600
TOTO	106,200	3,920.00	416,304,000
日本碍子	182,600	2,145.00	391,677,000
日本特殊陶業	124,600	1,923.00	239,605,800
ダントーホールディングス	13,000	186.00	2,418,000
MARUWA	5,300	3,840.00	20,352,000
品川リフラクトリーズ	37,000	197.00	7,289,000
黒崎播磨	32,000	278.00	8,896,000
ヨータイ	8,000	296.00	2,368,000
イソライト工業	7,100	264.00	1,874,400
東京窯業	17,000	163.00	2,771,000
ニッカトー	5,500	369.00	2,029,500
フジインコーポレーテッド	12,300	1,481.00	18,216,300
エーアンドエーマテリアル	31,000	91.00	2,821,000
ニチアス	74,000	929.00	68,746,000
新日鐵住金	651,800	2,027.50	1,321,524,500

神戸製鋼所	265,400	871.00	231,163,400	
中山製鋼所	16,200	663.00	10,740,600	
合同製鐵	8,100	1,896.00	15,357,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	395,000	1,443.50	570,182,500	
日新製鋼	65,900	1,382.00	91,073,800	
東京製鐵	79,800	719.00	57,376,200	
共英製鋼	15,400	1,910.00	29,414,000	
大和工業	31,900	2,957.00	94,328,300	
東京鐵鋼	30,000	415.00	12,450,000	
大阪製鐵	9,100	1,757.00	15,988,700	
淀川製鋼所	21,500	2,673.00	57,469,500	
東洋鋼鈹	34,600	293.00	10,137,800	
丸一鋼管	48,400	3,300.00	159,720,000	
モリ工業	4,200	1,659.00	6,967,800	
大同特殊鋼	242,000	452.00	109,384,000	
日本高周波鋼業	58,000	73.00	4,234,000	
日本冶金工業	106,600	147.00	15,670,200	
山陽特殊製鋼	86,000	551.00	47,386,000	
愛知製鋼	8,500	5,010.00	42,585,000	
日立金属	165,500	1,254.00	207,537,000	
日本金属	3,800	1,257.00	4,776,600	
大平洋金属	101,000	304.00	30,704,000	
新日本電工	81,500	180.00	14,670,000	
栗本鐵工所	6,900	1,801.00	12,426,900	
虹 技	21,000	245.00	5,145,000	
日本鑄鉄管	16,000	160.00	2,560,000	
日本製鋼所	47,800	2,287.00	109,318,600	
三菱製鋼	100,000	177.00	17,700,000	
日亜鋼業	18,800	232.00	4,361,600	
日本精線	10,000	490.00	4,900,000	
大紀アルミニウム工業所	23,000	398.00	9,154,000	
日本軽金属ホールディングス	327,100	218.00	71,307,800	
三井金属鉱業	368,000	228.00	83,904,000	
東邦亜鉛	76,000	343.00	26,068,000	
三菱マテリアル	90,200	2,722.00	245,524,400	
住友金属鉱山	399,000	1,293.50	516,106,500	
D O W Aホールディングス	186,000	721.00	134,106,000	
古河機械金属	225,000	161.00	36,225,000	
エス・サイエンス	65,100	36.00	2,343,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,200	1,422.00	20,192,400	
東邦チタニウム	24,500	719.00	17,615,500	
U A C J	202,000	311.00	62,822,000	
古河電気工業	45,400	2,962.00	134,474,800	
住友電気工業	578,500	1,504.00	870,064,000	
フジクラ	201,000	608.00	122,208,000	
昭和電線ホールディングス	174,000	71.00	12,354,000	
東京特殊電線	2,100	954.00	2,003,400	
タツタ電線	30,100	362.00	10,896,200	
沖電線	17,000	234.00	3,978,000	

カナレ電気	2,100	1,955.00	4,105,500
平河ヒューテック	7,000	892.00	6,244,000
リョービ	88,000	453.00	39,864,000
アーレスティ	16,800	1,121.00	18,832,800
アサヒホールディングス	21,800	1,771.00	38,607,800
東洋製罐グループホールディングス	102,600	1,803.00	184,987,800
ホッカンホールディングス	38,000	334.00	12,692,000
コロナ	7,600	1,025.00	7,790,000
横河ブリッジホールディングス	27,400	1,113.00	30,496,200
OSJBホールディングス	31,600	218.00	6,888,800
駒井ハルテック	2,600	1,917.00	4,984,200
高田機工	12,000	203.00	2,436,000
三和ホールディングス	143,400	967.00	138,667,800
文化シャッター	40,300	802.00	32,320,600
三協立山	18,900	1,546.00	29,219,400
アルインコ	11,100	937.00	10,400,700
東洋シャッター	3,600	578.00	2,080,800
LIXILグループ	201,300	2,268.00	456,548,400
日本ファイルコン	10,700	503.00	5,382,100
ノーリツ	28,300	2,137.00	60,477,100
長府製作所	15,500	2,662.00	41,261,000
リンナイ	26,900	9,290.00	249,901,000
ユニプレス	28,700	1,868.00	53,611,600
ダイニチ工業	7,700	647.00	4,981,900
日東精工	20,000	384.00	7,680,000
三洋工業	19,000	172.00	3,268,000
岡部	30,100	845.00	25,434,500
ジーテクト	15,100	1,938.00	29,263,800
中国工業	2,500	670.00	1,675,000
東プレ	27,800	2,152.00	59,825,600
高周波熱錬	26,900	801.00	21,546,900
東京製綱	9,800	1,674.00	16,405,200
サンコール	8,000	454.00	3,632,000
モリテックスチール	7,500	258.00	1,935,000
パイオラックス	7,300	6,520.00	47,596,000
日本発条	135,800	963.00	130,775,400
中央発條	17,000	285.00	4,845,000
アドバネクス	2,700	1,073.00	2,897,100
三浦工業	64,500	1,807.00	116,551,500
タクマ	53,000	904.00	47,912,000
テクノプロ・ホールディングス	23,400	3,635.00	85,059,000
インターワークス	2,600	1,099.00	2,857,400
KeepPer 技研	1,700	1,508.00	2,563,600
ファーストロジック	800	1,552.00	1,241,600
リブセンス	9,900	448.00	4,435,200
ジャパンマテリアル	6,000	3,600.00	21,600,000
ベクトル	13,800	957.00	13,206,600
ウチヤマホールディングス	7,700	412.00	3,172,400
サクセスホールディングス	1,200	1,205.00	1,446,000
キャリアリンク	3,900	834.00	3,252,600

I B J	11,400	709.00	8,082,600
アサンテ	5,400	1,597.00	8,623,800
N・フィールド	6,900	1,395.00	9,625,500
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	2,027.00	3,851,300
ライドオン・エクスプレス	3,200	991.00	3,171,200
E R Iホールディングス	4,000	775.00	3,100,000
アビスト	2,300	2,434.00	5,598,200
ウィルグループ	3,300	969.00	3,197,700
日本ビューホテル	2,100	1,317.00	2,765,700
リクルートホールディングス	290,800	4,120.00	1,198,096,000
エラン	1,700	1,244.00	2,114,800
ツガミ	42,000	576.00	24,192,000
オークマ	94,000	807.00	75,858,000
東芝機械	79,000	361.00	28,519,000
アマダホールディングス	210,600	1,089.00	229,343,400
アイダエンジニアリング	37,900	846.00	32,063,400
滝澤鉄工所	46,000	134.00	6,164,000
富士機械製造	47,100	1,254.00	59,063,400
牧野フライス製作所	72,000	644.00	46,368,000
オーエスジー	65,800	2,107.00	138,640,600
ダイジェット工業	17,000	147.00	2,499,000
旭ダイヤモンド工業	38,900	838.00	32,598,200
D M G森精機	85,500	1,102.00	94,221,000
ソディック	36,600	766.00	28,035,600
ディスコ	18,400	12,190.00	224,296,000
日東工器	8,400	2,291.00	19,244,400
パンチ工業	5,800	884.00	5,127,200
日本郵政	424,100	1,282.00	543,696,200
ベルシステム24ホールディングス	28,300	864.00	24,451,200
ソラスト	6,500	1,054.00	6,851,000
豊田自動織機	125,700	4,900.00	615,930,000
豊和工業	8,200	530.00	4,346,000
O K K	58,000	103.00	5,974,000
石川製作所	3,700	661.00	2,445,700
東洋機械金属	11,000	375.00	4,125,000
津田駒工業	32,000	161.00	5,152,000
エンシュウ	38,000	64.00	2,432,000
島精機製作所	20,400	2,862.00	58,384,800
N Cホールディングス	4,800	852.00	4,089,600
フリー	2,900	3,140.00	9,106,000
ヤマシンフィルタ	3,100	571.00	1,770,100
日阪製作所	18,300	840.00	15,372,000
やまびこ	26,500	957.00	25,360,500
ペガサスミシン製造	15,100	581.00	8,773,100
ナブテスコ	75,100	2,913.00	218,766,300
三井海洋開発	14,500	1,789.00	25,940,500
レオン自動機	12,300	708.00	8,708,400
S M C	43,300	29,360.00	1,271,288,000
新川	12,900	695.00	8,965,500
ホソカワミクロン	24,000	607.00	14,568,000

ユニオンツール	6,200	2,686.00	16,653,200
オイレス工業	18,700	1,754.00	32,799,800
日精エー・エス・ビー機械	4,600	1,782.00	8,197,200
サトーホールディングス	19,500	2,199.00	42,880,500
日本エアテック	4,800	623.00	2,990,400
日精樹脂工業	10,600	751.00	7,960,600
オカダアイヨン	3,000	785.00	2,355,000
ワイエイシイ	5,800	1,377.00	7,986,600
小松製作所	708,300	2,376.00	1,682,920,800
住友重機械工業	421,000	509.00	214,289,000
日立建機	64,500	2,070.00	133,515,000
日工	4,400	1,591.00	7,000,400
巴工業	5,900	1,582.00	9,333,800
井関農機	148,000	247.00	36,556,000
TOWA	14,000	1,177.00	16,478,000
丸山製作所	31,000	168.00	5,208,000
北川鉄工所	6,600	1,764.00	11,642,400
シンニッタン	13,400	475.00	6,365,000
ローツェ	5,100	1,985.00	10,123,500
タカキタ	3,600	508.00	1,828,800
クボタ	693,700	1,554.00	1,078,009,800
荏原実業	4,100	1,242.00	5,092,200
東洋エンジニアリング	83,000	349.00	28,967,000
三菱化工機	48,000	213.00	10,224,000
月島機械	27,400	1,121.00	30,715,400
帝国電機製作所	10,500	785.00	8,242,500
東京機械製作所	55,000	70.00	3,850,000
新東工業	32,700	917.00	29,985,900
澁谷工業	12,100	2,107.00	25,494,700
アイチコーポレーション	20,500	755.00	15,477,500
小森コーポレーション	32,000	1,322.00	42,304,000
鶴見製作所	10,800	1,559.00	16,837,200
住友精密工業	23,000	334.00	7,682,000
酒井重工業	28,000	189.00	5,292,000
荏原製作所	64,000	3,120.00	199,680,000
石井鐵工所	2,200	1,514.00	3,330,800
西島製作所	15,500	1,032.00	15,996,000
北越工業	15,700	667.00	10,471,900
千代田化工建設	111,000	890.00	98,790,000
ダイキン工業	201,000	9,718.00	1,953,318,000
オルガノ	25,000	416.00	10,400,000
トーヨーカネツ	69,000	216.00	14,904,000
栗田工業	86,800	2,421.00	210,142,800
椿本チエイン	82,000	791.00	64,862,000
大同工業	27,000	224.00	6,048,000
日機装	49,700	922.00	45,823,400
木村化工機	12,600	370.00	4,662,000
新興プランテック	31,700	754.00	23,901,800
アネスト岩田	23,300	1,044.00	24,325,200
ダイフク	74,200	1,840.00	136,528,000

サムコ	3,600	833.00	2,998,800	
加藤製作所	6,600	2,156.00	14,229,600	
油研工業	27,000	173.00	4,671,000	
タダノ	66,600	1,182.00	78,721,200	
フジテック	40,200	1,159.00	46,591,800	
C K D	38,400	1,200.00	46,080,000	
キトー	17,400	950.00	16,530,000	
平和	42,800	2,286.00	97,840,800	
理想科学工業	15,300	1,658.00	25,367,400	
S A N K Y O	38,300	3,475.00	133,092,500	
日本金銭機械	12,700	1,515.00	19,240,500	
マースエンジニアリング	7,800	1,979.00	15,436,200	
福島工業	8,500	3,200.00	27,200,000	
オーイズミ	5,900	740.00	4,366,000	
ダイコク電機	5,700	1,558.00	8,880,600	
竹内製作所	27,300	1,895.00	51,733,500	
アマノ	42,700	1,701.00	72,632,700	
J U K I	21,000	768.00	16,128,000	
サンデンホールディングス	84,000	304.00	25,536,000	
蛇の目ミシン工業	13,500	604.00	8,154,000	
ブラザー工業	178,400	1,823.00	325,223,200	
マックス	21,000	1,236.00	25,956,000	
モリタホールディングス	24,200	1,392.00	33,686,400	
グローリー	47,100	3,445.00	162,259,500	
新晃工業	9,700	1,250.00	12,125,000	
大和冷機工業	22,100	903.00	19,956,300	
セガサミーホールディングス	148,300	1,443.00	213,996,900	
日本ピストンリング	5,800	1,561.00	9,053,800	
リケン	6,400	3,505.00	22,432,000	
T P R	17,000	2,902.00	49,334,000	
ツバキ・ナカシマ	15,400	1,542.00	23,746,800	
ホシザキ	30,300	9,140.00	276,942,000	
大豊工業	11,100	1,171.00	12,998,100	
日本精工	283,600	1,084.00	307,422,400	
N T N	342,000	374.00	127,908,000	
ジェイテクト	147,100	1,578.00	232,123,800	
不二越	139,000	381.00	52,959,000	
ミネベア	222,500	1,035.00	230,287,500	
日本トムソン	47,300	383.00	18,115,900	
T H K	91,800	2,044.00	187,639,200	
ユーシン精機	5,400	2,502.00	13,510,800	
前澤給装工業	5,800	1,348.00	7,818,400	
イーグル工業	17,100	1,357.00	23,204,700	
前澤工業	10,200	297.00	3,029,400	
日本ピラー工業	14,000	1,029.00	14,406,000	
キッツ	61,400	590.00	36,226,000	
日立製作所	3,522,000	518.70	1,826,861,400	
東芝	2,906,000	355.30	1,032,501,800	
三菱電機	1,473,000	1,304.50	1,921,528,500	
富士電機	416,000	494.00	205,504,000	

東洋電機製造	27,000	311.00	8,397,000
安川電機	171,500	1,571.00	269,426,500
シンフォニアテクノロジー	90,000	176.00	15,840,000
明電舎	127,000	341.00	43,307,000
オリジン電気	20,000	261.00	5,220,000
山洋電気	36,000	617.00	22,212,000
デンヨー	12,700	1,133.00	14,389,100
日立工機	36,800	852.00	31,353,600
三櫻工業	17,700	642.00	11,363,400
マキタ	90,000	7,200.00	648,000,000
東芝テック	99,000	433.00	42,867,000
芝浦メカトロニクス	23,000	255.00	5,865,000
マブチモーター	39,000	5,890.00	229,710,000
日本電産	166,200	9,484.00	1,576,240,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,600	2,304.00	3,686,400
東光高岳	7,700	2,033.00	15,654,100
ダブル・スコープ	12,200	1,969.00	24,021,800
宮越ホールディングス	4,900	514.00	2,518,600
ダイヘン	81,000	538.00	43,578,000
田淵電機	15,700	362.00	5,683,400
ヤーマン	1,800	3,475.00	6,255,000
JVCケンウッド	101,300	265.00	26,844,500
ミマキエンジニアリング	12,500	536.00	6,700,000
第一精工	5,900	1,093.00	6,448,700
日新電機	32,400	1,586.00	51,386,400
大崎電気工業	26,000	958.00	24,908,000
オムロン	155,900	3,705.00	577,609,500
日東工業	22,000	1,397.00	30,734,000
I D E C	18,000	944.00	16,992,000
不二電機工業	1,400	1,365.00	1,911,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	266,000	435.00	115,710,000
サクサホールディングス	35,000	219.00	7,665,000
メルコホールディングス	7,600	2,751.00	20,907,600
テクノメディカ	3,100	1,643.00	5,093,300
日本電気	1,898,000	268.00	508,664,000
富士通	1,331,000	553.30	736,442,300
沖電気工業	59,800	1,428.00	85,394,400
岩崎通信機	66,000	71.00	4,686,000
電気興業	36,000	515.00	18,540,000
サンケン電気	75,000	341.00	25,575,000
ナカヨ	13,000	357.00	4,641,000
アイホン	7,900	1,700.00	13,430,000
ルネサスエレクトロニクス	71,500	626.00	44,759,000
セイコーエプソン	205,600	1,933.00	397,424,800
ワコム	107,200	304.00	32,588,800
アルバック	25,400	3,115.00	79,121,000
アクセル	6,300	773.00	4,869,900
E I Z O	13,600	2,905.00	39,508,000
ジャパンディスプレイ	257,800	175.00	45,115,000
日本信号	38,100	899.00	34,251,900

京三製作所	33,000	387.00	12,771,000
能美防災	15,700	1,467.00	23,031,900
ホーチキ	10,100	1,100.00	11,110,000
エレコム	12,000	2,114.00	25,368,000
日本無線	8,000	1,430.00	11,440,000
パナソニック	1,577,300	1,039.00	1,638,814,700
アンリツ	82,800	594.00	49,183,200
富士通ゼネラル	42,000	2,153.00	90,426,000
日立国際電気	31,600	1,882.00	59,471,200
ソニー	974,300	3,384.00	3,297,031,200
T D K	83,300	6,780.00	564,774,000
帝国通信工業	33,000	153.00	5,049,000
ミツミ電機	52,500	621.00	32,602,500
タムラ製作所	53,000	414.00	21,942,000
アルプス電気	119,000	2,608.00	310,352,000
池上通信機	44,000	129.00	5,676,000
パイオニア	223,400	221.00	49,371,400
日本電波工業	12,500	840.00	10,500,000
鈴木	5,700	528.00	3,009,600
日本トリム	3,700	5,480.00	20,276,000
ローランド ディー . ジー .	7,000	2,317.00	16,219,000
日本コロムビア	4,900	563.00	2,758,700
フォスター電機	17,300	1,886.00	32,627,800
クラリオン	73,000	326.00	23,798,000
S M K	39,000	349.00	13,611,000
ヨコオ	10,000	635.00	6,350,000
ティアック	101,000	38.00	3,838,000
ホシデン	41,900	720.00	30,168,000
ヒロセ電機	22,300	13,440.00	299,712,000
日本航空電子工業	40,000	1,706.00	68,240,000
T O A	16,300	932.00	15,191,600
日立マクセル	22,900	1,556.00	35,632,400
古野電気	16,400	627.00	10,282,800
ユニデンホールディングス	44,000	147.00	6,468,000
アルパイン	32,900	1,374.00	45,204,600
スミダコーポレーション	11,400	1,121.00	12,779,400
アイコム	7,700	2,021.00	15,561,700
リオン	5,300	1,413.00	7,488,900
本多通信工業	3,700	1,105.00	4,088,500
船井電機	13,900	855.00	11,884,500
横河電機	138,100	1,418.00	195,825,800
新電元工業	49,000	439.00	21,511,000
アズビル	45,000	3,050.00	137,250,000
東亜ディーケーケー	8,000	460.00	3,680,000
日本光電工業	57,700	2,529.00	145,923,300
チノー	5,100	1,008.00	5,140,800
共和電業	16,000	365.00	5,840,000
日本電子材料	5,800	543.00	3,149,400
堀場製作所	27,300	4,930.00	134,589,000
アドバンテスト	94,100	1,394.00	131,175,400

小野測器	7,000	884.00	6,188,000
エスベック	14,300	1,271.00	18,175,300
パナソニック デバイスSUNX	12,200	579.00	7,063,800
キーエンス	31,300	76,190.00	2,384,747,000
日置電機	7,200	1,909.00	13,744,800
シスメックス	107,300	7,540.00	809,042,000
日本マイクロニクス	25,800	1,353.00	34,907,400
メガチップス	13,800	1,966.00	27,130,800
OBARA GROUP	8,100	4,310.00	34,911,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,500	577.00	6,635,500
澤藤電機	8,000	195.00	1,560,000
デンソー	306,400	4,280.00	1,311,392,000
コーセル	19,200	1,240.00	23,808,000
イリソ電子工業	4,400	5,430.00	23,892,000
新日本無線	10,400	346.00	3,598,400
オブテックス	10,200	2,598.00	26,499,600
千代田インテグレ	7,300	2,119.00	15,468,700
アイ・オー・データ機器	4,400	1,007.00	4,430,800
レーザーテック	16,200	1,943.00	31,476,600
スタンレー電気	98,700	2,785.00	274,879,500
岩崎電気	47,000	155.00	7,285,000
ウシオ電機	83,800	1,202.00	100,727,600
岡谷電機産業	8,000	381.00	3,048,000
ヘリオス テクノ ホールディング	12,000	390.00	4,680,000
日本セラミック	11,300	1,872.00	21,153,600
遠藤照明	7,200	810.00	5,832,000
日本デジタル研究所	11,700	1,488.00	17,409,600
古河電池	10,000	733.00	7,330,000
双信電機	6,900	278.00	1,918,200
山一電機	12,200	855.00	10,431,000
図研	10,000	1,046.00	10,460,000
日本電子	55,000	400.00	22,000,000
カシオ計算機	138,400	1,435.00	198,604,000
ファナック	140,000	19,070.00	2,669,800,000
日本シイエムケイ	29,800	544.00	16,211,200
エンプラス	7,000	3,185.00	22,295,000
大真空	5,200	1,128.00	5,865,600
ローム	66,700	5,360.00	357,512,000
浜松ホトニクス	107,700	3,135.00	337,639,500
三井ハイテック	20,000	733.00	14,660,000
新光電気工業	51,900	621.00	32,229,900
京セラ	226,600	5,011.00	1,135,492,600
協栄産業	19,000	133.00	2,527,000
太陽誘電	67,100	1,044.00	70,052,400
村田製作所	145,600	14,100.00	2,052,960,000
ユーシン	18,400	729.00	13,413,600
双葉電子工業	22,600	1,663.00	37,583,800
日東電工	111,700	6,830.00	762,911,000
北陸電気工業	57,000	123.00	7,011,000

東海理化電機製作所	40,400	2,052.00	82,900,800	
ニチコン	43,400	849.00	36,846,600	
日本ケミコン	112,000	174.00	19,488,000	
K O A	19,100	917.00	17,514,700	
三井造船	534,000	149.00	79,566,000	
日立造船	109,300	515.00	56,289,500	
三菱重工業	2,458,000	442.60	1,087,910,800	
川崎重工業	1,074,000	293.00	314,682,000	
I H I	1,061,000	292.00	309,812,000	
名村造船所	41,400	714.00	29,559,600	
サノヤスホールディングス	16,800	286.00	4,804,800	
日本車輛製造	57,000	271.00	15,447,000	
ニチュ三菱フォークリフト	16,000	594.00	9,504,000	
近畿車輛	2,100	2,350.00	4,935,000	
F P G	48,600	906.00	44,031,600	
島根銀行	3,000	1,233.00	3,699,000	
じもとホールディングス	97,500	148.00	14,430,000	
全国保証	35,400	4,250.00	150,450,000	
めぶきフィナンシャルグループ	675,540	352.00	237,790,080	
東京T Yフィナンシャルグループ	18,800	2,992.00	56,249,600	
九州フィナンシャルグループ	208,400	669.00	139,419,600	
かんぽ生命保険	55,500	2,176.00	120,768,000	
ゆうちょ銀行	349,200	1,201.00	419,389,200	
富山第一銀行	34,700	491.00	17,037,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	949,300	442.00	419,590,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	88,800	1,037.00	92,085,600	
日産自動車	1,882,000	980.50	1,845,301,000	
いすゞ自動車	400,000	1,209.00	483,600,000	
トヨタ自動車	1,760,000	5,957.00	10,484,320,000	*
日野自動車	196,900	1,121.00	220,724,900	
三菱自動車工業	548,100	489.00	268,020,900	
エフテック	7,300	1,304.00	9,519,200	
レシップホールディングス	4,700	889.00	4,178,300	
G M B	2,400	1,003.00	2,407,200	
ファルテック	2,600	1,173.00	3,049,800	
武蔵精密工業	14,700	2,508.00	36,867,600	
日産車体	67,300	964.00	64,877,200	
新明和工業	60,000	692.00	41,520,000	
極東開発工業	27,500	1,183.00	32,532,500	
日信工業	30,800	1,621.00	49,926,800	
トピー工業	11,400	2,223.00	25,342,200	
ティラド	53,000	226.00	11,978,000	
曙ブレーキ工業	70,200	200.00	14,040,000	
タチエス	21,900	1,642.00	35,959,800	
N O K	66,800	2,297.00	153,439,600	
フタバ産業	42,200	500.00	21,100,000	
K Y B	154,000	456.00	70,224,000	
市光工業	33,000	296.00	9,768,000	

大同メタル工業	19,300	1,079.00	20,824,700
プレス工業	73,300	471.00	34,524,300
ミクニ	17,800	324.00	5,767,200
カルソニックカンセイ	105,000	990.00	103,950,000
太平洋工業	30,700	1,181.00	36,256,700
ケーヒン	31,700	1,664.00	52,748,800
河西工業	17,000	1,138.00	19,346,000
アイシン精機	141,500	4,745.00	671,417,500
富士機工	16,100	391.00	6,295,100
マツダ	437,100	1,633.50	714,002,850
今仙電機製作所	12,600	905.00	11,403,000
本田技研工業	1,242,400	3,039.00	3,775,653,600
スズキ	252,600	3,432.00	866,923,200
富士重工業	428,700	3,861.00	1,655,210,700
安永	4,300	471.00	2,025,300
ヤマハ発動機	195,000	2,155.00	420,225,000
ショーワ	35,800	564.00	20,191,200
小糸製作所	82,700	5,180.00	428,386,000
T B K	16,600	420.00	6,972,000
エクセディ	18,700	2,701.00	50,508,700
ミツバ	23,500	1,428.00	33,558,000
豊田合成	50,100	2,452.00	122,845,200
愛三工業	24,200	842.00	20,376,400
盟和産業	1,800	1,066.00	1,918,800
ヨロズ	12,900	1,615.00	20,833,500
エフ・シー・シー	22,600	2,289.00	51,731,400
新家工業	29,000	143.00	4,147,000
シマノ	55,700	16,110.00	897,327,000
タカタ	25,000	345.00	8,625,000
テイ・エス テック	32,100	2,730.00	87,633,000
ジャムコ	8,100	2,029.00	16,434,900
小野建	11,900	1,250.00	14,875,000
はるやま商事	5,900	768.00	4,531,200
ノジマ	15,700	1,254.00	19,687,800
佐鳥電機	10,900	730.00	7,957,000
カッパ・クリエイト	19,200	1,219.00	23,404,800
エコートレーディング	3,500	649.00	2,271,500
伯東	10,400	920.00	9,568,000
コンドーテック	11,000	753.00	8,283,000
中山福	8,900	777.00	6,915,300
ライトオン	10,200	988.00	10,077,600
ナガイレーベン	19,700	2,218.00	43,694,600
ジーンズメイト	4,600	169.00	777,400
三菱食品	15,000	3,305.00	49,575,000
良品計画	15,600	22,030.00	343,668,000
三城ホールディングス	17,200	433.00	7,447,600
松田産業	10,000	1,405.00	14,050,000
第一興商	24,100	4,045.00	97,484,500
メディバルホールディングス	136,300	1,753.00	238,933,900
アドヴァン	13,900	964.00	13,399,600

S P K	3,300	2,077.00	6,854,100
萩原電気	4,700	1,859.00	8,737,300
アルビス	3,600	2,114.00	7,610,400
アズワン	10,700	4,390.00	46,973,000
スズデン	4,600	952.00	4,379,200
尾家産業	4,800	960.00	4,608,000
シモジマ	9,500	1,049.00	9,965,500
ドウシシャ	16,000	2,137.00	34,192,000
小津産業	3,100	2,077.00	6,438,700
コナカ	17,200	486.00	8,359,200
高速	8,400	970.00	8,148,000
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,443.00	2,741,700
G - 7ホールディングス	4,100	1,379.00	5,653,900
たけびし	4,800	1,055.00	5,064,000
イオン北海道	9,300	541.00	5,031,300
コジマ	20,100	236.00	4,743,600
ヒマラヤ	4,300	807.00	3,470,100
コーナン商事	19,300	1,982.00	38,252,600
黒田電気	25,400	1,934.00	49,123,600
ネットワンシステムズ	58,900	699.00	41,171,100
エコス	5,300	1,152.00	6,105,600
ワタミ	16,100	1,079.00	17,371,900
マルシェ	3,700	817.00	3,022,900
リックス	3,100	1,198.00	3,713,800
ドンキホーテホールディングス	88,100	3,945.00	347,554,500
丸文	12,200	579.00	7,063,800
西松屋チェーン	26,900	1,482.00	39,865,800
ゼンショーホールディングス	70,100	1,854.00	129,965,400
ハビネット	12,500	1,073.00	13,412,500
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,578.00	13,886,400
ハークスレイ	4,000	928.00	3,712,000
橋本総業ホールディングス	2,600	1,587.00	4,126,200
日本ライフライン	6,500	5,480.00	35,620,000
サイゼリヤ	22,400	2,444.00	54,745,600
エクセル	6,700	1,258.00	8,428,600
V Tホールディングス	46,200	539.00	24,901,800
マルカキカイ	4,500	1,220.00	5,490,000
アルゴグラフィックス	6,300	1,968.00	12,398,400
魚力	4,300	1,291.00	5,551,300
I D O M	36,700	579.00	21,249,300
日本エム・ディ・エム	11,400	762.00	8,686,800
ポブラ	3,500	497.00	1,739,500
ユナイテッドアローズ	19,400	2,626.00	50,944,400
進和	8,000	1,505.00	12,040,000
エスケイジャパン	3,200	303.00	969,600
ダイトエレクトロン	6,400	777.00	4,972,800
ハイデイ日高	12,400	2,511.00	31,136,400
シークス	9,700	4,075.00	39,527,500
京都きもの友禅	9,700	879.00	8,526,300
コロワイド	45,300	1,910.00	86,523,000

ピーシーデポコーポレーション	18,120	516.00	9,349,920
田中商事	4,600	671.00	3,086,600
オーハシテクニカ	7,700	1,284.00	9,886,800
壱番屋	12,300	3,615.00	44,464,500
白銅	4,000	1,205.00	4,820,000
トップカルチャー	5,400	484.00	2,613,600
P L A N T	3,200	1,181.00	3,779,200
スギホールディングス	24,400	5,530.00	134,932,000
島津製作所	178,000	1,577.00	280,706,000
J M S	24,000	269.00	6,456,000
クボテック	3,000	499.00	1,497,000
長野計器	8,500	587.00	4,989,500
ブイ・テクノロジー	3,300	12,310.00	40,623,000
スター精密	26,200	1,310.00	34,322,000
東京計器	44,000	172.00	7,568,000
愛知時計電機	1,800	3,175.00	5,715,000
オーバル	13,600	237.00	3,223,200
東京精密	26,600	2,712.00	72,139,200
マニー	18,400	2,368.00	43,571,200
ニコン	257,700	1,570.00	404,589,000
トプコン	46,400	1,508.00	69,971,200
オリンパス	205,700	3,745.00	770,346,500
理研計器	11,200	1,263.00	14,145,600
S C R E E Nホールディングス	28,400	6,700.00	190,280,000
キヤノン電子	12,600	1,634.00	20,588,400
タムロン	11,400	1,696.00	19,334,400
H O Y A	306,700	4,106.00	1,259,310,200
ノーリツ鋼機	12,500	747.00	9,337,500
エー・アンド・デイ	12,900	416.00	5,366,400
キヤノン	743,200	2,989.50	2,221,796,400
リコー	446,900	919.00	410,701,100
シチズン時計	169,900	557.00	94,634,300
リズム時計工業	61,000	177.00	10,797,000
大研医器	10,900	768.00	8,371,200
メニコン	9,300	2,899.00	26,960,700
スノーピーク	1,600	3,455.00	5,528,000
パラマウントベッドホールディングス	14,600	3,765.00	54,969,000
トランザクション	2,800	1,665.00	4,662,000
S H O B I	5,000	414.00	2,070,000
ニホンフラッシュ	5,400	1,164.00	6,285,600
前田工織	13,900	1,130.00	15,707,000
永大産業	19,000	436.00	8,284,000
アートネイチャー	14,900	616.00	9,178,400
ダンロップスポーツ	8,900	1,007.00	8,962,300
バンダイナムコホールディングス	142,800	3,060.00	436,968,000
アイフィスジャパン	2,400	413.00	991,200
共立印刷	23,900	300.00	7,170,000
S H O E I	6,300	1,802.00	11,352,600
フランスベッドホールディングス	19,500	873.00	17,023,500
マーベラス	23,000	797.00	18,331,000

パイロットコーポレーション	24,100	4,275.00	103,027,500
萩原工業	3,900	2,431.00	9,480,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,100	1,392.00	34,939,200
トッパン・フォームズ	24,700	1,051.00	25,959,700
フジシールインターナショナル	16,800	4,100.00	68,880,000
タカラトミー	45,500	1,084.00	49,322,000
廣済堂	13,000	303.00	3,939,000
アーク	59,700	76.00	4,537,200
レック	4,600	2,533.00	11,651,800
タカノ	6,400	722.00	4,620,800
プロネクサス	13,000	1,141.00	14,833,000
ホクシン	11,900	210.00	2,499,000
ウッドワン	23,000	237.00	5,451,000
大建工業	10,800	1,966.00	21,232,800
きもと	23,700	244.00	5,782,800
凸版印刷	390,000	937.00	365,430,000
大日本印刷	398,000	1,004.00	399,592,000
図書印刷	26,000	449.00	11,674,000
共同印刷	47,000	341.00	16,027,000
日本写真印刷	23,200	2,557.00	59,322,400
光村印刷	3,000	210.00	630,000
藤森工業	12,400	2,447.00	30,342,800
宝印刷	6,800	1,356.00	9,220,800
前澤化成工業	10,300	1,008.00	10,382,400
アシックス	137,200	2,109.00	289,354,800
ツツミ	7,000	1,633.00	11,431,000
J S P	9,500	2,380.00	22,610,000
ニチハ	19,200	2,423.00	46,521,600
エフピコ	12,800	5,690.00	72,832,000
小松ウオール工業	4,800	1,686.00	8,092,800
ヤマハ	101,500	3,415.00	346,622,500
河合楽器製作所	5,200	1,857.00	9,656,400
クリナップ	16,300	842.00	13,724,600
ピジョン	78,300	2,953.00	231,219,900
天馬	10,800	1,567.00	16,923,600
兼松サステック	14,000	160.00	2,240,000
キングジム	11,600	835.00	9,686,000
リンテック	32,800	2,096.00	68,748,800
T A S A K I	2,700	1,531.00	4,133,700
信越ポリマー	28,400	671.00	19,056,400
東リ	36,000	319.00	11,484,000
イトーキ	29,200	721.00	21,053,200
任天堂	85,000	25,865.00	2,198,525,000
三菱鉛筆	11,400	5,080.00	57,912,000
松風	6,800	1,338.00	9,098,400
タカラスタンダード	28,500	1,887.00	53,779,500
コクヨ	71,800	1,460.00	104,828,000
ナカバヤシ	27,000	232.00	6,264,000
ニフコ	27,700	5,490.00	152,073,000

立川ブラインド工業	6,100	738.00	4,501,800
グローブライド	6,800	1,745.00	11,866,000
岡村製作所	48,300	1,026.00	49,555,800
日本バルカー工業	11,200	1,384.00	15,500,800
MUTOHホールディングス	17,000	227.00	3,859,000
伊藤忠商事	1,069,200	1,271.50	1,359,487,800
丸紅	1,340,700	536.30	719,017,410
スクロール	20,700	377.00	7,803,900
高島	25,000	171.00	4,275,000
ヨンドシーホールディングス	10,400	2,406.00	25,022,400
三陽商会	76,000	159.00	12,084,000
長瀬産業	81,700	1,245.00	101,716,500
ナイガイ	55,000	56.00	3,080,000
蝶理	8,700	1,487.00	12,936,900
豊田通商	151,700	2,403.00	364,535,100
オンワードホールディングス	93,000	713.00	66,309,000
三共生興	20,900	322.00	6,729,800
兼松	290,000	166.00	48,140,000
美津濃	74,000	529.00	39,146,000
ツカモトコーポレーション	25,000	108.00	2,700,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	59,900	6,430.00	385,157,000
ルック	26,000	143.00	3,718,000
三井物産	1,231,900	1,406.50	1,732,667,350
日本紙パルプ商事	71,000	340.00	24,140,000
東京エレクトロン	113,300	8,857.00	1,003,498,100
日立ハイテクノロジーズ	47,200	4,115.00	194,228,000
カメイ	17,700	919.00	16,266,300
東都水産	2,400	1,623.00	3,895,200
OUGホールディングス	20,000	261.00	5,220,000
スターゼン	4,900	5,320.00	26,068,000
セイコーホールディングス	89,000	325.00	28,925,000
山善	52,300	773.00	40,427,900
椿本興業	15,000	299.00	4,485,000
住友商事	857,600	1,198.00	1,027,404,800
日本ユニシス	37,700	1,218.00	45,918,600
内田洋行	34,000	424.00	14,416,000
三菱商事	1,022,400	2,352.50	2,405,196,000
第一実業	31,000	558.00	17,298,000
キャノンマーケティングジャパン	38,800	1,873.00	72,672,400
西華産業	44,000	279.00	12,276,000
佐藤商事	12,400	737.00	9,138,800
菱洋エレクトロ	15,300	1,273.00	19,476,900
東京産業	13,700	387.00	5,301,900
ユアサ商事	12,900	2,392.00	30,856,800
神鋼商事	3,100	1,809.00	5,607,900
小林産業	9,400	255.00	2,397,000
阪和興業	136,000	630.00	85,680,000
カナデン	13,100	993.00	13,008,300
菱電商事	22,000	646.00	14,212,000

ニプロ	102,800	1,288.00	132,406,400
フルサト工業	7,500	1,438.00	10,785,000
岩谷産業	162,000	616.00	99,792,000
すてきナイスグループ	58,000	140.00	8,120,000
昭光通商	50,000	88.00	4,400,000
ニチモウ	22,000	153.00	3,366,000
極東貿易	20,000	194.00	3,880,000
イワキ	21,000	198.00	4,158,000
兼松エレクトロニクス	8,600	1,976.00	16,993,600
三愛石油	33,600	702.00	23,587,200
稲畑産業	32,600	1,082.00	35,273,200
G S Iクレオス	36,000	114.00	4,104,000
明和産業	12,700	310.00	3,937,000
キムラタン	588,000	7.00	4,116,000
ゴールドウイン	6,100	4,690.00	28,609,000
ユニ・チャーム	292,800	2,580.50	755,570,400
デサント	33,000	1,336.00	44,088,000
キング	6,900	389.00	2,684,100
ワキタ	29,000	798.00	23,142,000
ヤマトインターナショナル	9,200	390.00	3,588,000
東邦ホールディングス	43,600	2,167.00	94,481,200
サンゲツ	47,000	1,973.00	92,731,000
ミツウロコグループホールディングス	22,200	591.00	13,120,200
シナネンホールディングス	5,600	2,092.00	11,715,200
伊藤忠エネクス	35,100	820.00	28,782,000
サンリオ	42,000	1,881.00	79,002,000
サンワテクノス	8,700	723.00	6,290,100
リョーサン	21,600	3,140.00	67,824,000
新光商事	16,000	1,063.00	17,008,000
トーヨー	6,300	2,396.00	15,094,800
三信電気	18,900	867.00	16,386,300
東陽テクニカ	18,000	1,021.00	18,378,000
モスフードサービス	17,800	3,325.00	59,185,000
加賀電子	12,300	1,257.00	15,461,100
三益半導体工業	10,600	1,145.00	12,137,000
ソーダニッカ	14,700	469.00	6,894,300
立花エレテック	10,100	1,017.00	10,271,700
木曽路	16,700	2,305.00	38,493,500
サトレストランシステムズ	16,300	819.00	13,349,700
千趣会	24,700	704.00	17,388,800
タカキュー	10,700	177.00	1,893,900
ケーヨー	23,200	526.00	12,203,200
アデランス	24,100	491.00	11,833,100
上新電機	32,000	874.00	27,968,000
日本瓦斯	20,800	3,255.00	67,704,000
ベスト電器	44,000	121.00	5,324,000
ロイヤルホールディングス	22,600	1,754.00	39,640,400
東天紅	10,000	134.00	1,340,000
いなげや	15,200	1,415.00	21,508,000
島忠	35,200	2,665.00	93,808,000

チヨダ	16,100	2,345.00	37,754,500
ライフコーポレーション	8,600	3,195.00	27,477,000
リンガーハット	12,300	2,442.00	30,036,600
さが美	12,000	113.00	1,356,000
MR MAX	12,400	340.00	4,216,000
テンアライド	13,400	368.00	4,931,200
AOKIホールディングス	31,100	1,178.00	36,635,800
オークワ	20,000	944.00	18,880,000
コメリ	21,000	2,483.00	52,143,000
青山商事	26,100	3,550.00	92,655,000
しまむら	15,800	12,770.00	201,766,000
はせがわ	4,800	430.00	2,064,000
高島屋	198,000	819.00	162,162,000
松屋	27,400	762.00	20,878,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,700	1,542.00	107,477,400
近鉄百貨店	52,000	350.00	18,200,000
丸栄	29,000	80.00	2,320,000
ニッセンホールディングス	20,600	67.00	1,380,200
パルコ	12,900	946.00	12,203,400
丸井グループ	167,200	1,384.00	231,404,800
クレディセゾン	103,300	1,729.00	178,605,700
アクシアル リテイリング	10,500	3,605.00	37,852,500
井筒屋	7,400	387.00	2,863,800
イオン	560,600	1,432.50	803,059,500
イズミ	27,100	4,455.00	120,730,500
東武ストア	1,600	2,803.00	4,484,800
フォーバル	7,300	720.00	5,256,000
平和堂	27,600	2,041.00	56,331,600
フジ	15,100	2,157.00	32,570,700
ヤオコー	15,500	4,020.00	62,310,000
ゼビオホールディングス	18,400	1,576.00	28,998,400
ケーズホールディングス	57,500	1,702.00	97,865,000
PALTAC	21,800	2,324.00	50,663,200
三谷産業	15,000	319.00	4,785,000
Olympicグループ	8,400	534.00	4,485,600
日産東京販売ホールディングス	22,800	226.00	5,152,800
新生銀行	1,180,000	161.00	189,980,000
あおぞら銀行	862,000	346.00	298,252,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,932,800	510.40	5,580,101,120
りそなホールディングス	1,594,300	423.50	675,186,050
三井住友トラスト・ホールディングス	284,500	3,250.00	924,625,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,091,000	3,386.00	3,694,126,000
第四銀行	173,000	410.00	70,930,000
北越銀行	14,700	2,313.00	34,001,100
千葉銀行	525,000	592.00	310,800,000
群馬銀行	302,600	470.00	142,222,000
武蔵野銀行	21,700	2,680.00	58,156,000
千葉興業銀行	37,400	420.00	15,708,000
筑波銀行	56,800	297.00	16,869,600
七十七銀行	213,000	429.00	91,377,000

青森銀行	99,000	336.00	33,264,000
秋田銀行	89,000	319.00	28,391,000
山形銀行	77,000	430.00	33,110,000
岩手銀行	9,500	4,050.00	38,475,000
東邦銀行	122,000	367.00	44,774,000
東北銀行	71,000	146.00	10,366,000
みちのく銀行	68,000	204.00	13,872,000
ふくおかフィナンシャルグループ	590,000	432.00	254,880,000
静岡銀行	399,000	827.00	329,973,000
十六銀行	170,000	297.00	50,490,000
スルガ銀行	129,300	2,424.00	313,423,200
八十二銀行	246,300	535.00	131,770,500
山梨中央銀行	84,000	474.00	39,816,000
大垣共立銀行	182,000	346.00	62,972,000
福井銀行	117,000	265.00	31,005,000
北國銀行	145,000	321.00	46,545,000
清水銀行	4,700	2,875.00	13,512,500
富山銀行	2,600	3,915.00	10,179,000
滋賀銀行	128,000	505.00	64,640,000
南都銀行	13,200	3,765.00	49,698,000
百五銀行	122,000	382.00	46,604,000
京都銀行	260,000	745.00	193,700,000
紀陽銀行	53,500	1,630.00	87,205,000
三重銀行	6,100	2,095.00	12,779,500
ほくほくフィナンシャルグループ	92,600	1,407.00	130,288,200
広島銀行	402,000	419.00	168,438,000
山陰合同銀行	81,900	707.00	57,903,300
中国銀行	96,500	1,264.00	121,976,000
鳥取銀行	4,400	1,704.00	7,497,600
伊予銀行	145,500	607.00	88,318,500
百十四銀行	149,000	324.00	48,276,000
四国銀行	106,000	232.00	24,592,000
阿波銀行	109,000	651.00	70,959,000
大分銀行	78,000	376.00	29,328,000
宮崎銀行	91,000	283.00	25,753,000
佐賀銀行	83,000	264.00	21,912,000
十八銀行	84,000	309.00	25,956,000
沖縄銀行	12,500	3,385.00	42,312,500
琉球銀行	28,100	1,266.00	35,574,600
セブン銀行	510,700	317.00	161,891,900
みずほフィナンシャルグループ	19,587,700	168.00	3,290,733,600
高知銀行	54,000	109.00	5,886,000
山口フィナンシャルグループ	127,000	1,080.00	137,160,000
アクリーティブ	11,500	374.00	4,301,000
芙蓉総合リース	15,600	5,060.00	78,936,000
興銀リース	25,600	2,083.00	53,324,800
東京センチュリー	32,000	3,515.00	112,480,000
SBIホールディングス	163,500	1,189.00	194,401,500
日本証券金融	59,800	443.00	26,491,400
アイフル	228,200	300.00	68,460,000

日本アジア投資	9,900	339.00	3,356,100
ポケットカード	13,800	498.00	6,872,400
長野銀行	4,500	1,954.00	8,793,000
名古屋銀行	11,400	3,580.00	40,812,000
北洋銀行	205,100	366.00	75,066,600
愛知銀行	4,600	5,150.00	23,690,000
第三銀行	7,800	1,719.00	13,408,200
中京銀行	5,600	2,346.00	13,137,600
大光銀行	49,000	231.00	11,319,000
愛媛銀行	16,000	1,320.00	21,120,000
トマト銀行	5,400	1,524.00	8,229,600
みなと銀行	12,300	1,741.00	21,414,300
京葉銀行	111,000	436.00	48,396,000
関西アーバン銀行	19,000	1,093.00	20,767,000
栃木銀行	70,000	454.00	31,780,000
北日本銀行	4,300	2,823.00	12,138,900
東和銀行	256,000	94.00	24,064,000
福島銀行	168,000	91.00	15,288,000
大東銀行	83,000	166.00	13,778,000
リコーリース	10,700	2,868.00	30,687,600
イオンフィナンシャルサービス	92,700	1,801.00	166,952,700
アコム	273,800	460.00	125,948,000
ジャックス	75,000	398.00	29,850,000
オリエントコーポレーション	588,500	189.00	111,226,500
日立キャピタル	32,100	2,117.00	67,955,700
アプラスフィナンシャル	65,000	102.00	6,630,000
オリックス	964,900	1,443.00	1,392,350,700
三菱UFJリース	345,600	474.00	163,814,400
ジャフコ	22,800	2,990.00	68,172,000
トモニホールディングス	104,600	498.00	52,090,800
大和証券グループ本社	1,275,000	583.00	743,325,000
野村ホールディングス	2,621,700	461.80	1,210,701,060
岡三証券グループ	116,000	525.00	60,900,000
丸三証券	40,400	847.00	34,218,800
東洋証券	53,000	188.00	9,964,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,300	498.00	77,837,400
光世証券	33,000	117.00	3,861,000
水戸証券	41,900	242.00	10,139,800
いちよし証券	30,500	773.00	23,576,500
松井証券	66,700	818.00	54,560,600
SOMPOホールディングス	302,700	3,289.00	995,580,300
だいこう証券ビジネス	6,800	502.00	3,413,600
日本取引所グループ	400,100	1,542.00	616,954,200
マネックスグループ	158,300	234.00	37,042,200
カブドットコム証券	116,200	331.00	38,462,200
極東証券	18,300	1,361.00	24,906,300
岩井コスモホールディングス	12,900	912.00	11,764,800
藍澤證券	25,600	563.00	14,412,800
フィデアホールディングス	111,300	168.00	18,698,400

池田泉州ホールディングス	144,500	456.00	65,892,000
アニコム ホールディングス	9,200	2,322.00	21,362,400
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	407,200	2,884.00	1,174,364,800
マネースクウェアHD	4,700	1,248.00	5,865,600
ソニーフィナンシャルホールディング ス	130,500	1,378.00	179,829,000
マネーパートナーズグループ	13,000	502.00	6,526,000
小林洋行	4,700	283.00	1,330,100
第一生命ホールディングス	873,100	1,448.50	1,264,685,350
東京海上ホールディングス	552,000	3,994.00	2,204,688,000
イー・ギャランティ	4,500	2,497.00	11,236,500
アサックス	2,500	1,489.00	3,722,500
NECキャピタルソリューション	5,500	1,662.00	9,141,000
T & Dホールディングス	496,600	1,180.50	586,236,300
アドバンスクリエイト	3,300	1,651.00	5,448,300
三井不動産	723,000	2,067.50	1,494,802,500
三菱地所	1,013,000	1,857.50	1,881,647,500
平和不動産	25,800	1,380.00	35,604,000
東京建物	158,200	1,172.00	185,410,400
ダイビル	35,100	890.00	31,239,000
京阪神ビルディング	23,000	526.00	12,098,000
住友不動産	327,000	2,474.50	809,161,500
太平洋興発	59,000	82.00	4,838,000
大京	253,000	188.00	47,564,000
テオーシー	53,000	869.00	46,057,000
東京楽天地	23,000	485.00	11,155,000
レオパレス21	160,500	636.00	102,078,000
スターツコーポレーション	15,700	1,831.00	28,746,700
フジ住宅	17,700	671.00	11,876,700
空港施設	16,800	505.00	8,484,000
明和地所	7,800	567.00	4,422,600
住友不動産販売	9,800	2,069.00	20,276,200
ゴールドクレスト	10,800	1,604.00	17,323,200
リログループ	5,400	16,930.00	91,422,000
日本エスリード	5,600	1,029.00	5,762,400
日神不動産	18,600	336.00	6,249,600
日本エスコン	18,600	311.00	5,784,600
タカラレーベン	59,500	708.00	42,126,000
サンヨーハウジング名古屋	7,200	881.00	6,343,200
イオンモール	88,000	1,471.00	129,448,000
ファースト住建	5,300	1,321.00	7,001,300
ランド	64,400	16.00	1,030,400
東祥	4,300	4,140.00	17,802,000
トーセイ	18,800	731.00	13,742,800
穴吹興産	16,000	242.00	3,872,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	84,800	906.00	76,828,800
サンフロンティア不動産	16,500	963.00	15,889,500
エフ・ジェー・ネクスト	12,100	547.00	6,618,700
ランドビジネス	8,600	257.00	2,210,200

グランディハウス	12,600	353.00	4,447,800
東武鉄道	737,000	503.00	370,711,000
相鉄ホールディングス	237,000	499.00	118,263,000
東京急行電鉄	804,000	747.00	600,588,000
京浜急行電鉄	378,000	1,044.00	394,632,000
小田急電鉄	221,000	2,216.00	489,736,000
京王電鉄	386,000	863.00	333,118,000
京成電鉄	103,500	2,462.00	254,817,000
富士急行	38,000	1,128.00	42,864,000
新京成電鉄	18,000	392.00	7,056,000
東日本旅客鉄道	250,400	9,138.00	2,288,155,200
西日本旅客鉄道	132,900	6,274.00	833,814,600
東海旅客鉄道	123,600	17,205.00	2,126,538,000
西武ホールディングス	146,700	1,713.00	251,297,100
鴻池運輸	19,600	1,385.00	27,146,000
西日本鉄道	179,000	480.00	85,920,000
ハマキョウレックス	10,600	1,864.00	19,758,400
サカイ引越センター	5,500	2,380.00	13,090,000
近鉄グループホールディングス	1,390,000	417.00	579,630,000
阪急阪神ホールディングス	185,300	3,420.00	633,726,000
南海電気鉄道	310,000	482.00	149,420,000
京阪ホールディングス	309,000	699.00	215,991,000
神戸電鉄	33,000	366.00	12,078,000
名古屋鉄道	503,000	542.00	272,626,000
山陽電気鉄道	50,000	506.00	25,300,000
トランコム	4,000	5,980.00	23,920,000
日本通運	534,000	486.00	259,524,000
ヤマトホールディングス	246,900	2,366.00	584,165,400
山九	182,000	589.00	107,198,000
日新	57,000	326.00	18,582,000
丸運	8,800	238.00	2,094,400
丸全昭和運輸	45,000	392.00	17,640,000
センコー	62,200	695.00	43,229,000
トナミホールディングス	29,000	264.00	7,656,000
ニッコンホールディングス	43,900	2,238.00	98,248,200
日本石油輸送	1,600	2,233.00	3,572,800
福山通運	84,000	589.00	49,476,000
セイノーホールディングス	97,900	1,084.00	106,123,600
神奈川中央交通	16,000	701.00	11,216,000
日立物流	28,800	2,020.00	58,176,000
丸和運輸機関	4,200	2,397.00	10,067,400
C & F ロジホールディングス	13,300	1,021.00	13,579,300
日本郵船	1,239,000	207.00	256,473,000
商船三井	672,000	251.00	168,672,000
川崎汽船	604,000	270.00	163,080,000
NSユニテッド海運	62,000	150.00	9,300,000
明治海運	13,000	366.00	4,758,000
飯野海運	71,600	387.00	27,709,200
共栄タンカー	12,000	188.00	2,256,000
日本航空	264,300	2,931.00	774,663,300

ANAホールディングス	2,562,000	272.70	698,657,400
パスコ	13,000	325.00	4,225,000
三菱倉庫	98,000	1,459.00	142,982,000
三井倉庫ホールディングス	80,000	317.00	25,360,000
住友倉庫	101,000	545.00	55,045,000
澁澤倉庫	36,000	286.00	10,296,000
ヤマタネ	6,500	1,357.00	8,820,500
東陽倉庫	24,000	252.00	6,048,000
乾汽船	11,000	970.00	10,670,000
日本トランスシティ	31,000	380.00	11,780,000
ケイヒン	27,000	130.00	3,510,000
中央倉庫	7,900	966.00	7,631,400
安田倉庫	10,800	607.00	6,555,600
東洋埠頭	40,000	167.00	6,680,000
宇徳	11,400	326.00	3,716,400
上組	164,000	877.00	143,828,000
サンリツ	1,700	485.00	824,500
キムラユニティー	3,700	1,040.00	3,848,000
キューソー流通システム	3,900	2,374.00	9,258,600
郵船ロジスティクス	12,800	1,010.00	12,928,000
近鉄エクスプレス	24,800	1,339.00	33,207,200
東海運	8,300	316.00	2,622,800
エーアイティー	8,600	859.00	7,387,400
内外トランスライン	4,400	929.00	4,087,600
東京放送ホールディングス	81,600	1,602.00	130,723,200
日本テレビホールディングス	124,300	1,780.00	221,254,000
朝日放送	13,400	662.00	8,870,800
テレビ朝日ホールディングス	37,200	1,872.00	69,638,400
スカパーJ S A Tホールディングス	103,400	508.00	52,527,200
テレビ東京ホールディングス	12,300	2,317.00	28,499,100
日本BS放送	3,200	969.00	3,100,800
U-NEXT	3,700	648.00	2,397,600
ワイヤレスゲート	4,100	1,765.00	7,236,500
コネクシオ	12,000	1,349.00	16,188,000
日本通信	96,800	177.00	17,133,600
クロップス	1,400	510.00	714,000
日本電信電話	1,053,300	4,610.00	4,855,713,000
KDDI	1,348,000	3,085.00	4,158,580,000
光通信	16,400	9,230.00	151,372,000
NTTドコモ	1,018,200	2,491.50	2,536,845,300
エムティーアイ	20,900	614.00	12,832,600
GMOインターネット	49,800	1,276.00	63,544,800
カドカワ	42,500	1,477.00	62,772,500
学研ホールディングス	46,000	317.00	14,582,000
ゼンリン	18,000	1,790.00	32,220,000
昭文社	7,600	580.00	4,408,000
インプレスホールディングス	11,100	139.00	1,542,900
東京電力ホールディングス	1,171,100	411.00	481,322,100
中部電力	422,500	1,436.50	606,921,250
関西電力	563,500	916.50	516,447,750

中国電力	190,900	1,222.00	233,279,800
北陸電力	135,300	1,189.00	160,871,700
東北電力	345,000	1,264.00	436,080,000
四国電力	124,300	950.00	118,085,000
九州電力	305,000	905.00	276,025,000
北海道電力	129,300	830.00	107,319,000
沖縄電力	22,000	2,201.00	48,422,000
電源開発	117,700	2,324.00	273,534,800
エフオン	5,900	635.00	3,746,500
イーレックス	4,200	3,360.00	14,112,000
東京瓦斯	1,481,000	455.00	673,855,000
大阪瓦斯	1,429,000	420.60	601,037,400
東邦瓦斯	348,000	918.00	319,464,000
北海道瓦斯	34,000	274.00	9,316,000
広島ガス	24,400	338.00	8,247,200
西部瓦斯	156,000	246.00	38,376,000
静岡ガス	40,300	784.00	31,595,200
メタウォーター	8,900	2,805.00	24,964,500
アイネット	8,580	1,049.00	9,000,420
松竹	90,000	1,204.00	108,360,000
東宝	97,200	3,185.00	309,582,000
エイチ・アイ・エス	23,500	2,567.00	60,324,500
東映	51,000	801.00	40,851,000
AOI Pro.	7,100	800.00	5,680,000
ラックランド	2,200	1,782.00	3,920,400
エヌ・ティ・ティ・データ	84,200	5,100.00	429,420,000
共立メンテナンス	10,900	5,940.00	64,746,000
イチネンホールディングス	15,400	974.00	14,999,600
建設技術研究所	8,800	901.00	7,928,800
スペース	7,800	1,221.00	9,523,800
アインホールディングス	16,400	6,670.00	109,388,000
燦ホールディングス	2,900	1,455.00	4,219,500
ピー・シー・エー	1,900	1,160.00	2,204,000
スバル興業	3,000	408.00	1,224,000
東京テアトル	58,000	117.00	6,786,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	962.00	1,635,400
ナガワ	2,700	3,650.00	9,855,000
よみうりランド	29,000	443.00	12,847,000
東京都競馬	99,000	205.00	20,295,000
常磐興産	5,400	1,506.00	8,132,400
カナモト	20,100	2,501.00	50,270,100
東京ドーム	57,600	951.00	54,777,600
D T S	15,200	2,272.00	34,534,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,700	3,395.00	195,891,500
シーイーシー	8,900	1,914.00	17,034,600
カプコン	34,800	2,324.00	80,875,200
西尾レントオール	11,600	2,988.00	34,660,800
アイ・エス・ピー	2,300	835.00	1,920,500

アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	77,000	35.00	2,695,000	
日本空港ビルデング	43,500	3,770.00	163,995,000	
トランス・コスモス	16,800	2,699.00	45,343,200	
乃村工藝社	30,900	1,606.00	49,625,400	
ジャステック	8,700	1,086.00	9,448,200	
S C S K	32,400	3,870.00	125,388,000	
藤田観光	47,000	342.00	16,074,000	
K N T - C Tホールディングス	72,000	111.00	7,992,000	
日本管財	12,400	1,513.00	18,761,200	
トーカイ	6,400	3,415.00	21,856,000	
白洋舎	500	2,419.00	1,209,500	
セコム	150,000	7,534.00	1,130,100,000	
日本システムウエア	5,200	1,707.00	8,876,400	
セントラル警備保障	6,400	1,796.00	11,494,400	
アイネス	19,300	1,156.00	22,310,800	
丹青社	27,100	734.00	19,891,400	
メイテック	17,400	3,475.00	60,465,000	
T K C	12,600	2,930.00	36,918,000	
アサツー ディ・ケイ	23,500	2,769.00	65,071,500	
富士ソフト	20,200	2,779.00	56,135,800	
応用地質	13,600	1,122.00	15,259,200	
船井総研ホールディングス	18,600	1,517.00	28,216,200	
N S D	29,000	1,593.00	46,197,000	
進学会	7,200	494.00	3,556,800	
丸紅建材リース	12,000	183.00	2,196,000	
オオバ	11,000	419.00	4,609,000	
コナミホールディングス	61,500	3,990.00	245,385,000	
学究社	2,200	1,232.00	2,710,400	
ベネッセホールディングス	48,300	2,691.00	129,975,300	
イオンディライト	14,000	3,100.00	43,400,000	
ナック	9,000	851.00	7,659,000	
福井コンピュータホールディングス	4,000	2,321.00	9,284,000	
ニチイ学館	25,200	801.00	20,185,200	
ダイセキ	27,100	2,026.00	54,904,600	
ステップ	5,000	1,208.00	6,040,000	
日鉄住金物産	11,900	3,645.00	43,375,500	
元気寿司	3,900	2,049.00	7,991,100	
トラスコ中山	15,600	5,210.00	81,276,000	
ヤマダ電機	414,100	510.00	211,191,000	
オートバックスセブン	50,400	1,474.00	74,289,600	
アーランドサカモト	23,100	1,188.00	27,442,800	
ニトリホールディングス	58,900	11,920.00	702,088,000	
グルメ杵屋	9,000	989.00	8,901,000	
愛眼	10,800	200.00	2,160,000	
ケーユーホールディングス	7,200	773.00	5,565,600	
吉野家ホールディングス	50,200	1,496.00	75,099,200	
加藤産業	21,300	2,475.00	52,717,500	
イノテック	12,600	467.00	5,884,200	
イエローハット	12,800	2,171.00	27,788,800	

松屋フーズ	6,600	3,090.00	20,394,000
JBCホールディングス	11,400	663.00	7,558,200
JKホールディングス	13,900	503.00	6,991,700
サガミチェーン	18,300	1,255.00	22,966,500
日伝	5,700	2,931.00	16,706,700
関西スーパーマーケット	11,200	1,508.00	16,889,600
ミロク情報サービス	10,100	1,892.00	19,109,200
北沢産業	11,000	163.00	1,793,000
杉本商事	7,900	1,190.00	9,401,000
因幡電機産業	19,100	3,715.00	70,956,500
王将フードサービス	10,000	3,955.00	39,550,000
プレナス	15,200	1,950.00	29,640,000
ミニストップ	10,100	1,819.00	18,371,900
アークス	25,500	2,431.00	61,990,500
パローホールディングス	29,300	2,870.00	84,091,000
バイテックホールディングス	5,600	1,028.00	5,756,800
ミスミグループ本社	153,100	1,958.00	299,769,800
アルテック	12,900	136.00	1,754,400
ベルク	6,700	3,930.00	26,331,000
大 庄	7,400	1,534.00	11,351,600
タキヒヨー	22,000	421.00	9,262,000
ファーストリテイリング	22,700	33,790.00	767,033,000
ソフトバンクグループ	772,100	6,578.00	5,078,873,800
蔵王産業	2,300	1,321.00	3,038,300
スズケン	62,000	3,310.00	205,220,000
サンドラッグ	28,800	8,040.00	231,552,000
サックスパー ホールディングス	12,900	1,102.00	14,215,800
ジェコス	9,400	900.00	8,460,000
ヤマザワ	2,900	1,685.00	4,886,500
やまや	2,800	1,483.00	4,152,400
ルネサスイーストン	11,400	418.00	4,765,200
ベルーナ	34,200	656.00	22,435,200
合計	212,626,940		274,144,773,250

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,747,530,910
国債証券		314,821,199,800
地方債証券		23,892,646,241
特殊債券		20,116,560,490
社債券		18,355,103,890
未収利息		676,597,865
前払費用		10,464,910
流動資産合計		379,620,104,106
資産合計		379,620,104,106
負債の部		
流動負債		
未払解約金		531,583,000
流動負債合計		531,583,000
負債合計		531,583,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	291,973,791,531
剰余金		
剰余金又は欠損金()		87,114,729,575
元本等合計		379,088,521,106
純資産合計		379,088,521,106
負債純資産合計		379,620,104,106

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10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	341,377,581,143円 52,776,738,530円 102,180,528,142円
元本の内訳 ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	10,458,069,463円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	159,532,734円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	125,209,751円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	43,871,381円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	381,270,488円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	110,183,872円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	21,400,757円
たわらノーロード 国内債券	885,657,182円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,268,043,060円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,632,761,411円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	6,578,817,520円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,554,204,766円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,609,638,301円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,690,614,896円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	237,929,018円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	105,278,258円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,257,679,789円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,112,040円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	302,015,090円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	221,948,921円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	50,978,906円
投資のソムリエ	6,567,663,875円
クルーズコントロール	2,610,923,070円
投資のソムリエ<DC年金>	180,275,881円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	961,890,169円
DIAM DC バランス・F(成長型)	90,184,473円
クルーズコントロール<DC年金>	833,577円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	8,493,906円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	21,306,101円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	59,777,173円
ダイナミック・ナビゲーション	1,495,303円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,050,583,696円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	936,406,293円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	534,261,862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)	462,575,957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)	269,246,072円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	113,762,861円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	310,994,299円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	132,470,850円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	88,267,911円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,881,081,105円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,074,303,601円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,043,095,308円

D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	3,351,334,587円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,912,828,633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)	749,275,470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)	2,758,515,887円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,223,738,820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)	5,752,830,754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)	812,385,968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)	6,129,868,013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)	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)	84,823,847,127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)	1,168,090,154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)	7,298,174,808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)	26,880,783,364円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	94,584,425円
D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	12,678,405円
D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	1,822,460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)	30,149,878,097円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	537,946,652円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	135,725,739円
D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	660,620,390円
D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	426,081円
D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)	321,173円
計	291,973,791,531円
2. 受益権の総数	291,973,791,531口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	7,967,012,900
地方債証券	30,330,126
特殊債券	74,212,077
社債券	78,323,800
合計	7,784,146,897

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年2月16日から平成28年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.2984円
(1万口当たり純資産額)	(12,984円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	361回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,005,510,000	
	363回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,006,030,000	
	364回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,509,420,000	
	365回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,516,125,000	
	366回 利付国庫債券(2年)	4,000,000,000	4,026,720,000	
	367回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	503,505,000	
	107回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,320,163,000	
	109回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,011,760,000	
	110回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,017,520,000	
	112回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,517,490,000	
	113回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,019,940,000	
	114回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,539,795,000	
	116回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,243,344,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,045,480,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,543,470,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,519,950,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,020,680,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,549,050,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,540,530,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,542,875,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,038,070,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,255,818,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,041,580,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,057,640,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	899,694,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,057,504,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,217,352,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,175,328,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,011,353,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,109,672,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,290,120,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	471,115,000	
	289回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,268,992,000	
	290回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,024,490,000	
	293回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,242,288,000	
	296回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,069,420,000	
	297回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,384,088,000	
	299回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	934,218,000	
	301回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,037,025,000	

303回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,363,193,000	
305回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,623,075,000	
306回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,584,525,000	
308回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	845,296,000	
309回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,049,190,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,934,960,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,330,922,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,201,840,000	
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,598,865,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,064,510,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,801,201,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,601,295,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,593,435,000	
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,663,950,000	
324回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,585,755,000	
325回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,119,460,000	
326回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,267,212,000	
328回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,577,640,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,280,832,000	
330回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,353,032,000	
332回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,114,300,000	
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,116,680,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,436,896,000	
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,105,220,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,053,410,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,347,905,000	
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,091,240,000	
339回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,405,984,000	
340回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,140,880,000	
341回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,671,135,000	
342回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,074,200,000	
343回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,579,020,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	135,253,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	130,911,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,072,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	278,062,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,864,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,240,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	397,998,000	
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	376,368,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	496,460,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	392,718,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	388,095,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	681,255,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	276,434,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	554,004,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	274,074,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,111,264,000	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	271,482,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	418,623,000	

21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	680,775,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	658,028,200	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	842,184,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	421,761,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	821,340,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	973,602,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,276,173,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,140,600,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,553,024,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,398,270,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,245,546,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,695,696,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,758,172,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,684,464,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,771,588,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,914,822,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	2,158,848,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,329,870,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,086,688,000	
40回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	934,871,000	
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,049,832,000	
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,314,830,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,052,632,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,054,688,000	
45回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,267,370,000	
46回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,269,450,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,556,496,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,369,280,000	
49回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,246,660,000	
50回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,300,692,000	
51回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	662,102,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	416,600,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	756,050,400	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	855,952,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	940,074,600	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	981,666,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	545,085,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,041,086,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	557,225,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	853,491,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	662,268,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	612,920,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	787,577,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	907,621,200	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,266,018,100	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	675,462,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,088,831,700	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	862,528,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,387,568,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	687,870,000	

65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,266,045,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,195,127,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,498,300,000	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,475,237,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,400,808,500	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,666,098,000	
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,706,969,000	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,666,532,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,685,474,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,690,794,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,477,236,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,471,032,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,586,078,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	849,562,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	979,312,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,499,628,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,740,578,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,730,722,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,626,898,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,791,468,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,622,894,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,752,856,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,970,512,000	
111回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,036,080,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,895,160,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,153,611,000	
116回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,310,102,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,259,850,000	
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,109,502,000	
121回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,998,528,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,303,460,000	
125回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,334,366,000	
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	879,767,000	
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,118,151,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,866,975,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,217,474,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,123,947,000	
135回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	987,000,000	
137回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,100,503,000	
140回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,979,776,000	
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,354,138,000	
143回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,569,707,000	
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,737,610,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,986,592,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,083,265,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,813,155,000	
149回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,540,202,000	
150回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,026,859,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,084,724,000	
152回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,851,488,000	

	153回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,234,134,000	
	154回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,737,195,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,017,566,000	
	156回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,510,890,000	
	157回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,740,654,000	
国債証券 合計		278,520,000,000	314,821,199,800	
地方債証券	659回 東京都公募公債	203,500,000	209,049,445	
	667回 東京都公募公債	300,000,000	311,433,000	
	680回 東京都公募公債	200,000,000	209,504,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	520,725,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	207,358,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	525,875,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	733,985,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	525,160,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	317,133,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	420,532,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	117,641,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	246,762,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	209,144,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	211,042,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	311,952,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,199,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	312,225,000	
	319回 大阪府公募公債	200,000,000	206,906,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	210,072,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	315,825,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	210,988,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	313,560,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	318,567,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	362,890,500	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	207,270,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	324,792,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	204,990,320	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	208,154,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	210,646,000	
	1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	119,315,000	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	103,116,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	208,906,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	529,400,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	316,602,000	
	22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	209,884,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	200,000,000	208,132,000	
	23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	210,946,000	
	26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	418,392,000	
	21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	208,878,000	
	25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	209,926,000	
	21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	208,300,000	
	24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	313,266,000	
	25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	211,246,000	
	65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,013,000	

80回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,578,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	526,475,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	738,353,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,306,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	528,910,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	735,294,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	524,760,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,940,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	837,437,476		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,180,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,644,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,425,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,015,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,435,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	415,176,000		
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	418,320,000		
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,445,000		
488回	名古屋市長募公債 10年	450,000,000	470,614,500		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	209,148,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	210,494,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	473,787,000		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	423,412,000		
19年度7回	札幌市長募公債	300,000,000	306,354,000		
25年度4回	札幌市長募公債	200,000,000	210,416,000		
2回	川崎市長募公債 15年	100,000,000	106,001,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	208,672,000		
23年度1回	千葉市長募公債	200,000,000	212,352,000		
地方債証券 合計		22,744,400,000	23,892,646,241		
特殊債券	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	204,842,000	
	48回	高速道路機構債	700,000,000	729,085,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	731,353,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	104,755,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,605,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	332,703,000	
	47回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,722,000	
	54回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,400,000	
	56回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	204,382,000	
	60回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	729,284,640	
	66回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	166,895,640	
	67回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	414,501,670	
	71回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	619,044,000	

7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	725,704,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,177,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	311,940,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	421,180,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,046,260,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,200,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	530,140,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	350,634,900	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	519,045,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	677,228,790	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,427,840	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,070,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,176,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	522,910,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,994,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,792,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,473,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,672,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	421,236,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,790,000	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,993,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	205,846,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	312,306,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	58,212,000	62,496,403	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	40,860,000	43,857,898	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	60,525,000	65,007,481	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	64,935,000	70,309,669	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	27,707,000	29,081,821	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	141,420,000	147,404,894	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,967,000	40,100,550	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,178,000	25,022,737	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	87,520,000	94,468,212	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	66,981,000	72,053,471	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,670,000	124,569,725	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,830,000	228,837,830	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	400,432,000	428,906,719	
7 5 5 号 利付商工債	260,000,000	261,159,600	
い第 7 6 9 号 利付商工債	200,000,000	201,298,000	
い第 7 7 9 号 利付商工債	200,000,000	201,412,000	

	753号 利附農林債	300,000,000	300,993,000	
	760号 利附農林債	300,000,000	302,289,000	
	764号 利附農林債	500,000,000	503,885,000	
	282回 利附信金中金債	300,000,000	301,407,000	
	293回 利附信金中金債	400,000,000	402,432,000	
	302回 利附信金中金債	300,000,000	301,773,000	
	186号 利附商工債(3年)	200,000,000	200,536,000	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	308,385,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	207,200,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	525,905,000	
特殊債券 合計		19,351,237,000	20,116,560,490	
社債券	1回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,983,000	
	337回 東京交通債	200,000,000	218,370,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,032,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	312,105,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	104,666,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,612,000	
	3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	103,277,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	104,562,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	103,666,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,746,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	104,763,000	
	11回 パナソニック社債	100,000,000	101,460,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,714,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	101,393,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	209,894,000	
	16回 トヨタ自動車社債	100,000,000	103,145,000	
	49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	103,809,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	104,961,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	104,109,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	103,274,000	
	69回 三菱商事社債	300,000,000	309,513,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,932,000	
	32回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,648,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	106,092,000	
	140回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,885,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	212,374,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,078,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	211,572,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	319,443,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,853,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,235,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	210,082,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	106,545,000	
	12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,602,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	206,866,000		
10回 セブン銀行社債	100,000,000	104,521,000		

1 1 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	204,984,000	
2 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,396,000	
2 2 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	209,710,000	
2 3 回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	423,476,000	
1 0 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,476,000	
1 4 回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	211,494,000	
2 3 回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,424,000	
1 5 回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	212,860,000	
4 7 回	日立キャピタル社債	200,000,000	208,154,000	
1 4 4 回	オリックス社債	100,000,000	101,728,000	
1 6 4 回	オリックス社債	100,000,000	102,775,000	
1 6 7 回	オリックス社債	200,000,000	201,146,000	
3 9 回	野村ホールディングス社債	300,000,000	303,516,000	
4 6 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,656,000	
3 8 回	三井不動産社債	200,000,000	209,300,000	
7 2 回	三菱地所社債	100,000,000	115,685,000	
9 0 回	三菱地所社債	100,000,000	102,500,000	
9 6 回	三菱地所社債	200,000,000	208,604,000	
8 4 回	住友不動産社債	100,000,000	100,483,000	
8 7 回	住友不動産社債	100,000,000	102,391,000	
8 回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	102,852,000	
1 5 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	329,163,000	
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,689,000	
3 9 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	347,235,000	
5 2 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	307,296,000	
5 6 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	310,857,000	
9 回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	222,844,000	
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	338,472,000	
5 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,212,000	
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,789,000	
1 1 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,002,000	
1 4 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,771,000	
1 5 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	210,412,000	
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,260,000	
5 4 回	日本電信電話社債	200,000,000	205,122,000	
6 0 回	日本電信電話社債	300,000,000	314,532,000	
1 5 回	NTTドコモ社債	200,000,000	206,656,000	
4 5 5 回	東京電力社債	200,000,000	207,288,000	
5 4 2 回	東京電力社債	500,000,000	510,295,000	
4 7 6 回	中部電力社債	100,000,000	103,581,000	
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	520,145,000	
4 1 0 回	関西電力社債	300,000,000	312,078,000	
4 9 2 回	関西電力社債	200,000,000	202,448,000	
4 9 3 回	関西電力社債	200,000,000	202,496,000	
3 7 7 回	中国電力社債	200,000,000	212,478,000	
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	107,860,000	
2 8 1 回	北陸電力社債	200,000,000	206,014,000	
4 7 1 回	東北電力社債	200,000,000	212,238,000	
4 7 3 回	東北電力社債	300,000,000	305,145,000	
2 3 7 回	四国電力社債	100,000,000	104,220,000	

253回 四国電力社債	200,000,000	210,084,000	
423回 九州電力社債	200,000,000	204,756,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	213,076,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	421,416,000	
320回 北海道電力社債	200,000,000	203,594,000	
321回 北海道電力社債	161,000,000	168,484,890	
38回 電源開発社債	300,000,000	313,992,000	
17回 東京ガス社債	100,000,000	104,288,000	
9回 大阪ガス社債	100,000,000	103,740,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	107,995,000	
27回 NTTデータ社債	100,000,000	104,688,000	
社債券 合計	17,561,000,000	18,355,103,890	
合計	338,176,637,000	377,185,510,421	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		245,750,070
投資証券		26,253,479,756
未収入金		9,520,050
未収配当金		199,681,769
流動資産合計		26,708,431,645
資産合計		26,708,431,645
負債の部		
流動負債		
未払金		167,325,764
流動負債合計		167,325,764
負債合計		167,325,764
純資産の部		
元本等		
元本	1	15,180,336,252
剰余金		
剰余金又は欠損金()		11,360,769,629
元本等合計		26,541,105,881
純資産合計		26,541,105,881
負債純資産合計		26,708,431,645

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10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	14,550,922,737円 12,085,387,213円 11,455,973,698円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド（安定型）	610,789円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,551,539円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	3,359,219円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,458,959円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,365,431円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,638,645円
たわらノーロード 国内リート	498,813,334円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	32,348,443円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,802,327円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	344,976,938円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,262,040円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	11,428,642円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	31,357,057円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	67,624,587円
投資のソムリエ	686,059,285円
投資のソムリエ<DC年金>	18,941,627円

DIAM 8資産バランスファンドN <DC年金>	36,986,155円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑 制型	3,505,706円
ダイナミック・ナビゲーション	469,965円
DIAM J-REITインデックス 私募ファンド201210(適格機関 投資家限定)	978,666,133円
DIAM J-REITインデックス 私募ファンド201212(適格機関 投資家限定)	1,054,623,756円
DIAM J-REITインデックス 私募ファンド201401(適格機関 投資家限定)	1,900,673,417円
DIAM J-REITインデックス ファンド(適格機関投資家向け)	7,772,152,934円
DIAMグローバル 私募ファンド (適格機関投資家向け)	57,813,260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)	661,075,280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)	954,293,116円
DIAM リスクコントロールJ-R EITファンド(適格機関投資家限 定)	37,477,668円
計	15,180,336,252円
2. 受益権の総数	15,180,336,252口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	1,329,405,736
合計	1,329,405,736

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年6月7日から平成28年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.7484円
(1万口当たり純資産額)	(17,484円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	6,521	850,990,500	
	MCUBS MidCity投資法人	608	193,344,000	
	SIA不動産投資法人	215	80,517,500	
	いちごオフィスリート投資法人	3,502	255,996,200	
	いちごホテルリート投資法人	589	76,452,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,370	723,360,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,080	887,656,000	
	イオンリート投資法人	2,993	385,797,700	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,864	167,573,600	
	インヴィンシブル投資法人	8,401	447,773,300	
	オリックス不動産投資法人	5,770	1,017,828,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	443	162,581,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	925	555,925,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	798	229,664,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	965	234,012,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,174	288,334,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	647	52,859,900	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	194	29,449,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,598	676,662,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,984	435,962,400	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,992	1,738,352,000	
	スターアジア不動産投資法人	788	69,580,400	
	スターツプロシード投資法人	397	66,418,100	
	トーセイ・リート投資法人	368	40,480,000	
	ヒューリックリート投資法人	2,379	440,828,700	
	フロンティア不動産投資法人	1,134	561,330,000	
	プレミアム投資法人	3,010	396,116,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	275	29,562,500	
	マリモ地方創生リート投資法人	208	17,035,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,749	1,210,770,600	
	ラサールロジポート投資法人	2,514	273,020,400	
	阪急リート投資法人	1,366	188,508,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	512	162,048,000	
	産業ファンド投資法人	806	411,060,000	
森トラスト総合リート投資法人	3,017	514,398,500		
森ヒルズリート投資法人	4,001	603,350,800		
星野リゾート・リート投資法人	187	232,067,000		
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	2,327	268,768,500		
積水ハウス・リート投資法人	2,043	316,665,000		

大江戸温泉リート投資法人	403	34,335,600	
大和ハウスリート投資法人	3,471	1,011,335,340	
大和証券オフィス投資法人	1,138	679,386,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,234	307,398,400	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,107	512,541,000	
日本ビルファンド投資法人	3,227	1,965,243,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,995	883,785,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,210	1,055,868,000	
日本ヘルスケア投資法人	171	31,036,500	
日本リート投資法人	895	236,369,500	
日本リテールファンド投資法人	5,833	1,356,172,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,011	457,904,700	
日本賃貸住宅投資法人	3,748	311,458,800	
福岡リート投資法人	1,707	318,867,600	
平和不動産リート投資法人	2,319	190,621,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	9,560	1,608,055,916	
投資証券 合計	130,744	26,253,479,756	
合計	130,744	26,253,479,756	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		4,972,546,971
コール・ローン		98,225,753
株式		240,970,135,633
投資信託受益証券		819,369,297
投資証券		5,741,105,528
派生商品評価勘定		36,397,654
未収入金		2,921,921
未収配当金		280,921,804
差入委託証拠金		1,171,790,039
流動資産合計		254,093,414,600
資産合計		254,093,414,600
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		34,581,305
未払解約金		377,050,000
流動負債合計		411,631,305
負債合計		411,631,305
純資産の部		
元本等		
元本	1	100,403,068,668
剰余金		
剰余金又は欠損金()		153,278,714,627
元本等合計		253,681,783,295
純資産合計		253,681,783,295
負債純資産合計		254,093,414,600

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10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	98,425,773,739円
	同期中追加設定元本額	20,806,177,728円
	同期中一部解約元本額	18,828,882,799円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,951,069,361円
	MITO ラップ型ファンド(安定型)	6,302,436円
	MITO ラップ型ファンド(中立型)	15,885,054円
	MITO ラップ型ファンド(積極型)	34,557,068円
	グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,053,332円
	グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,976,337円
	グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,854,378円
	たわらノーロード 先進国株式	1,925,384,634円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	426,031円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	12,210,923円
	DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	35,775,985,290円
	DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	184,975,989円
	DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	953,771,814円
	DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,154,273,058円
	DIAM DC バランス30インデックスファンド	154,219,442円
	DIAM DC バランス50インデックスファンド	424,912,023円
	DIAM DC バランス70インデックスファンド	351,218,100円
	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	44,877,625円
	マネックス資産設計ファンド<育成型>	962,087,439円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	228,191,393円
	DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	27,448,009円
	DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	55,450,918円
	DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	106,709,231円

投資のソムリエ	543,340,779円
クルーズコントロール	531,098,739円
投資のソムリエ<DC年金>	14,886,372円
DIAM 8資産バランスファンドN <DC年金>	87,691,558円
DIAM DC バランス・F(成長 型)	40,468,070円
クルーズコントロール<DC年金>	169,726円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実 型)	4,309,803円
DIAMコア資産設計ファンド(積極 型)	10,831,563円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑 制型	4,359,505円
ダイナミック・ナビゲーション	439,073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)	199,567,957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)	3,233,690,106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)	147,200,968円
DIAM先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	392,381円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	36,367,478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)	201,127,434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)	351,435,122円
DIAM国際分散バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	25,425,328円
DIAM国際分散バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	162,351,419円
DIAM国内重視バランスファンド3 0VA(適格機関投資家限定)	13,816,919円
DIAM国内重視バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	23,041,123円
DIAM世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	2,048,221,117円
DIAM世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	1,083,778,037円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	919,211,282円
DIAMバランスファンド37.5V A(適格機関投資家限定)	1,021,084,457円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,089,092,005円
DIAMグローバル・アセット・バラ ンスVA(適格機関投資家限定)	1,300,978,067円
DIAMグローバル・アセット・バラ ンスVA2(適格機関投資家限定)	1,728,448,000円

D I A M アクサ グローバル バラ ンスファンド30VA(適格機関投資 家限定)	1,470,108,607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)	999,380,756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)	13,494,600円
D I A M世界バランスファンド55V A(適格機関投資家限定)	4,787,679,095円
D I A M世界バランスファンド35V A(適格機関投資家限定)	1,708,239,056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)	11,069,827,660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)	610,228,493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)	1,905,576,749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)	7,010,880,357円
D I A Mバランス30VA(適格機関 投資家限定)	30,570,864円
D I A Mバランス50VA(適格機関 投資家限定)	10,518,093円
D I A Mバランス70VA(適格機関 投資家限定)	3,463,728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)	9,440,136,846円
D I A Mバランス20VA(適格機関 投資家限定)	103,812,926円
D I A Mバランス40VA(適格機関 投資家限定)	188,138円
D I A Mバランス60VA(適格機関 投資家限定)	298,427円
計	100,403,068,668円
2. 受益権の総数	100,403,068,668口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	30,288,208,875
投資信託受益証券	49,142,697
投資証券	510,076,515
合計	30,847,428,087

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年2月16日から平成28年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在			
	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	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902
アメリカ・ドル	261,702,840	-	261,147,600	555,240
イギリス・ポンド	43,453,250	-	43,210,600	242,650
オーストラリア・ドル	27,557,260	-	27,422,500	134,760
カナダ・ドル	16,514,808	-	16,430,400	84,408
ユーロ	77,319,944	-	76,668,100	651,844
合計	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902

(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10月12日 現在			
	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	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447
合計	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	2.5266円
(1万口当たり純資産額)	(25,266円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	32,021	831.000	26,609,451.000	
	ABBOTT LABORATORIES	117,024	41.160	4,816,707.840	
	AES CORP	56,133	11.520	646,652.160	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,977	154.790	11,296,109.830	
	ADOBE SYSTEMS INC	39,274	107.370	4,216,849.380	
	CHUBB LTD	37,498	123.740	4,640,002.520	
	AGCO CORP	5,610	51.700	290,037.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,700	132.650	2,215,255.000	
	ALLEGHANY CORP	1,288	519.630	669,283.440	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	69,297	68.940	4,777,335.180	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	102.330	481,257.990	
	ALLSTATE CORP	29,557	68.200	2,015,787.400	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,299	105.780	6,166,868.220	
	ALCOA INC	34,259	27.910	956,168.690	
	AMGEN INC	60,032	164.320	9,864,458.240	
	HESS CORP	22,862	52.570	1,201,855.340	
	AMERICAN EXPRESS CO	65,075	60.860	3,960,464.500	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,743	61.340	2,437,835.620	
	AFLAC INC	32,779	70.980	2,326,653.420	
	AMERICAN INTL GROUP	90,937	59.860	5,443,488.820	
	AMERCO	551	338.000	186,238.000	
	ANALOG DEVICES	24,925	62.100	1,547,842.500	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	63.720	2,612,711.160	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,216	121.770	2,218,162.320	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	75,492	44.240	3,339,766.080	
	TIME WARNER	63,059	78.570	4,954,545.630	
	JONES LANG LASALLE INC	3,815	100.980	385,238.700	
	VALERO ENERGY CORP	37,999	54.190	2,059,165.810	
	APACHE CORP	30,532	62.870	1,919,546.840	
	ANSYS INC	7,266	91.150	662,295.900	
APPLE INC	437,670	116.300	50,901,021.000		
APPLIED MATERIALS INC	89,516	28.640	2,563,738.240		
ALBEMARLE CORP	9,134	81.720	746,430.480		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,497	42.340	2,053,362.980		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	72.900	570,879.900		

AMEREN CORP	19,716	46.880	924,286.080	
ARROW ELECTRONICS INC	7,403	62.740	464,464.220	
AUTOLIV INC	7,327	103.150	755,780.050	
AUTODESK INC	16,207	70.170	1,137,245.190	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	36,096	86.090	3,107,504.640	
AUTOZONE INC	2,471	760.610	1,879,467.310	
AVERY DENNISON CORP	7,368	75.560	556,726.080	
AVNET INC	10,288	41.790	429,935.520	
BAKER HUGHES INC	33,914	52.520	1,781,163.280	
BALL CORP	16,040	78.380	1,257,215.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	95,531	143.950	13,751,687.450	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,897	39.950	3,391,635.150	
CR BARD INC	5,892	217.760	1,283,041.920	
BAXTER INTERNATIONAL INC	40,198	47.010	1,889,707.980	
BED BATH & BEYOND INC	13,962	42.530	593,803.860	
BECTON DICKINSON & CO	17,278	173.970	3,005,853.660	
AMETEK INC	19,168	46.400	889,395.200	
BE AEROSPACE INC	8,229	51.070	420,255.030	
VERIZON COMM INC	325,987	49.900	16,266,751.300	
WR BERKLEY CORP	8,134	57.490	467,623.660	
BEST BUY CO INC	23,778	38.330	911,410.740	
YUM! BRANDS INC	32,791	88.250	2,893,805.750	
FIRSTENERGY CORP	34,261	31.220	1,069,628.420	
H&R BLOCK INC	20,906	22.820	477,074.920	
BOEING CO	50,166	133.740	6,709,200.840	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	37.920	411,280.320	
BORGWARNER INC	17,824	35.560	633,821.440	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,273	23.160	2,507,602.680	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	70.710	819,670.320	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	411.440	906,402.320	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	133,563	49.550	6,618,046.650	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,537	146.640	665,305.680	
INGREDION INC	5,305	133.470	708,058.350	
ONEOK INC	16,401	49.820	817,097.820	
UNITED RENTALS INC	7,795	79.500	619,702.500	
SEMPRA ENERGY	19,256	102.770	1,978,939.120	
FEDEX CORP	20,669	174.080	3,598,059.520	
VERISIGN INC	8,114	75.470	612,363.580	
AMPHENOL CORP	25,425	64.000	1,627,200.000	
BROWN-FORMAN CORP	16,642	46.380	771,855.960	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,735	45.380	1,122,474.300	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	179,873	4.080	733,881.840	

CSX CORP	77,703	30.470	2,367,610.410	
CABOT OIL & GAS CORP	38,049	23.640	899,478.360	
CAMPBELL SOUP CO	16,224	53.850	873,662.400	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	35.100	815,688.900	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,266	169.710	2,421,082.860	
CARDINAL HEALTH INC	26,820	75.320	2,020,082.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	25,034	46.850	1,172,842.900	
CATERPILLAR INC	45,874	87.470	4,012,598.780	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	11,333	76.630	868,447.790	
CELGENE CORP	62,258	101.640	6,327,903.120	
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	114.420	413,285.040	
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	83.070	1,037,544.300	
CENTURYLINK INC	44,114	27.640	1,219,310.960	
CERNER CORP	23,765	60.730	1,443,248.450	
JPMORGAN CHASE & CO	293,456	68.310	20,045,979.360	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,206	46.970	996,045.820	
CIGNA CORP	20,878	125.000	2,609,750.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,667	74.600	944,958.200	
CINTAS CORP	6,282	109.320	686,748.240	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	96,233	4.150	399,366.950	
CISCO SYSTEMS INC	401,169	31.040	12,452,285.760	
CLOROX COMPANY	10,463	120.890	1,264,872.070	
COCA-COLA CO/THE	329,545	41.540	13,689,299.300	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,859	72.200	4,971,619.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	27,369	66.610	1,823,049.090	
COMERICA INC	13,912	48.640	676,679.680	
NRG ENERGY, INC.	23,703	11.130	263,814.390	
COMCAST CORP-CL A	194,702	64.960	12,647,841.920	
CA INC	26,267	32.390	850,788.130	
CONAGRA FOODS INC	31,942	46.980	1,500,635.160	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,660	71.660	1,695,475.600	
CMS ENERGY CORP	22,372	40.110	897,340.920	
COOPER COS INC	3,794	179.620	681,478.280	
MOLSON COORS BREWING CO	15,273	109.840	1,677,586.320	
CORNING INC	91,502	23.640	2,163,107.280	
WR GRACE & CO	5,923	70.160	415,557.680	
SEALED AIR CORP	16,041	44.590	715,268.190	
CUMMINS INC	13,365	127.860	1,708,848.900	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,892	149.560	881,207.520	
DR HORTON INC	28,738	29.200	839,149.600	
DANAHER CORP	50,365	76.340	3,844,864.100	
MOODY'S CORP	14,180	107.580	1,525,484.400	

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,931	49.890	2,391,277.590	
TARGET CORP	45,204	68.390	3,091,501.560	
DEERE & CO	21,801	87.050	1,897,777.050	
MORGAN STANLEY	115,706	32.180	3,723,419.080	
REPUBLIC SERVICES INC	19,564	49.600	970,374.400	
THE WALT DISNEY CO	123,933	91.860	11,384,485.380	
DOLLAR TREE INC	19,144	77.240	1,478,682.560	
DOVER CORP	12,592	66.910	842,530.720	
DOW CHEMICAL	88,477	53.520	4,735,289.040	
OMNICOM GROUP	18,417	81.940	1,509,088.980	
DTE ENERGY CO	14,532	91.600	1,331,131.200	
DUKE ENERGY CORP	55,845	75.910	4,239,193.950	
FLOWSERVE CORP	10,787	45.000	485,415.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	62.400	588,806.400	
EBAY INC	91,657	31.460	2,883,529.220	
BANK OF AMERICA CORP	824,162	16.110	13,277,249.820	
CITIGROUP INC	234,898	48.990	11,507,653.020	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,077	65.310	788,748.870	
E*TRADE FINANCIAL CORP	22,307	28.930	645,341.510	
EATON CORP PLC	36,973	63.120	2,333,735.760	
EATON VANCE CORP	9,184	37.520	344,583.680	
CADENCE DESIGN SYS INC	25,316	25.660	649,608.560	
DISH NETWORK CORP	18,138	55.330	1,003,575.540	
ECOLAB INC	21,802	117.160	2,554,322.320	
ELECTRONIC ARTS INC	25,227	83.370	2,103,174.990	
SALESFORCE.COM INC	49,119	72.420	3,557,197.980	
EMERSON ELECTRIC CO	50,537	50.790	2,566,774.230	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	68.960	566,920.160	
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	6.070	427,570.800	
ENERGY CORP	13,984	73.290	1,024,887.360	
EOG RESOURCES INC	43,035	96.050	4,133,511.750	
EQUIFAX INC	9,656	128.650	1,242,244.400	
EQT CORP	13,874	71.050	985,747.700	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,994	87.280	1,570,516.320	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	51.140	730,228.060	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	47,994	69.030	3,313,025.820	
EXXON MOBIL CORP	332,419	87.740	29,166,443.060	
FMC CORP	10,694	47.250	505,291.500	
NEXTERA ENERGY INC	37,378	121.150	4,528,344.700	
ASSURANT INC	4,960	90.500	448,880.000	
FASTENAL CO	21,654	39.960	865,293.840	
FIFTH THIRD BANCORP	63,684	20.390	1,298,516.760	
M&T BANK CORP	11,736	116.060	1,362,080.160	
FISERV INC	17,144	99.130	1,699,484.720	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	29.870	347,179.010	
MACY'S INC	24,512	37.240	912,826.880	
FORD MOTOR CO	292,126	11.990	3,502,590.740	

FRANKLIN RESOURCES INC	31,936	34.780	1,110,734.080	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	9.870	955,534.440	
FLEX LTD	44,363	13.900	616,645.700	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	49.820	606,608.320	
TEGNA INC	16,963	20.590	349,268.170	
GAP INC/THE	18,295	26.560	485,915.200	
DENTSPLY SIRONA INC	19,774	57.890	1,144,716.860	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,588	149.600	3,229,564.800	
GENERAL MILLS INC	47,773	61.950	2,959,537.350	
GENUINE PARTS CO	12,418	97.290	1,208,147.220	
GILEAD SCIENCES INC	109,133	73.820	8,056,198.060	
GARTNER INC	6,829	87.450	597,196.050	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22,038	32.150	708,521.700	
MCKESSON CORP	18,102	163.630	2,962,030.260	
NVIDIA CORP	43,025	66.130	2,845,243.250	
GENERAL ELECTRIC CO	731,501	28.920	21,155,008.920	
WW GRAINGER INC	4,486	216.570	971,533.020	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	13.930	309,747.480	
HALLIBURTON CO	67,096	46.640	3,129,357.440	
MONSTER BEVERAGE CORP	10,850	143.120	1,552,852.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,032	169.040	5,076,609.280	
HARLEY-DAVIDSON INC	14,799	50.020	740,245.980	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,679	81.660	463,747.140	
HARRIS CORP	10,390	91.170	947,256.300	
HASBRO INC	8,909	78.690	701,049.210	
HENRY SCHEIN INC	6,731	158.630	1,067,738.530	
HELMERICH & PAYNE INC	8,757	69.260	606,509.820	
HERSHEY FOODS CORP	11,306	94.630	1,069,886.780	
HP INC	140,131	15.440	2,163,622.640	
F5 NETWORKS INC	5,809	121.810	707,594.290	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,481	55.100	632,603.100	
REYNOLDS AMERICAN INC	69,489	46.390	3,223,594.710	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	108.480	1,124,829.120	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	121.110	417,466.170	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	23.940	664,095.600	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	24.720	343,311.360	
HOLOGIC INC	21,078	38.690	815,507.820	
UNUM GROUP	19,263	36.640	705,796.320	
HOME DEPOT INC	98,336	125.850	12,375,585.600	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	91.670	1,181,351.290	
HORMEL FOODS CORP	23,322	37.800	881,571.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	21.840	697,831.680	
HUMANA INC	12,124	177.530	2,152,373.720	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,455	81.800	609,819.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	10.020	753,113.220	
RED HAT INC	15,033	76.750	1,153,782.750	
BIOGEN INC	17,412	298.300	5,193,999.600	
ILLINOIS TOOL WORKS	25,712	115.040	2,957,908.480	
INTUIT INC	18,923	106.990	2,024,571.770	
IDEXX LABORATORIES INC	7,050	112.840	795,522.000	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	64.780	1,364,461.140	
INTEL CORP	377,945	37.270	14,086,010.150	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,594	135.480	893,355.120	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,350	45.720	1,433,322.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,502	22.520	754,465.040	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,014	50.100	501,701.400	
INCYTE CORP	13,436	92.110	1,237,589.960	
JOHNSON & JOHNSON	221,142	117.640	26,015,144.880	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	32,350	43.190	1,397,196.500	
KLA-TENCOR CORP	14,558	72.390	1,053,853.620	
DEVON ENERGY CORP	37,258	44.140	1,644,568.120	
WESTAR ENERGY INC	9,911	56.320	558,187.520	
KELLOGG CO	20,813	76.050	1,582,828.650	
KEYCORP	70,481	12.740	897,927.940	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,291	121.390	3,555,634.490	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,758	351.870	3,433,547.460	
KOHL'S CORP	14,862	45.900	682,165.800	
KROGER CO	75,423	30.110	2,270,986.530	
LAM RESEARCH CORP	12,756	99.590	1,270,370.040	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,455	80.610	600,947.550	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	54.130	777,685.710	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	45.590	437,116.920	
LENNAR CORP	14,850	41.580	617,463.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	27,535	19.270	530,599.450	
ELI LILLY & CO	79,647	81.810	6,515,921.070	
L BRANDS INC	20,102	70.550	1,418,196.100	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,990	48.730	925,382.700	
LINEAR TECH CORP	19,803	59.110	1,170,555.330	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,845	108.700	5,961,651.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,930	45.690	1,230,431.700	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,285	231.850	5,166,777.250	
LOEWS CORP	23,670	41.180	974,730.600	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	38.780	531,169.660	
LOWE'S COS INC	71,320	70.090	4,998,818.800	

DOMINION RESOURCES INC/VA	48,462	71.690	3,474,240.780	
SCANA CORP	10,902	68.340	745,042.680	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,882	26.550	979,217.100	
MCCORMICK & CO INC	9,163	94.160	862,788.080	
MCDONALD'S CORPORATION	72,035	113.680	8,188,938.800	
S&P GLOBAL INC	21,416	122.750	2,628,814.000	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	190.200	622,334.400	
MANPOWERGROUP INC	5,703	71.940	410,273.820	
MARKEL CORPORATION	1,153	919.150	1,059,779.950	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,461	118.250	2,064,763.250	
MARSH & MCLENNAN COS	42,209	65.530	2,765,955.770	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,056	77.700	315,151.200	
MASCO CORP	27,299	33.230	907,145.770	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,004	169.190	846,626.760	
MATTEL INC	27,746	29.440	816,842.240	
METLIFE INC	73,317	47.310	3,468,627.270	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,577	38.060	897,340.620	
MEDTRONIC PLC	112,296	83.200	9,343,027.200	
ACTIVISION BLIZZARD INC	46,881	42.900	2,011,194.900	
CVS HEALTH CORP	87,707	86.400	7,577,884.800	
MERCK & CO. INC.	222,237	61.930	13,763,137.410	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,362	136.480	1,141,245.760	
MICROSOFT CORP	601,435	57.190	34,396,067.650	
MICRON TECH INC	83,952	16.860	1,415,430.720	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,192	59.690	1,026,190.480	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,922	12.830	448,049.260	
3M CO	48,388	169.680	8,210,475.840	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,759	191.990	913,680.410	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,882	73.500	946,827.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,789	95.620	840,404.180	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	29.290	364,455.470	
ENDO INTERNATIONAL PLC	16,587	20.460	339,370.020	
MYLAN NV	31,922	38.310	1,222,931.820	
ILLUMINA INC	12,052	138.990	1,675,107.480	
XCEL ENERGY INC	40,991	39.450	1,617,094.950	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,520	36.960	1,128,019.200	
NETAPP INC	24,525	34.080	835,812.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,400	43.090	706,676.000	
NEWELL BRANDS INC	36,046	50.340	1,814,555.640	
DUN & BRADSTREET CORP	3,012	127.560	384,210.720	

NEWMONT MINING CORP	43,070	33.850	1,457,919.500	
NIKE INC-CL B	107,325	51.820	5,561,581.500	
NOBLE ENERGY INC	34,645	35.740	1,238,212.300	
NORDSTROM INC	11,509	54.140	623,097.260	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,311	94.670	2,301,522.370	
EVERSOURCE ENERGY	25,660	51.980	1,333,806.800	
NISOURCE INC	22,198	22.380	496,791.240	
COACH INC	22,645	36.250	820,881.250	
NORTHERN TRUST CORP	17,585	71.070	1,249,765.950	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,964	215.220	3,005,332.080	
WELLS FARGO & CO	386,036	45.450	17,545,336.200	
NUCOR CORP	26,212	47.400	1,242,448.800	
MONSANTO CO	34,763	103.330	3,592,060.790	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	42.000	668,934.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,426	72.160	3,061,460.160	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	60,498	73.690	4,458,097.620	
OGE ENERGY CORP	16,028	29.890	479,076.920	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,584	274.590	2,082,490.560	
ORACLE CORP	251,870	38.010	9,573,578.700	
PACCAR INC	28,571	57.430	1,640,832.530	
EXELON CORP	74,581	32.150	2,397,779.150	
PARKER HANNIFIN CORP	10,973	123.070	1,350,447.110	
PATTERSON COS INC	7,169	45.500	326,189.500	
PAYCHEX INC	25,896	56.030	1,450,952.880	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	55.870	475,956.530	
MEDNAX INC	7,824	65.660	513,723.840	
PPL CORPORATION	54,358	32.190	1,749,784.020	
PEPSICO INC	115,706	105.570	12,215,082.420	
PENTAIR PLC	13,787	59.150	815,501.050	
PFIZER INC	494,350	33.130	16,377,815.500	
CONOCOPHILLIPS	97,469	43.330	4,223,331.770	
PVH CORP	6,682	112.640	752,660.480	
PG&E CORP	39,914	58.820	2,347,741.480	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,256	192.460	2,743,709.760	
ALTRIA GROUP INC	156,655	61.990	9,711,043.450	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,768	90.510	3,689,911.680	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	74.030	370,890.300	
GARMIN LTD	9,959	48.060	478,629.540	
AETNA INC	28,172	112.070	3,157,236.040	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	50.000	491,050.000	
PPG INDUSTRIES INC	20,722	92.300	1,912,640.600	
PRAXAIR INC	23,235	117.130	2,721,515.550	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,981	151.010	5,282,480.810	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,251	65.950	1,335,553.450	

QUEST DIAGNOSTICS	11,714	83.310	975,893.340	
PROCTER & GAMBLE CO	211,323	88.540	18,710,538.420	
PROGRESSIVE CORP	47,700	31.120	1,484,424.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	40,943	40.590	1,661,876.370	
PULTE GROUP INC	25,477	19.680	501,387.360	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	39,870	14.060	560,572.200	
GLOBAL PAYMENTS INC	12,589	73.700	927,809.300	
QUALCOMM INC	119,297	66.090	7,884,338.730	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	58.300	593,902.100	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	120.830	427,134.050	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,328	386.050	2,442,924.400	
AUTONATION INC	5,772	48.310	278,845.320	
RESMED INC	11,376	64.080	728,974.080	
US BANCORP	138,468	43.290	5,994,279.720	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,261	77.510	795,330.110	
RITE AID CORP	85,598	7.370	630,857.260	
ROSS STORES INC	33,046	63.750	2,106,682.500	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,820	176.860	1,383,045.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,729	115.200	1,235,980.800	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,567	72.330	981,301.110	
RAYTHEON COMPANY	24,384	136.300	3,323,539.200	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,873	208.250	1,014,802.250	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	31.300	586,530.700	
ACCENTURE PLC-CL A	49,981	116.970	5,846,277.570	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	124,719	42.330	5,279,355.270	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,919	128.730	1,276,872.870	
ROCKWELL COLLINS INC	10,829	82.690	895,450.010	
ST JUDE MEDICAL INC	23,176	78.410	1,817,230.160	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	24,007	114.000	2,736,798.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	25,122	76.490	1,921,581.780	
PRICELINE GROUP INC	3,945	1,459.020	5,755,833.900	
SCHLUMBERGER LTD	110,719	81.690	9,044,635.110	
SCHWAB (CHARLES) CORP	93,509	31.900	2,982,937.100	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,310	126.620	2,065,172.200	
BUNGE LTD	11,367	60.270	685,089.090	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	44.290	491,929.030	
ANTHEM INC	21,326	121.900	2,599,639.400	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,019	79.610	1,275,272.590	

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	52.500	1,225,927.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,396	267.410	1,710,354.360	
CENTENE CORP	13,899	61.700	857,568.300	
SMITH (A.O.) CORP	12,522	49.540	620,339.880	
ACUITY BRANDS INC	3,573	240.090	857,841.570	
SNAP-ON INC	4,811	146.700	705,773.700	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,772	84.370	3,018,083.640	
ADVANCE AUTO PARTS	6,029	146.760	884,816.040	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,997	13.170	513,590.490	
EDISON INTERNATIONAL	26,295	69.410	1,825,135.950	
SOUTHERN CO	73,354	49.410	3,624,421.140	
BB&T CORP	63,246	38.750	2,450,782.500	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	39.790	546,953.340	
AT&T INC	492,775	39.100	19,267,502.500	
CHEVRON CORP	150,426	103.040	15,499,895.040	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,590	117.660	1,363,679.400	
STAPLES INC	52,662	7.760	408,657.120	
STATE STREET CORP	31,077	70.340	2,185,956.180	
STARBUCKS CORP	118,040	52.920	6,246,676.800	
STRYKER CORP	27,397	113.730	3,115,860.810	
NETFLIX INC	34,895	100.590	3,510,088.050	
STERICYCLE INC	6,853	76.160	521,924.480	
SUNTRUST BANKS INC	41,008	45.630	1,871,195.040	
SYMANTEC CORP	53,442	25.060	1,339,256.520	
SYNOPSYS INC	12,600	59.570	750,582.000	
SYSCO CORP	43,896	48.010	2,107,446.960	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,047	710.300	2,164,284.100	
TESORO CORP	9,395	81.270	763,531.650	
TEXAS INSTRUMENTS INC	79,919	68.760	5,495,230.440	
TEXTRON INC	21,883	37.900	829,365.700	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,602	154.900	4,895,149.800	
TIFFANY & CO	10,305	73.470	757,108.350	
TOLL BROTHERS INC	13,356	29.150	389,327.400	
TORCHMARK CORP	7,699	64.210	494,352.790	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	46.850	638,893.450	
DAVITA INC	13,946	62.000	864,652.000	
TRACTOR SUPPLY CO	10,977	68.260	749,290.020	
TRIMBLE INC	20,073	28.150	565,054.950	
TYSON FOODS INC	24,179	71.380	1,725,897.020	
UGI CORP	12,068	42.960	518,441.280	
MARATHON OIL CORP	66,702	15.080	1,005,866.160	
UNION PACIFIC CORP	67,363	96.540	6,503,224.020	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	63,313	98.770	6,253,425.010	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,971	134.750	10,237,092.250	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	121.090	901,030.690	
VALSPAR CORP	6,122	105.540	646,115.880	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	97.220	665,762.560	
VF CORP	26,770	54.180	1,450,398.600	
CBS CORP	33,859	55.450	1,877,481.550	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,184	81.660	1,648,225.440	
VULCAN MATERIALS CO	10,906	106.710	1,163,779.260	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	73,166	78.080	5,712,801.280	
WAL-MART STORES INC	123,110	67.390	8,296,382.900	
WASTE MANAGEMENT INC	36,145	62.430	2,256,532.350	
WATERS CORP	6,779	156.830	1,063,150.570	
ALLERGAN PLC	31,542	237.950	7,505,418.900	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,725	132.170	1,285,353.250	
WESTERN DIGITAL CORP	22,106	56.620	1,251,641.720	
WABTEC CORP	7,363	80.890	595,593.070	
WHIRLPOOL CORP	6,288	161.030	1,012,556.640	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,061	79.430	1,196,295.230	
WYNN RESORTS LTD	6,279	97.700	613,458.300	
WHOLE FOODS MARKET INC	26,602	28.560	759,753.120	
NASDAQ INC	9,132	65.940	602,164.080	
CME GROUP INC	27,754	103.930	2,884,473.220	
WILLIAMS COS INC	58,139	30.300	1,761,611.700	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	57.060	427,322.340	
LKQ CORP	22,948	33.110	759,808.280	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	36.370	595,849.710	
WEC ENERGY GROUP INC	25,516	56.590	1,443,950.440	
FOOT LOCKER INC	11,034	68.530	756,160.020	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,474	35.710	766,836.540	
CARMAX INC	15,331	51.140	784,027.340	
XEROX CORP	69,821	9.760	681,452.960	
XILINX INC	21,006	50.990	1,071,095.940	
YAHOO! INC	70,470	42.680	3,007,659.600	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	139.160	974,537.480	
TJX COMPANIES INC	53,271	74.230	3,954,306.330	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	6.800	643,960.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,000	61.420	1,228,400.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,068	34.830	211,348.440	
SIGNATURE BANK	4,171	120.960	504,524.160	
CBRE GROUP INC	25,519	27.020	689,523.380	
LIBERTY GLOBAL PLC	23,519	32.290	759,428.510	

REGIONS FINANCIAL CORP	104,065	10.260	1,067,706.900	
DOMINO'S PIZZA INC	3,935	152.380	599,615.300	
T-MOBILE US INC	23,522	45.610	1,072,838.420	
LAS VEGAS SANDS CORP	35,605	58.960	2,099,270.800	
MOSAIC CO/THE	26,525	24.860	659,411.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	24.830	895,791.910	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	87,154	24.640	2,147,474.560	
CELANESE CORP	12,107	65.490	792,887.430	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	26.400	275,167.200	
EXPEDIA INC	9,786	117.720	1,152,007.920	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	23.460	433,423.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,809	99.690	1,276,929.210	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	50,537	31.510	1,592,420.870	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,758	265.350	2,589,285.300	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	38.120	560,211.520	
VIACOM INC-CLASS B	27,527	35.730	983,539.710	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,433	423.020	1,029,207.660	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	7,814	53.520	418,205.280	
TRANSDIGM GROUP INC	4,387	276.700	1,213,882.900	
MASTERCARD INC	78,095	101.350	7,914,928.250	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	35,957	18.820	676,710.740	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	9,200	67.500	621,000.000	
HANESBRANDS INC	32,964	25.910	854,097.240	
WESTERN UNION CO	41,207	19.920	820,843.440	
AERCAP HOLDINGS NV	14,032	40.560	569,137.920	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,099	16.380	296,461.620	
SPECTRA ENERGY CORP	54,583	41.860	2,284,844.380	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	65.110	542,366.300	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,440	15.780	290,983.200	
DELTA AIR LINES INC	17,228	38.940	670,858.320	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,680	53.140	461,255.200	
DISCOVER FINANCIAL	33,582	55.490	1,863,465.180	
TE CONNECTIVITY LTD	28,732	62.750	1,802,933.000	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	9,777	140.080	1,369,562.160	
WABCO HOLDING INC	4,379	110.460	483,704.340	

LULULEMON ATHLETICA INC	9,052	56.760	513,791.520	
VMWARE INC	5,491	73.400	403,039.400	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	236.660	1,161,290.620	
INVESCO LTD	34,162	30.540	1,043,307.480	
MSCI INC	7,958	80.100	637,435.800	
NETSUITE INC	3,026	102.600	310,467.600	
CALPINE CORP NPR	27,876	12.960	361,272.960	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,943	95.520	11,839,035.360	
VISA INC	153,349	82.040	12,580,751.960	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,377	87.140	1,252,811.780	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,301	70.490	1,008,077.490	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	62.140	409,191.900	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	80.400	490,038.000	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,874	25.820	538,966.680	
MARATHON PETROLEUM CORP	42,347	41.960	1,776,880.120	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	54.780	636,762.720	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	154,779	20.820	3,222,498.780	
XYLEM INC	14,720	49.700	731,584.000	
ALKERMES PLC	12,053	44.670	538,407.510	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,950	80.300	2,404,985.000	
LINKEDIN CORP	9,511	190.340	1,810,323.740	
SPLUNK INC	10,674	59.630	636,490.620	
HCA HOLDINGS INC	25,820	75.760	1,956,123.200	
VERISK ANALYTICS INC	12,227	79.400	970,823.800	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,846	122.470	593,489.620	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,373	171.070	1,261,299.110	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,177	79.850	1,211,883.450	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11,990	77.530	929,584.700	
CIT GROUP INC	16,266	36.570	594,847.620	
NXP SEMICONDUCTOR NV	24,098	101.930	2,456,309.140	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	183,200	0.440	80,608.000	
LEAR CORP	6,051	118.400	716,438.400	
DOLLAR GENERAL CORP	23,585	68.700	1,620,289.500	
FORTINET INC	11,399	34.090	388,591.910	
AON PLC	21,841	109.850	2,399,233.850	
REALOGY HOLDINGS CORP	12,857	25.360	326,053.520	

TESLA MOTORS INC	8,425	200.100	1,685,842.500	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	14,212	38.000	540,056.000	
GENERAL MOTORS CO	109,842	31.890	3,502,861.380	
VANTIV INC	12,141	56.000	679,896.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	63.430	587,552.090	
ALLY FINANCIAL INC	35,251	19.650	692,682.150	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	14,486	45.650	661,285.900	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	30.900	513,990.600	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,217	67.800	1,506,312.600	
PHILLIPS 66	38,340	80.560	3,088,670.400	
FACEBOOK INC	183,929	128.880	23,704,769.520	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	11,968	77.230	924,288.640	
SERVICENOW INC	12,640	78.800	996,032.000	
WHITEWAVE FOODS CO	14,444	53.550	773,476.200	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	155.480	1,095,823.040	
WORKDAY INC	8,710	88.290	769,005.900	
ABBVIE INC	128,678	62.390	8,028,220.420	
ZOETIS INC	36,853	50.960	1,878,028.880	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	37.950	463,900.800	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.670	413,695.210	
MALLINCKRODT PLC	9,419	68.160	641,999.040	
CDW CORP	12,562	44.270	556,119.740	
SPRINT CORP	63,882	6.780	433,119.960	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	14,164	21.900	310,191.600	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	13,112	38.200	500,878.400	
VERSUM MATERIALS INC	8,350	23.300	194,555.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	32.710	163,746.260	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	18,330	32.100	588,393.000	
XL GROUP LTD	24,408	34.080	831,824.640	
BROADCOM LTD	31,048	171.170	5,314,486.160	
DELL TECHNOLOGIES INC	17,283	47.140	814,720.620	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	33.210	511,766.100	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	27.220	358,296.860	
TWITTER INC	43,692	18.000	786,456.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	20,871	13.510	281,967.210	
PERRIGO CO PLC	11,759	89.230	1,049,255.570	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	44,389	22.550	1,000,971.950	
ARAMARK	17,307	36.540	632,397.780	
SABRE CORP	17,624	26.430	465,802.320	
NAVIENT CORP	28,699	14.110	404,942.890	
IHS MARKIT LTD	23,398	36.120	845,135.760	
FNF GROUP	20,571	36.130	743,230.230	

SYNCHRONY FINANCIAL	67,120	26.540	1,781,364.800	
MOBILEYE NV	14,001	38.360	537,078.360	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,810	24.960	1,068,537.600	
CDK GLOBAL INC	10,850	54.910	595,773.500	
QORVO INC	10,599	55.520	588,456.480	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	5,647	68.270	385,520.690	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	26.150	384,666.500	
LIBERTY LILAC GROUP-C	6,305	28.170	177,611.850	
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,438	51.750	1,523,416.500	
ADVANSIX INC	2,331	15.640	36,456.840	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,128	112.970	579,310.160	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	37.870	609,328.300	
WESTROCK CO	19,981	45.660	912,332.460	
KRAFT HEINZ CO	49,423	87.240	4,311,662.520	
FORTIVE CORP	23,758	49.220	1,169,368.760	
WASTE CONNECTIONS INC	11,793	72.660	856,879.380	
ALPHABET INC-CL A	23,367	809.570	18,917,222.190	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	139,382	21.980	3,063,616.360	
PAYPAL HOLDINGS INC	89,723	39.190	3,516,244.370	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	32.680	265,819.120	
ALPHABET INC-CL C	24,944	783.070	19,532,898.080	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	17,085	257.860	4,405,538.100	
アメリカ・ドル 小計	25,083,559		1,513,239,314.560 (156,832,122,562)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	3.405	242,916.100	
ANTOFAGASTA PLC	25,905	5.570	144,290.850	
ASHTREAD GROUP	41,347	13.330	551,155.510	
SEVERN TRENT PLC	19,770	23.150	457,675.500	
BHP BILLITON PLC	171,489	12.390	2,124,748.710	
BARCLAYS PLC	1,351,523	1.724	2,330,025.650	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,682	4.797	396,625.550	
BT GROUP PLC	681,176	3.731	2,541,467.650	
SKY PLC	86,067	8.785	756,098.590	
AGGREKO PLC	19,416	9.675	187,849.800	
BUNZL PLC	26,929	23.230	625,560.670	
EASYJET PLC	13,628	9.005	122,720.140	
CAPITA PLC	54,894	5.840	320,580.960	
AVIVA PLC	330,507	4.472	1,478,027.300	
CRODA INTERNATIONAL	10,965	36.590	401,209.350	
DIAGEO PLC	199,681	22.285	4,449,891.080	
SCHRODERS PLC	11,918	27.960	333,227.280	
DCC PLC	7,281	70.800	515,494.800	

NATIONAL GRID PLC	303,709	10.530	3,198,055.770	
GKN PLC	134,180	3.329	446,685.220	
KINGFISHER PLC	196,101	3.700	725,573.700	
BAE SYSTEMS PLC	257,892	5.440	1,402,932.480	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	31.200	373,994.400	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,368	48.835	7,245,551.280	
COBHAM PLC	142,739	1.702	242,941.770	
NEXT PLC	11,843	47.120	558,042.160	
IMPERIAL BRANDS PLC	77,589	38.905	3,018,600.040	
IMI PLC	21,218	10.980	232,973.640	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,938	35.240	561,655.120	
SABMILLER PLC	79,054	44.945	3,553,082.030	
ANGLO AMERICAN PLC	114,150	10.310	1,176,886.500	
COMPASS GROUP PLC	133,391	14.960	1,995,529.360	
HSBC HOLDINGS PLC	1,571,934	6.185	9,722,411.790	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	475,238	2.147	1,020,335.980	
CENTRICA PLC	441,116	2.122	936,048.150	
UNILEVER PLC	101,414	37.540	3,807,081.560	
MEGGITT PLC	62,181	4.577	284,602.430	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.173	338,296.980	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	9.225	512,900.770	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.560	449,603.840	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29,159	25.040	730,141.360	
PEARSON PLC	65,009	8.170	531,123.530	
PERSIMMON PLC	23,150	17.280	400,032.000	
PRUDENTIAL PLC	201,621	14.380	2,899,309.980	
RIO TINTO PLC	100,701	26.795	2,698,283.290	
VODAFONE GROUP PLC	2,109,862	2.260	4,768,288.120	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,384	74.090	3,732,950.560	
RELX PLC	91,193	14.560	1,327,770.080	
OLD MUTUAL PLC	389,986	1.977	771,002.320	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	146,260	7.745	1,132,783.700	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	1.810	505,790.020	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	9.425	385,331.700	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.750	300,265.750	
SSE PLC	81,467	15.120	1,231,781.040	
BP PLC	1,469,397	4.867	7,151,555.190	
SHIRE PLC	71,239	52.200	3,718,675.800	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	7.370	628,447.270	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.100	478,972.000	
STANDARD CHARTERED PLC	267,656	6.687	1,789,815.670	

LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,076,744	0.536	2,721,134.780	
TATE & LYLE PLC	39,915	7.975	318,322.120	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.477	373,713.490	
TESCO PLC	665,246	2.021	1,344,462.160	
3I GROUP PLC	78,491	6.690	525,104.790	
SMITH & NEPHEW PLC	74,628	12.440	928,372.320	
GLAXOSMITHKLINE PLC	388,362	17.190	6,675,942.780	
WEIR GROUP	18,336	17.560	321,980.160	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,907	28.290	704,619.030	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	10.000	213,020.000	
WPP PLC	116,020	18.280	2,120,845.600	
WOLSELEY PLC	20,579	45.520	936,756.080	
ASTRAZENECA PLC	100,765	50.510	5,089,640.150	
WHITBREAD PLC	14,978	38.870	582,194.860	
CARNIVAL PLC	15,378	38.170	586,978.260	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.320	399,362.800	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	36.890	496,022.940	
WILLIAM HILL PLC	72,474	3.063	221,987.860	
BURBERRY GROUP PLC	35,774	15.160	542,333.840	
INVESTEC PLC	50,655	4.907	248,564.080	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,187	32.440	492,666.280	
ICAP PLC	44,767	4.682	209,599.090	
ITV PLC	301,271	1.776	535,057.290	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.328	254,706.480	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	69.600	603,640.800	
G4S PLC	122,250	2.311	282,519.750	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.240	321,674.320	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	24.320	260,856.320	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	342,067	21.025	7,191,958.670	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	310,847	22.120	6,875,935.640	
INMARSAT PLC	34,127	7.270	248,103.290	
PETROFAC LTD	21,809	9.415	205,331.730	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	20.200	231,431.400	
TUI AG-DI	19,394	10.820	209,843.080	
STANDARD LIFE PLC	155,609	3.459	538,251.530	
EXPERIAN PLC	78,135	15.790	1,233,751.650	
MONDI PLC	30,200	16.700	504,340.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	12.600	268,254.000	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	16.470	257,574.330	
GLENCORE PLC	994,899	2.219	2,207,680.880	
DIXONS CARPHONE PLC	84,639	3.420	289,465.380	

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.510	395,555.940	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	8.985	275,084.760	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	18.260	244,793.560	
	ROYAL MAIL PLC	79,209	4.864	385,272.570	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.489	224,616.090	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.901	297,833.540	
	WORLDPAY GROUP PLC	112,202	2.986	335,035.170	
イギリス・ボンド	小計	23,777,577		145,697,861.480 (18,518,198,194)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,152	21.830	2,229,978.160	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	14.850	1,845,409.500	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	7.240	1,362,785.200	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	14.640	723,377.040	
	NICE LTD	5,638	255.100	1,438,253.800	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	75,895	172.800	13,114,656.000	
イスラエル・シュケル	小計	545,596		20,714,459.700 (564,054,737)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	79.120	879,418.800	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	230,880	28.200	6,510,816.000	
	AMCOR LTD	93,885	15.470	1,452,400.950	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	264,904	30.660	8,121,956.640	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	11.100	339,315.900	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	5.180	591,167.500	
	TELSTRA CORP LTD	349,459	5.050	1,764,767.950	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.190	436,566.660	
	AMP LTD	240,738	5.410	1,302,392.580	
	ASX LTD	16,354	47.550	777,632.700	
	BHP BILLITON LTD	253,232	23.800	6,026,921.600	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	34.810	729,130.260	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	10.760	409,310.400	
	CSL LIMITED	37,912	105.480	3,998,957.760	
	REA GROUP LTD	4,119	54.550	224,691.450	
	TRANSURBAN GROUP	166,791	10.550	1,759,645.050	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.890	480,663.890	
	COCHLEAR LTD	3,992	138.070	551,175.440	
	ORIGIN ENERGY LTD	143,330	5.790	829,880.700	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	135,878	74.610	10,137,857.580	

BORAL LIMITED	60,188	6.780	408,074.640	
RIO TINTO LIMITED	31,897	53.200	1,696,920.400	
APA GROUP	94,292	8.040	758,107.680	
ARISTOCRAT LEISU	44,406	16.170	718,045.020	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	200,111	5.650	1,130,627.150	
TPG TELECOM LTD	28,719	7.920	227,454.480	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,706	35.490	167,015.940	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	20.210	723,315.900	
ORICA LTD	34,301	16.400	562,536.400	
CIMIC GROUP LTD	8,709	27.860	242,632.740	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.470	550,791.100	
MACQUARIE GROUP LTD	24,601	83.450	2,052,953.450	
SUNCORP GROUP LTD	104,995	12.570	1,319,787.150	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	208,468	28.280	5,895,475.040	
NEWCREST MINING LTD	61,110	20.520	1,253,977.200	
OIL SEARCH LTD	116,483	7.650	891,094.950	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	2.860	390,178.360	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	109,432	10.220	1,118,395.040	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	10.470	478,552.290	
SANTOS LTD	133,862	3.940	527,416.280	
SONIC HEALTHCARE	33,734	21.820	736,075.880	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	5.070	358,834.320	
WESFARMERS LTD	92,057	45.350	4,174,784.950	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.535	283,380.950	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	30.050	1,740,586.150	
WOOLWORTHS LTD	101,809	24.100	2,453,596.900	
DUET GROUP	207,776	2.370	492,429.120	
SEEK LTD	25,899	15.460	400,398.540	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	67.720	310,225.320	
TATTS GROUP LTD	109,937	3.550	390,276.350	
AUSNET SERVICES	165,066	1.560	257,502.960	
AGL ENERGY LTD	55,792	18.900	1,054,468.800	
BRAMBLES LTD	129,410	12.160	1,573,625.600	
CROWN RESORTS LTD	32,861	13.120	431,136.320	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	43,023	5.630	242,219.490	
AURIZON HOLDINGS LTD	171,522	4.760	816,444.720	
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	11.230	717,844.060	
HEALTHSCOPE LTD	149,047	3.000	447,141.000	
MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.510	589,470.990	
SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	2.530	1,093,028.310	
オーストラリア・ドル 小計	6,179,841		87,001,491.750	

(6,817,436,893)

カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	59.220	955,870.020	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	34,037	64.780	2,204,916.860	
	BARRICK GOLD CORP	93,528	20.550	1,922,000.400	
	ATCO LTD	7,193	45.720	328,863.960	
	BANK OF MONTREAL	52,218	83.930	4,382,656.740	
	BANK OF NOVA SCOTIA	95,090	69.870	6,643,938.300	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,571	45.620	1,257,789.020	
	BCE INC	11,568	59.710	690,725.280	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	69,814	46.700	3,260,313.800	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	30.390	784,639.410	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	1.730	262,293.950	
	SAPUTO INC	20,680	45.540	941,767.200	
	BLACKBERRY LTD	39,652	10.150	402,467.800	
	CGI GROUP INC	18,082	62.160	1,123,977.120	
	CCL INDUSTRIES INC	2,268	236.670	536,767.560	
	CAE INC	23,000	18.600	427,800.000	
	CAMECO CORP	32,627	10.520	343,236.040	
	ROGERS COMM-CL B	29,459	54.240	1,597,856.160	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,271	99.540	3,212,255.340	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	88,596	43.120	3,820,259.520	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,911	130.670	772,390.370	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	36.110	329,287.090	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	62,184	88.110	5,479,032.240	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	21.530	245,808.010	
	AGRIUM INC	10,775	118.410	1,275,867.750	
	YAMANA GOLD INC	67,520	4.820	325,446.400	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	36.260	680,165.080	
	OPEN TEXT CORP	9,878	84.460	834,295.880	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.570	213,830.300	
	EMPIRE CO LTD	15,093	19.440	293,407.920	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.760	474,767.160	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	25.470	251,949.240	
	FORTIS INC	22,804	40.560	924,930.240	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	10.680	590,561.280	
TELUS CORP	18,945	42.340	802,131.300		
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	33.160	823,594.920		
IMPERIAL OIL LTD	24,952	43.120	1,075,930.240		
ENBRIDGE INC	74,606	57.300	4,274,923.800		
IGM FINANCIAL INC	8,426	35.270	297,185.020		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.820	336,140.900		

MANULIFE FINANCIAL CORP	152,230	19.220	2,925,860.600	
LINAMAR CORP	3,827	55.550	212,589.850	
LOBLAW CO LTD	17,936	66.070	1,185,031.520	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	49.460	476,299.800	
MAGNA INTERNATIONAL INC	33,042	56.760	1,875,463.920	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,032	43.190	2,160,882.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,805	728.790	1,315,465.950	
METRO INC	19,350	41.130	795,865.500	
HUSKY ENERGY INC	28,749	16.370	470,621.130	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	17.910	716,256.720	
METHANEX CORP	7,381	48.350	356,871.350	
ONEX CORP	6,646	83.870	557,400.020	
GOLDCORP INC	67,652	18.530	1,253,591.560	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	68,403	21.390	1,463,140.170	
POWER CORP OF CANADA	31,258	28.430	888,664.940	
POWER FINANCIAL CORP	22,140	31.050	687,447.000	
ROYAL BANK OF CANADA	118,120	82.030	9,689,383.600	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,459	51.830	645,749.970	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,856	201.890	2,393,607.840	
SHAW COMM INC-B	34,029	26.330	895,983.570	
SUNCOR ENERGY INC	130,834	37.400	4,893,191.600	
ENCANA CORP	69,257	14.690	1,017,385.330	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,857	24.270	1,112,949.390	
THOMSON REUTERS CORP	28,406	52.640	1,495,291.840	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	147,356	57.920	8,534,859.520	
TRANSCANADA CORP	59,771	60.450	3,613,156.950	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	40.230	229,150.080	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	107.590	510,299.370	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	92.630	992,808.340	
SILVER WHEATON CORP	33,943	29.890	1,014,556.270	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	590.790	882,640.260	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	13,919	82.080	1,142,471.520	
WASTE CONNECTIONS INC	2,429	96.080	233,378.320	
CI FINANCIAL CORP	20,695	24.390	504,751.050	
VERESEN INC	24,982	13.370	334,009.340	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	36.180	570,884.220	
KEYERA CORP	13,728	41.000	562,848.000	
ALTAGAS LTD	12,538	33.090	414,882.420	
PEMBINA PIPELINE CORP	30,719	39.680	1,218,929.920	
DOLLARAMA INC	9,286	100.770	935,750.220	

	CENOVUS ENERGY INC W/I	67,060	20.400	1,368,024.000	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	53.410	442,822.310	
	ARC RESOURCES LTD	30,676	24.160	741,132.160	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	37.440	542,617.920	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	13.080	400,653.480	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	28.140	677,695.620	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	28.720	429,679.920	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	31.650	545,361.150	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,390	57.790	1,004,968.100	
	ECN CAPITAL CORP	30,631	3.160	96,793.960	
	HYDRO ONE LTD	16,612	24.350	404,502.200	
カナダ・ドル 小計		3,246,914		123,236,661.490 (9,643,268,762)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.240	405,000.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	2.600	211,640.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.780	467,586.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.355	245,709.700	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	146,600	15.370	2,253,242.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	9.040	262,160.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	42.610	436,496.840	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.390	509,171.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.120	600,334.800	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.755	441,222.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	5.410	645,413.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.790	496,341.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	714,200	0.185	132,127.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	249,053	8.660	2,156,798.980	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	642,722	3.890	2,500,188.580	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.500	498,750.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	104,900	18.770	1,968,973.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	151,000	3.200	483,200.000	
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	145,700	0.765	111,460.500		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	256,000	1.840	471,040.000		
シンガポール・ドル 小計		4,662,074		15,296,854.400 (1,149,864,545)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	153,118	13.180	2,018,095.240	
	SYNGENTA AG	7,570	420.200	3,180,914.000	

NESTLE SA-REGISTERED	255,377	75.350	19,242,656.950	
CIE FINANC RICHEMONT	42,276	63.350	2,678,184.600	
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	56,214	238.900	13,429,524.600	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	180.200	639,349.600	
SIKA INHABER	176	4,666.000	821,216.000	
SGS SA-REG	405	2,154.000	872,370.000	
NOVARTIS AG-REG SHS	180,180	76.000	13,693,680.000	
BALOISE HOLDING AG -R	4,127	118.300	488,224.100	
BARRY CALLEBAUT AG	232	1,255.000	291,160.000	
SWISSCOM AG-REG	2,105	453.200	953,986.000	
ABB LTD	154,073	22.190	3,418,879.870	
ADECCO GROUP AG-REG	13,319	56.900	757,851.100	
GEBERIT AG	3,062	423.900	1,297,981.800	
LONZA GROUP AG-REG	4,373	183.300	801,570.900	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,330.000	399,750.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	64,850.000	583,650.000	
GIVAUDAN-REG	757	1,947.000	1,473,879.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,176	255.900	3,115,838.400	
LAFARGEHOLCIM LTD	20,941	51.850	1,085,790.850	
ACTELION	8,330	166.600	1,387,778.000	
SONOVA HOLDING AG	4,519	136.100	615,035.900	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	138.700	617,631.100	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,454	291.900	716,322.600	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	57.400	263,580.800	
SCHINDLER NAMEN	1,663	181.700	302,167.100	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,618	253.100	662,615.800	
GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,067.000	325,435.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	507.000	280,371.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	81.700	489,383.000	
DUFREY GROUP	3,566	123.100	438,974.600	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,474	495.250	729,998.500	
ARYZTA AG	7,191	45.510	327,262.410	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,205	40.670	740,397.350	
SWISS RE LTD	27,071	87.700	2,374,126.700	
UBS GROUP AG	288,297	13.610	3,923,722.170	
スイス・フラン 小計	1,295,394		85,439,355.040 (8,954,044,407)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	52,983	259.900	13,770,281.700	
ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	233.600	6,811,075.200	
ERICSSON LM-B SHS	248,663	61.850	15,379,806.550	
GETINGE AB-B SHS	13,153	162.700	2,139,993.100	
SKF AB-B SHS	32,306	146.000	4,716,676.000	
SANDVIK AB	86,729	97.050	8,417,049.450	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	121,939	89.400	10,901,346.600	
	SKANSKA AB-B SHS	27,150	196.100	5,324,115.000	
	SWEDBANK AB	72,788	203.100	14,783,242.800	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	50,376	252.100	12,699,789.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	119.000	14,150,171.000	
	VOLVO AB-B SHS	125,161	99.300	12,428,487.300	
	SWEDISH MATCH AB	15,807	305.800	4,833,780.600	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	74.800	2,017,804.800	
	NORDEA AB	244,219	88.000	21,491,272.000	
	INDUSTRIVARDEN C	14,804	159.800	2,365,679.200	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	217.700	4,177,880.700	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	137.300	3,308,655.400	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	321.000	10,725,252.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,506	251.200	19,469,507.200	
	ASSA ABLOY AB-B	81,437	172.700	14,064,169.900	
	TELIA CO AB	217,869	38.360	8,357,454.840	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	162.600	2,730,054.000	
	BOLIDEN AB	21,855	206.200	4,506,501.000	
	ALFA LAVAL AB	24,553	136.700	3,356,395.100	
	KINNEVIK AB-B	18,310	227.700	4,169,187.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	443.500	2,364,742.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	277.200	1,641,024.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	74.100	2,496,577.200	
	HEXAGON AB	21,137	372.000	7,862,964.000	
	スウェーデン・クローネ 小計	1,882,222		241,460,935.240 (2,832,336,770)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,601	616.000	5,298,216.000	
	A P MOLLER A/S	481	9,695.000	4,663,295.000	
	AP MOLLER MAERSK A	351	9,240.000	3,243,240.000	
	DANSKE BANK A/S	58,792	196.900	11,576,144.800	
	GENMAB A/S	4,633	1,136.000	5,263,088.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,126	293.100	5,605,830.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	149,127	268.900	40,100,250.300	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,097	529.500	9,582,361.500	
	TDC A/S	68,939	38.050	2,623,128.950	
	COLOPLAST-B	9,961	493.200	4,912,765.200	
	DSV A/S	15,601	322.200	5,026,642.200	
	WILLIAM DEMANT	6,537	135.800	887,724.600	
	TRYG A/S	11,107	137.700	1,529,433.900	
	PANDORA A/S	9,446	795.500	7,514,293.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	386.900	2,982,225.200	
	ISS A/S	11,125	266.700	2,967,037.500	
	デンマーク・クローネ 小計	399,632		113,775,676.750	

(1,749,869,908)

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.780	664,385.760	
	CONTACT ENERGY L	64,605	4.740	306,227.700	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	10.120	761,843.720	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	166,326	3.490	580,477.740	
ニュージーランド・ドル 小計		404,204		2,312,934.920 (169,422,484)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	31,839	150.100	4,779,033.900	
	DNB ASA	78,026	112.300	8,762,319.800	
	NORSK HYDRO ASA	119,498	35.200	4,206,329.600	
	TELENOR ASA	61,888	136.600	8,453,900.800	
	ORKLA ASA	61,421	81.400	4,999,669.400	
	STATOIL ASA	88,513	138.600	12,267,901.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,576	275.800	4,020,060.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	154.000	2,569,182.000	
ノルウェー・クローネ 小計		472,444		50,058,398.100 (633,238,736)	
ユーロ	CRH PLC	67,295	29.650	1,995,296.750	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	95.500	596,493.000	
	KERRY GROUP PLC-A	13,414	70.490	945,552.860	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.173	380,364.200	
	UMICORE	7,660	56.000	428,960.000	
	AIR LIQUIDE	27,762	92.870	2,578,256.940	
	AIRBUS GROUP SE	48,107	53.030	2,551,114.210	
	AXA	152,004	20.515	3,118,362.060	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,818	19.565	974,689.170	
	ADIDAS AG	15,210	155.550	2,365,915.500	
	ASSICURAZIONI GENERALI	96,611	11.360	1,097,500.960	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	53,488	13.650	730,111.200	
	DANONE	46,350	64.870	3,006,724.500	
	SAFRAN SA	25,619	63.830	1,635,260.770	
	INTESA SANPAOLO	1,009,721	1.971	1,990,160.090	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	1.861	209,297.360	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,830	77.660	2,005,957.800	
	ACCOR SA	14,860	33.425	496,695.500	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	32.500	245,797.500	
	BOUYGUES	17,362	29.520	512,526.240	
	BNP PARIBAS	83,715	48.550	4,064,363.250	
	RELX NV	80,368	15.070	1,211,145.760	
	THALES SA	8,128	82.170	667,877.760	
CAP GEMINI SA	13,109	82.950	1,087,391.550		
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	42.430	180,921.520		
CHRISTIAN DIOR SE	4,641	168.800	783,400.800		

INGENICO GROUP	4,334	71.500	309,881.000	
UNICREDIT SPA	417,621	2.094	874,498.370	
NATIXIS	70,166	4.415	309,782.890	
KONINKLIJKE DSM NV	14,459	59.400	858,864.600	
COMMERZBANK AG	87,317	5.754	502,422.010	
EIFFAGE	4,777	66.540	317,861.580	
FRESENIUS SE & CO KGAA	33,358	70.350	2,346,735.300	
UNITED INTERNET	9,882	38.005	375,565.410	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	40.520	224,723.920	
PUBLICIS GROUPE	15,068	65.390	985,296.520	
MAN SE	3,396	92.440	313,926.240	
IBERDROLA SA	450,146	5.871	2,642,807.160	
ENI SPA	199,298	13.340	2,658,635.320	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.955	311,393.730	
KBC GROUPE	20,385	52.970	1,079,793.450	
HANNOVER RUECK SE	5,050	95.150	480,507.500	
WARTSILA OYJ	11,645	40.750	474,533.750	
L'OREAL	20,609	164.050	3,380,906.450	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,052	164.100	3,618,733.200	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	22.175	212,880.000	
GEA GROUP AG	14,635	48.450	709,065.750	
BOLLORE	71,347	3.057	218,107.770	
MEDIOBANCA SPA	42,404	6.170	261,632.680	
MICHELIN(CGDE)-B	14,633	97.660	1,429,058.780	
CONTINENTAL AG	9,039	180.400	1,630,635.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	77,665	27.600	2,143,554.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	30.610	287,703.390	
AXEL SPRINGER SE	3,067	44.565	136,680.850	
OMV AG	13,397	26.525	355,355.420	
PERNOD-RICARD	17,390	105.200	1,829,428.000	
PEUGEOT SA	40,058	13.100	524,759.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,066	47.105	568,368.930	
RENAULT SA	15,758	76.270	1,201,862.660	
REPSOL SA	88,869	12.590	1,118,860.710	
REMY COINTREAU	1,860	74.980	139,462.800	
MERCK KGAA	10,600	96.770	1,025,762.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	38,991	38.130	1,486,726.830	
SAIPEM	465,751	0.400	186,300.400	
RWE AG	39,183	13.595	532,692.880	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,915	40.900	569,123.500	
SOCIETE GENERALE-A	62,440	33.040	2,063,017.600	
VINCI S.A.	40,691	65.170	2,651,832.470	
SODEXO	7,368	103.350	761,482.800	
SOLVAY SA	5,991	101.900	610,482.900	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,818	62.000	2,716,716.000	
VIVENDI SA	90,331	18.195	1,643,572.540	

SAP SE	78,072	80.410	6,277,769.520	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	8,870	58.240	516,588.800	
TELEFONICA S.A	351,801	8.815	3,101,125.810	
TOTAL SA	182,530	43.340	7,910,850.200	
VALEO	19,670	52.570	1,034,051.900	
E.ON SE	160,581	6.583	1,057,104.720	
VOEST-ALPINE AG	9,875	31.620	312,247.500	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	21.485	328,333.770	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	102.600	883,796.400	
METRO AG	15,629	27.060	422,920.740	
SIEMENS AG-REG	60,636	105.000	6,366,780.000	
UPM-KYMMENE OYJ	41,826	19.070	797,621.820	
ING GROEP NV-CVA	335,379	11.235	3,767,983.060	
BAYER AG	65,915	90.450	5,962,011.750	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	8.240	348,576.720	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,356	119.350	1,713,388.600	
DAIMLER AG	76,017	64.410	4,896,254.970	
BASF SE	72,364	78.330	5,668,272.120	
BEIERSDORF AG	8,300	81.790	678,857.000	
HOCHTIEF AG	1,707	121.350	207,144.450	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	84.580	931,141.220	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,988	74.880	1,346,941.440	
ORANGE	161,525	13.850	2,237,121.250	
SAMPO OYJ-A SHS	36,399	40.730	1,482,531.270	
RANDSTAD HOLDINGS	9,998	42.670	426,614.660	
ALLIANZ SE	36,015	137.100	4,937,656.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.814	537,738.510	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	104,690	20.050	2,099,034.500	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	38.970	685,949.940	
HERMES INTL	2,185	367.450	802,878.250	
ENDESA S.A.	27,930	18.500	516,705.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	9.814	193,806.870	
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	27.005	629,864.620	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,558	168.700	2,287,234.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	148,840	5.707	849,429.880	
SOCIETE BIC SA	2,478	128.900	319,414.200	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,673	75.450	805,277.850	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,897	26.555	422,144.830	
HEINEKEN NV	19,424	78.730	1,529,251.520	
AKZO NOBEL	18,209	60.740	1,106,014.660	
ASML HOLDING NV	29,103	93.600	2,724,040.800	
AEGON NV	144,321	3.704	534,564.980	
BANKINTER S.A.	57,960	6.448	373,726.080	
VOLKSWAGEN AG	2,794	132.500	370,205.000	

VOLKSWAGEN AG PFD	14,987	120.300	1,802,936.100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	508,070	5.628	2,859,417.960	
KERING	6,178	190.950	1,179,689.100	
CNP ASSURANCES	13,987	15.060	210,644.220	
FORTUM OYJ	37,132	14.380	533,958.160	
AGEAS	16,658	33.255	553,961.790	
UCB SA	10,367	68.100	705,992.700	
THYSSENKRUPP AG	29,215	22.145	646,966.170	
UNILEVER NV-CVA	129,092	40.765	5,262,435.380	
CARREFOUR SA	43,732	23.230	1,015,894.360	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	17.540	508,835.400	
ATOS SE	7,050	95.560	673,698.000	
NOKIA OYJ	471,518	4.872	2,297,235.690	
TUI AG	19,196	11.930	229,008.280	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,794	26.280	1,886,746.320	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	35.630	879,027.730	
SANOFI	93,854	69.280	6,502,205.120	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	7.299	430,713.990	
ELISA OYJ	9,517	31.900	303,592.300	
BANCO SANTANDER SA	1,139,846	3.983	4,540,006.610	
METSO OYJ	8,585	26.170	224,669.450	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.700	646,945.200	
QIAGEN N.V.	19,737	24.375	481,089.370	
LINDE AG	15,184	148.100	2,248,750.400	
DEUTSCHE BANK AG-REG	112,859	12.305	1,388,729.990	
BMW VORZUG	4,116	66.510	273,755.160	
K & S	14,982	17.300	259,188.600	
ENEL SPA	621,624	3.794	2,358,441.450	
COLRUYT NV	4,673	49.090	229,397.570	
VOPAK (KON.)	5,364	46.745	250,740.180	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	254,691	14.520	3,698,113.320	
BANCO POPULAR ESPANOL	277,768	1.110	308,322.480	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	34,431	10.080	347,064.480	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	89,582	15.850	1,419,874.700	
KONINKLIJKE KPN NV	276,563	2.838	784,885.790	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.508	138,723.930	
EURAZEO	4,063	51.400	208,838.200	
BANCO SABADELL	428,014	1.141	488,363.970	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	78.030	453,666.420	
FRAPORT AG	3,149	49.830	156,914.670	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	71.590	573,722.260	
INDITEX	89,467	32.345	2,893,810.110	
JC DECAUX SA	6,058	27.945	169,290.810	
ANDRITZ AG	6,265	48.100	301,346.500	
MAPFRE SA	84,474	2.566	216,760.280	

ESSILOR INTL	16,004	111.800	1,789,247.200	
SNAM SPA	186,129	4.670	869,222.430	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	9.255	792,089.170	
ENAGAS	18,095	25.515	461,693.920	
WENDEL	2,220	104.850	232,767.000	
TENARIS SA	38,237	12.880	492,492.560	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	2.200	164,898.800	
TELECOM ITALIA SPA	804,591	0.722	580,914.700	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.596	296,567.210	
ATLANTIA SPA	33,870	21.880	741,075.600	
ILIAD SA	2,102	183.700	386,137.400	
PROXIMUS	13,498	25.995	350,880.510	
SES FDR	30,439	21.100	642,262.900	
TERNA SPA	117,108	4.342	508,482.930	
GRIFOLS SA	25,309	19.100	483,401.900	
FERROVIAL SA	40,995	17.870	732,580.650	
LANXESS AG	6,856	56.890	390,037.840	
EXOR SPA	9,441	37.170	350,921.970	
NESTE OYJ	10,692	39.460	421,906.320	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	14.225	137,143.220	
KONE OYJ	27,018	44.510	1,202,571.180	
ENGIE	120,700	13.255	1,599,878.500	
ALSTOM	12,046	23.330	281,033.180	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.135	227,449.170	
ELECTRICITE DE FRANCE	20,751	10.060	208,755.060	
DEUTSCHE WOHNEN AG	26,714	29.980	800,885.720	
ARKEMA SA	5,658	82.590	467,294.220	
LEGRAND SA	21,957	51.160	1,123,320.120	
ADP	2,313	87.250	201,809.250	
ORION OYJ	8,051	34.690	279,289.190	
RTL GROUP SA	3,446	72.450	249,662.700	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	12.515	474,581.310	
SYMRISE AG	10,237	63.540	650,458.980	
SCOR SE	13,875	28.130	390,303.750	
REXEL SA	23,245	12.580	292,422.100	
PRYSMIAN SPA	14,925	23.540	351,334.500	
CAIXABANK	226,091	2.342	529,505.120	
BUREAU VERITAS SA	21,480	18.700	401,676.000	
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	8.570	322,626.220	
SUEZ SA	25,406	13.735	348,951.410	
ENGIE	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT GROUP SA	36,223	43.355	1,570,448.160	
TNT EXPRESS NV W/I	44,157	8.447	372,994.170	
BRENNTAG AG	12,331	49.735	613,282.280	

	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	68,448	4.159	284,675.230	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	5.530	267,126.650	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	29.900	346,092.500	
	EDENRED	18,682	19.890	371,584.980	
	BANKIA SA	370,638	0.760	281,684.880	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.534	217,485.890	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	50.420	263,091.560	
	OSRAM LICHT AG	7,017	56.200	394,355.400	
	GEMALTO	6,103	55.900	341,157.700	
	VONOVIA SE	39,169	31.665	1,240,286.380	
	OCI NV	8,363	12.675	106,001.020	
	FERRARI NV	10,363	48.080	498,253.040	
	DEUTSCHE BOERSE AG	15,463	71.190	1,100,810.970	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	6.710	527,707.950	
	SFR GROUP SA	8,774	23.820	208,996.680	
	NN GROUP NV	25,750	27.325	703,618.750	
	ZALANDO SE	6,674	37.610	251,009.140	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	5.890	412,947.900	
	AENA SA	5,256	126.800	666,460.800	
	ABN AMRO GROUP NV	19,363	18.520	358,602.760	
	ALTICE NV-A	38,525	16.680	642,597.000	
	COVESTRO AG	5,966	52.410	312,678.060	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,561	115.850	7,595,241.850	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.085	243,491.270	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA-RTS	508,068	0.086	43,693.840	
	SCHAEFFLER AG	12,644	13.870	175,372.280	
	LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	47.455	669,352.770	
	UNIPER SE	16,058	10.905	175,112.490	
	ユーロ 小計	19,172,391		261,372,221.230 (29,908,823,276)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	17.180	5,325,800.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	31.950	3,567,537.000	
	CLP HOLDINGS LTD	150,500	77.350	11,641,175.000	
	PCCW LTD	331,000	4.750	1,572,250.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	2,000	10.740	21,480.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	3.850	2,049,740.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	63.150	3,094,350.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,640	206.800	19,571,552.000	
	MTR CORP	118,500	42.100	4,988,850.000	

HANG SENG BANK LTD	62,600	139.600	8,738,960.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	94,222	45.500	4,287,101.000	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	112,500	71.450	8,038,125.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	55.600	6,658,100.000	
HONG KONG & CHINA GAS	616,588	14.680	9,051,511.840	
HYSAN DEVELOPMENT CO	8,000	36.900	295,200.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	32.000	6,048,000.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	384,500	25.950	9,977,775.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	12,000	30.200	362,400.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	9.780	4,315,581.480	
SINO LAND CO	255,400	13.380	3,417,252.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	124,000	114.500	14,198,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	83.050	3,529,625.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	30.250	3,433,375.000	
WHEELOCK & CO LTD	76,000	44.750	3,401,000.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	12.020	1,495,288.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	113,200	13.640	1,544,048.000	
AIA GROUP LTD	943,627	53.100	50,106,593.700	
HKT TRUST / HKT LTD	214,000	10.960	2,345,440.000	
SANDS CHINA LTD	198,000	35.200	6,969,600.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	22.450	2,339,290.000	
WH GROUP LTD	530,500	6.800	3,607,400.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	221,332	95.400	21,115,072.800	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	221,832	55.100	12,222,943.200	
香港・ドル 小計	7,022,617		239,330,416.020 (3,197,454,359)	
合計	94,144,465		240,970,135,633 (240,970,135,633)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	758,827.270	
		GOODMAN GROUP	143,627.000	999,643.920	
		GPT GROUP	144,955.000	695,784.000	
		LENLEASE GROUP	51,144.000	728,802.000	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	630,017.790	
		SCENTRE GROUP	428,482.000	1,936,738.640	
		STOCKLAND	193,279.000	883,285.030	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	816,737.860	
	WESTFIELD CORP	159,515.000	1,488,274.950		
オーストラリア・ドル 小計		1,775,157.000	8,938,111.460 (700,390,414)		

	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	500,006.940	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	333,380.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	421,880.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	327,530.500	
	シンガポール・ドル 小計		802,906.000	1,582,797.440 (118,978,883)	
投資信託受益証券 合計			2,578,063	819,369,297 (819,369,297)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	488,821.590	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,587.000	569,427.040	
		AMERICAN TOWER CORP	34,415.000	3,749,170.100	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	776,055.280	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,002.000	1,836,013.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,365.000	1,575,795.600	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17,297.000	452,143.580	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	482,813.700	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,844.000	2,389,116.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,787.000	1,078,746.240	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	728,913.900	
		EQUINIX INC	5,560.000	1,961,568.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,299.000	1,772,589.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,283.000	1,110,856.410	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,980.000	747,701.600	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	827,852.200	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	48,619.000	1,249,994.490	
		HCP INC	37,800.000	1,351,350.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	898,355.700	
		IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	649,037.850	
		KIMCO REALTY	32,980.000	923,440.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	447,787.560	
		MID AMERICA	6,099.000	524,148.060	
		PROLOGIS INC	41,891.000	2,082,820.520	
		PUBLIC STORAGE	11,882.000	2,491,893.040	
		REALTY INCOME CORP	20,047.000	1,219,058.070	
		REGENCY CENTERS CORP	7,365.000	543,537.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	25,048.000	4,898,136.400	
		SL GREEN	7,722.000	807,875.640	
		THE MACERICH COMPANY	10,631.000	808,487.550	
UDR INC	21,797.000	733,687.020			

	VENTAS INC	27,031.000	1,792,425.610	
	VEREIT INC	59,654.000	563,730.300	
	VORNADO REALTY TRUST	13,819.000	1,316,259.750	
	WELLTOWER INC	28,765.000	1,977,306.100	
	WEYERHAEUSER CO	63,671.000	1,958,519.960	
アメリカ・ドル 小計		867,349.000	47,785,435.120 (4,952,482,496)	
イギリス・債券	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	423,679.540	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	325,904.960	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	213,153.330	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	620,928.420	
	SEGRO PLC	50,928.000	221,434.940	
イギリス・債券 小計		319,358.000	1,805,101.190 (229,428,361)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	236,885.920	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	408,918.160	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,670.000	467,514.000	
カナダ・ドル 小計		40,182.000	1,113,318.080 (87,117,139)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	184,722.120	
	GECINA SA	3,212.000	422,538.600	
	KLEPIERRE	17,042.000	650,152.300	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,773.000	1,705,784.850	
ユーロ 小計		30,370.000	2,963,197.870 (339,078,732)	
香港・ドル	LINK REIT	181,000.000	9,955,000.000	
香港・ドル 小計		181,000.000	9,955,000.000 (132,998,800)	
投資証券 合計		1,438,259	5,741,105,528 (5,741,105,528)	
合計			6,560,474,825 (6,560,474,825)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 591銘柄	61.82%	-%	-%	65.36%
	投資証券 36銘柄	-%	-%	1.95%	
イギリス・ポンド	株式 107銘柄	7.30%	-%	-%	7.57%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.09%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.22%	-%	-%	0.23%
オーストラリア・ドル	株式 60銘柄	2.69%	-%	-%	3.04%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.28%	-%	
カナダ・ドル	株式 91銘柄	3.80%	-%	-%	3.93%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.03%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.45%	-%	-%	0.51%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	3.53%	-%	-%	3.62%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.12%	-%	-%	1.14%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.69%	-%	-%	0.71%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.07%	-%	-%	0.07%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.25%	-%	-%	0.26%
ユーロ	株式 233銘柄	11.79%	-%	-%	12.22%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 33銘柄	1.26%	-%	-%	1.35%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		4,622,897,664
コール・ローン		292,048,366
国債証券		248,004,631,992
派生商品評価勘定		3,962,181
未収利息		2,264,031,939
前払費用		79,137,813
流動資産合計		255,266,709,955
資産合計		255,266,709,955
負債の部		
流動負債		
未払解約金		663,989,000
流動負債合計		663,989,000
負債合計		663,989,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	153,207,422,796
剰余金		
剰余金又は欠損金()		101,395,298,159
元本等合計		254,602,720,955
純資産合計		254,602,720,955
負債純資産合計		255,266,709,955

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10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	160,412,378,404円 27,602,214,764円 34,807,170,372円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	4,923,309,794円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	17,010,648円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	50,032,973円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	71,577,949円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	40,389,489円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	43,876,816円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	34,916,201円
たわらノーロード 先進国債券	425,744,276円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,782,952,941円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	445,944,676円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	1,429,659,466円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,455,334,787円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	353,883,541円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	730,899,335円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	531,495,396円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27,312,327円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	581,807,796円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	8,340,436円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	12,331,966円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	22,428,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	39,976,566円
クルーズコントロール	2,024,754,282円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	39,881,567円
DIAM DC バランス・F(成長型)	51,403,963円
クルーズコントロール<DC年金>	646,905円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	13,148,246円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	33,073,415円
ダイナミック・ナビゲーション	333,384円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,651,641,769円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	7,895,832,420円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,286,933,742円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	4,756,637,427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)	281,150,448円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	127,409,910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)	1,449,457,258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)	843,885,824円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	89,083,952円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	162,342,227円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	41,481,518円

D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	17,272,003円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	4,610,042,461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)	1,083,797,795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)	4,830,307,899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)	2,845,837,057円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	4,634,610,481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)	977,493,356円
D I A Mグローバル・アセット・バラ ンスV A 2 (適格機関投資家限定)	3,036,652,050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)	4,400,424,719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)	16,488,444,970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)	64,131,288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)	2,401,530,036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)	11,168,532,699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)	16,608,296,167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)	21,048,962,914円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関 投資家限定)	27,742,137円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関 投資家限定)	9,926,790円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関 投資家限定)	1,425,740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)	18,889,807,936円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格 機関投資家限定)	128,259,731円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関 投資家限定)	154,605,081円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関 投資家限定)	237,762円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関 投資家限定)	150,698円
計	153,207,422,796円
2 . 受益権の総数	153,207,422,796口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	1,779,748,901	
合計	1,779,748,901	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月23日から平成28年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在			
	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	710,939,851	-	706,977,670	3,962,181
アメリカ・ドル	368,553,984	-	367,679,240	874,744
イギリス・ポンド	58,094,079	-	57,571,770	522,309
ユーロ	284,291,788	-	281,726,660	2,565,128
合計	710,939,851	-	706,977,670	3,962,181

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.6618円
(1万口当たり純資産額)	(16,618円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.625 04/30/18	10,500,000.000	10,465,455.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	13,500,000.000	13,484,610.000	
		US T N/B 0.75 04/15/18	3,000,000.000	2,995,650.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	19,000,000.000	18,988,790.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	2,700,000.000	2,701,998.000	
		US T N/B 0.875 07/15/18	10,000,000.000	10,001,900.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	6,973,750.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	10,000,000.000	10,024,200.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	3,500,000.000	3,497,375.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	4,995,300.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,487,260.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	11,041,250.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,853,136.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	7,043,960.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	2,000,000.000	2,018,120.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	13,124,410.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,353,613.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	12,098,400.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	13,500,000.000	13,605,435.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	14,000,000.000	13,842,500.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	35,500,000.000	35,824,470.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	12,700,000.000	12,846,812.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,207,060.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	10,500,000.000	10,385,970.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	15,236,700.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	7,000,000.000	6,917,960.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	15,000,000.000	15,144,600.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,559,700.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	5,071,050.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	3,000,000.000	3,053,430.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	15,000,000.000	15,254,850.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	15,000,000.000	15,194,400.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	5,077,700.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,124,680.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,185,580.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,279,290.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	7,000,000.000	7,159,670.000	
US T N/B 1.875 09/30/17	18,000,000.000	18,199,620.000			
US T N/B 2.0 02/15/22	2,500,000.000	2,579,475.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,781,200.000			

US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,725,625.000	
US T N/B 2.0 02/28/21	11,000,000.000	11,340,230.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,375,000.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	12,000,000.000	12,268,080.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,182,760.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,729,056.000	
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,821,510.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,286,800.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	10,849,440.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,853,210.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	21,000,000.000	21,790,650.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,104,280.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,375,700.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,700,000.000	13,184,124.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,293,680.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,980,585.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,000,000.000	1,897,340.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,500,000.000	10,963,470.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	13,000,000.000	13,554,450.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	10,000,000.000	10,165,600.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	15,000,000.000	15,388,350.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,377,663.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,683,211.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,000,000.000	7,008,750.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	7,000,000.000	7,001,610.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,566,640.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	5,000,000.000	5,005,850.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,489,360.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,382,915.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,332,760.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	12,000,000.000	12,501,960.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	7,000,000.000	7,557,200.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,890,000.000	4,113,363.800	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,785,900.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,590,434.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,301,900.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	6,070,000.000	6,558,877.800	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,400,000.000	6,908,480.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,512,231.700	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,500,000.000	7,187,050.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,800,000.000	7,520,324.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	7,200,000.000	7,961,616.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	2,035,962.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	5,600,000.000	6,337,184.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,713,440.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,648,720.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,100,000.000	6,907,274.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,000,000.000	3,393,030.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,690,000.000	7,923,970.500	

US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,281,240.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	14,496,440.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,000,000.000	2,412,180.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	15,148,420.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	19,485,000.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	6,047,415.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	6,500,000.000	8,039,135.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,366,950.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	6,433,752.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,480,000.000	4,350,243.600	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	7,206,909.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,390,240.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,570,000.000	3,263,488.800	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	12,700,200.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,178,462.400	
US T N/B 4.25 11/15/17	9,000,000.000	9,338,850.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,680,620.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,450,000.000	1,975,161.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,799,170.900	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,450,000.000	3,350,938.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,256,554.200	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,800,000.000	3,851,736.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,980,878.900	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,200,000.000	3,039,938.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	5,203,680.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	4,311,780.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	2,093,491.400	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	2,045,730.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,731,870.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,493,054.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,381,120.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	2,004,940.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	2,126,250.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,306,790.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,965,420.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,795,120.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,742,320.000	
アメリカ・ドル 小計	993,110,000.000 (102,925,920,400)	1,048,394,434.500 (108,655,599,192)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 1.25 07/22/18	3,000,000.000	3,056,700.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	3,200,000.000	3,350,432.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,200,000.000	1,257,240.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,700,000.000	4,900,972.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,535,290.000	

UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,500,000.000	1,594,725.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	4,300,000.000	4,706,952.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,500,000.000	3,880,835.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,200,000.000	1,595,880.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,800,000.000	3,223,248.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,600,000.000	4,828,680.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,000,000.000	5,633,600.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,940,000.000	4,989,474.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,600,000.000	4,122,300.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,428,360.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	4,400,000.000	4,995,760.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,200,000.000	3,723,776.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,400,000.000	4,275,120.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,737,000.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,550,000.000	5,156,375.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,150,000.000	4,421,340.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,250,000.000	3,368,700.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,160,000.000	2,876,256.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,500,000.000	3,792,750.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,700,000.000	4,342,950.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,457,521.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,490,000.000	4,455,357.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,400,000.000	2,651,040.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,300,000.000	4,856,940.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,950,000.000	4,724,720.000	

	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.000	7,495,150.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,600,000.000	3,773,640.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,500,000.000	3,962,250.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	1,800,000.000	1,922,400.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,880,000.000	3,852,864.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,249,385.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	2,000,000.000	2,703,800.000	
	イギリス・ポンド 小計	105,590,000.000 (13,420,489,000)	138,899,782.000 (17,654,162,292)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,815,580.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,500,000.000	4,878,315.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,340,840.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,397,240.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,000,000.000	990,400.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	4,078,347.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	895,905.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,546,020.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,200,000.000	3,333,216.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,000,000.000	4,338,960.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	2,072,368.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	943,407.000	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	1,500,000.000	1,545,945.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	1,881,429.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	4,100,000.000	4,818,812.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,253,096.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,900,000.000	4,810,416.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	5,200,000.000	5,447,520.000	

	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,640,770.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.000	3,625,320.000	
オーストラリア・ドル 小計		56,450,000.000 (4,423,422,000)	62,653,906.000 (4,909,560,074)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,666,250.000	
	CANADA 0.5 11/01/18	4,600,000.000	4,591,582.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,406,648.000	
	CANADA 1.25 02/01/18	2,000,000.000	2,017,080.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,600,000.000	1,614,512.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,450,000.000	2,481,188.500	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,869,246.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,748,705.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,000,000.000	1,027,810.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,971,522.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,500,000.000	2,775,650.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,317,339.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	800,000.000	980,032.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	900,000.000	1,175,796.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	3,200,000.000	3,570,464.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,300,000.000	4,741,180.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,550,000.000	3,507,525.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	4,006,138.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,350,000.000	3,354,907.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	5,500,000.000	5,827,470.000	
CANADA 5.0 06/01/37	2,060,000.000	3,193,885.800		
CANADA 5.75 06/01/29	1,800,000.000	2,689,074.000		
CANADA 5.75 06/01/33	2,000,000.000	3,177,580.000		
カナダ・ドル 小計		55,910,000.000 (4,374,957,500)	64,711,584.300 (5,063,681,471)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	1,080,000.000	1,073,412.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	821,200.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	200,000.000	215,956.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	610,000.000	655,445.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	432,200.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	495,544.200	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	879,255.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,738,400.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,438,490.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	551,520.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,138,000.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,550,000.000	1,639,683.000	
	シンガポール・ドル 小計		10,330,000.000 (776,506,100)	11,079,105.200 (832,816,338)
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	3,000,000.000	3,231,480.000	

	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,867,880.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,800,000.000	14,343,490.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,900,000.000	10,198,890.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	15,370,000.000	18,718,200.800	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	12,300,000.000	13,780,059.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	14,051,643.200	
スウェーデン・クローナ	小計	70,480,000.000 (826,730,400)	85,191,643.000 (999,297,972)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	2,000,000.000	2,035,220.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,500,000.000	9,478,605.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	14,470,000.000	16,590,723.200	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	15,228,200.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	9,780,000.000	10,273,890.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	13,900,000.000	15,882,140.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	18,000,000.000	32,759,820.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	3,700,000.000	5,820,359.000	
デンマーク・クローネ	小計	83,350,000.000 (1,281,923,000)	108,068,957.200 (1,662,100,562)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	2,000,000.000	2,042,220.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,965,794.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	8,057,064.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	10,400,000.000	11,782,784.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	9,100,000.000	10,262,980.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	7,560,000.000	8,298,234.000	
ノルウェー・クローネ	小計	40,460,000.000 (511,819,000)	44,409,076.000 (561,774,811)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,935,200.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,132,900.000	
	POLAND 10/25/18	2,000,000.000	1,930,200.000	
	POLAND 2.5 07/25/18	1,500,000.000	1,521,750.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,004,700.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,180,520.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,404,145.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	7,000,000.000	7,231,000.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,335,755.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	1,000,000.000	1,037,650.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,723,001.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,965,456.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,307,544.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,688,000.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,246,720.000	
ポーランド・ズロチ	小計	51,470,000.000 (1,374,763,700)	54,644,541.000 (1,459,555,690)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,976,200.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,214,815.000	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,220,416.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,486,295.100	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	3,700,000.000	3,767,562.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,149,621.000	

	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	802,072.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,833,479.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,673,635.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,485,913.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	4,300,000.000	4,389,526.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,823,225.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,217,636.300	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,881,126.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,578,375.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,786,768.000	
マレーシア・リンギット 小計		41,430,000.000 (1,024,149,600)	42,286,665.500 (1,045,326,371)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	17,000,000.000	23,593,620.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	41,000,000.000	51,753,480.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	41,500,000.000	41,181,280.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,904,500.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	10,000,000.000	10,333,600.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	39,254,760.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	11,055,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,248,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	22,967,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,908,880.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	33,000,000.000	34,019,040.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	32,353,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,729,700.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	36,974,940.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	19,000,000.000	23,331,810.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	15,000,000.000	15,931,500.000	
メキシコ・ペソ 小計		341,500,000.000 (1,874,835,000)	382,541,910.000 (2,100,155,086)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	200,000.000	204,962.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	800,000.000	841,592.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,700,000.000	1,873,366.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,422,037.500	

AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,596,000.000	
AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,497,118.000	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,161,495.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	970,000.000	1,494,857.300	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,841,355.000	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,600,000.000	3,101,800.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,600,000.000	1,954,400.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	570,000.000	1,098,110.700	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,500,000.000	2,913,750.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,800,000.000	2,962,800.000	
AUSTRIA 4.35 03/15/19	2,300,000.000	2,577,242.000	
AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,700,000.000	1,812,676.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,500,000.000	2,175,870.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,897,488.500	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,700,000.000	2,860,353.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,400,000.000	1,497,706.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,000,000.000	1,048,540.000	
BELGIUM 1.25 06/22/18	2,000,000.000	2,064,900.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	986,958.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	900,000.000	1,068,246.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	300,000.000	358,920.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	2,000,000.000	2,337,120.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,135,600.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,167,687.500	
BELGIUM 3.0 09/28/19	2,100,000.000	2,323,713.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,500,000.000	2,477,355.000	
BELGIUM 3.75 09/28/20	3,000,000.000	3,511,350.000	
BELGIUM 4.0 03/28/18	1,200,000.000	1,281,864.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,950,000.000	2,173,957.500	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,300,000.000	2,858,601.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,400,000.000	2,096,948.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,500,000.000	4,284,000.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,653,379.500	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,600,000.000	3,317,236.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,258,736.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,000,000.000	5,200,500.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,750,000.000	4,352,480.000	
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,034,720.000	
BUNDESOBL 0.5 02/23/18	3,300,000.000	3,353,361.000	
BUNDESOBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,192,535.000	
BUNDESOBL 0.5 10/13/17	4,100,000.000	4,148,749.000	
BUNDESOBL 04/09/21	3,200,000.000	3,279,424.000	
BUNDESOBL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,860,948.000	
BUNDESSCHAT 06/15/18	800,000.000	809,064.000	
BUNDESSCHAT 12/15/17	2,000,000.000	2,016,020.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,900,000.000	4,128,189.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,200,000.000	4,411,932.000	

DEUTSCHLAND 08/15/26	1,300,000.000	1,294,033.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,858,284.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,519,712.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,000,000.000	1,121,980.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,275,760.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	3,800,000.000	4,319,916.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,791,782.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,730,280.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,500,000.000	3,945,795.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	3,300,000.000	3,732,960.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,100,000.000	3,607,315.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	2,700,000.000	3,007,557.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,500,000.000	3,982,055.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,700,000.000	3,057,588.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,800,000.000	4,129,832.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,780,000.000	4,158,435.200	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	4,500,000.000	5,115,465.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	7,700,000.000	8,686,216.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,800,000.000	4,493,994.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,350,000.000	3,833,672.500	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	5,900,000.000	6,577,792.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	4,900,000.000	5,388,432.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,900,000.000	4,127,448.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,500,000.000	5,912,270.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	5,200,000.000	5,645,900.000	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,200,000.000	3,961,518.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,600,000.000	2,480,320.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,100,000.000	5,467,222.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,500,000.000	4,843,350.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,700,000.000	4,715,334.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,360,000.000	3,846,729.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,400,000.000	2,076,466.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,500,000.000	2,717,640.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	2,350,000.000	3,994,412.500	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	517,230.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	700,000.000	722,344.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	469,687.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	321,030.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	400,000.000	413,796.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,270,000.000	1,415,542.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	447,164.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	800,000.000	928,640.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	952,228.200	
FINLAND 2.75 07/04/28	780,000.000	1,006,800.600	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,130,000.000	1,286,505.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,000,000.000	1,180,150.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,010,000.000	1,363,651.500	
FINLAND 4.375 07/04/19	810,000.000	921,172.500	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	2,200,000.000	3,467,354.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,300,000.000	4,447,619.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,249,676.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	4,300,000.000	4,413,993.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,770,992.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	1,200,000.000	1,241,364.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	4,700,000.000	5,052,312.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,500,000.000	1,594,650.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,200,000.000	3,590,464.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,970,636.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	150,000.000	166,392.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	6,460,000.000	7,369,826.400	

FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,600,000.000	5,417,374.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	5,419,288.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,800,000.000	6,038,448.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,700,000.000	10,869,820.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,940,000.000	7,480,301.400	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,282,779.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,450,000.000	5,226,370.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,800,000.000	9,229,272.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,486,651.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,940,000.000	9,105,974.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	7,200,000.000	8,575,632.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,470,210.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	6,200,000.000	6,644,106.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,600,000.000	4,717,180.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	3,459,825.600	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,010,000.000	6,456,220.300	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	7,600,000.000	8,540,044.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	4,500,000.000	4,730,985.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,589,310.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,600,000.000	8,672,466.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,600,000.000	8,095,218.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,100,000.000	6,909,484.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,800,000.000	7,786,128.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,600,000.000	8,184,320.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,495,931.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	5,363,400.000	
IRISH 0.8 03/15/22	800,000.000	844,512.000	
IRISH 1.0 05/15/26	700,000.000	733,222.000	
IRISH 2.0 02/18/45	860,000.000	992,947.400	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,325,049.000	
IRISH 3.4 03/18/24	1,230,000.000	1,521,768.300	
IRISH 3.9 03/20/23	800,000.000	1,002,760.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,130,000.000	1,278,425.500	
IRISH 4.5 04/18/20	1,750,000.000	2,055,777.500	
IRISH 4.5 10/18/18	1,540,000.000	1,695,078.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,400,000.000	1,706,320.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,600,000.000	2,264,832.000	

IRISH 5.5 10/18/17	300,000.000	318,414.000	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,133,540.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	4,400,000.000	4,482,280.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	3,000,000.000	3,036,300.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,061,600.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	500,000.000	521,750.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,561,700.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,530,750.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,100,000.000	3,047,362.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	3,200,000.000	3,392,672.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,000,000.000	1,086,500.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	500,000.000	513,300.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,427,760.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	550,000.000	577,115.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,300,000.000	3,867,072.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,100,000.000	3,767,771.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,100,000.000	2,259,390.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,801,798.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,654,890.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	4,500,000.000	5,226,300.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,282,223.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,750,000.000	6,211,575.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	5,051,200.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,281,810.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,200,000.000	5,926,960.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	7,174,400.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	10,500,000.000	11,134,725.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,151,600.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,750,040.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,627,997.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,601,520.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,100,000.000	3,838,730.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	6,200,000.000	6,708,896.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,100,000.000	6,438,750.000	

ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,722,900.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,230,000.000	4,335,919.700	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,538,200.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	6,200,000.000	7,670,020.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,430,000.000	5,787,706.400	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,800,000.000	5,506,580.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	4,458,000.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	5,142,570.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,700,000.000	6,674,940.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	5,000,000.000	6,417,750.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,215,500.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,470,000.000	3,807,999.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,700,000.000	7,245,050.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	4,000,000.000	6,028,000.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,200,000.000	3,407,580.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	2,400,000.000	3,734,400.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	1,150,000.000	1,182,487.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,500,000.000	2,551,800.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,200,000.000	1,241,400.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,300,000.000	1,326,806.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	3,500,000.000	3,585,050.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	2,060,000.000	2,148,456.400	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,400,000.000	2,736,432.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,500,000.000	2,920,050.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,789,165.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,316,757.800	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,750,000.000	2,702,787.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	3,380,000.000	3,983,668.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,270,000.000	2,621,282.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,500,000.000	3,149,500.000	

NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,270,000.000	3,922,333.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,150,000.000	3,590,715.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	2,879,982.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,463,881.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,000,000.000	3,190,800.000	
SPAIN 0.25 01/31/19	1,400,000.000	1,412,936.000	
SPAIN 0.25 04/30/18	800,000.000	806,000.000	
SPAIN 0.5 10/31/17	500,000.000	504,005.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,752,411.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	1,200,000.000	1,252,788.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,200,000.000	1,224,168.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,800,000.000	1,912,788.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	3,200,000.000	3,469,920.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,894,157.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,868,580.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,146,680.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	3,900,000.000	4,503,408.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,512,472.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	300,000.000	368,511.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	2,700,000.000	2,921,454.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	3,400,000.000	4,179,382.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,571,200.000	
SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,634,282.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,676,296.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	5,600,000.000	6,348,216.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,676,127.000	
SPAIN 4.5 01/31/18	5,700,000.000	6,052,488.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	4,700,000.000	5,317,345.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	3,600,000.000	4,737,816.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	2,300,000.000	3,523,094.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	3,200,000.000	4,163,008.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,466,979.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,400,000.000	3,748,560.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	3,148,640.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	2,000,000.000	3,295,760.000	
SPAIN 5.4 01/31/23	3,200,000.000	4,204,448.000	
SPAIN 5.5 04/30/21	4,200,000.000	5,235,342.000	
SPAIN 5.75 07/30/32	3,000,000.000	4,813,830.000	
SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,803,747.000	
SPAIN 5.9 07/30/26	2,800,000.000	4,062,156.000	
SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,387,760.000	
ユーロ 小計	720,360,000.000 (82,430,794,800)	891,386,039.900 (102,001,304,546)	

南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,598,750.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,551,807.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,404,872.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	19,660,000.000	18,538,397.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,472,560.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	4,000,000.000	3,842,960.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,838,330.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	7,000,000.000	7,011,060.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,079,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,900,061.300	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,180,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	15,619,090.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	2,845,620.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	3,000,000.000	2,833,710.000	
南アフリカ・ランド 小計	160,740,000.000 (1,160,542,800)	146,717,117.300 (1,059,297,587)		
国債証券 合計	216,406,853,300 (216,406,853,300)	248,004,631,992 (248,004,631,992)		
合計	216,406,853,300 (216,406,853,300)	248,004,631,992 (248,004,631,992)		

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 126銘柄	42.68%	43.81%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	6.93%	7.12%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	1.93%	1.98%
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	1.99%	2.04%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.33%	0.34%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.39%	0.40%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.65%	0.67%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.22%	0.23%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	0.57%	0.59%
マレーシア・リングgit	国債証券 16銘柄	0.41%	0.42%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.82%	0.85%
ユーロ	国債証券 253銘柄	40.06%	41.13%
南アフリカ・ランド	国債証券 14銘柄	0.42%	0.43%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		72,308,226
コール・ローン		72,617,518
投資信託受益証券		3,799,644,381
投資証券		29,332,846,273
未収入金		213,389
未収配当金		124,253,600
流動資産合計		33,401,883,387
資産合計		33,401,883,387
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		102,960
未払金		29,595,231
未払解約金		11,476,000
流動負債合計		41,174,191
負債合計		41,174,191
純資産の部		
元本等		
元本	1	32,289,268,109
剰余金		
剰余金又は欠損金()		1,071,441,087
元本等合計		33,360,709,196
純資産合計		33,360,709,196
負債純資産合計		33,401,883,387

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年10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	26,841,967,994円
同期中追加設定元本額	23,087,438,568円
同期中一部解約元本額	17,640,138,453円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM先進国REITインデックス ファンド<為替ヘッジなし>(ファン ドラップ)	90,931,487円
DIAM先進国REITインデックス ファンド<為替ヘッジあり>(ファン ドラップ)	27,194,088円
MITO ラップ型ファンド(安定 型)	10,655,424円
MITO ラップ型ファンド(中立 型)	26,796,979円
MITO ラップ型ファンド(積極 型)	58,355,776円
グローバル8資産ラップファンド(安 定型)	25,458,475円
グローバル8資産ラップファンド(中 立型)	23,584,286円
グローバル8資産ラップファンド(積 極型)	28,465,922円
たわらノーロード 先進国リート	1,069,507,663円
たわらノーロード 先進国リート< ラップ向け>	52,479,179円
マネックス資産設計ファンド<隔月分 配型>	25,666,170円
マネックス資産設計ファンド<育成型 >	550,156,660円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	93,463,454円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド(新興国10)	18,933,972円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド(新興国20)	51,803,674円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド(新興国30)	113,496,055円
投資のソムリエ	2,441,448,202円
投資のソムリエ<DC年金>	66,691,954円
DIAM 8資産バランスファンドN <DC年金>	61,217,576円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑 制型	8,663,431円
ダイナミック・ナビゲーション	267,265円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,447,767,054円
DIAM外国リートインデックスファ ンド<DC年金>	6,888,886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)	712,540,766円
D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	138,086,616円
D I A M世界アセットバランスファンドV A(適格機関投資家向け)	4,638,206,163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)	50,484,750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)	12,805,943,579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)	2,898,424,533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)	4,183,723,745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)	561,964,325円
計	32,289,268,109円
2 . 受益権の総数	32,289,268,109口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資信託受益証券	141,205,033	
投資証券	1,662,288,644	
合計	1,803,493,677	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年6月23日から平成28年10月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	34,300,860	-	34,197,900	102,960
アメリカ・ドル	34,300,860	-	34,197,900	102,960
合計	34,300,860	-	34,197,900	102,960

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.0332円
(1万口当たり純資産額)	(10,332円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	360 CAPITAL GROUP LTD	62,283.000	56,054.700	
		360 CAPITAL OFFICE FUND	11,233.000	24,712.600	
		ABACUS PROPERTY GROUP	85,920.000	240,576.000	
		ALE PROPERTY GROUP	53,840.000	235,280.800	
		ARENA REIT	71,480.000	145,104.400	
		ASPEN GROUP	31,613.000	35,406.560	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	17,970.000	123,274.200	
		BWP TRUST	140,890.000	433,941.200	
		CHARTER HALL GROUP	123,960.000	611,122.800	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	98,100.000	411,039.000	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	392,600.000	363,155.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	292,050.000	2,520,391.500	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	64,900.000	172,634.000	
		GDI PROPERTY GROUP	144,920.000	140,572.400	
		GENERATION HEALTHCARE REIT	39,700.000	75,430.000	
		GOODMAN GROUP	478,960.000	3,333,561.600	
		GPT GROUP	545,880.000	2,620,224.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	55,000.000	181,500.000	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	43,960.000	127,923.600	
		INDUSTRIA REIT	35,000.000	72,100.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	52,000.000	145,600.000	
		INVESTA OFFICE FUND	187,750.000	799,815.000	
		MIRVAC GROUP	1,127,150.000	2,400,829.500	
		NATIONAL STORAGE REIT	137,770.000	215,610.050	
		SCENTRE GROUP	1,616,900.000	7,308,388.000	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	214,220.000	464,857.400	
		STOCKLAND	722,770.000	3,303,058.900	
VICINITY CENTRES	993,390.000	3,000,037.800			
WESTFIELD CORP	580,700.000	5,417,931.000			
	オーストラリア・ドル 小計		8,422,909.000	34,980,132.010 (2,741,043,145)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	10,100.000	119,988.000	
	カナダ・ドル 小計		10,100.000	119,988.000 (9,389,061)	

シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	168,095.000	235,333.000	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	251,200.000	184,632.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	714,061.000	1,778,011.890	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	287,000.000	328,615.000	
	CACHE LOGISTICS TRUST	252,600.000	221,025.000	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	312,205.000	173,273.770	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	644,006.000	1,017,529.480	
	CAPITALAND MALL TRUST	822,064.000	1,742,775.680	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	215,080.000	348,429.600	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	200,300.000	278,417.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	262,000.000	158,510.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	149,000.000	202,640.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	170,000.000	357,000.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	173,180.000	238,988.400	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	323,000.000	316,540.000	
	KEPPEL DC REIT	197,000.000	241,325.000	
	KEPPEL REIT	536,000.000	597,640.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	558,000.000	214,830.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	539,000.000	827,365.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	565,000.000	618,675.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	356,020.000	617,694.700	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	472,020.000	502,701.300	
	QUE COMMERCIAL REIT	161,000.000	115,115.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	340,020.000	236,313.900	
	PARKWAY LIFE REIT	115,200.000	291,456.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	195,200.000	103,456.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	201,000.000	142,710.000	
	SPH REIT	220,000.000	221,100.000	
STARHILL GLOBAL REIT	393,000.000	324,225.000		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	775,091.000	1,321,530.150		
シンガポール・ドル 小計	10,567,342.000	13,957,857.870 (1,049,212,175)		

投資信託受益証券 合計			19,000,351	3,799,644,381 (3,799,644,381)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	23,830.000	814,271.100	
		AGREE REALTY CORP	7,000.000	323,750.000	
		ALEXANDER'S INC.	1,040.000	402,376.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	23,720.000	2,417,542.400	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,290.000	496,024.400	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	39,730.000	1,869,693.800	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	66,140.000	1,342,642.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	47,670.000	2,015,487.600	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	47,810.000	873,966.800	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	9,600.000	121,344.000	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	8,100.000	113,805.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	24,740.000	144,976.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,700.000	6,958,896.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	6,540.000	78,349.200	
		BOSTON PROPERTIES INC	46,690.000	5,950,173.600	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	52,460.000	788,998.400	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	78,820.000	2,060,354.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	26,610.000	2,044,180.200	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	25,130.000	664,185.900	
		CARETRUST REIT INC	17,940.000	242,728.200	
		CBL & ASSOCIATES	52,400.000	633,516.000	
		CEDAR REALTY TRUST INC	22,430.000	150,505.300	
		CHATHAM LODGING TRUST	11,960.000	215,280.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	17,800.000	402,458.000	
		CITY OFFICE REIT INC	5,980.000	72,716.800	
		COLONY STARWOOD HOMES	14,620.000	396,933.000	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	37,010.000	798,675.800	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4,070.000	88,278.300	
		CORESITE REALTY CORP	10,250.000	758,090.000	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28,380.000	773,355.000	
		CORRECTIONS CORP OF AMERICA	36,150.000	484,410.000	
COUSINS PROPERTIES INC	103,896.000	815,583.600			

CUBESMART	53,910.000	1,397,886.300	
CYRUSONE INC	22,690.000	1,069,606.600	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	27,500.000	1,246,025.000	
DDR CORP	93,650.000	1,528,368.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	61,710.000	560,943.900	
DIGITAL REALTY TRUST INC	44,630.000	4,084,537.600	
DOUGLAS EMMETT INC	43,140.000	1,518,528.000	
DUKE REALTY TRUST	106,680.000	2,704,338.000	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	22,780.000	896,848.600	
EAST GROUP	9,810.000	674,339.400	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	7,580.000	140,002.600	
EDUCATION REALTY TRUST INC	22,030.000	880,098.500	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	36,600.000	716,994.000	
EPR PROPERTIES	19,390.000	1,431,757.600	
EQUITY COMMONWEALTH	38,320.000	1,136,954.400	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,420.000	1,742,367.000	
EQUITY ONE INC	28,150.000	807,623.500	
EQUITY RESIDENTIAL	111,030.000	6,717,315.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,900.000	4,184,373.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	38,260.000	2,866,439.200	
FARMLAND PARTNERS INC	3,500.000	36,715.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,560.000	3,108,952.000	
FELCOR LODGING TR INC	38,100.000	244,221.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	35,220.000	917,481.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	17,380.000	150,858.400	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	65,950.000	1,403,416.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	17,540.000	349,572.200	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	32,900.000	378,021.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	58,710.000	1,889,287.800	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	177,430.000	4,561,725.300	
GEO GROUP INC	22,630.000	517,548.100	
GETTY REALTY CORP	7,840.000	173,185.600	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,920.000	120,269.600	
GLOBAL NET LEASE INC	50,100.000	378,756.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	21,890.000	446,993.800	

GRAMERCY PROPERTY TRSUT	128,730.000	1,127,674.800	
HCP INC	142,060.000	5,078,645.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	35,360.000	1,129,044.800	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	41,500.000	1,274,050.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	12,410.000	226,358.400	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	29,650.000	1,450,181.500	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	49,390.000	1,408,108.900	
HOST HOTELS & RESORTS INC	225,730.000	3,487,528.500	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	32,440.000	1,048,460.800	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	19,690.000	167,168.100	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	37,800.000	214,326.000	
IRON MOUNTAIN INC	74,470.000	2,508,894.300	
ISTAR INC	21,880.000	232,584.400	
KILROY REALTY CORP	28,070.000	1,908,760.000	
KIMCO REALTY	127,700.000	3,575,600.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	25,210.000	655,207.900	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	33,880.000	820,912.400	
LEXINGTON REALTY TRUST	64,510.000	627,682.300	
LIBERTY PROPERTY TRUST	44,700.000	1,718,268.000	
LIFE STORAGE INC	14,160.000	1,235,460.000	
LTC PROPERTIES INC	12,100.000	593,747.000	
MACK CALI	27,090.000	691,065.900	
MANULIFE US REIT	185,000.000	154,475.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	89,420.000	1,274,235.000	
MID AMERICA	22,990.000	1,975,760.600	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	19,700.000	254,524.000	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	51,270.000	529,619.100	
NATIONAL HEALTH INVS INC	11,970.000	895,834.800	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	44,740.000	2,078,620.400	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	10,320.000	200,414.400	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	24,400.000	249,368.000	
NEW YORK REIT INC	48,800.000	441,640.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,030.000	89,534.000	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	18,190.000	187,357.000	

NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	54,630.000	715,653.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	58,890.000	1,945,725.600	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,460.000	103,159.800	
PARKWAY INC	12,987.000	249,350.400	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,840.000	595,358.400	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	21,400.000	452,610.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	40,270.000	791,708.200	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	43,470.000	900,263.700	
POST PROPERTIES, INC	16,340.000	989,387.000	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	7,100.000	86,336.000	
PROLOGIS INC	160,020.000	7,956,194.400	
PS BUSINESS PARKS	5,900.000	622,037.000	
PUBLIC STORAGE	45,280.000	9,496,121.600	
QTS REALTY TRUST INC	14,250.000	728,032.500	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	23,440.000	411,137.600	
REALTY INCOME CORP	78,560.000	4,777,233.600	
REGENCY CENTERS CORP	31,800.000	2,346,840.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	32,410.000	666,349.600	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	72,440.000	1,148,898.400	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	19,500.000	415,350.000	
RLJ LODGING TRUST	37,550.000	777,660.500	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,270.000	743,343.600	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	19,300.000	451,234.000	
SAUL CENTERS INC	3,550.000	222,301.000	
SELECT INCOME REIT	19,510.000	490,481.400	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	72,360.000	1,577,448.000	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	6,650.000	324,320.500	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	11,100.000	182,706.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	95,380.000	18,651,559.000	
SL GREEN	30,500.000	3,190,910.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	146,060.000	1,784,853.200	
STAG INDUSTRIAL INC	21,950.000	491,899.500	
STORE CAPITAL CORP	46,110.000	1,267,563.900	

	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	26,200.000	334,312.000	
	SUN COMMUNITIES INC	19,050.000	1,441,323.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	64,910.000	829,549.800	
	TANGER FACTORY OUTLET	28,930.000	1,055,945.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	18,420.000	1,303,215.000	
	TERRENO REALTY CORP	13,420.000	339,526.000	
	THE MACERICH COMPANY	36,690.000	2,790,274.500	
	TIER REIT INC	13,830.000	198,875.400	
	UDR INC	81,230.000	2,734,201.800	
	UMH PROPERTIES INC	7,760.000	89,084.800	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,830.000	227,770.100	
	URBAN EDGE PROPERTIES	27,630.000	719,761.500	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9,160.000	194,466.800	
	VENTAS INC	106,710.000	7,075,940.100	
	VEREIT INC	293,530.000	2,773,858.500	
	VORNADO REALTY TRUST	52,210.000	4,973,002.500	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	56,040.000	643,339.200	
	WASHINGTON REIT	22,260.000	653,108.400	
	WEINGARTEN REALTY INVST	35,860.000	1,333,633.400	
	WELLTOWER INC	108,690.000	7,471,350.600	
	WHEELER REIT INC	16,560.000	28,317.600	
	WHITESTONE REIT	8,330.000	105,457.800	
	WP CAREY INC	32,190.000	1,974,856.500	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	33,110.000	507,245.200	
	アメリカ・ドル 小計	6,529,543.000	231,159,450.800 (23,957,365,481)	
イギリス・ポンド	ASSURA PLC	486,000.000	282,366.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	43,990.000	315,408.300	
	BRITISH LAND CO PLC	311,510.000	1,836,351.450	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	134,330.000	78,851.710	
	DERWENT LONDON PLC	33,420.000	813,777.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	143,440.000	167,824.800	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	103,970.000	628,498.650	
	HAMMERSON PLC	239,070.000	1,329,229.200	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	231,360.000	260,048.640	
	INTU PROPERTIES PLC	275,570.000	786,201.210	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	243,670.000	2,392,839.400	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	186,000.000	283,650.000	
	MCKAY SECURITIES PLC	23,500.000	45,825.000	

	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	16,720.000	79,620.640	
	NEWRIVER REIT PLC	72,770.000	234,319.400	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	186,870.000	207,425.700	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	385,190.000	162,935.370	
	REGIONAL REIT LTD	60,200.000	63,210.000	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	63,100.000	235,930.900	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	162,200.000	91,967.400	
	SEGRO PLC	249,450.000	1,084,608.600	
	SHAFTESBURY PLC	84,970.000	795,744.050	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	255,810.000	345,855.120	
	WORKSPACE GROUP PLC	35,400.000	234,525.000	
	イギリス・ボンド 小計	4,028,510.000	12,757,013.540 (1,621,416,420)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	47,870.000	555,292.000	
イスラエル・シュケル	小計	47,870.000	555,292.000 (15,120,601)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	3,240.000	33,404.400	
	ALLIED PROPERTIES REIT	12,640.000	462,497.600	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,180.000	253,101.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,920.000	349,598.400	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	4,200.000	113,904.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	20,400.000	577,932.000	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	10,900.000	494,315.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	13,310.000	179,418.800	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	27,120.000	397,579.200	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	13,500.000	184,410.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,600.000	142,944.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,390.000	173,540.500	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	8,770.000	66,125.800	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	16,900.000	283,751.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,740.000	277,890.200	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	41,890.000	923,255.600	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,790.000	83,406.700	
	MILESTONE APARTMENTS REIT	10,180.000	181,102.200	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4,810.000	60,557.900	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	7,440.000	115,022.400	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	7,000.000	150,150.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,860.000	103,332.800	
	ONEREIT	9,828.000	34,299.720	
	PLAZA RETAIL REIT	14,000.000	72,100.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	31,740.000	168,222.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	48,720.000	1,263,796.800	
	SLATE OFFICE REIT	4,920.000	41,180.400	
	SLATE RETAIL REIT	4,000.000	55,560.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,250.000	658,350.000	
カナダ・ドル 小計		419,238.000	7,900,748.420 (618,233,564)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	245,240.000	261,180.600	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	314,740.000	399,719.800	
	INVESTORE PROPERTY LTD	65,120.000	99,633.600	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	388,000.000	564,540.000	
	PRECINCT PROPERTIES	302,680.000	378,350.000	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	143,670.000	229,153.650	
	STRIDE STAPLED GROUP	105,410.000	199,224.900	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	97,370.000	209,832.350	
ニュージーランド・ドル 小計		1,662,230.000	2,341,634.900 (171,524,756)	
ユーロ	AEDIFICA	4,300.000	326,542.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	31,970.000	372,450.500	
	ALTAREA	760.000	129,466.000	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	16,870.000	189,197.050	
	BEFIMMO	6,777.000	351,387.450	
	BENI STABILI SPA	324,700.000	165,921.700	
	COFINIMMO SA	6,110.000	646,132.500	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,590.000	561,131.400	
	FONCIERE DES REGIONS	14,970.000	1,180,234.800	
	GECINA SA	12,260.000	1,612,803.000	
	GREEN REIT PLC	204,400.000	282,072.000	
	HAMBORNER REIT AG	23,330.000	212,536.300	
	HIBERNIA REIT PLC	213,460.000	276,430.700	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	32,950.000	377,607.000	

	ICADE	13,720.000	904,559.600	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	94,280.000	61,093.440	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,120.000	99,765.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	107,600.000	129,658.000	
	KLEPIERRE	63,030.000	2,404,594.500	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	26,557.000	163,856.690	
	MERCIALYS	16,460.000	319,406.300	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	98,740.000	980,290.720	
	MONTEA SCA	2,030.000	92,547.700	
	NSI NV	42,100.000	155,770.000	
	RETAIL ESTATES	1,730.000	135,805.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	30,150.000	6,616,417.500	
	VASTNED RETAIL	5,980.000	206,638.900	
	WAREHOUSES DE PAUW	4,200.000	356,160.000	
	WERELDHAVE BELGIUM	650.000	71,207.500	
	WERELDHAVE NV	12,190.000	534,348.650	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,000.000	34,495.000	
	ユーロ 小計	1,431,984.000	19,950,527.700 (2,282,938,885)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	625,070.000	2,856,569.900	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	420,000.000	4,006,800.000	
	LINK REIT	682,023.000	37,511,265.000	
	PROSPERITY REIT	335,000.000	1,128,950.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	267,000.000	552,690.000	
	SPRING REIT	216,000.000	745,200.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	320,000.000	1,555,200.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	328,000.000	1,512,080.000	
	香港・ドル 小計	3,193,093.000	49,868,754.900 (666,246,566)	
	投資証券 合計	17,312,468	29,332,846,273 (29,332,846,273)	
	合計		33,132,490,654 (33,132,490,654)	

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

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

通貨	銘柄数	組入投資 信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券 の合計金額に 対する比率

アメリカ・ドル	投資証券	158銘柄	-%	71.81%	72.31%
イギリス・ポンド	投資証券	24銘柄	-%	4.86%	4.89%
イスラエル・シケル	投資証券	1銘柄	-%	0.05%	0.05%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	29銘柄	8.22%	-%	8.27%
カナダ・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.03%	-%	1.89%
	投資証券	29銘柄	-%	1.85%	
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	30銘柄	3.15%	-%	3.17%
ニュージーランド・ドル	投資証券	8銘柄	-%	0.51%	0.52%
ユーロ	投資証券	31銘柄	-%	6.84%	6.89%
香港・ドル	投資証券	8銘柄	-%	2.00%	2.01%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「コモディティインデックス・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10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		29,194,253
コール・ローン		3,273,161
社債券		2,485,876,372
流動資産合計		2,518,343,786
資産合計		2,518,343,786
負債の部		
流動負債		
未払金		22,797,500
未払解約金		2,000,000
流動負債合計		24,797,500
負債合計		24,797,500
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,786,925,196
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2	4,293,378,910
元本等合計		2,493,546,286
純資産合計		2,493,546,286
負債純資産合計		2,518,343,786

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	社債券 原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成28年10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	4,928,968,096円
	同期中追加設定元本額	2,460,719,218円
	同期中一部解約元本額	602,762,118円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	DIAMコモディティパッシブ・ファン ド	6,227,100,392円
	MITO ラップ型ファンド（安定 型）	19,989,336円
	MITO ラップ型ファンド（中立 型）	58,983,541円
	MITO ラップ型ファンド（積極 型）	84,913,094円
	グローバル8資産ラップファンド（安 定型）	47,644,368円
	グローバル8資産ラップファンド（中 立型）	51,905,759円
	グローバル8資産ラップファンド（積 極型）	41,282,537円
	DIAMグローバル 私募ファンド （適格機関投資家向け）	255,106,169円
	計	6,786,925,196円
2 .	受益権の総数	6,786,925,196口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その 差額は4,293,378,910円であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、流動性リスク及び特定の債券への銘柄集中リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
社債券	58,106,317
合計	58,106,317

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年1月21日から平成28年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.3674円
(1万口当たり純資産額)	(3,674円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカ・ドル	GS Commodity Index Certificate 06/08/2017	106,480.000	23,985,684.800	
	アメリカ・ドル 小計		106,480.000 (11,035,587)	23,985,684.800 (2,485,876,372)	
社債券 合計			11,035,587 (11,035,587)	2,485,876,372 (2,485,876,372)	
合計			11,035,587 (11,035,587)	2,485,876,372 (2,485,876,372)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額に對する 比率
アメリカ・ドル	社債券 1銘柄	99.69%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,065,962,937
コール・ローン		34,538,081
株式		35,920,091,690
投資信託受益証券		260,189,850
投資証券		98,681,275
派生商品評価勘定		15,045,065
未収入金		880,097
未収配当金		46,814,137
差入委託証拠金		311,085,929
流動資産合計		37,753,289,061
資産合計		37,753,289,061
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		699,052
未払金		792,710
未払解約金		436,732,000
流動負債合計		438,223,762
負債合計		438,223,762
純資産の部		
元本等		
元本	1	41,601,299,999
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2	4,286,234,700
元本等合計		37,315,065,299
純資産合計		37,315,065,299
負債純資産合計		37,753,289,061

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10月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	39,619,567,643円
同期中追加設定元本額	18,703,237,598円
同期中一部解約元本額	16,721,505,242円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM新興国株式インデックスファ ンド<DC年金>	1,460,950,989円
DIAM新興国株式インデックスファ ンド<為替ヘッジなし>（ファンド ラップ）	116,851,142円
MITO ラップ型ファンド（安定 型）	6,895,928円
MITO ラップ型ファンド（中立 型）	20,266,691円
MITO ラップ型ファンド（積極 型）	29,076,623円
グローバル8資産ラップファンド（安 定型）	16,465,885円
グローバル8資産ラップファンド（中 立型）	17,826,533円
グローバル8資産ラップファンド（積 極型）	14,181,088円
たわらノーロード 新興国株式	659,631,630円
たわらノーロード 新興国株式<ラッ プ向け>	81,047,957円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	539,443,143円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド（新興国10）	38,882,124円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド（新興国20）	104,443,992円
DIAM DC 8資産バランスファ ンド（新興国30）	226,045,440円
投資のソムリエ	1,547,904,861円
クルーズコントロール	1,491,958,601円
投資のソムリエ<DC年金>	42,390,510円
DIAM 8資産バランスファンドN <DC年金>	125,353,913円
クルーズコントロール<DC年金>	476,753円
DIAMコア資産設計ファンド（堅実 型）	24,199,715円
DIAMコア資産設計ファンド（積極 型）	60,932,800円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑 制型	10,554,863円
ダイナミック・ナビゲーション	1,866,081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）	7,078,939,545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)	189,946,132円
	エマージング株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,193,601,345円
	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)	15,625,917,469円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	9,875,248,246円
	計	41,601,299,999円
2 .	受益権の総数	41,601,299,999口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,286,234,700円であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,165,428,920
投資信託受益証券	40,503,003
投資証券	10,040,595
合計	2,195,891,328

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年4月19日から平成28年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在			
	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	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600
アメリカ・ドル	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600
合計	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600

(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10月12日 現在			
	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	991,418,685	-	1,004,485,098	13,066,413
合計	991,418,685	-	1,004,485,098	13,066,413

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.8970円
(1万口当たり純資産額)	(8,970円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	31,600	46.770	1,477,932.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,273	12.310	224,940.630	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	65,400	4.750	310,650.000	
	CREDICORP LTD	5,649	147.040	830,628.960	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	47,625	7.980	380,047.500	
	NETEASE INC-ADR	6,700	254.200	1,703,140.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,480	26.180	195,826.400	
	LUKOIL SPON ADR	37,512	49.600	1,860,595.200	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	48,121	1.990	95,760.790	
	GAZPROM PAO ADR	518,954	4.400	2,283,397.600	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	93,041	4.285	398,680.680	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	79,280	1.666	132,080.480	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	69,241	4.625	320,239.620	
	SISTEMA PJSC GDR	15,837	7.680	121,628.160	
	NOVATEK OAO GDR	8,214	111.900	919,146.600	
	BAIDU INC -SPON ADR	23,200	177.040	4,107,328.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	50,644	15.450	782,449.800	
	ROSTELECOM SPON ADR	19,141	7.710	147,577.110	
	ROSNEFT OIL CO GDR	107,099	5.790	620,103.210	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	11,400	45.900	523,260.000	
	SEVERSTAL GDR	21,971	13.050	286,721.550	
	TATNEFT ADR	21,657	31.440	680,896.080	
	VTB BANK OJSC GDR	246,633	2.191	540,372.900	
	DP WORLD LTD	14,393	18.780	270,300.540	
	MAGNIT PJSC GDR	25,012	41.600	1,040,499.200	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	34,300	14.860	509,698.000	
	FANG HOLDINGS LTD ADR	23,400	3.640	85,176.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	138,161	1.185	163,720.780	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	3,800	70.490	267,862.000	
	SBERBANK ADR	236,766	9.949	2,355,584.930	
PHOSAGRO OAO GDR	11,514	12.950	149,106.300		
YY INC-ADR	2,400	53.950	129,480.000		
MEGAFON PJSC GDR	11,719	9.800	114,846.200		
58.COM INC ADR	6,600	46.850	309,210.000		

	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	3,200	28.850	92,320.000	
	JD.COM INC ADR	58,700	26.750	1,570,225.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	96,000	105.230	10,102,080.000	
アメリカ・ドル 小計		2,220,637		36,103,512.220 (3,741,768,006)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	75,484	11.300	852,969.200	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	110,195	5.320	586,237.400	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	149,976	19.950	2,992,021.200	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	164,030	6.240	1,023,547.200	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	55,579	8.750	486,316.250	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,973	6.920	2,082,733.160	
	ARABTEC HOLDING CO	190,922	1.430	273,018.460	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	267,344	2.580	689,747.520	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	174,604	1.240	216,508.960	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.680	477,484.880	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,667,273		9,680,584.230 (273,670,116)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	111,140	1,096.350	121,848,339.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	22,447	657.800	14,765,636.600	
	ASIAN PAINTS LTD	24,832	1,212.650	30,112,524.800	
	EICHER MOTORS LTD	1,137	25,804.600	29,339,830.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,955	1,376.900	43,998,839.500	
	SHREE CEMENT LTD	709	17,595.700	12,475,351.300	
	ICICI BANK LTD	94,024	250.100	23,515,402.400	
	STATE BANK OF INDIA LTD	131,852	256.600	33,833,223.200	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,923	1,384.450	4,046,747.350	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	25,256	592.850	14,973,019.600	
	TATA STEEL LTD	25,639	418.400	10,727,357.600	
	TATA MOTORS LTD	136,092	562.050	76,490,508.600	
	JSW STEEL LTD	7,479	1,814.750	13,572,515.250	
	TATA POWER CO LTD	91,986	80.850	7,437,068.100	
	NESTLE INDIA LTD	1,963	6,632.600	13,019,793.800	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	134.950	6,625,910.050	
	GAIL INDIA LTD	26,335	419.100	11,036,998.500	
	VEDANTA LTD	86,499	199.550	17,260,875.450	
	AXIS BANK LTD	142,910	531.550	75,963,810.500	
	TITAN COMPANY LTD	25,302	403.700	10,214,417.400	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	70,439	266.950	18,803,691.050		

GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	881	6,198.600	5,460,966.600	
LUPIN LTD	18,904	1,520.200	28,737,860.800	
ACC LTD	3,300	1,668.500	5,506,050.000	
BAJAJ FINANCE LTD	13,840	1,073.950	14,863,468.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	128,439	1,391.450	178,716,446.550	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	49,458	568.600	28,121,818.800	
INFOSYS LTD	157,741	1,029.950	162,465,342.950	
WIPRO LTD	53,495	477.000	25,517,115.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	55,901	876.150	48,977,661.150	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,999	1,344.050	9,407,005.950	
HCL TECHNOLOGIES LTD	48,447	813.000	39,387,411.000	
DABUR INDIA LTD	44,319	286.350	12,690,745.650	
HERO MOTOCORP LTD	4,116	3,488.850	14,360,106.600	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,155	3,078.650	31,263,690.750	
BHARTI AIRTEL LTD	84,784	315.900	26,783,265.600	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	2,468.750	13,439,875.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	82,384	755.450	62,236,992.800	
DIVI'S LABORATORIES LTD	6,922	1,264.650	8,753,907.300	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,023	5,712.350	51,542,534.050	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,754	927.250	11,826,146.500	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,467	856.750	19,248,602.250	
HAVELLS INDIA LTD	20,340	447.250	9,097,065.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	36,648	331.450	12,146,979.600	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	12,785	1,178.050	15,061,369.250	
CIPLA LTD/INDIA	30,629	580.650	17,784,728.850	
LARSEN & TOUBRO LTD	27,288	1,450.000	39,567,600.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,015	3,976.750	11,989,901.250	
ASHOK LEYLAND LTD	103,421	80.750	8,351,245.750	
BOSCH LTD	631	23,101.550	14,577,078.050	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	40,549	2,380.300	96,518,784.700	
NTPC LTD	140,731	146.650	20,638,201.150	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,629	1,848.800	12,255,695.200	
YES BANK LTD	26,588	1,279.500	34,019,346.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	51,721	257.000	13,292,297.000	
BHARAT FORGE LTD	9,622	936.850	9,014,370.700	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	95,921	160.750	15,419,300.750	
ITC LTD	291,014	240.100	69,872,461.400	
UNITED PHOSPHORUS LTD	30,236	670.900	20,285,332.400	
SIEMENS INDIA LTD	6,447	1,239.250	7,989,444.750	

	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,178	1,615.300	16,440,523.400	
	TECH MAHINDRA LTD	21,631	421.850	9,125,037.350	
	CAIRN INDIA LTD	37,231	227.550	8,471,914.050	
	IDEA CELLULAR LTD	103,591	79.850	8,271,741.350	
	MARICO LTD	38,600	278.250	10,740,450.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	51,530	121.950	6,284,083.500	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	70,134	264.000	18,515,376.000	
	BAJAJ AUTO LTD	7,194	2,876.400	20,692,821.600	
	COAL INDIA LTD	59,515	318.900	18,979,333.500	
	TATA MOTORS LTD	31,568	365.650	11,542,839.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	379.150	8,991,542.250	
	BHARTI INFRA TEL LTD	50,446	377.450	19,040,842.700	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,108	844.300	21,198,684.400	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	388.250	7,045,184.500	
	インド・ルビー 小計	3,412,593		2,002,590,449.150 (3,124,041,101)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	6,400.000	962,560,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	144,301	19,450.000	2,806,654,450.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	389,600	8,925.000	3,477,180,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	131,300	45,250.000	5,941,325,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,734,500	8,325.000	14,439,712,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,345,600	4,160.000	18,077,696,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,900	3,700.000	2,297,330,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	43,500	64,500.000	2,805,750,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	825,000	4,090.000	3,374,250,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	121,700	17,675.000	2,151,047,500.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	870,500	1,785.000	1,553,842,500.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	3,960.000	1,150,047,360.000	
	BANK MANDIRI	800,200	10,850.000	8,682,170,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	199,400	17,700.000	3,529,380,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	951,700	11,950.000	11,372,815,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	953,400	2,590.000	2,469,306,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	632,200	5,200.000	3,287,440,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,748,400	1,720.000	3,007,248,000.000	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	241,600	10,000.000	2,416,000,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,055,000	15,800.000	16,669,000,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	2,650.000	770,355,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,560,300	940.000	1,466,682,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	625,200	875.000	547,050,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,030.000	951,055,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	4,670.000	875,625,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	2,180.000	1,292,304,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	1,400.000	1,526,700,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	182,600	9,800.000	1,789,480,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	220,400	6,150.000	1,355,460,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	2,640.000	1,034,880,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	535,800	2,620.000	1,403,796,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		22,395,917		123,484,141,310.000 (987,873,130)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	9,967	87.900	876,099.300	
	QATAR NATIONAL BANK	17,917	155.700	2,789,676.900	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	13,439	39.750	534,200.250	
	OOREDOO QSC	6,737	97.000	653,489.000	
	DOHA BANK QSC	10,788	37.200	401,313.600	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,398	214.000	513,172.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,841	107.700	1,382,975.700	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,187	104.000	539,448.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	25,786	23.900	616,285.400	
	MASRAF AL RAYAN	32,030	35.400	1,133,862.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	33.500	265,186.000	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	68,371	16.830	1,150,683.930	
	VODAFONE QATAR	26,513	10.950	290,317.350	
カタール・リアル 小計		239,890		11,146,709.430 (317,904,153)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	30,075	9,850.000	296,238,750.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	7,787	37,860.000	294,815,820.000	
	ECOPETROL SA	413,049	1,325.000	547,289,925.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	9,067	38,400.000	348,172,800.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	247,861	1,225.000	303,629,725.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	38,592	11,800.000	455,385,600.000	

	GRUPO ARGOS SA	24,430	19,400.000	473,942,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	39,277	28,180.000	1,106,825,860.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	20,613	38,500.000	793,600,500.000	
コロンビア・ペソ	小計	830,751		4,619,900,980.000 (164,006,485)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	157.500	3,102,750.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	20.400	1,758,480.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	310,900	17.400	5,409,660.000	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PCL-NVDR	39,400	51.750	2,038,950.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	135,200	143.000	19,333,600.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	834,855	6.450	5,384,814.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	49,000	185.000	9,065,000.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.020	2,040,200.000	
	IRPC PCL NVDR	937,000	4.900	4,591,300.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	127,000	16.200	2,057,400.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	10,100	197.000	1,989,700.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	229,000	30.000	6,870,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	87,700	153.000	13,418,100.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	361,920	9.300	3,365,856.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	45,500	79.750	3,628,625.000	
	PTT PCL	85,100	337.000	28,678,700.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	164,100	20.700	3,396,870.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,050	500.000	5,525,000.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	36,800	380.000	13,984,000.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	24,500	506.000	12,397,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	99,400	185.000	18,389,000.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	113,600	54.250	6,162,800.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	351,700	21.600	7,596,720.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	30,300	164.000	4,969,200.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	183,910	38.250	7,034,557.500	
	THAI OIL PCL NVDR	75,100	69.500	5,219,450.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	75.500	3,140,800.000	
	CP ALL PCL NVDR	425,900	59.750	25,447,525.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	8.300	4,276,990.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	114,545	81.750	9,364,053.750	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	75,722	26.500	2,006,633.000	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	26.500	1,455,724.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	176,108	59.000	10,390,372.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	93,000	24.900	2,315,700.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	578,400	6.750	3,904,200.000	
タイ・パーツ 小計		7,534,543		259,709,731.500 (760,949,513)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,700	888.000	5,949,600.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	223.400	1,268,241.800	
	CEZ	13,634	454.000	6,189,836.000	
チェコ・コルナ 小計		26,011		13,407,677.800 (56,714,477)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,829,922	34.660	202,065,096.520	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,370	31,277.000	105,403,490.000	
	BANCO DE CHILE	2,171,579	74.280	161,304,888.120	
	EMPRESAS CMPC SA	102,793	1,285.300	132,119,842.900	
	EMPRESAS COPEC SA	39,358	6,193.600	243,767,708.800	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	6,680.000	88,109,200.000	
	ENTEL CHILE SA	12,913	6,483.600	83,722,726.800	
	ENDESA CHILE	274,605	447.950	123,009,309.750	
	ENERSIS AMERICAS SA	1,664,838	110.990	184,780,369.620	
	COLBUN SA	616,527	136.900	84,402,546.300	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	417.090	93,476,542.440	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,572.700	55,004,326.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	25,767	5,684.900	146,482,818.300	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,243	18,380.000	151,506,340.000	
	SACI FALABELLA	51,782	4,880.700	252,732,407.400	
	ITAU CORPBANCA	13,410,500	5.773	77,418,816.500	
	CENCOSUD SA	119,987	1,978.900	237,442,274.300	
	AES GENER SA	209,506	221.360	46,376,248.160	
ENDESA AMERICAS SA	274,605	304.930	83,735,302.650		
ENERSIS CHILE SA	1,664,838	66.670	110,994,749.460		
チリ・ペソ 小計		26,739,819		2,663,855,004.020 (413,696,682)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	185,551	8.130	1,508,529.630	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	16,570	19.290	319,635.300	
	ARCELIK	20,283	21.500	436,084.500	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	112,625	4.160	468,520.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	32.280	180,251.520	

	KOC HOLDING AS	54,486	13.180	718,125.480	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	47,602	4.330	206,116.660	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	56,871	3.210	182,555.910	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	10,370	22.620	234,569.400	
	TURK HAVA YOLLARI	51,118	5.360	273,992.480	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	71,853	10.050	722,122.650	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	195,586	8.040	1,572,511.440	
	TURKIYE IS BANKASI	139,877	4.770	667,213.290	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,419	60.800	694,275.200	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	14,893	21.560	321,093.080	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	78,404	3.580	280,686.320	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	81,700	9.360	764,712.000	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	37.880	244,363.880	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,655	50.800	947,674.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	4.450	283,055.600	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	15,347	13.150	201,813.050	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	51,480	8.920	459,201.600	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	39,975	5.620	224,659.500	
	トルコ・リラ 小計	1,350,308		11,911,762.490 (400,116,101)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	12,643	5,735.000	72,507,605.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,236	17,550.000	56,791,800.000	
	OTP BANK NYRT	20,037	7,429.000	148,854,873.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	35,916		278,154,278.000 (104,363,484)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	631,800	38.300	24,197,940.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	157,720	76.100	12,002,492.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	59,486	104.400	6,210,338.400	
	AYALA CORP	21,803	858.000	18,706,974.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	169,800	15.800	2,682,840.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.760	4,489,606.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,960	1,824.000	5,399,040.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	77.200	3,140,496.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	242,150	71.700	17,362,155.000	

	JOLLIBEE FOODS CORP	37,710	244.000	9,201,240.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	47,451	84.550	4,011,982.050	
	BDO UNIBANK INC	136,318	109.600	14,940,452.800	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.570	4,396,340.000	
	PLDT INC	8,220	1,609.000	13,225,980.000	
	ROBINSONS LAND CORP	131,600	30.800	4,053,280.000	
	SECURITY BANK CORP	9,450	218.800	2,067,660.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	712,875	28.000	19,960,500.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	78,780	180.000	14,180,400.000	
	SM INVESTMENTS CORP	21,048	671.500	14,133,732.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	876,500	5.960	5,223,940.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,180,800	7.070	8,348,256.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	45.650	5,610,385.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,900	1,399.000	9,653,100.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,010,801		223,199,129.250 (475,414,146)	
ブラジル・リアル	BRF SA	51,892	56.980	2,956,806.160	
	VALE SA	110,227	18.600	2,050,222.200	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	34.570	277,182.260	
	VALE SA-PREF A	163,796	16.690	2,733,755.240	
	RAIA DROGASIL SA	19,700	67.100	1,321,870.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	8.400	585,480.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	24.830	482,943.500	
	BANCO DO BRASIL SA	74,200	24.870	1,845,354.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	331,178	8.760	2,901,119.280	
	LOJAS AMERICANAS SA	51,574	20.550	1,059,845.700	
	LOJAS AMERICANAS SA	14,670	14.870	218,142.900	
	GERDAU SA	76,630	9.500	727,985.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	13,706	53.240	729,707.440	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	254,210	17.080	4,341,906.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	335,512	15.390	5,163,529.680	
	KROTON EDUCACIONAL SA	120,268	15.950	1,918,274.600	
	CCR SA	76,320	17.270	1,318,046.400	
	WEG SA	50,340	17.800	896,052.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	237,515	30.750	7,303,586.250	
	BANCO BRADESCO SA	70,741	29.900	2,115,155.900	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	31.310	463,388.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	54,806	10.200	559,021.200	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	10.220	320,908.000	
	CPFL ENERGIA SA	17,474	24.180	422,521.320	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	251,908	37.970	9,564,946.760	

PORTO SEGURO SA	9,400	31.210	293,374.000	
FIBRIA CELULOSE SA	21,490	23.500	505,015.000	
BRASKEM SA	14,130	26.100	368,793.000	
ENGIE BRASIL SA	13,970	38.800	542,036.000	
LOCALIZA RENT A CAR	13,105	41.100	538,615.500	
TELEFONICA BRASIL S.A.	37,728	43.890	1,655,881.920	
LOJAS RENNER SA	55,300	25.500	1,410,150.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,064	15.140	394,608.960	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	30,652	71.500	2,191,618.000	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,000	40.410	444,510.000	
TOTVS SA	11,500	30.150	346,725.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	16,800	50.600	850,080.000	
EMBRAER SA	56,360	14.010	789,603.600	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,000	15.040	255,680.000	
M DIAS BRANCO SA	2,800	137.050	383,740.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	8,200	21.290	174,578.000	
ODONTOPREV SA	22,300	12.260	273,398.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	49,400	12.780	631,332.000	
JBS SA	61,100	12.570	768,027.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	66,649	8.650	576,513.850	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	30,398	30.890	938,994.220	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,000	63.660	445,620.000	
DURATEX SA	27,734	8.680	240,731.120	
SUL AMERICA SA	15,448	16.940	261,689.120	
HYPERMARCAS SA	29,900	28.580	854,542.000	
BM&FBOVESPA SA	148,000	17.490	2,588,520.000	
QUALICORP SA	17,800	20.380	362,764.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	34,900	22.420	782,458.000	
CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,259	43.490	881,063.910	
CIELO SA	86,923	33.040	2,871,935.920	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	59,400	30.450	1,808,730.000	
AMBEV SA	403,695	19.450	7,851,867.750	
KLABIN SA	49,200	16.510	812,292.000	
RUMO LOGISTICA OPERADORA MULTIMODAL SA	68,700	6.520	447,924.000	
AES TIETE ENERGIA SA	14,758	15.920	234,947.360	
ブラジル・リアル 小計	4,079,098		87,056,109.820	

(2,823,229,641)

ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	59,382	5.940	352,729.080	
	MBANK	1,260	342.400	431,424.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	78.900	204,824.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,128	72.300	876,854.400	
	BANK PEKAO SA	13,381	127.800	1,710,091.800	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.860	343,396.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	27,535	69.580	1,915,885.300	
	LPP SA	112	5,100.000	571,200.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,975	312.000	928,200.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	74,211	26.180	1,942,843.980	
	CCC SA	2,228	184.800	411,734.400	
	SYNTHOS SA	46,508	4.650	216,262.200	
	EUROCASH SA	6,142	40.210	246,969.820	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	29.530	235,560.810	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	150,232	5.240	787,215.680	
	CYFROWY POLSAT SA	16,740	24.120	403,768.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	60.950	234,840.350	
	ENEA SA	18,176	8.660	157,404.160	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,259	10.070	747,788.130	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	2.470	203,834.280	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	49,966	26.100	1,304,112.600		
ALIOR BANK SA	7,434	48.200	358,318.800		
ENERGA SA	16,930	7.530	127,482.900		
ポーランド・ズロチ 小計	735,149		14,712,741.890 (392,977,336)		
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	152,500	4.060	619,150.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.580	239,108.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	251,500	4.790	1,204,685.000	
	DIGI.COM BHD	294,300	5.000	1,471,500.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	6.630	458,265.600	
	RHB BANK BHD	64,480	4.630	298,542.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	45,000	7.660	344,700.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	69,235	3.220	222,936.700	
	GAMUDA BHD	135,700	4.850	658,145.000	
	GENTING BHD	190,300	7.980	1,518,594.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.770	654,917.700	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	16,656	15.520	258,501.120	

HONG LEONG BANK BHD	59,308	13.200	782,865.600	
IJM CORP BHD	254,060	3.300	838,398.000	
IOI CORP BHD	189,613	4.500	853,258.500	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	36,500	24.020	876,730.000	
MALAYAN BANKING BHD	293,575	7.700	2,260,527.500	
LAFARGE MALAYSIA BHD	34,100	8.130	277,233.000	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	86,100	3.770	324,597.000	
MISC BHD	94,580	7.690	727,320.200	
PPB GROUP BHD	43,600	16.100	701,960.000	
PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	23.360	408,800.000	
PETRONAS GAS BHD	58,800	21.780	1,280,664.000	
GENTING MALAYSIA BHD	253,500	4.700	1,191,450.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	49.320	562,248.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.720	638,400.000	
TENAGA NASIONAL BHD	294,250	14.380	4,231,315.000	
UMW HOLDINGS BHD	36,300	5.900	214,170.000	
DIALOG GROUP BHD	243,444	1.530	372,469.320	
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	235,530	19.780	4,658,783.400	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.610	234,839.430	
AIRASIA BHD	107,200	2.830	303,376.000	
SIME DARBY BERHAD	213,500	7.830	1,671,705.000	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	63,700	4.750	302,575.000	
AXIATA GROUP BERHAD	222,000	5.310	1,178,820.000	
MAXIS BHD	164,100	6.080	997,728.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	204,200	6.780	1,384,476.000	
SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	319,200	1.680	536,256.000	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	125,500	2.810	352,655.000	
IHH HEALTHCARE BHD	282,100	6.550	1,847,755.000	
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	2.360	281,312.000	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	83,500	4.380	365,730.000	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	139,639	2.500	349,097.500	
マレーシア・リンギット 小計	6,208,263		38,956,559.970 (963,006,162)	
メキシコ・ペソ				
ALFA SAB DE CV	240,400	31.120	7,481,248.000	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	42,300	150.640	6,372,072.000	
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	15,600	204.470	3,189,732.000	
GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	152,500	34.020	5,188,050.000	
GRUPO TELEVISIA SAB	208,400	98.730	20,575,332.000	

	GRUPO BIMBO SAB DE CV	139,200	52.180	7,263,456.000	
	GRUMA SAB DE CV	18,425	258.010	4,753,834.250	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,125	214.030	4,735,413.750	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	46,900	82.100	3,850,490.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	212,400	108.350	23,013,540.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	85,488	44.990	3,846,105.120	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,195	438.090	5,780,597.550	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	130,300	43.120	5,618,536.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,355	292.430	5,075,122.650	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	330,552	47.710	15,770,635.920	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,729,878	11.340	30,956,816.520	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,300	30.770	6,101,691.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	36,400	117.410	4,273,724.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	452,200	41.660	18,838,652.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	30,000	188.180	5,645,400.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	23.710	1,664,442.000	
	GENTERA SAB DE CV	95,000	36.570	3,474,150.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	29,000	43.010	1,247,290.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	56,500	37.000	2,090,500.000	
メキシコ・ペソ 小計		5,372,618		196,806,830.760 (1,080,469,501)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	500,000	0.147	73,500.000	
	ALPHA BANK A.E.	100,000	1.650	165,000.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.198	791.600	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	21.150	74,405.700	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	8.080	80,832.320	
	FF GROUP	3,130	21.730	68,014.900	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	0.544	886.720	
	OPAP SA	8,501	7.660	65,117.660	
	JUMBO SA	5,623	11.750	66,070.250	
ユーロ 小計		636,404		594,619.150 (68,042,270)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,627	16,200.000	91,157,400.000	
	HANMI PHARM CO LTD	1,068	94,700.000	101,139,600.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,205	100,500.000	322,102,500.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,860	288,000.000	823,680,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,192	66,900.000	280,444,800.000	

COWAY CO LTD	4,617	95,100.000	439,076,700.000	
KT&G CORP	9,966	119,500.000	1,190,937,000.000	
S-1 CORPORATION	1,579	98,900.000	156,163,100.000	
KOREA GAS CORP	2,659	45,500.000	120,984,500.000	
CJ CORP	1,242	184,000.000	228,528,000.000	
KAKAO CORP	2,569	81,500.000	209,373,500.000	
SK TELECOM CO LTD	1,695	219,500.000	372,052,500.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,400	88,300.000	211,920,000.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	15,692	7,870.000	123,496,040.000	
NCSOFT CORPORATION	1,500	288,500.000	432,750,000.000	
LG UPLUS CORP	18,179	11,500.000	209,058,500.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	25,400.000	102,870,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,183	6,690.000	81,504,270.000	
POSCO DAEWOO CORP	4,351	26,600.000	115,736,600.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	806	903,000.000	727,818,000.000	
LG CHEM LTD	3,924	235,000.000	922,140,000.000	
LG CHEM LTD	726	163,000.000	118,338,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	167	476,000.000	79,492,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	36,398	41,750.000	1,519,616,500.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	4,997	52,700.000	263,341,900.000	
S-OIL CORP	3,868	83,200.000	321,817,600.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	9,297	25,450.000	236,608,650.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,874	35,200.000	171,564,800.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,310	311,000.000	407,410,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	59,500.000	175,822,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,546	153,000.000	542,538,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,825	274,500.000	1,598,962,500.000	
SK HYNIX INC	49,806	41,300.000	2,056,987,800.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,099	42,900.000	261,647,100.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,907	97,000.000	184,979,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	12,262	134,500.000	1,649,239,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,811	50,100.000	341,231,100.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,291	12,400.000	264,008,400.000	
KCC CORP	483	403,000.000	194,649,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,519	42,050.000	946,923,950.000	
KOREA ZINC CO LTD	725	458,500.000	332,412,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,913	51,000.000	1,117,563,000.000	
HANWHA CORP	3,785	36,400.000	137,774,000.000	

KOREAN AIR CO LTD	2,950	32,400.000	95,580,000.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	97,200.000	145,800,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	630	210,000.000	132,300,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,423	75,500.000	107,436,500.000	
KT CORP	3,085	31,550.000	97,331,750.000	
LG ELECTRONICS INC	9,041	53,500.000	483,693,500.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	430	178,000.000	76,540,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	60	1,612,000.000	96,720,000.000	
HANSSEM CO LTD	869	175,500.000	152,509,500.000	
LG CORP	8,057	62,800.000	505,979,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	10,050.000	116,479,500.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	30,950.000	122,097,750.000	
NAVER CORP	2,399	862,000.000	2,067,938,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	15,250.000	49,882,750.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,243	123,000.000	152,889,000.000	
DONGSUH CO INC	2,798	29,000.000	81,142,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,287	40,300.000	132,466,100.000	
OTTOGI CORP	112	736,000.000	82,432,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,395	162,500.000	389,187,500.000	
KANGWON LAND INC	10,077	38,250.000	385,445,250.000	
POSCO	5,933	233,500.000	1,385,355,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,676	93,600.000	437,673,600.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,000	47,500.000	237,500,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,566	1,545,000.000	13,234,470,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	12,525	9,940.000	124,498,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,531	1,251,000.000	1,915,281,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	186,500.000	124,768,500.000	
HYOSUNG CORP	1,781	140,000.000	249,340,000.000	
ORION CORP	299	817,000.000	244,283,000.000	
YUHAN CORP	699	262,500.000	183,487,500.000	
HANON SYSTEMS	16,843	12,150.000	204,642,450.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	36,600.000	208,986,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,663	53,300.000	248,537,900.000	
LG DISPLAY CO LTD	20,044	29,550.000	592,300,200.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	6,900.000	70,932,000.000	
CELLTRION INC	6,579	102,600.000	675,005,400.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,608	30,650.000	784,885,200.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,601	179,000.000	286,579,000.000	

MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	6,755	23,050.000	155,702,750.000	
LOTTE SHOPPING CO	928	222,000.000	206,016,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,006	106,000.000	636,636,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,757	371,000.000	1,022,847,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	206,000.000	154,912,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	50,400.000	145,000,800.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,513	162,000.000	893,106,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	710	352,500.000	250,275,000.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	55,100.000	100,557,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,196	78,200.000	93,527,200.000	
SK HOLDINGS CO LTD	3,962	213,500.000	845,887,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	32,923	40,000.000	1,316,920,000.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,454	85,600.000	124,462,400.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	4,961	80,500.000	399,360,500.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,598	8,820.000	208,134,360.000	
HANMI PHARM CO LTD	440	428,000.000	188,320,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	19,713	6,100.000	120,249,300.000	
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,537	75,200.000	115,582,400.000	
E-MART CO LTD	1,648	159,500.000	262,856,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	9,200.000	124,558,800.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	47,650.000	118,267,300.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,577	61,000.000	401,197,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	797	181,500.000	144,655,500.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,961	158,500.000	469,318,500.000	
WOORI BANK	25,506	11,800.000	300,970,800.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,478	155,500.000	1,007,329,000.000	
韓国・ウォン 小計	705,992		56,674,885,870.000 (5,236,759,455)	
香港・ドル				
JIANGXI COPPER CO LTD	100,000	9.050	905,000.000	
JIANGSU EXPRESS	110,000	11.060	1,216,600.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	4.520	732,240.000	
CHINA MOBILE LIMITED	525,000	95.250	50,006,250.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	104,500	21.650	2,262,425.000	
BEIJING ENTERPRISES	44,500	38.050	1,693,225.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	4.880	1,747,040.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	4.310	1,189,560.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	176,000	5.880	1,034,880.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	62,000	62.750	3,890,500.000	

HUADIAN POWER INTL CORP-H	128,000	3.460	442,880.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	78,320	12.760	999,363.200	
CNOOC LTD	1,519,000	10.380	15,767,220.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	258,000	8.800	2,270,400.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	352,000	8.250	2,904,000.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	337,120	24.000	8,090,880.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	234,888	19.420	4,561,524.960	
CITIC LTD	370,000	11.220	4,151,400.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	126,000	8.890	1,120,140.000	
LENOVO GROUP LTD	618,000	5.150	3,182,700.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,798,000	5.550	9,978,900.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	516,742	9.940	5,136,415.480	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	136,790	16.160	2,210,526.400	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,177,200	5.850	12,736,620.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	18.920	1,456,840.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,000	39.500	2,528,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	282,000	6.140	1,731,480.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	130,000	8.270	1,075,100.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	108,000	20.900	2,257,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	362,000	2.900	1,049,800.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	84,000	15.520	1,303,680.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	152,000	12.380	1,881,760.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	440,000	7.550	3,322,000.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	78,000	26.800	2,090,400.000	
BYD CO LTD	55,000	51.350	2,824,250.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,200,000	4.070	4,884,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.720	1,235,200.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,020,000	1.670	1,703,400.000	
SINOTRANS LTD	147,000	3.910	574,770.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	208,000	9.330	1,940,640.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	391,192	12.860	5,030,729.120	

AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	188,000	5.490	1,032,120.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	161,200	13.520	2,179,424.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	273,000	8.210	2,241,330.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	635,000	21.000	13,335,000.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	583,000	2.410	1,405,030.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.570	891,200.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,443,000	0.900	2,198,700.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	84,720	10.860	920,059.200	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	3.960	1,176,120.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	23.500	1,081,000.000	
TINGYI HOLDING CORP	164,000	9.600	1,574,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	31.550	946,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	248,000	11.760	2,916,480.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	137,333	17.080	2,345,647.640	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	8.450	980,200.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	373,000	5.760	2,148,480.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.710	483,930.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	234,000	14.840	3,472,560.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	483,100	215.800	104,252,980.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	445,000	41.150	18,311,750.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	382,000	5.520	2,108,640.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,097,240	1.050	1,152,102.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	3.020	821,440.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	5.320	861,840.000	
ZTE CORP	58,488	11.360	664,423.680	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.730	932,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	293,000	15.740	4,611,820.000	
COSCO HOLDINGS	227,000	2.720	617,440.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	742,205	5.940	4,408,697.700	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	146,000	10.440	1,524,240.000	

AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	62,500	77.950	4,871,875.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,195,530	5.780	41,590,163.400	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	47,000	52.750	2,479,250.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	8.000	1,824,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	141,000	7.190	1,013,790.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	238,000	3.500	833,000.000	
BANK OF CHINA LTD	6,786,200	3.570	24,226,734.000	
SHUI ON LAND LTD	338,100	2.030	686,343.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	102,000	10.080	1,028,160.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	90,800	10.780	978,824.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	331,470	19.640	6,510,070.800	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,307,235	4.910	30,968,523.850	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	5.070	1,062,672.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	374,000	8.250	3,085,500.000	
CHINA COAL ENERGY CO	162,000	4.380	709,560.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	15.900	858,600.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	48,500	41.000	1,988,500.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	13.420	1,409,100.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	489,142	3.870	1,892,979.540	
CHINA CITIC BANK-H	769,800	5.150	3,964,470.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	539,000	5.540	2,986,060.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	85,000	21.100	1,793,500.000	
FOSUN INTERNATIONAL	217,528	11.980	2,605,985.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	316,000	2.180	688,880.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	249,500	3.470	865,765.000	
SOHO CHINA LTD	196,000	4.010	785,960.000	
KINGSOFT CORP LTD	71,000	19.000	1,349,000.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,096,000	1.090	1,194,640.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	343,000	5.660	1,941,380.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	172,000	8.830	1,518,760.000	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	487,000	4.980	2,425,260.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	224,600	29.650	6,659,390.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	349,000	5.490	1,916,010.000	
CRRC CORP LTD - H	354,450	7.080	2,509,506.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	110,000	13.120	1,443,200.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	200,500	5.450	1,092,725.000	
SINOPHARM GROUP CO	101,600	38.400	3,901,440.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	177,805	10.680	1,898,957.400	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	212,000	4.840	1,026,080.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	277,000	6.300	1,745,100.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	56,800	21.600	1,226,880.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	2.630	899,460.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	178,000	5.190	923,820.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	126,500	11.020	1,394,030.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	67,100	35.050	2,351,855.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	509,380	8.860	4,513,106.800	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.590	922,630.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,133,000	3.370	7,188,210.000	
FAR EAST HORIZON LTD	166,000	7.250	1,203,500.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	187,500	17.040	3,195,000.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	263,600	13.800	3,637,680.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	585,000	3.180	1,860,300.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	25.000	837,500.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	114,000	6.870	783,180.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	253,000	7.340	1,857,020.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	2.890	933,470.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	745,000	2.890	2,153,050.000	

	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	113,000	15.140	1,710,820.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	112,561	19.220	2,163,422.420	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	120,000	5.470	656,400.000	
	CGN POWER CO LTD	892,000	2.320	2,069,440.000	
	GF SECURITIES CO LTD	118,200	17.000	2,009,400.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	131,200	16.480	2,162,176.000	
	3SBIO INC	90,000	8.710	783,900.000	
香港・ドル	小計	65,302,739		580,337,218.030 (7,753,305,233)	
台湾・ドル	ACER INC	235,532	14.450	3,403,437.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	60,554	282.000	17,076,228.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	37,616	113.000	4,250,608.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	545,729	38.800	21,174,285.200	
	ASIA CEMENT CORP	204,928	27.850	5,707,244.800	
	TAIWAN BUSINESS BANK	326,380	8.010	2,614,303.800	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	58,000	42.100	2,441,800.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	60.400	4,711,200.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,312	78.700	3,644,754.400	
	QUANTA COMPUTER INC	229,858	66.400	15,262,571.200	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	63,070	48.000	3,027,360.000	
	EVA AIRWAYS CORP	187,555	14.600	2,738,303.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	246.000	13,716,960.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	438,196	16.300	7,142,594.800	
	CHINA AIRLINES	232,156	9.390	2,179,944.840	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	165,169	66.300	10,950,704.700	
	CHINA STEEL CORP	1,016,058	22.000	22,353,276.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	298,162	28.550	8,512,525.100	
	ADVANTECH CO LTD	26,264	261.000	6,854,904.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	377,304	19.250	7,263,102.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	167,663	165.000	27,664,395.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	57,000	40.150	2,288,550.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	322,327	112.000	36,100,624.000	
	AU OPTRONICS CORP	731,194	11.650	8,518,410.100	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	140,800	111.500	15,699,200.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	160,392	12.000	1,924,704.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	268,824	23.450	6,303,922.800	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	137.000	4,086,025.000	

ECLAT TEXTILE CO LTD	15,022	358.500	5,385,387.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,285	116.500	5,508,702.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	355,633	79.800	28,379,513.400	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	70,000	30.050	2,103,500.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	274,594	85.600	23,505,246.400	
TRANSCEND INFORMATION INC	19,897	90.100	1,792,719.700	
GIANT MANUFACTURING	23,151	222.000	5,139,522.000	
MEDIATEK INC	126,507	241.000	30,488,187.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	574,936	45.000	25,872,120.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	621,632	16.100	10,008,275.200	
HOTAI MOTOR CO LTD	21,000	372.000	7,812,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	140,000	75.200	10,528,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	21,088	98.500	2,077,168.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	833,141	11.250	9,372,836.250	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	705,920	40.000	28,236,800.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,150,403	8.000	9,203,224.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	665,240	18.000	11,974,320.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,324,532	81.100	107,419,545.200	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	945,495	21.800	20,611,791.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	3,680.000	30,249,600.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	755,748	11.600	8,766,676.800	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	739,724	6.830	5,052,314.920	
INVENTEC CO LTD	207,005	25.550	5,288,977.750	
HTC CORPORATION	56,832	94.800	5,387,673.600	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	178,845	45.700	8,173,216.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	875,332	9.260	8,105,574.320	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,382,452	18.150	25,091,503.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	820,282	16.700	13,698,709.400	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	16,950	140.000	2,373,000.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	55,560	83.500	4,639,260.000	
NAN YA PLASTICS CORP	403,828	63.000	25,441,164.000	
WISTRON CORP	224,110	23.800	5,333,818.000	

POU CHEN CORP	188,990	44.100	8,334,459.000		
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	414,297	60.500	25,064,968.500		
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,392	246.000	11,658,432.000		
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	101,480	98.400	9,985,632.000		
PHISON ELECTRONICS CORP	13,658	235.500	3,216,459.000		
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	37.150	2,806,571.050		
RUENTEX INDUSTRIES LTD	45,715	48.450	2,214,891.750		
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	80,588	93.700	7,551,095.600		
SILICONWARE PRECISION INDS	184,743	47.500	8,775,292.500		
STANDARD FOODS CORP	35,653	81.900	2,919,980.700		
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	114,899	34.150	3,923,800.850		
TAIWAN CEMENT CORP	291,874	36.050	10,522,057.700		
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	156,000	27.100	4,227,600.000		
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,108,083	187.500	395,265,562.500		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,030,525	11.650	12,005,616.250		
YULON MOTOR CO	65,149	27.900	1,817,657.100		
INOTERA MEMORIES INC	235,000	29.300	6,885,500.000		
INNOLUX CORPORATION	794,345	10.500	8,340,622.500		
WPG HOLDINGS CO LTD	122,526	36.700	4,496,704.200		
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	17,216	161.000	2,771,776.000		
TAI MED BIOLOGICS INC	13,000	208.500	2,710,500.000		
HERMES MICROVISION INC	4,000	1,380.000	5,520,000.000		
PEGATRON CORP	165,554	80.700	13,360,207.800		
CHAILEASE HOLDING CO LTD	90,076	54.800	4,936,164.800		
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.250	1,927,000.000		
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	68.600	2,358,811.000		
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	643,523	13.900	8,944,969.700		
OBI PHARMA INC	9,000	361.500	3,253,500.000		
CASETEK HOLDINGS LTD	12,000	110.000	1,320,000.000		
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	12,000	380.000	4,560,000.000		
台湾・ドル 小計	27,516,210		1,342,308,117.380 (4,389,347,544)		
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	BIDVEST GROUP LTD	26,558	162.900	4,326,298.200	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	36,673	68.750	2,521,268.750	

DISCOVERY LTD	29,704	109.750	3,260,014.000	
REDEFINE PROPERTIES LTD	370,520	11.060	4,097,951.200	
MASSMART HOLDINGS LTD	9,965	110.500	1,101,132.500	
GOLD FIELDS LTD	73,055	57.860	4,226,962.300	
REMGRO LTD	41,352	223.900	9,258,712.800	
THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	132.840	2,298,264.840	
MMI HOLDINGS LTD	82,706	21.900	1,811,261.400	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	184,806	24.650	4,555,467.900	
EXXARO RESOURCES LTD	12,410	111.050	1,378,130.500	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	663.810	2,113,571.040	
LIBERTY HOLDINGS LTD	10,532	112.130	1,180,953.160	
MTN GROUP LTD	141,118	113.750	16,052,172.500	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,562	187.630	6,860,128.060	
TELKOM SA SOC LTD	20,227	57.460	1,162,243.420	
FIRSTRAND LTD	291,702	45.340	13,225,768.680	
PSG GROUP LTD	8,154	211.000	1,720,494.000	
NASPERS LTD	37,435	2,332.240	87,307,404.400	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	21,138	74.650	1,577,951.700	
NEDBANK GROUP LTD	16,321	216.630	3,535,618.230	
NETCARE LTD	77,025	35.800	2,757,495.000	
PICK'N PAY STORES LTD	30,212	65.630	1,982,813.560	
RMB HOLDINGS LTD	59,473	56.710	3,372,713.830	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	340.000	1,785,340.000	
SAPPI LTD	47,759	76.500	3,653,563.500	
SASOL LTD	47,200	410.110	19,357,192.000	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	36,349	187.500	6,815,437.500	
MR PRICE GROUP LTD	21,087	153.000	3,226,311.000	
BRAIT SE	28,931	100.550	2,909,012.050	
STANDARD BANK GROUP LTD	109,662	140.000	15,352,680.000	
SPAR GROUP LTD/THE	15,747	191.960	3,022,794.120	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,923	77.000	6,462,071.000	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,278	162.000	2,151,036.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,975	305.510	9,463,172.250	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	35,478	150.500	5,339,439.000	
TIGER BRANDS LTD	13,872	384.030	5,327,264.160	
SANLAM LTD	121,375	63.870	7,752,221.250	
INVESTEC LTD	23,104	85.610	1,977,933.440	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	59,865	62.000	3,711,630.000	
PIONEER FOODS LTD	10,707	168.000	1,798,776.000	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	20,406	164.600	3,358,827.600	
MONDI LTD	10,429	292.810	3,053,715.490	

LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	79,370	38.100	3,023,997.000	
RMI HOLDINGS	52,887	39.050	2,065,237.350	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	32,270	31.880	1,028,767.600	
VODACOM GROUP PTY LTD	30,522	147.390	4,498,637.580	
SIBANYE GOLD LTD	64,504	38.580	2,488,564.320	
REMGRO LTD-RTS	4,135	31.900	131,906.500	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	16.300	1,286,836.100	
FORTRESS INCOME FUND LTD	69,755	32.510	2,267,735.050	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	252,443	75.590	19,082,166.370	
BID CORP LTD	27,891	259.960	7,250,544.360	
南アフリカ・ランド 小計	3,178,791		331,362,486.720 (2,392,437,154)	
合計	186,199,723		35,920,091,690 (35,920,091,690)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,191,811.000	19,009,385.450	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	157,000.000	28,384,030.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,348,811.000	47,393,415.450 (260,189,850)	
投資信託受益証券 合計			1,348,811	260,189,850 (260,189,850)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	484,947.320	
		トルコ・リラ 小計	162,734.000	484,947.320 (16,289,381)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	221,300.000	7,798,612.000	
		メキシコ・ペソ 小計	221,300.000	7,798,612.000 (42,814,380)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,966.000	2,457,005.540	
		RESILIENT REIT LTD	26,226.000	3,024,644.580	
南アフリカ・ランド 小計		47,192.000	5,481,650.120 (39,577,514)		
投資証券 合計			431,226	98,681,275 (98,681,275)	
合計				358,871,125 (358,871,125)	

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

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 37銘柄	10.03%	-%	-%	10.31%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.73%	-%	-%	0.75%
インド・ルピー	株式 74銘柄	8.37%	-%	-%	8.61%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.65%	-%	-%	2.72%
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.85%	-%	-%	0.88%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.44%	-%	-%	0.45%
タイ・バーツ	株式 35銘柄	2.04%	-%	-%	2.10%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.15%	-%	-%	0.16%
チリ・ペソ	株式 20銘柄	1.11%	-%	-%	1.14%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	1.07% -%	-% -%	-% 0.04%	1.15%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.28%	-%	-%	0.29%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.27%	-%	-%	1.31%
ブラジル・レアル	株式 60銘柄	7.57%	-%	-%	7.78%
ポーランド・ズロチ	株式 23銘柄	1.05%	-%	-%	1.08%
マレーシア・リンギット	株式 43銘柄	2.58%	-%	-%	2.65%
メキシコ・ペソ	株式 24銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.90% -% -%	-% 0.70% -%	-% -% 0.11%	3.81%
ユーロ	株式 9銘柄	0.18%	-%	-%	0.19%
韓国・ウォン	株式 107銘柄	14.03%	-%	-%	14.43%
香港・ドル	株式 136銘柄	20.78%	-%	-%	21.37%
台湾・ドル	株式 90銘柄	11.76%	-%	-%	12.10%
南アフリカ・ランド	株式 54銘柄 投資証券 2銘柄	6.41% -%	-% -%	-% 0.11%	6.70%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

平成28年10月31日現在

資産総額	323,831,264円
負債総額	5,258,612円
純資産総額(-)	318,572,652円
発行済数量	322,630,744口
1口当たり純資産額(/)	0.9874円

MITO ラップ型ファンド(中立型)

平成28年10月31日現在

資産総額	474,918,227円
負債総額	9,516,116円
純資産総額(-)	465,402,111円
発行済数量	492,052,622口
1口当たり純資産額(/)	0.9458円

MITO ラップ型ファンド(積極型)

平成28年10月31日現在

資産総額	556,374,112円
負債総額	3,124,929円
純資産総額(-)	553,249,183円
発行済数量	609,044,382口
1口当たり純資産額(/)	0.9084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10月31日現在

資産総額	290,566,534,387円
負債総額	2,811,971,620円
純資産総額(-)	287,754,562,767円
発行済数量	139,847,546,154口
1口当たり純資産額(/)	2.0576円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産総額	382,691,101,994円
負債総額	3,095,861,000円
純資産総額(-)	379,595,240,994円
発行済数量	292,293,745,591口
1口当たり純資産額(/)	1.2987円

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産総額	27,250,995,004円
負債総額	183,436,305円
純資産総額(-)	27,067,558,699円
発行済数量	15,436,544,164口
1口当たり純資産額(/)	1.7535円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産総額	255,267,358,155円
負債総額	335,876,115円
純資産総額(-)	254,931,482,040円
発行済数量	100,248,476,550口
1口当たり純資産額(/)	2.5430円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産総額	254,974,936,194円
負債総額	95,208,846円
純資産総額(-)	254,879,727,348円
発行済数量	153,330,058,685口
1口当たり純資産額(/)	1.6623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10月31日現在

資産総額	33,162,261,033円
負債総額	34,330,372円
純資産総額(-)	33,127,930,661円
発行済数量	32,288,125,859口
1口当たり純資産額(/)	1.0260円

コモディティインデックス・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産総額	2,476,500,173円
負債総額	1,500,000円
純資産総額(-)	2,475,000,173円
発行済数量	6,774,678,812口
1口当たり純資産額(/)	0.3653円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年10月31日現在

資産総額	37,953,138,316円
負債総額	188,760,979円
純資産総額(-)	37,764,377,337円
発行済数量	41,805,779,720口
1口当たり純資産額(/)	0.9033円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4)受益権の譲渡の対抗要件

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

(5)受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成28年10月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成28年10月31日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	910,496,212,163
追加型株式投資信託	861	11,216,062,117,507
単位型公社債投資信託	57	364,642,142,940
単位型株式投資信託	96	597,823,643,427
合計	1,052	13,089,024,116,037

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

3．委託会社は、第31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

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、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に變更いたしました。

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

会計上の見積りの変更

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	0	182
ソフトウェア	12,988	442

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	-	2,653

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期(平成27年3月31日現在)

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

第31期(平成28年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
 該当事項はありません。

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

7. 減損処理を行った有価証券
 該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
 該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
 該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
 該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払 手数料	372,837
								預金の預入 (純額)	879,733	現金・ 預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収 収益	123
その他の 関係会 社の子 会社	みずほ第 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	557,013	未払 費用	292,861
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻 (純額)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の 支払	8,336		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

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

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末
(平成28年9月30日現在)

- 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
- 子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式(中間貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
- その他有価証券

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

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

(金銭の信託関係)

第32期中間会計期間末
(平成28年9月30日現在)

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

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

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

第32期中間会計期間
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

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

1．結合当事企業

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

2．企業結合日

平成28年10月1日

3．企業結合の方法

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

4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5．交付した株式数

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

6．企業結合の主な目的

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

7．取得企業を決定するに至った主な根拠

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

8．実施予定の会計処理

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

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

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

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

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	江見 睦生 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1)貸借対照表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	124,850	100,000
工具、器具及び備品（純額）	71,443	90,655
リース資産（純額）	2,140	818
有形固定資産合計	1 198,434	1 191,474
無形固定資産		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
投資その他の資産		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
負債の部		
流動負債		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
未払金		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033
未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
固定負債		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600

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

(2)損益計算書

	（単位： 千円）	
	前事業年度 （自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日）	当事業年度 （自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）
営業収益		
委託者報酬	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405
営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767

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

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位: 千円)

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

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

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位: 千円)

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

(4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

(5) 時効後支払損引当金

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

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

1. 概要

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

2. 適用予定日

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

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

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

追加情報

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

(損益計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

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

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

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

2 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

2 自己株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発効日が翌期となるもの

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

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としております。

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的な時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

資 産

(1) 現金及び預金

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

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

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

(単位:千円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものではありません。

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

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

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

(デリバティブ取引関係)

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

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

前事業年度(平成27年3月31日)

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度(平成28年3月31日)

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）及び当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位: 千円)

第54期中間会計期間
(平成28年9月30日)

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

(2) 中間損益計算書

(単位: 千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：千円)

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

(4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

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

(5) 時効後支払損引当金

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

4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1 発行済株式に関する事項

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

2 . 自己株式に関する事項

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

3 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

（金融商品関係）

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

（単位： 千円）

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

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

資 産

(1) 現金及び預金

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

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

(1) 未払手数料

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

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

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	60,720

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

(有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

1 その他有価証券

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

(2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(重要な後発事象)

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

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

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

（参考）新光投信株式会社の経理状況

1．財務諸表の作成方法について

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

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

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

2．監査証明について

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

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 福村 寛

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 役員賞与引当金

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

(3) 外国税支払損失引当金

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

(4) 訴訟損失引当金

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

(5) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

（6）役員退職慰労引当金

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

（7）執行役員退職慰労引当金

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

4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

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

（未適用の会計基準）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

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

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

（追加情報）

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2. 特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

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

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

2. 自己株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

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

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

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

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

流動性リスクの管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

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

(3) 未収委託者報酬

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

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

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

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

(注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

(有価証券関係)

1. 関連会社株式

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

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

3.売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

(5)年金資産に関する事項

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

関連当事者情報

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

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

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社(非上場)

(1株当たり情報)

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

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

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

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

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

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

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

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

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 訴訟損失引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

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

(中間貸借対照表関係)

1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

2. 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

（金融商品関係）

金融商品の時価等に関する事項

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

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 未払手数料

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

（注）2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1．関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

(追加情報)

役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

役員退職慰労引当金

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

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

執行役員退職慰労引当金

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

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

繰延税金資産

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

(重要な後発事象)

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

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、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。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

(3)投資顧問会社

a. 名称

水戸証券株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末日現在 12,272百万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

投資顧問会社は、委託会社との投資顧問契約に基づき、各ファンドの信託財産の運用助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（安定型）の平成27年12月1日から平成28年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（安定型）の平成28年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（中立型）の平成27年12月1日から平成28年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（中立型）の平成28年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（積極型）の平成27年12月1日から平成28年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（積極型）の平成28年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。