

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年9月12日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 恵正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【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】	ワールドアセットバランス（基本コース） ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	当初申込期間： ワールドアセットバランス（基本コース） 1,000億円を上限とします。 ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） 1,000億円を上限とします。 継続申込期間： ワールドアセットバランス（基本コース） 2,000億円を上限とします。 ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） 2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書の提出に伴い、平成28年11月29日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、あわせて委託会社の統合に伴い一部記載を統一するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

原届出書の「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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々2,000億円とします。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 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

■ 上記資産に関しては、主としてマザーファンド(*)を通じて実質的に投資します。また、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等へ直接投資する場合があります。

■ DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

(*)外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国リート/パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式/パッシブ・マザーファンド、エマージング債券/パッシブ・マザーファンド

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。



2 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、為替リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。



3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

■ 各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

※経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

■ 基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

■ リスク抑制コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値(**))までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(***)を機動的に変更します。

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(**) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本投資比率をもとに運用を行います。

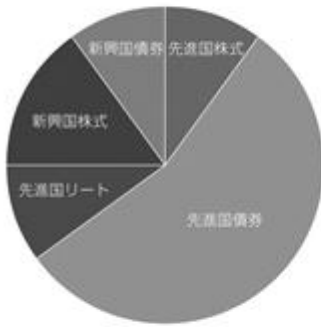
■ 各コース間でスイッチングが可能です。

※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。

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。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。

基本投資比率のイメージ

基本コース リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。
 ※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



※この図においては、左記の5つの資産への投資比率の合計を「合計資産比率」として表示しています。以下同じ。
 ※合計資産比率には、ETFおよび有価証券指数等先物取引等を含みます。

リスク抑制コース

基本投資比率をもとに投資対象資産の合計資産比率を変更し、基準価額の下落の抑制をめざします。



※合計資産比率は、10%～100%程度とします。それにあわせて現金等の比率は変動します。

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少(現金等比率を増加)させることで基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることをめざします。

その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加(現金等比率を減少)させます。
 ※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

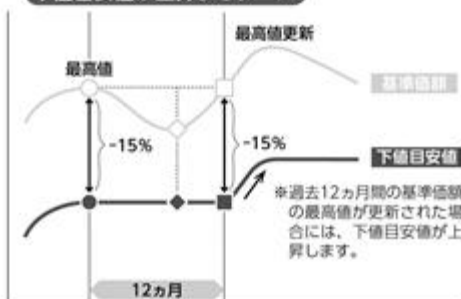
*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

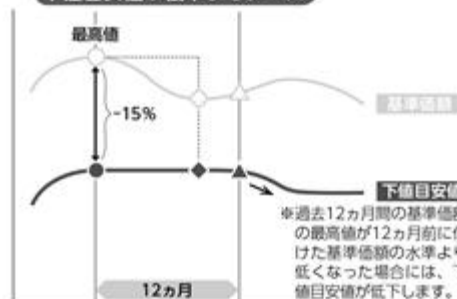
※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が更新された場合には、下値目安値が上昇します。

下値目安値が低下するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が12ヵ月前に付けた基準価額の水準より低くなった場合には、下値目安値が低下します。

※下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去12ヵ月間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去12ヵ月間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。

4

各資産への投資比率の決定にあたっては、
 みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の
 投資助言を活用します。

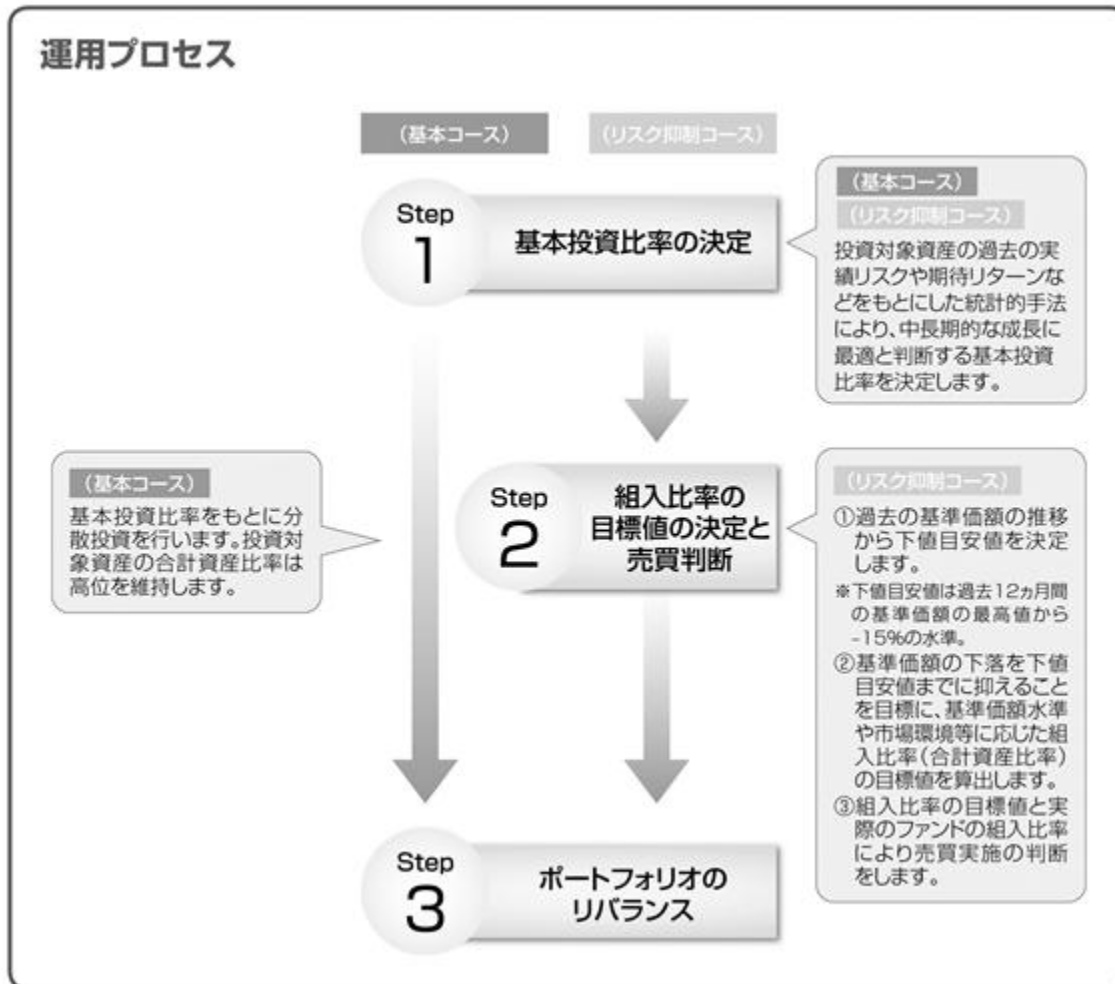
5

年2回決算を行います。

■毎年6月、12月の各11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、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には、分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。



分配方針

年2回の決算時(毎年6月、12月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	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。
海外	目論見書または投資信託約款において、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。
資産複合	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 (日本除く) 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) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)
不動産投信 その他資産 ()	その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
資産複合 (投資信託証 券(債券、株 式、不動産投 信)、先物、 ETF、短期 金融資産) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

資産複合（投資信託証券（債券、株式、不動産投信）、先物、ETF、短期金融資産）資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本除く）	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除く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。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり（フルヘッジ）	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

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

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

（２）【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成29年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始（予定）

<訂正後>

平成29年1月18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】

< 訂正前 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成28年10月1日現在）

(略)

大株主の状況

(平成28年10月1日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

< 訂正後 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成29年6月30日現在）

(略)

大株主の状況

(平成29年6月30日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

(略)

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

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。

<訂正後>

(略)

運用体制は平成29年6月30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。

3【投資リスク】

<訂正前>

<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

(略)

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

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

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

(略)

<リスク管理体制>

(略)

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

<訂正後>

<基準価額の主な変動要因>

各ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、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。

・資産配分リスク

(略)

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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、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。

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

(略)

<リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成29年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

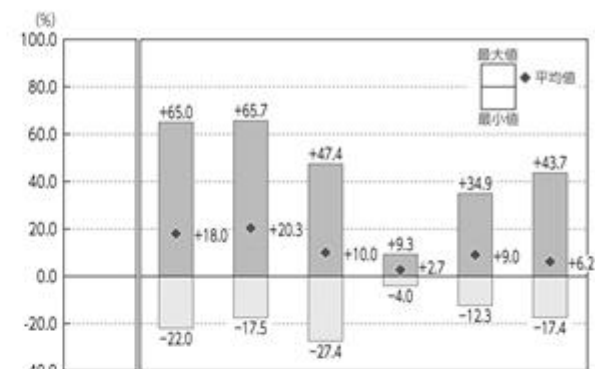
(基本コース)



(リスク抑制コース)

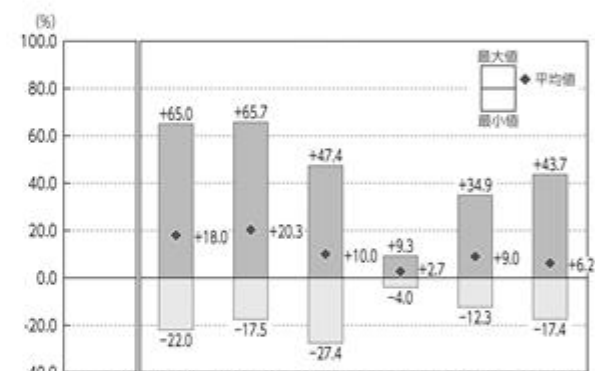


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2017年6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:2012年7月～2017年6月



ファンド:2017年6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:2012年7月～2017年6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2017年6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ぬ。

*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ぬ。

*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(配当込み、円ベース)
 新興国株... MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、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、円換算しております。

日本国債... NOMJURA-BPI国債
 先進国債... シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 新興国債... JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

●「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、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。

●「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。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。

●「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。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。

●「NOMJURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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。また、同社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。

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (3) 信託報酬等」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.2204%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.55%	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0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）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かかる消費税等に相当する金額を含みます。)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

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。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(ジュニアニーサ)」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。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

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解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成29年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。)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ついて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】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成29年6月30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	32,413,696	0.49
内 アメリカ	32,413,696	0.49
親投資信託受益証券	6,366,813,491	96.13
内 日本	6,366,813,491	96.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	223,618,895	3.38
純資産総額	6,622,846,082	100.00

その他資産の投資状況

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	2,905,686,000	43.87
-	2,905,686,000	43.87

（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。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

平成29年6月30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	49,960,960	0.39
内 アメリカ	49,960,960	0.39
親投資信託受益証券	12,275,036,311	96.48
内 日本	12,275,036,311	96.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	397,953,894	3.13
純資産総額	12,722,951,165	100.00

その他資産の投資状況

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	5,954,653,600	46.80
-	5,954,653,600	46.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	264,753,397,086	95.38
内 アメリカ	161,707,951,110	58.25
内 イギリス	18,655,637,131	6.72
内 フランス	10,640,222,759	3.83
内 ドイツ	10,598,616,493	3.82
内 カナダ	10,577,107,282	3.81
内 スイス	10,264,108,185	3.70
内 オーストラリア	7,153,274,137	2.58
内 オランダ	5,216,733,722	1.88
内 アイルランド	4,386,996,805	1.58
内 スペイン	3,863,291,167	1.39
内 スウェーデン	3,195,840,575	1.15
内 香港	2,631,214,671	0.95
内 イタリア	2,170,883,600	0.78
内 シンガポール	2,123,351,849	0.76
内 デンマーク	1,988,595,473	0.72
内 ジャージー	1,559,311,455	0.56
内 バミューダ	1,346,869,350	0.49
内 ベルギー	1,250,235,999	0.45
内 フィンランド	1,144,481,308	0.41
内 オランダ領キュラソー	731,069,745	0.26
内 ケイマン諸島	724,506,046	0.26
内 イスラエル	674,280,751	0.24
内 ノルウェー	670,111,885	0.24
内 ルクセンブルグ	355,601,894	0.13
内 オーストリア	276,270,005	0.10
内 パナマ	181,807,068	0.07
内 ポルトガル	176,811,901	0.06
内 ニュージーランド	175,622,735	0.06
内 リベリア	150,444,684	0.05
内 パプアニューギニア	55,726,875	0.02
内 イギリス領バージン諸島	47,672,923	0.02
内 マン島	37,380,311	0.01
内 モーリシャス	21,367,192	0.01
投資信託受益証券	798,770,477	0.29
内 オーストラリア	685,569,168	0.25
内 シンガポール	113,201,309	0.04
投資証券	6,300,542,971	2.27
内 アメリカ	5,467,320,751	1.97
内 フランス	385,966,535	0.14
内 イギリス	258,818,411	0.09
内 香港	140,538,877	0.05
内 カナダ	47,898,397	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,736,762,269	2.07

純資産総額	277,589,472,803	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	8,958,400	0.00
-	8,958,400	0.00
為替予約取引(売建)	60,599,000	0.02
-	60,599,000	0.02
株価指数先物取引(買建)	5,561,508,870	2.00
内 アメリカ	3,659,040,000	1.32
内 ドイツ	1,071,828,091	0.39
内 イギリス	425,298,588	0.15
内 カナダ	231,090,540	0.08
内 オーストラリア	174,251,651	0.06

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

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30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	4,843,310,882	11.13
内 オーストラリア	3,469,182,237	7.97
内 シンガポール	1,359,454,370	3.12
内 カナダ	14,674,275	0.03
投資証券	38,155,558,355	87.65
内 アメリカ	30,801,692,165	70.76
内 イギリス	2,316,804,074	5.32
内 フランス	1,928,679,606	4.43
内 香港	795,751,524	1.83
内 カナダ	790,133,902	1.82
内 スペイン	367,980,195	0.85
内 ベルギー	337,986,246	0.78
内 ニュージーランド	218,157,257	0.50
内 オランダ	206,026,586	0.47
内 アイルランド	104,329,298	0.24
内 シンガポール	86,500,974	0.20
内 ドイツ	84,844,888	0.19
内 イタリア	38,605,574	0.09
内 ガーンジー	28,431,997	0.07
内 マン島	26,182,697	0.06
内 イスラエル	23,451,372	0.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	533,669,893	1.23
純資産総額	43,532,539,130	100.00

その他資産の投資状況

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	99,226,460	0.23
-	99,226,460	0.23

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	175,214,992,904	99.01
内 アメリカ	77,002,885,491	43.51
内 フランス	17,548,627,357	9.92
内 イタリア	17,122,253,131	9.68
内 ドイツ	12,860,448,115	7.27
内 イギリス	12,573,280,120	7.10
内 スペイン	10,000,327,313	5.65
内 ベルギー	4,490,518,808	2.54
内 オランダ	3,930,344,445	2.22
内 オーストラリア	3,751,577,287	2.12
内 カナダ	3,633,497,421	2.05
内 オーストリア	2,614,691,782	1.48
内 メキシコ	1,631,577,356	0.92
内 アイルランド	1,405,670,106	0.79
内 ポーランド	1,111,989,992	0.63
内 フィンランド	1,070,848,039	0.61
内 デンマーク	1,022,793,593	0.58
内 南アフリカ	880,470,067	0.50
内 スウェーデン	814,911,339	0.46
内 マレーシア	669,118,640	0.38
内 シンガポール	646,380,963	0.37
内 ノルウェー	432,781,539	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,748,919,780	0.99
純資産総額	176,963,912,684	100.00

その他資産の投資状況

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	177,499,000,578	100.30
-	177,499,000,578	100.30

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	45,264,151,081	93.42
内 韓国	7,153,860,733	14.76
内 ケイマン諸島	6,297,136,148	13.00
内 台湾	5,659,960,881	11.68
内 中国	4,438,348,432	9.16
内 インド	4,049,757,859	8.36
内 ブラジル	2,991,654,983	6.17
内 南アフリカ	2,736,990,303	5.65
内 香港	1,609,023,256	3.32
内 ロシア	1,444,847,533	2.98
内 メキシコ	1,296,719,168	2.68
内 インドネシア	1,113,203,418	2.30
内 マレーシア	1,089,660,940	2.25
内 タイ	996,128,353	2.06
内 ポーランド	605,551,782	1.25
内 フィリピン	538,233,262	1.11
内 トルコ	524,324,661	1.08
内 チリ	520,346,649	1.07
内 バミューダ	495,466,209	1.02
内 アラブ首長国連邦	337,827,626	0.70
内 カタール	302,118,765	0.62
内 コロンビア	209,683,107	0.43
内 アメリカ	174,671,347	0.36
内 ハンガリー	156,594,186	0.32
内 オランダ	147,747,600	0.30
内 ギリシャ	96,601,633	0.20
内 チェコ	88,373,702	0.18
内 パキスタン	61,654,352	0.13
内 エジプト	58,810,583	0.12
内 ペルー	26,799,950	0.06
内 マン島	26,567,368	0.05
内 マルタ	15,486,292	0.03
投資信託受益証券	321,093,548	0.66
内 メキシコ	321,093,548	0.66
投資証券	110,794,243	0.23
内 南アフリカ	49,988,971	0.10
内 メキシコ	45,600,514	0.09
内 トルコ	15,204,758	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,755,976,377	5.69
純資産総額	48,452,015,249	100.00

その他資産の投資状況

平成29年6月30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）	221,709,400	0.46
-	221,709,400	0.46
株価指数先物取引（買建）	2,834,504,400	5.85
内 アメリカ	2,834,504,400	5.85

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	89,513,308,815	95.49
内 トルコ	13,294,130,528	14.18
内 メキシコ	11,518,311,280	12.29
内 ロシア	10,171,038,255	10.85
内 ブラジル	9,206,062,880	9.82
内 インドネシア	8,901,262,720	9.50
内 コロンビア	7,801,822,112	8.32
内 フィリピン	6,831,354,096	7.29
内 ハンガリー	4,624,017,888	4.93
内 パナマ	4,261,202,400	4.55
内 ペルー	4,053,026,880	4.32
内 南アフリカ	3,704,323,392	3.95
内 クロアチア	2,855,904,688	3.05
内 ルーマニア	2,290,851,696	2.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,230,447,786	4.51
純資産総額	93,743,756,601	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ワールドアセットバランス(基本コース)

平成29年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	為替フルヘッジ外国債券パ シブ・ファンド・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	2,600,263,608	1.3425 3,490,882,950	1.3348 3,470,831,863	- -	52.41%
2	エマージング株式パシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	857,242,358	1.0815 927,186,997	1.0978 941,080,660	- -	14.21%
3	外国リート・パシブ・ファ ンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	557,078,784	1.1608 646,664,284	1.1832 659,135,617	- -	9.95%
4	外国株式パシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	206,325,378	3.1041 640,468,376	3.1483 649,574,187	- -	9.81%
5	エマージング債券パシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	347,526,710	1.8412 639,876,735	1.8594 646,191,164	- -	9.76%
6	DEUTSCHE X-TRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益 証券	13,300	2,420.32 32,190,256	2,437.12 32,413,696	- -	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29年6月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.49%
親投資信託受益証券	96.13%
合計	96.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

平成29年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	為替フルヘッジ外国債券パ ッシブ・ファンド・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	4,995,638,561	1.3425 6,707,033,114	1.3348 6,668,178,351	- -	52.41%
2	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,667,646,788	1.0816 1,803,743,011	1.0978 1,830,742,643	- -	14.39%
3	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	1,076,268,960	1.1622 1,250,857,179	1.1832 1,273,441,433	- -	10.01%
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	398,493,092	3.1062 1,237,836,708	3.1483 1,254,575,801	- -	9.86%
5	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	671,237,003	1.8424 1,236,689,939	1.8594 1,248,098,083	- -	9.81%
6	DEUTSCHE X-TRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益 証券	20,500	2,420.32 49,616,560	2,437.12 49,960,960	- -	0.39%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年6月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.39%
親投資信託受益証券	96.48%
合計	96.87%

(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。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30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	378,639	15,122.23 5,725,869,831	16,092.15 6,093,119,370	- -	2.20%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	530,114	7,231.83 3,833,699,629	7,670.87 4,066,440,880	- -	1.46%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・通信販売	29,270	93,678.81 2,741,979,005	109,304.15 3,199,332,763	- -	1.15%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	196,051	13,032.31 2,554,999,368	14,855.67 2,912,470,919	- -	1.05%
5	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	170,014	14,992.93 2,549,008,553	16,916.47 2,876,038,430	- -	1.04%
6	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消 耗燃料	299,082	9,275.83 2,774,236,778	9,038.39 2,703,222,748	- -	0.97%
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	258,489	10,030.71 2,592,830,782	10,208.79 2,638,862,503	- -	0.95%
8	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	22,612	91,891.85 2,077,858,668	102,792.47 2,324,343,557	- -	0.84%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・ サービス	21,352	94,086.75 2,008,940,385	105,035.83 2,242,725,255	- -	0.81%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	224,790	8,545.37 1,920,915,970	9,792.06 2,201,159,190	- -	0.79%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	343,838	6,493.75 2,232,801,450	6,247.35 2,148,079,767	- -	0.77%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	723,491	2,694.71 1,949,605,667	2,723.83 1,970,673,725	- -	0.71%
13	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリッ ト	629,434	3,391.35 2,134,637,290	3,026.23 1,904,818,348	- -	0.69%
14	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	443,959	4,564.00 2,026,228,876	4,213.43 1,870,594,608	- -	0.67%
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	184,431	9,840.31 1,814,860,057	9,742.87 1,796,889,101	- -	0.65%
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービ ス	89,522	18,698.39 1,673,918,164	18,961.59 1,697,480,355	- -	0.61%

17	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	429,777	3,668.00 1,576,422,036	3,766.55 1,618,780,857	- -	0.58%
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消 耗燃料	136,394	12,602.23 1,718,869,922	11,661.43 1,590,550,447	- -	0.57%
19	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	161,207	8,791.20 1,417,203,945	9,417.47 1,518,163,214	- -	0.55%
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	87,964	15,832.31 1,392,674,196	17,041.91 1,499,075,450	- -	0.54%
21	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	199,568	6,700.95 1,337,297,185	7,501.75 1,497,111,239	- -	0.54%
22	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,432,243	1,016.44 1,455,800,361	1,043.12 1,494,011,987	- -	0.54%
23	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	341,815	4,261.04 1,456,487,388	4,353.43 1,488,071,093	- -	0.54%
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	294,156	4,539.35 1,335,279,980	5,020.95 1,476,945,509	- -	0.53%
25	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	112,129	11,488.95 1,288,245,595	13,112.95 1,470,343,091	- -	0.53%
26	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	50,742	27,790.04 1,410,122,412	28,902.11 1,466,551,068	- -	0.53%
27	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	293,969	5,406.23 1,589,266,966	4,973.91 1,462,178,288	- -	0.53%
28	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ブ ロバイダー/ヘル スケア・サー ビス	69,576	18,270.55 1,271,192,482	20,750.23 1,443,718,698	- -	0.52%
29	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	198,943	7,353.91 1,463,010,906	7,206.07 1,433,599,173	- -	0.52%
30	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	134,141	9,727.19 1,304,816,335	10,575.03 1,418,546,440	- -	0.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年6月30日現在

種類	投資比率
株式	95.38%
投資信託受益証券	0.29%
投資証券	2.27%
合計	97.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.59%
医薬品		5.88%
石油・ガス・消耗燃料		5.82%
保険		4.19%
ソフトウェア		3.68%
インターネットソフトウェア・サービス		2.99%
資本市場		2.88%
情報技術サービス		2.73%
コンピュータ・周辺機器		2.55%
メディア		2.51%
化学		2.49%
半導体・半導体製造装置		2.45%
各種電気通信サービス		2.29%
バイオテクノロジー		2.27%
ヘルスケア機器・用品		2.06%
食品		2.05%
飲料		2.05%
コングロマリット		2.04%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.00%
航空宇宙・防衛		1.95%
電力		1.91%
ホテル・レストラン・レジャー		1.84%
食品・生活必需品小売り		1.76%
インターネット販売・通信販売		1.72%
専門小売り		1.63%
タバコ		1.63%
機械		1.56%
家庭用品		1.41%
金属・鉱業		1.39%
繊維・アパレル・贅沢品		1.18%
総合公益事業		1.07%
自動車		0.99%
陸運・鉄道		0.91%
各種金融サービス		0.90%
通信機器		0.84%
電気設備		0.78%
パーソナル用品		0.74%
専門サービス		0.61%
エネルギー設備・サービス		0.58%
航空貨物・物流サービス		0.57%
不動産管理・開発		0.55%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.53%
消費者金融		0.49%
家庭用耐久財		0.48%
自動車部品		0.45%
建設関連製品		0.44%
電子装置・機器・部品		0.40%

商業サービス・用品	0.38%
建設資材	0.37%
無線通信サービス	0.37%
複合小売り	0.34%
建設・土木	0.34%
容器・包装	0.31%
商社・流通業	0.30%
運送インフラ	0.27%
旅客航空輸送業	0.16%
ガス	0.15%
紙製品・林産品	0.10%
海運業	0.09%
販売	0.08%
水道	0.08%
レジャー用品	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.03%
各種消費者サービス	0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
合計	95.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30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	106,380	17,783.35 1,891,793,836	18,208.95 1,937,069,164	- -	4.45%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	180,660	6,501.60 1,174,579,056	6,573.27 1,187,528,764	- -	2.73%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	50,930	23,777.60 1,210,993,168	23,247.83 1,184,012,491	- -	2.72%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	124,730	8,640.80 1,077,766,984	8,344.00 1,040,747,120	- -	2.39%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	46,930	21,790.71 1,022,638,489	21,505.11 1,009,235,281	- -	2.32%
6	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	33,910	29,663.44 1,005,887,453	28,473.32 965,530,450	- -	2.22%
7	VENTAS INC アメリカ	投資証券	120,870	7,922.87 957,638,505	7,751.51 936,926,222	- -	2.15%
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	125,050	7,617.12 952,520,856	7,425.60 928,571,280	- -	2.13%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	52,390	14,013.43 734,164,121	13,796.15 722,780,822	- -	1.66%
10	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	54,400	13,336.96 725,530,624	12,648.16 688,059,904	- -	1.58%
11	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,818,950	361.08 656,798,925	358.50 652,109,581	- -	1.50%
12	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	22,330	29,846.87 666,480,830	29,140.15 650,699,772	- -	1.49%
13	LINK REIT 香港	投資証券	755,520	881.06 665,663,730	859.56 649,418,548	- -	1.49%
14	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	58,640	10,379.03 608,626,905	10,455.20 613,092,928	- -	1.41%
15	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	92,941	6,207.03 576,888,504	6,246.23 580,531,791	- -	1.33%
16	HCP INC アメリカ	投資証券	159,490	3,701.60 590,368,184	3,581.75 571,254,902	- -	1.31%
17	GGP INC アメリカ	投資証券	198,240	2,644.31 524,209,996	2,666.71 528,650,572	- -	1.21%
18	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	252,820	2,083.20 526,674,624	2,069.75 523,276,723	- -	1.20%
19	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	651,760	729.94 475,748,692	710.98 463,391,583	- -	1.06%
20	MID AMERICA アメリカ	投資証券	38,830	12,341.27 479,211,902	11,827.20 459,250,176	- -	1.05%
21	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	30,980	13,335.64 413,138,276	13,326.87 412,866,742	- -	0.95%
22	SL GREEN アメリカ	投資証券	34,640	11,929.80 413,248,522	11,840.63 410,159,769	- -	0.94%

23	UDR INC アメリカ	投資証券	90,940	4,490.45 408,362,328	4,390.40 399,262,976	- -	0.92%
24	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	270,140	1,508.92 407,621,404	1,472.47 397,775,477	- -	0.91%
25	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	544,660	719.60 391,940,293	700.64 381,612,434	- -	0.88%
26	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	120,930	3,191.28 385,921,782	3,096.80 374,496,024	- -	0.86%
27	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	42,820	8,746.29 374,516,385	8,683.35 371,821,475	- -	0.85%
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	24,560	13,816.71 339,338,553	14,303.51 351,294,451	- -	0.81%
29	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	49,730	6,718.80 334,126,051	7,053.75 350,783,484	- -	0.81%
30	KLEPIERRE フランス	投資証券	70,520	4,752.40 335,139,952	4,613.31 325,331,220	- -	0.75%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年6月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	11.13%
投資証券	87.65%
合計	98.77%

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.25 01/31/24 アメリカ	国債証券	1,500,800,000	101.82 1,528,114,560	101.17 1,518,494,432	2.250000 2024/1/31	0.86%
2	US T N/B 1.25 11/30/18 アメリカ	国債証券	1,512,000,000	99.87 1,510,155,360	99.91 1,510,639,200	1.250000 2018/11/30	0.85%
3	US T N/B 1.25 10/31/18 アメリカ	国債証券	1,400,000,000	99.88 1,398,348,000	99.90 1,398,684,000	1.250000 2018/10/31	0.79%
4	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,338,400,000	102.65 1,373,947,904	102.55 1,372,582,736	2.375000 2020/12/31	0.78%
5	US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ	国債証券	1,328,320,000	103.41 1,373,708,694	103.30 1,372,260,825	2.625000 2020/11/15	0.78%
6	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,344,000,000	101.70 1,366,888,320	101.44 1,363,420,800	2.125000 2021/12/31	0.77%
7	US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,344,000,000	99.14 1,332,441,600	99.04 1,331,178,240	1.375000 2021/1/31	0.75%
8	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,243,200,000	104.94 1,304,676,240	104.35 1,297,291,632	2.750000 2023/11/15	0.73%
9	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,265,600,000	101.13 1,279,977,216	101.09 1,279,433,008	2.375000 2018/6/30	0.72%
10	US T N/B 0.75 07/15/19 アメリカ	国債証券	1,232,000,000	98.73 1,216,353,600	98.73 1,216,452,160	0.750000 2019/7/15	0.69%
11	US T N/B 1.0 09/15/18 アメリカ	国債証券	1,209,600,000	99.63 1,205,197,056	99.64 1,205,293,824	1.000000 2018/9/15	0.68%
12	US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ	国債証券	1,176,000,000	101.39 1,192,440,480	101.35 1,191,887,760	2.000000 2020/7/31	0.67%
13	US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ	国債証券	1,198,400,000	99.13 1,187,997,888	99.11 1,187,770,192	1.000000 2019/9/30	0.67%
14	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,097,600,000	101.70 1,116,292,128	101.50 1,114,140,832	2.125000 2021/9/30	0.63%
15	US T N/B 0.75 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,120,000,000	99.37 1,113,033,600	99.36 1,112,910,400	0.750000 2018/8/31	0.63%
16	US T N/B 1.0 11/15/19 アメリカ	国債証券	1,120,000,000	99.02 1,109,102,400	99.00 1,108,833,600	1.000000 2019/11/15	0.63%
17	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,120,000,000	98.96 1,108,441,600	98.85 1,107,131,200	1.375000 2021/4/30	0.63%
18	US T N/B 1.125 06/30/21 アメリカ	国債証券	1,120,000,000	97.85 1,096,020,800	97.72 1,094,531,200	1.125000 2021/6/30	0.62%
19	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,047,200,000	103.30 1,081,841,376	103.19 1,080,658,040	2.625000 2020/8/15	0.61%
20	US T N/B 1.625 04/30/23 アメリカ	国債証券	1,097,600,000	98.50 1,081,136,000	98.03 1,075,988,256	1.625000 2023/4/30	0.61%
21	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,052,800,000	99.02 1,042,556,256	98.98 1,042,103,552	1.000000 2019/11/30	0.59%
22	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	1,097,600,000	94.71 1,039,536,960	93.84 1,030,020,768	1.500000 2026/8/15	0.58%
23	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	996,800,000	101.24 1,009,220,128	101.00 1,006,768,000	2.000000 2021/11/15	0.57%

24	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,008,000,000	99.65 1,004,532,480	99.65 1,004,492,160	1.250000 2019/10/31	0.57%
25	US T N/B 1.5 02/28/19 アメリカ	国債証券	952,000,000	100.28 954,675,120	100.25 954,380,000	1.500000 2019/2/28	0.54%
26	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	896,000,000	105.62 946,364,160	105.53 945,593,600	3.625000 2020/2/15	0.53%
27	US T N/B 1.125 12/31/19 アメリカ	国債証券	952,000,000	99.25 944,926,640	99.23 944,745,760	1.125000 2019/12/31	0.53%
28	US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ	国債証券	918,400,000	100.49 922,918,528	100.21 920,402,112	1.875000 2022/3/31	0.52%
29	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	902,720,000	101.30 914,491,468	101.10 912,658,947	2.000000 2021/5/31	0.52%
30	US T N/B 1.25 07/31/23 アメリカ	国債証券	940,800,000	96.17 904,852,032	95.64 899,781,120	1.250000 2023/7/31	0.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年6月30日現在

種類	投資比率
国債証券	99.01%
合計	99.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年6月30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	494,700	3,346.07 1,655,305,363	4,075.40 2,016,100,380	- -	4.16%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・ 周辺機器	8,522	204,870.80 1,745,909,010	235,145.69 2,003,911,655	- -	4.14%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体 製造装置	2,138,083	693.91 1,483,655,338	772.79 1,652,310,542	- -	3.41%
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	98,400	12,666.06 1,246,341,237	15,770.72 1,551,838,848	- -	3.20%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	38,000	21,330.49 810,558,879	21,955.32 834,302,456	- -	1.72%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,287,530	89.98 655,762,985	87.24 635,822,417	- -	1.31%
7	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	532,000	1,212.96 645,299,368	1,192.48 634,402,020	- -	1.31%
8	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,359,532	359.24 488,404,527	437.91 595,366,253	- -	1.23%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,399,235	72.20 462,063,465	75.76 484,857,237	- -	1.00%
10	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	23,600	19,462.31 459,310,659	20,118.56 474,798,016	- -	0.98%
11	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,903,200	53.36 368,356,614	55.10 380,393,932	- -	0.79%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不 動産金融	131,000	2,604.28 341,160,703	2,856.35 374,181,850	- -	0.77%
13	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	281,698	1,308.83 368,696,002	1,237.32 348,551,667	- -	0.72%
14	PING AN INSURANCE GROUP CO- H 中国	株式 保険	456,500	614.76 280,641,685	749.78 342,277,993	- -	0.71%
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体 製造装置	50,844	4,884.06 248,325,601	6,719.84 341,664,053	- -	0.71%

16	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・ 周辺機器	1,534	157,047.65 240,911,097	186,390.00 285,922,260	- -	0.59%
17	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消 耗燃料	112,800	2,431.24 274,244,717	2,437.22 274,918,980	- -	0.57%
18	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	238,600	1,216.78 290,325,268	1,139.60 271,908,560	- -	0.56%
19	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,927,878	84.60 247,719,666	89.17 261,095,277	- -	0.54%
20	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	159,700	1,622.69 259,144,443	1,627.85 259,967,645	- -	0.54%
21	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット 販売・通信販売	57,500	3,696.78 212,565,405	4,424.00 254,380,000	- -	0.53%
22	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	409,495	612.29 250,729,878	618.49 253,269,586	- -	0.52%
23	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	268,696	988.16 265,516,217	937.05 251,783,870	- -	0.52%
24	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	6,900	29,986.36 206,905,895	33,835.20 233,462,880	- -	0.48%
25	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	652,000	331.98 216,452,988	344.40 224,548,800	- -	0.46%
26	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	13,584	14,297.80 194,221,316	15,794.09 214,547,054	- -	0.44%
27	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消 耗燃料	474,700	486.23 230,815,569	446.88 212,133,936	- -	0.44%
28	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消 耗燃料	38,000	5,754.85 218,684,514	5,450.48 207,118,240	- -	0.43%
29	NAVER CORP 韓国	株式 インターネット ソフトウェア・ サービス	2,436	77,539.00 188,885,017	83,679.29 203,842,774	- -	0.42%
30	KB FINANCIAL GROUP INC 韓国	株式 銀行	35,133	4,980.67 174,986,063	5,670.17 199,210,433	- -	0.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年6月30日現在

種類	投資比率
株式	93.42%
投資信託受益証券	0.66%
投資証券	0.23%
合計	94.31%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.40%
インターネットソフトウェア・サービス		9.69%
石油・ガス・消耗燃料		6.16%
コンピュータ・周辺機器		5.80%
半導体・半導体製造装置		5.21%
無線通信サービス		3.39%
保険		3.30%
電子装置・機器・部品		2.83%
金属・鉱業		2.78%
自動車		2.52%
メディア		2.25%
化学		2.21%
不動産管理・開発		2.02%
コングロマリット		1.81%
各種電気通信サービス		1.65%
食品・生活必需品小売り		1.64%
情報技術サービス		1.56%
食品		1.50%
医薬品		1.33%
各種金融サービス		1.23%
資本市場		1.22%
電力		1.04%
インターネット販売・通信販売		1.03%
運送インフラ		1.02%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.95%
飲料		0.94%
建設資材		0.93%
建設・土木		0.81%
自動車部品		0.77%
パーソナル用品		0.75%
家庭用耐久財		0.71%
タバコ		0.71%
ホテル・レストラン・レジャー		0.70%
機械		0.62%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.61%
複合小売り		0.58%
繊維・アパレル・贅沢品		0.53%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.48%

ガス	0.48%
各種消費者サービス	0.44%
家庭用品	0.38%
専門小売り	0.34%
紙製品・林産品	0.34%
バイオテクノロジー	0.27%
旅客航空輸送業	0.26%
水道	0.24%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.22%
ソフトウェア	0.21%
航空宇宙・防衛	0.20%
消費者金融	0.20%
電気設備	0.19%
陸運・鉄道	0.15%
商業サービス・用品	0.11%
海運業	0.08%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.08%
エネルギー設備・サービス	0.08%
総合公益事業	0.07%
航空貨物・物流サービス	0.06%
容器・包装	0.05%
レジャー用品	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
商社・流通業	0.05%
建設関連製品	0.04%
販売	0.04%
通信機器	0.03%
ヘルスケア・テクノロジー	0.03%
合計	93.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	3,308,760,000	121.01 4,004,203,887	120.11 3,974,449,423	7.500000 2030/3/31	4.24%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,556,800,000	99.72 1,552,493,600	98.12 1,527,610,000	4.250000 2025/1/7	1.63%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,187,200,000	120.24 1,427,524,000	121.37 1,440,904,640	5.625000 2050/11/18	1.54%
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,388,800,000	102.44 1,422,724,800	101.10 1,404,076,800	5.000000 2045/6/15	1.50%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,388,800,000	99.07 1,376,020,800	100.35 1,393,660,800	4.750000 2044/3/8	1.49%
6	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	985,600,000	129.75 1,278,910,080	130.79 1,289,066,240	7.350000 2025/7/21	1.38%
7	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,108,800,000	104.23 1,155,772,800	105.05 1,164,794,400	4.000000 2023/10/2	1.24%
8	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	896,000,000	127.61 1,143,416,960	128.49 1,151,270,400	6.700000 2036/1/26	1.23%
9	RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 ロシア	国債証券	1,120,000,000	102.44 1,147,346,144	101.68 1,138,838,400	3.500000 2019/1/16	1.21%
10	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	952,000,000	116.22 1,106,490,000	118.34 1,126,644,400	6.050000 2040/1/11	1.20%
11	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,030,400,000	105.14 1,083,429,312	104.61 1,077,952,960	4.750000 2026/5/27	1.15%
12	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	929,600,000	114.73 1,066,576,000	115.60 1,074,617,600	7.375000 2025/2/5	1.15%
13	TURKEY 7.0 06/05/20 トルコ	国債証券	974,400,000	109.79 1,069,797,568	109.62 1,068,215,232	7.000000 2020/6/5	1.14%
14	TURKEY 6.75 05/30/40 トルコ	国債証券	952,000,000	109.63 1,043,689,472	112.06 1,066,887,360	6.750000 2040/5/30	1.14%
15	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	940,800,000	113.24 1,065,394,176	112.71 1,060,394,496	6.375000 2021/3/29	1.13%
16	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	918,400,000	110.49 1,014,748,000	112.02 1,028,837,600	5.550000 2045/1/21	1.10%
17	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	963,200,000	106.06 1,021,630,400	104.85 1,009,915,200	4.875000 2021/1/22	1.08%
18	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	918,400,000	107.82 990,292,352	107.47 987,087,136	4.875000 2023/9/16	1.05%
19	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,120,000,000	90.61 1,014,888,000	87.40 978,880,000	5.000000 2045/1/27	1.04%

20	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	828,800,000	116.14 962,617,600	115.80 959,750,400	6.125000 2041/1/18	1.02%
21	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 メキシコ	国債証券	918,400,000	104.04 955,584,000	104.45 959,268,800	4.125000 2026/1/21	1.02%
22	TURKEY 6.875 03/17/36 トルコ	国債証券	851,200,000	110.60 941,489,920	112.67 959,047,040	6.875000 2036/3/17	1.02%
23	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	817,600,000	116.20 950,080,880	116.41 951,792,688	6.750000 2022/2/7	1.02%
24	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	896,000,000	106.83 957,247,200	106.09 950,638,080	5.000000 2020/4/29	1.01%
25	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	582,400,000	159.35 928,077,248	161.11 938,345,408	9.500000 2030/2/2	1.00%
26	BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル	国債証券	884,800,000	107.20 948,548,720	105.75 935,676,000	5.875000 2019/1/15	1.00%
27	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	851,200,000	110.75 942,753,280	108.68 925,101,184	5.625000 2042/4/4	0.99%
28	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	940,800,000	97.43 916,686,400	98.07 922,689,600	4.600000 2046/1/23	0.98%
29	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	840,000,000	110.42 927,544,800	109.20 917,280,000	7.375000 2019/3/18	0.98%
30	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	828,800,000	110.21 913,494,400	109.80 910,022,400	5.625000 2044/2/26	0.97%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年6月30日現在

種類	投資比率
国債証券	95.49%
合計	95.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成29年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2017年07月	売建	19,840,000	2,185,351,820	2,221,286,400	33.54%
		香港・ドル売/円買2017年07月	売建	14,110,000	199,477,285	202,337,400	3.06%
		ユーロ売/円買2017年07月	売建	1,080,000	133,470,770	138,207,600	2.09%
		イギリス・ポンド売/円買2017年07月	売建	590,000	82,937,290	86,004,300	1.30%
		オーストラリア・ドル売/円買2017年07月	売建	850,000	70,508,700	73,219,000	1.11%
		南アフリカ・ランド売/円買2017年07月	売建	6,950,000	59,133,560	59,700,500	0.90%
		カナダ・ドル売/円買2017年07月	売建	430,000	35,312,450	37,083,200	0.56%
		メキシコ・ペソ売/円買2017年07月	売建	4,670,000	28,160,100	28,954,000	0.44%
		シンガポール・ドル売/円買2017年07月	売建	260,000	20,688,200	21,114,600	0.32%
		スイス・フラン売/円買2017年07月	売建	180,000	20,491,200	21,070,800	0.32%
		スウェーデン・クローナ売/円買2017年07月	売建	520,000	6,583,200	6,869,200	0.10%
		デンマーク・クローネ売/円買2017年07月	売建	240,000	3,986,400	4,130,400	0.06%
		ニュージーランド・ドル売/円買2017年07月	売建	40,000	3,169,600	3,278,800	0.05%
		ノルウェー・クローネ売/円買2017年07月	売建	110,000	1,426,700	1,467,400	0.02%
イスラエル・シケル売/円買2017年07月	売建	30,000	936,600	962,400	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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

平成29年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2017年07月	売建	40,610,000	4,481,026,060	4,546,695,600	35.74%
		香港・ドル売/円買2017年07月	売建	29,120,000	412,323,438	417,580,800	3.28%
		ユーロ売/円買2017年07月	売建	2,210,000	274,010,350	282,813,700	2.22%
		イギリス・ポンド売/円買2017年07月	売建	1,200,000	169,155,730	174,924,000	1.37%
		オーストラリア・ドル売/円買2017年07月	売建	1,740,000	144,851,070	149,883,600	1.18%
		南アフリカ・ランド売/円買2017年07月	売建	14,370,000	122,362,740	123,438,300	0.97%
		カナダ・ドル売/円買2017年07月	売建	880,000	72,672,280	75,891,200	0.60%
		メキシコ・ペソ売/円買2017年07月	売建	10,590,000	64,129,455	65,658,000	0.52%
		シンガポール・ドル売/円買2017年07月	売建	570,000	45,446,890	46,289,700	0.36%
		スイス・フラン売/円買2017年07月	売建	380,000	43,396,920	44,482,800	0.35%
		スウェーデン・クローナ売/円買2017年07月	売建	860,000	10,887,600	11,360,600	0.09%
		デンマーク・クローネ売/円買2017年07月	売建	390,000	6,477,900	6,711,900	0.05%
		ニュージーランド・ドル売/円買2017年07月	売建	60,000	4,754,400	4,918,200	0.04%
		ノルウェー・クローネ売/円買2017年07月	売建	180,000	2,334,600	2,401,200	0.02%
イスラエル・シュケル売/円買2017年07月	売建	50,000	1,561,000	1,604,000	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。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2017年07月	買建	80,000	8,957,200	8,958,400	0.00%
		イギリス・ポンド売/ 円買2017年07月	売建	310,000	45,187,150	45,191,800	0.02%
		ユーロ売/円買201 7年07月	売建	80,000	10,235,840	10,237,600	0.00%
		オーストラリア・ドル 売/円買2017年0 7月	売建	60,000	5,169,000	5,169,600	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Sep 17	買建	270	3,674,572,440	3,659,040,000	1.32%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 17	買建	242	1,098,703,071	1,071,828,091	0.39%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep17	買建	40	433,968,719	425,298,588	0.15%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT S ep17	買建	15	234,019,584	231,090,540	0.08%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Sep1 7	買建	14	171,101,772	174,251,651	0.06%

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2017年07月	売建	690,000	77,255,850	77,266,200	0.18%
		イギリス・ポンド売/ 円買2017年07月	売建	70,000	10,203,550	10,204,600	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2017年0 7月	売建	80,000	6,892,000	6,892,800	0.02%
		ユーロ売/円買201 7年07月	売建	38,000	4,862,024	4,862,860	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2017年07月	売建	692,483,400	76,907,206,404	77,530,441,464	43.81%
		ユーロ売/円買2017年07月	売建	563,964,100	69,948,467,323	72,170,485,877	40.78%
		イギリス・ポンド売/円買2017年07月	売建	88,765,300	12,501,704,852	12,939,317,781	7.31%
		オーストラリア・ドル売/円買2017年07月	売建	44,234,300	3,712,142,456	3,810,784,945	2.15%
		カナダ・ドル売/円買2017年07月	売建	42,817,400	3,571,399,334	3,692,572,576	2.09%
		メキシコ・ペソ売/円買2017年07月	売建	265,041,700	1,611,453,536	1,643,258,540	0.93%
		ポーランド・ズロチ売/円買2017年07月	売建	37,871,700	1,103,202,621	1,141,074,321	0.64%
		デンマーク・クローネ売/円買2017年07月	売建	60,647,800	1,010,998,826	1,043,748,638	0.59%
		南アフリカ・ランド売/円買2017年07月	売建	109,249,200	925,340,724	939,543,120	0.53%
		スウェーデン・クローナ売/円買2017年07月	売建	62,838,600	797,421,834	830,097,906	0.47%
		マレーシア・リンギット売/円買2017年07月	売建	25,370,000	658,097,800	661,649,600	0.37%
		シンガポール・ドル売/円買2017年07月	売建	8,014,800	641,424,444	650,962,056	0.37%
		ノルウェー・クローネ売/円買2017年07月	売建	33,363,100	434,053,931	445,063,754	0.25%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2017年07月	買建	1,980,000	222,011,020	221,709,400	0.46%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 17	買建	505	2,850,685,040	2,834,504,400	5.85%

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成29年6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。

ワールドアセットバランス(基本コース)

	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29年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
平成29年1月末日	2,494	-	0.9970	-
2月末日	3,387	-	1.0148	-
3月末日	4,335	-	1.0154	-
4月末日	4,757	-	1.0235	-
5月末日	5,763	-	1.0303	-
6月末日	6,622	-	1.0287	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	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29年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
平成29年1月末日	2,823	-	0.9969	-
2月末日	4,466	-	1.0146	-
3月末日	7,263	-	1.0150	-
4月末日	8,165	-	1.0232	-
5月末日	9,521	-	1.0299	-
6月末日	12,722	-	1.0285	-

【分配の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4

(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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4

(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】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876

(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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

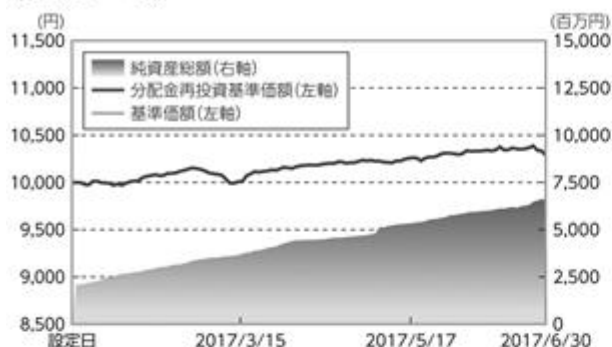
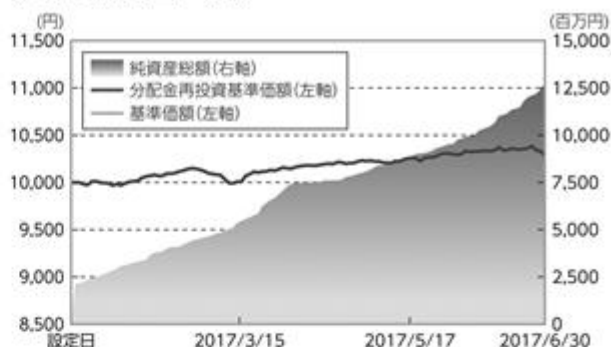
	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722

(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:2017年6月30日

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2017年6月30日)**(基本コース)****(リスク抑制コース)**

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年1月18日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)**■ワールドアセットバランス****(基本コース)**

第1期 (2017.06.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

(リスク抑制コース)

第1期 (2017.06.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況**■ワールドアセットバランス**

※投資比率(%)は、各ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

(基本コース)**組入銘柄一覧**

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	投資比率
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	52.41%
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.21%
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.95%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.81%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.76%
6	DEUTSCHE X-TRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.49%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△43.87

(リスク抑制コース)**組入銘柄一覧**

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	投資比率
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	52.41%
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.39%
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.01%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.86%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.81%
6	DEUTSCHE X-TRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.39%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△46.80

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

○委託会社の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。

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	99.01
内 アメリカ	43.51
内 フランス	9.92
内 イタリア	9.68
内 ドイツ	7.27
内 イギリス	7.10
内 その他	21.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	0.99
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	アメリカ	2.250000	2024/1/31	0.86%
2	US T N/B 1.25 11/30/18	国債証券	アメリカ	1.250000	2018/11/30	0.85%
3	US T N/B 1.25 10/31/18	国債証券	アメリカ	1.250000	2018/10/31	0.79%
4	US T N/B 2.375 12/31/20	国債証券	アメリカ	2.375000	2020/12/31	0.78%
5	US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/11/15	0.78%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△100.30

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	95.49
内 トルコ	14.18
内 メキシコ	12.29
内 ロシア	10.85
内 ブラジル	9.82
内 インドネシア	9.50
内 その他	38.85
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.51
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	ロシア	7.500000	2030/3/31	4.24%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.63%
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.54%
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.50%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.49%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.38
内 アメリカ	58.25
内 イギリス	6.72
内 フランス	3.83
内 ドイツ	3.82
内 カナダ	3.81
内 その他	18.95
投資信託受益証券	0.29
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.27
内 アメリカ	1.97
内 フランス	0.14
内 イギリス	0.09
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.07
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.20%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.46%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.15%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.05%
5	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	1.04%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	銀行	9.59%
2	医薬品	5.88%
3	石油・ガス・消耗燃料	5.82%
4	保険	4.19%
5	ソフトウェア	3.68%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.00
為替予約取引(売建)	△0.02
株価指数先物取引(買建)	2.00

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

■エマージング株式バッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	93.42
内 韓国	14.76
内 ケイマン諸島	13.00
内 台湾	11.68
内 中国	9.16
内 インド	8.36
内 その他	36.46
投資信託受益証券	0.66
内 メキシコ	0.66
投資証券	0.23
内 南アフリカ	0.10
内 メキシコ	0.09
内 トルコ	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.69
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	4.16%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	4.14%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.41%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	3.20%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.72%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	銀行	15.40%
2	インターネットソフトウェア・サービス	9.69%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.16%
4	コンピュータ・周辺機器	5.80%
5	半導体・半導体製造装置	5.21%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.46
株価指数先物取引(買建)	5.85

■外国リート・バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	11.13
内 オーストラリア	7.97
内 シンガポール	3.12
内 カナダ	0.03
投資証券	87.65
内 アメリカ	70.76
内 イギリス	5.32
内 フランス	4.43
内 香港	1.83
内 カナダ	1.82
内 その他	3.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.23
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

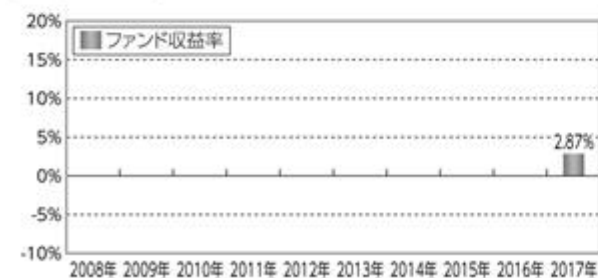
順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	4.45%
2	PROLOGIS INC	アメリカ	2.73%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.72%
4	WELLTOWER INC	アメリカ	2.39%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.32%

その他資産の投資状況

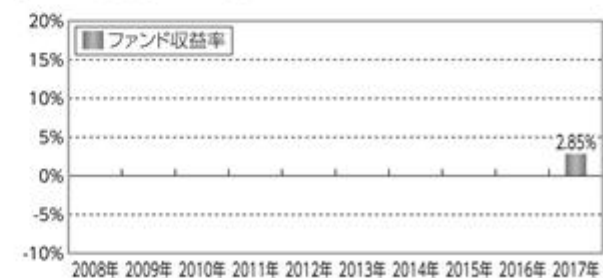
資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.23

年間収益率の推移(暦年ベース)

(基本コース)



(リスク抑制コース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から基準日までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社の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】

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 3 資産管理等の概要 (1) 資産の評価」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
不動産投資信託証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
上場先物取引等	計算日における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

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

基準価額（1万口当たり）は、設定日以降の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）

4【受益者の権利等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 4 受益者の権利等」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

収益分配金請求権

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委託会社または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。

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、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還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、委託会社または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します。)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。

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。

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】

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

<更新・訂正後>

ワールドアセットバランス(基本コース)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年1月18日から平成29年6月12日までとなっております。
- (4) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(平成29年1月18日から平成29年6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】

【ワールドアセットバランス（基本コース）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成29年6月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	605,994
コール・ローン	296,545,173
投資信託受益証券	31,681,535
親投資信託受益証券	5,680,879,342
派生商品評価勘定	16,425,408
流動資産合計	6,026,137,452
資産合計	6,026,137,452
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,669,655
未払解約金	3,954
未払受託者報酬	532,285
未払委託者報酬	19,518,470
その他未払費用	79,781
流動負債合計	21,804,145
負債合計	21,804,145
純資産の部	
元本等	
元本	1 5,806,408,586
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	197,924,721
（分配準備積立金）	145,231,496
元本等合計	6,004,333,307
純資産合計	6,004,333,307
負債純資産合計	6,026,137,452

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日
営業収益	
受取利息	486
有価証券売買等損益	118,290,370
為替差損益	48,423,650
営業収益合計	166,714,506
営業費用	
支払利息	55,046
受託者報酬	532,285
委託者報酬	19,518,470
その他費用	214,682
営業費用合計	20,320,483
営業利益又は営業損失()	146,394,023
経常利益又は経常損失()	146,394,023
当期純利益又は当期純損失()	146,394,023
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()	1,162,527
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	53,097,091
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	53,097,091
剰余金減少額又は欠損金増加額	403,866
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	403,866
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	197,924,721

(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. 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	第1期 平成29年6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>2,088,903,041円</p> <p>3,779,718,421円</p> <p>62,212,876円</p>
2. 受益権の総数	5,806,408,586口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（40,857,743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（104,373,753円）、信託約款に規定される収益調整金（52,693,225円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は197,924,721円（1万口当たり340.87円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6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、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。</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、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。</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	第1期
	平成29年6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	第1期
	平成29年6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	2,084,028
親投資信託受益証券	116,206,342
合計	118,290,370

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第1期			
	平成29年6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	2,579,748,553	-	2,564,992,800	14,755,753
アメリカ・ドル	1,972,008,600	-	1,959,602,000	12,406,600
イギリス・ポンド	74,244,040	-	73,054,800	1,189,240
イスラエル・シユケル	939,900	-	936,600	3,300
オーストラリア・ドル	61,646,250	-	62,160,000	513,750
カナダ・ドル	31,210,920	-	31,118,200	92,720
シンガポール・ドル	20,814,820	-	20,688,200	126,620
スイス・フラン	20,631,240	-	20,491,200	140,040
スウェーデン・クローナ	6,632,808	-	6,583,200	49,608
デンマーク・クローネ	4,023,360	-	3,986,400	36,960
ニュージーランド・ドル	3,136,360	-	3,169,600	33,240
ノルウェー・クローネ	1,444,740	-	1,426,700	18,040
メキシコ・ペソ	27,620,715	-	28,160,100	539,385
ユーロ	119,685,120	-	118,579,200	1,105,920
香港・ドル	182,402,960	-	181,146,600	1,256,360
南アフリカ・ランド	53,306,720	-	53,890,000	583,280
合計	2,579,748,553	-	2,564,992,800	14,755,753

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成29年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.0341円
(1万口当たり純資産額)	(10,341円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年6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	DEUTSCHE X-TRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	13,300.000	287,413.000	
	アメリカ・ドル 小計		13,300.000	287,413.000 (31,681,535)	
投資信託受益証券 合計			13,300	31,681,535 (31,681,535)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	185,831,655	576,468,376	
		外国リート・パッシブ・ファ ンド・マザーファンド	487,108,825	564,364,284	
		為替フルヘッジ外国債券パッ シブ・ファンド・マザーファ ンド	2,327,881,799	3,124,482,950	
		エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	781,824,653	845,386,997	
		エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	309,828,145	570,176,735	
	日本円 小計		4,092,475,077	5,680,879,342	
親投資信託受益証券 合計			4,092,475,077	5,680,879,342	
合計				5,712,560,877 (31,681,535)	

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	0.53%	0.55%

(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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年1月18日から平成29年6月12日までとなっております。
- (4) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(平成29年1月18日から平成29年6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。

【ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 平成29年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		613,017
コール・ローン		384,696,636
投資信託受益証券		48,832,441
親投資信託受益証券		9,994,959,951
派生商品評価勘定		27,149,054
流動資産合計		10,456,251,099
資産合計		10,456,251,099
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,864,845
未払解約金		34,448,198
未払受託者報酬		821,725
未払委託者報酬		30,131,316
その他未払費用		123,196
流動負債合計		69,389,280
負債合計		69,389,280
純資産の部		
元本等		
元本		10,048,037,798
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		338,824,021
（分配準備積立金）		225,690,756
元本等合計		10,386,861,819
純資産合計		10,386,861,819
負債純資産合計		10,456,251,099

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日
営業収益	
受取利息	494
有価証券売買等損益	191,435,322
為替差損益	72,094,314
営業収益合計	263,530,130
営業費用	
支払利息	85,332
受託者報酬	821,725
委託者報酬	30,131,316
その他費用	258,097
営業費用合計	31,296,470
営業利益又は営業損失()	232,233,660
経常利益又は経常損失()	232,233,660
当期純利益又は当期純損失()	232,233,660
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()	6,542,904
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	116,174,713
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	116,174,713
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,041,448
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,041,448
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	338,824,021

(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. 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	第1期 平成29年6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	2,157,741,288円 8,247,023,232円 356,726,722円
2. 受益権の総数	10,048,037,798口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（64,597,295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（161,093,461円）、信託約款に規定される収益調整金（113,133,265円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は338,824,021円（1万口当たり337.20円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6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29年6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	第1期
	平成29年6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	3,148,371
親投資信託受益証券	188,286,951
合計	191,435,322

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第1期			
	平成29年6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	4,444,001,409	-	4,420,717,200	23,284,209
アメリカ・ドル	3,412,419,540	-	3,392,973,800	19,445,740
イギリス・ポンド	131,269,220	-	129,250,800	2,018,420
イスラエル・シユケル	1,566,500	-	1,561,000	5,500
オーストラリア・ドル	109,301,650	-	110,230,400	928,750
カナダ・ドル	51,744,420	-	51,590,700	153,720
シンガポール・ドル	33,623,940	-	33,419,400	204,540
スイス・フラン	33,239,220	-	33,013,600	225,620
スウェーデン・クローナ	10,969,644	-	10,887,600	82,044
デンマーク・クローネ	6,537,960	-	6,477,900	60,060
ニュージーランド・ドル	4,704,540	-	4,754,400	49,860
ノルウェー・クローネ	2,364,120	-	2,334,600	29,520
メキシコ・ペソ	45,719,085	-	46,611,900	892,815
ユーロ	210,565,770	-	208,748,800	1,816,970
香港・ドル	301,775,880	-	299,697,300	2,078,580
南アフリカ・ランド	88,199,920	-	89,165,000	965,080
合計	4,444,001,409	-	4,420,717,200	23,284,209

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成29年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.0337円
(1万口当たり純資産額)	(10,337円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年6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	DEUTSCHE X-TRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	443,005.000	
	アメリカ・ドル	小計	20,500.000	443,005.000 (48,832,441)	
投資信託受益証券 合計			20,500	48,832,441 (48,832,441)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	324,501,695	1,006,636,708	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	876,797,151	1,015,857,179	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,148,586,734	5,568,233,114	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,293,297,893	1,398,443,011	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	546,535,858	1,005,789,939	
	日本円	小計	7,189,719,331	9,994,959,951	
親投資信託受益証券 合計			7,189,719,331	9,994,959,951	
合計				10,043,792,392 (48,832,441)	

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	0.47%	0.49%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「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29年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		3,757,534,985
コール・ローン		236,099,433
株式		261,922,388,422
投資信託受益証券		780,845,176
投資証券		6,202,054,039
派生商品評価勘定		58,066,101
未収入金		23,369,050
未収配当金		544,751,662
差入委託証拠金		1,434,738,404
流動資産合計		274,959,847,272
資産合計		274,959,847,272
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,985,127
未払解約金		259,840,000
流動負債合計		263,825,127
負債合計		263,825,127
純資産の部		
元本等		
元本	1	88,552,177,603
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		186,143,844,542
元本等合計		274,696,022,145
純資産合計		274,696,022,145
負債純資産合計		274,959,847,272

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29年6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	92,335,327,550円
	同期中追加設定元本額	7,216,242,320円
	同期中一部解約元本額	10,999,392,267円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,688,460,733円
	M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,185,275円
	M I T O ラップ型ファンド(中立型)	9,628,667円
	M I T O ラップ型ファンド(積極型)	27,957,802円
	グローバル8資産ラップファンド(安定型)	6,160,298円
	グローバル8資産ラップファンド(中立型)	8,871,853円
	グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,884,033円
	たわらノーロード 先進国株式	3,174,894,890円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	425,349円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	195,572,745円
	D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	35,746,590,470円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	164,078,105円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	867,715,289円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,044,655,683円
	D I A M DC バランス30インデックスファンド	142,948,772円
	D I A M DC バランス50インデックスファンド	408,653,663円
	D I A M DC バランス70インデックスファンド	329,391,295円
	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	37,347,623円
	マネックス資産設計ファンド<育成型>	847,024,117円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	201,414,979円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	28,370,185円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	60,530,898円

D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国30)	115,927,900円
投資のソムリエ	1,085,019,602円
クルーズコントロール	828,472,858円
投資のソムリエ<DC年金>	50,718,738円
D I A M 8 資産バランスファン ドN<DC年金>	96,005,250円
D I A M D C バランス・F (成長型)	51,407,710円
クルーズコントロール<DC年金 >	272,914円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	4,112,941円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	10,816,397円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	19,462,765円
ダイナミック・ナビゲーション	1,631,703円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	187,519,689円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	185,831,655円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	324,501,695円
D I A M外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家専 用)	143,196,331円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向け)	3,123,590,428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)	189,862,329円
D I A M先進国株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	161,410,146円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	87,164,719円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	27,394,127円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	141,691,145円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資 家限定)	273,930,804円
D I A M国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	19,200,702円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	120,555,988円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	10,786,442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)	14,920,537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)	44,480,411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)	117,580,114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)	683,941,290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)	824,912,632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)	2,569,380,302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)	990,758,874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)	630,292,099円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格 機関投資家限定)	1,139,197,857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)	744,686,488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)	8,099,193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)	2,302,217,730円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	1,368,462,961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)	9,095,141,163円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投資 家限定)	490,577,206円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投資 家限定)	1,547,127,988円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資家 限定)	5,806,791,288円
D I A Mバランス3 0 V A (適格 機関投資家限定)	23,707,946円
D I A Mバランス5 0 V A (適格 機関投資家限定)	1,320,182円
D I A Mバランス7 0 V A (適格 機関投資家限定)	12,957,336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)	7,785,150,269円

	D I A Mバランス20VA(適格 機関投資家限定)	78,789,955円
	D I A Mバランス40VA(適格 機関投資家限定)	165,376円
	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	270,704円
	計	88,552,177,603円
2.	受益権の総数	88,552,177,603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29年1月18日 至 平成29年6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29年6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29年6月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	11,182,788,635	
投資信託受益証券	9,456,969	
投資証券	205,156,583	
合計	11,397,402,187	

(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29年2月16日から平成29年6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29年6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	177,702,630	-	177,838,500	135,870
アメリカ・ドル	140,940,856	-	141,078,000	137,144
イギリス・債券	11,242,944	-	11,242,400	544
オーストラリア・ ドル	1,660,020	-	1,660,000	20
カナダ・ドル	4,096,890	-	4,096,500	390
ユーロ	19,761,920	-	19,761,600	320
買 建	52,193,472	-	52,368,300	174,828
イギリス・債券	7,007,460	-	7,026,500	19,040
オーストラリア・ ドル	14,094,020	-	14,110,000	15,980
カナダ・ドル	11,396,952	-	11,470,200	73,248
ユーロ	19,695,040	-	19,761,600	66,560
合計	229,896,102	-	230,206,800	38,958

(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29年6月12日 現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引					
先物取引					
買 建	5,512,483,866	-	5,566,525,882		54,042,016
合計	5,512,483,866	-	5,566,525,882		54,042,016

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年6月12日現在
1口当たり純資産額	3.1021円
(1万口当たり純資産額)	(31,021円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年6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	29,270	978.310	28,635,133.700	
	ABBOTT LABORATORIES	123,985	47.290	5,863,250.650	
	AES CORP	45,579	11.720	534,185.880	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	65,123	154.100	10,035,454.300	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	12.280	731,016.120	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,564	138.050	4,909,610.200	
	CHUBB LTD	33,654	146.560	4,932,330.240	
	AGCO CORP	5,610	67.210	377,048.100	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14,622	145.850	2,132,618.700	
	ALLEGHANY CORP	1,054	591.430	623,367.220	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	62,324	82.900	5,166,659.600	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	70.150	329,915.450	
	ALLSTATE CORP	27,316	87.370	2,386,598.920	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,100	133.790	6,970,459.000	
	AMGEN INC	52,950	164.060	8,686,977.000	
	HESS CORP	20,421	45.490	928,951.290	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,985	80.310	4,415,845.350	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,960	71.860	2,655,945.600	
	AFLAC INC	28,218	78.000	2,201,004.000	
	AMERICAN INTL GROUP	69,779	64.180	4,478,416.220	
	AMERCO	551	358.110	197,318.610	
	ANALOG DEVICES	27,120	78.600	2,131,632.000	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	47.980	1,967,323.940	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	105.380	1,687,660.700	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	68,862	42.070	2,897,024.340	
	TIME WARNER	55,890	99.190	5,543,729.100	
	JONES LANG LASALLE INC	3,815	120.430	459,440.450	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	65.260	2,095,172.300	
	APACHE CORP	28,309	48.340	1,368,457.060	
	ANSYS INC	5,619	124.520	699,677.880	
	APPLE INC	378,639	148.980	56,409,638.220	
	APPLIED MATERIALS INC	78,309	44.740	3,503,544.660	
	ALBEMARLE CORP	7,904	115.400	912,121.600	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	41,382	42.020	1,738,871.640		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	87.990	689,049.690		
AMEREN CORP	17,312	56.290	974,492.480		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	77.110	443,845.160
AUTOLIV INC	6,197	111.940	693,692.180
AUTODESK INC	14,259	105.950	1,510,741.050
AUTOMATIC DATA PROCESSING	32,742	100.110	3,277,801.620
AUTOZONE INC	2,015	606.360	1,221,815.400
AVERY DENNISON CORP	6,262	84.090	526,571.580
AVNET INC	10,288	38.640	397,528.320
BAKER HUGHES INC	28,404	55.530	1,577,274.120
BALL CORP	24,324	40.280	979,770.720
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	89,522	170.000	15,218,740.000
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	74,205	49.400	3,665,727.000
CR BARD INC	5,309	314.250	1,668,353.250
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	58.910	2,054,545.160
BED BATH & BEYOND INC	10,744	35.640	382,916.160
BECTON DICKINSON & CO	15,808	192.000	3,035,136.000
AMETEK INC	16,775	62.380	1,046,424.500
VERIZON COMM INC	293,969	46.720	13,734,231.680
WR BERKLEY CORP	8,134	69.080	561,896.720
BEST BUY CO INC	21,033	58.130	1,222,648.290
YUM! BRANDS INC	23,738	73.100	1,735,247.800
FIRSTENERGY CORP	30,796	29.110	896,471.560
H&R BLOCK INC	16,114	26.190	422,025.660
BOEING CO	41,995	190.030	7,980,309.850
ROBERT HALF INTL INC	8,158	47.250	385,465.500
BORGWARNER INC	14,648	42.960	629,278.080
BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,578	27.820	2,798,079.960
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	67.860	671,406.840
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	593.950	1,091,680.100
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	120,268	53.750	6,464,405.000
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	162.490	615,512.120
INGREDION INC	5,305	115.830	614,478.150
ONEOK INC	16,401	49.450	811,029.450
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,405	99.480	438,209.400
UNITED RENTALS INC	6,332	110.220	697,913.040
SEMPRA ENERGY	16,912	115.000	1,944,880.000
FEDEX CORP	18,672	206.400	3,853,900.800
VERISIGN INC	6,321	92.330	583,617.930
AMPHENOL CORP	21,490	75.760	1,628,082.400
BROWN-FORMAN CORP	13,612	49.160	669,165.920
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,337	62.360	1,392,935.320
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.200	660,878.400
CSX CORP	66,444	53.050	3,524,854.200

CABOT OIL & GAS CORP	32,261	22.880	738,131.680
CAMPBELL SOUP CO	14,050	56.540	794,387.000
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	42.370	984,636.430
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	181.000	2,215,440.000
CARDINAL HEALTH INC	22,125	75.200	1,663,800.000
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	63.340	1,578,179.440
CATERPILLAR INC	42,279	105.920	4,478,191.680
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	110.800	1,089,385.600
CELGENE CORP	55,976	118.190	6,615,803.440
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	106.710	385,436.520
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	78.320	853,374.720
CENTURYLINK INC	39,384	26.110	1,028,316.240
CERNER CORP	20,809	66.280	1,379,220.520
JPMORGAN CHASE & CO	258,489	86.960	22,478,203.440
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	53.000	997,566.000
CIGNA CORP	19,066	166.740	3,179,064.840
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	71.780	788,287.960
CINTAS CORP	6,282	123.700	777,083.400
CISCO SYSTEMS INC	361,836	31.370	11,350,795.320
CLOROX COMPANY	9,331	137.140	1,279,653.340
COCA-COLA CO/THE	294,156	45.320	13,331,149.920
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,959	75.770	4,543,093.430
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,366	102.420	2,393,145.720
COMERICA INC	12,068	72.670	876,981.560
COMCAST CORP-CL A	341,815	40.690	13,908,452.350
CA INC	22,732	31.710	720,831.720
CONAGRA BRANDS INC	31,942	38.760	1,238,071.920
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	83.250	1,810,687.500
CMS ENERGY CORP	22,372	46.980	1,051,036.560
COOPER COS INC	3,794	237.430	900,809.420
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	87.400	1,210,927.000
CORNING INC	65,641	28.950	1,900,306.950
WR GRACE & CO	5,923	70.650	418,459.950
SEALED AIR CORP	13,870	44.140	612,221.800
CUMMINS INC	11,239	159.230	1,789,585.970
DR HORTON INC	24,498	33.620	823,622.760
DANAHER CORP	44,764	84.490	3,782,110.360
MOODY'S CORP	12,924	116.820	1,509,781.680
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,287	66.310	2,870,360.970
TARGET CORP	37,486	56.900	2,132,953.400
DEERE & CO	19,364	125.950	2,438,895.800
MORGAN STANLEY	102,200	44.910	4,589,802.000
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	63.940	1,110,957.500
COSTAR GROUP INC	2,278	252.550	575,308.900
THE WALT DISNEY CO	113,350	105.620	11,972,027.000

DOLLAR TREE INC	17,493	75.380	1,318,622.340
DOVER CORP	10,736	83.020	891,302.720
DOW CHEMICAL	86,616	64.740	5,607,519.840
OMNICOM GROUP	16,993	81.500	1,384,929.500
DTE ENERGY CO	13,122	108.980	1,430,035.560
DUKE ENERGY CORP	51,765	85.720	4,437,295.800
FLOWSERVE CORP	8,406	47.300	397,603.800
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	92.120	869,244.320
EBAY INC	73,800	34.940	2,578,572.000
BANK OF AMERICA CORP	723,491	23.670	17,125,031.970
CITIGROUP INC	199,568	64.450	12,862,157.600
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	82.560	841,534.080
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	36.940	692,255.600
EATON CORP PLC	32,234	75.740	2,441,403.160
EATON VANCE CORP	9,184	48.710	447,352.640
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	34.720	724,849.440
DISH NETWORK CORP	16,150	65.020	1,050,073.000
ECOLAB INC	19,009	133.810	2,543,594.290
ELECTRONIC ARTS INC	23,105	110.460	2,552,178.300
SALESFORCE.COM INC	47,199	87.270	4,119,056.730
EMERSON ELECTRIC CO	45,639	60.710	2,770,743.690
ATMOS ENERGY CORP	8,221	83.640	687,604.440
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	4.460	314,162.400
ENTERGY CORP	13,984	79.280	1,108,651.520
EOG RESOURCES INC	42,707	90.080	3,847,046.560
EQUIFAX INC	8,495	135.520	1,151,242.400
EQT CORP	13,874	56.490	783,742.260
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	96.350	1,554,510.900
EXPEDITORS INTERNATIONAL	11,457	54.810	627,958.170
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	42,945	61.410	2,637,252.450
EXXON MOBIL CORP	299,082	82.130	24,563,604.660
FMC CORP	10,694	76.620	819,374.280
NEXTERA ENERGY INC	34,612	140.240	4,853,986.880
ASSURANT INC	4,089	101.680	415,769.520
FASTENAL CO	21,654	43.520	942,382.080
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	25.060	1,307,455.380
M&T BANK CORP	9,799	163.360	1,600,764.640
FISERV INC	15,880	122.860	1,951,016.800
FLIR SYSTEMS INC	11,623	36.850	428,307.550
MACY'S INC	24,512	22.700	556,422.400
FORD MOTOR CO	263,347	11.130	2,931,052.110
FRANKLIN RESOURCES INC	22,859	43.680	998,481.120
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	12.360	1,196,596.320
FLEX LTD	35,913	17.330	622,372.290
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	57.880	704,746.880
GAP INC/THE	18,295	22.830	417,674.850
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	63.340	1,106,993.180
GENERAL DYNAMICS CORP	18,563	199.470	3,702,761.610

GENERAL MILLS INC	40,614	57.090	2,318,653.260
GENUINE PARTS CO	11,094	91.610	1,016,321.340
GILEAD SCIENCES INC	93,706	64.700	6,062,778.200
GARTNER INC	5,570	118.710	661,214.700
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	35.450	641,538.650
MCKESSON CORP	15,054	163.390	2,459,673.060
NVIDIA CORP	38,827	149.600	5,808,519.200
GENERAL ELECTRIC CO	629,434	27.940	17,586,385.960
VW GRAINGER INC	3,832	176.330	675,696.560
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	18.620	414,034.320
HALLIBURTON CO	61,429	44.850	2,755,090.650
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	50.050	1,477,576.100
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,103	222.440	5,806,351.320
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	53.280	687,365.280
HARRIS CORP	8,954	109.060	976,523.240
HASBRO INC	7,736	107.900	834,714.400
HENRY SCHEIN INC	5,713	185.750	1,061,189.750
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	53.270	384,236.510
HERSHEY FOODS CORP	10,132	114.020	1,155,250.640
HP INC	122,725	17.800	2,184,505.000
F5 NETWORKS INC	4,874	129.300	630,208.200
CROWN HOLDINGS INC NPR	8,582	57.360	492,263.520
REYNOLDS AMERICAN INC	63,698	65.310	4,160,116.380
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	130.190	448,764.930
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.610	793,641.400
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	25.660	356,366.080
HOLOGIC INC	17,500	44.670	781,725.000
UNUM GROUP	16,000	46.490	743,840.000
HOME DEPOT INC	87,964	152.960	13,454,973.440
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	90.230	1,162,794.010
HORMEL FOODS CORP	23,322	34.770	810,905.940
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	28.240	902,324.480
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	178.660	417,528.420
HUMANA INC	11,161	229.690	2,563,570.090
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	88.460	524,302.420
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	13.290	998,889.690
RED HAT INC	13,472	88.850	1,196,987.200
BIOGEN INC	15,451	259.890	4,015,560.390
IDEX CORP	4,479	110.990	497,124.210
ILLINOIS TOOL WORKS	22,278	144.800	3,225,854.400
INTUIT INC	17,739	140.210	2,487,185.190
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	164.560	1,029,322.800
INGERSOLL-RAND PLC	19,490	88.110	1,717,263.900
INTEL CORP	340,372	35.710	12,154,684.120
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	137.200	765,301.600
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	54.890	1,557,503.750

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	24.070	701,808.990	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	54.950	435,808.450	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,312	103.270	445,300.240	
INCYTE CORP	12,360	119.040	1,471,334.400	
JOHNSON & JOHNSON	196,051	131.530	25,786,588.030	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	51.510	1,315,050.300	
ENBRIDGE INC	50,819	38.700	1,966,695.300	
KLA-TENCOR CORP	11,724	101.980	1,195,613.520	
DEVON ENERGY CORP	34,184	32.580	1,113,714.720	
WESTAR ENERGY INC	9,911	52.960	524,886.560	
KELLOGG CO	18,922	72.660	1,374,872.520	
EAST WEST BANCORP INC	9,098	58.430	531,596.140	
KEYCORP	81,264	18.620	1,513,135.680	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,358	128.770	3,265,349.660	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,646	418.500	3,618,351.000	
KOHL'S CORP	14,862	37.870	562,823.940	
KROGER CO	66,588	30.780	2,049,578.640	
LAM RESEARCH CORP	11,522	157.780	1,817,941.160	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,455	104.950	782,402.250	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	48.130	607,496.860	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	52.170	500,205.960	
LENNAR CORP	14,850	52.000	772,200.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	25.280	542,559.360	
ELI LILLY & CO	71,610	81.040	5,803,274.400	
L BRANDS INC	18,583	52.300	971,890.900	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,276	68.250	1,179,087.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	50,402	107.030	5,394,526.060	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	59.210	1,436,789.860	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,908	277.000	5,237,516.000	
LOEWS CORP	21,346	47.470	1,013,294.620	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	23.170	317,359.490	
LOWE'S COS INC	63,367	78.650	4,983,814.550	
DOMINION ENERGY INC	45,131	79.280	3,577,985.680	
SCANA CORP	10,902	68.050	741,881.100	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	31.980	1,029,692.040	
MCCORMICK & CO INC	7,476	104.400	780,494.400	
MCDONALD'S CORPORATION	60,045	151.480	9,095,616.600	
S&P GLOBAL INC	18,409	146.810	2,702,625.290	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	255.570	836,225.040	
MANPOWERGROUP INC	4,257	104.650	445,495.050	
MARKEL CORPORATION	989	992.010	981,097.890	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	116.120	1,831,909.120	
MARSH & MCLENNAN COS	38,323	78.230	2,998,008.290	

MASCO CORP	23,043	37.220	857,660.460
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	234.820	1,030,155.340
MATTEL INC	24,003	22.270	534,546.810
METLIFE INC	67,501	52.840	3,566,752.840
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	47.080	957,701.360
MEDTRONIC PLC	98,849	86.510	8,551,426.990
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,233	58.030	2,915,020.990
CVS HEALTH CORP	73,660	79.710	5,871,438.600
MERCK & CO. INC.	198,943	64.390	12,809,939.770
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	140.610	1,009,017.360
MICROSOFT CORP	530,114	70.320	37,277,616.480
MICRON TECH INC	76,146	30.600	2,330,067.600
MIDDLEBY CORP	4,100	130.950	536,895.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,176	83.480	1,266,892.480
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,922	17.260	602,753.720
3M CO	43,056	206.930	8,909,578.080
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,759	240.160	1,142,921.440
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,150	86.170	960,795.500
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	99.590	721,728.730
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	25.210	313,688.030
MYLAN NV	34,754	40.090	1,393,287.860
ILLUMINA INC	10,453	174.080	1,819,658.240
XCEL ENERGY INC	37,554	47.350	1,778,181.900
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	34.210	921,548.980
NETAPP INC	20,641	39.520	815,732.320
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	30.060	413,024.400
NEWELL BRANDS INC	32,324	53.240	1,720,929.760
NEWMONT MINING CORP	38,093	34.300	1,306,589.900
NVR INC	229	2,376.090	544,124.610
NIKE INC-CL B	94,835	53.460	5,069,879.100
NOBLE ENERGY INC	31,005	29.120	902,865.600
NORDSTROM INC	9,487	47.160	447,406.920
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,706	118.920	2,581,277.520
EVERSOURCE ENERGY	23,085	62.300	1,438,195.500
NISOURCE INC	22,198	25.770	572,042.460
COACH INC	19,175	46.720	895,856.000
NORTHERN TRUST CORP	16,090	91.750	1,476,257.500
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,954	256.690	3,068,472.260
WELLS FARGO & CO	343,838	53.800	18,498,484.400
NUCOR CORP	23,780	59.790	1,421,806.200
MONSANTO CO	32,099	117.520	3,772,274.480
CHENIERE ENERGY INC	15,927	49.250	784,404.750
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,190	80.070	2,737,593.300
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,049	61.010	3,297,529.490

OGE ENERGY CORP	16,028	35.370	566,910.360
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	232.840	1,484,355.000
ORACLE CORP	222,070	45.030	9,999,812.100
PACCAR INC	24,366	64.010	1,559,667.660
EXELON CORP	69,607	36.620	2,549,008.340
PARKER HANNIFIN CORP	9,981	157.040	1,567,416.240
PATTERSON COS INC	7,169	46.130	330,705.970
PAYCHEX INC	23,141	58.560	1,355,136.960
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	64.950	423,863.700
MEDNAX INC	7,824	55.980	437,987.520
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	148.850	782,206.750
PPL CORPORATION	49,957	39.200	1,958,314.400
PEPSICO INC	103,033	115.940	11,945,646.020
PENTAIR PLC	11,775	66.260	780,211.500
PFIZER INC	429,777	32.770	14,083,792.290
CONOCOPHILLIPS	87,671	44.820	3,929,414.220
PVH CORP	5,387	105.590	568,813.330
PG&E CORP	37,651	68.410	2,575,704.910
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	169.450	2,060,173.100
ALTRIA GROUP INC	140,294	75.460	10,586,585.240
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,864	123.170	4,294,198.880
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	87.410	437,924.100
GARMIN LTD	7,795	51.890	404,482.550
AETNA INC	25,247	149.790	3,781,748.130
FLUOR CORP (NEW)	9,821	46.350	455,203.350
PPG INDUSTRIES INC	17,934	109.930	1,971,484.620
PRAXAIR INC	20,519	136.190	2,794,482.610
COSTCO WHOLESALE CORP	31,576	180.380	5,695,678.880
T ROWE PRICE GROUP INC	18,304	73.270	1,341,134.080
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	108.410	1,125,078.980
PROCTER & GAMBLE CO	184,431	88.160	16,259,436.960
PROGRESSIVE CORP	41,336	43.480	1,797,289.280
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	44.330	1,645,307.950
PULTE GROUP INC	21,209	23.440	497,138.960
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	13.670	415,403.960
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	89.100	959,517.900
QUALCOMM INC	106,032	57.050	6,049,125.600
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	78.290	797,540.230
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	142.430	503,490.050
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	475.790	2,692,495.610
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	127.940	593,897.480
AUTONATION INC	5,772	40.650	234,631.800

RESMED INC	11,376	73.480	835,908.480
US BANCORP	122,040	52.890	6,454,695.600
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	64.810	474,214.770
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	92.800	804,947.200
ROSS STORES INC	28,189	61.960	1,746,590.440
ROLLINS INC	5,357	42.470	227,511.790
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,021	228.840	1,606,685.640
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,667	162.130	1,567,310.710
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	109.820	1,350,017.260
RAYTHEON COMPANY	21,099	160.940	3,395,673.060
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	241.360	928,753.280
ACCENTURE PLC-CL A	44,729	125.820	5,627,802.780
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	109,427	45.620	4,992,059.740
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	145.660	1,288,945.340
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	104.990	1,268,909.140
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	125.230	2,473,918.650
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	23,052	84.610	1,950,429.720
PRICELINE GROUP INC	3,537	1,842.120	6,515,578.440
SCHLUMBERGER LTD	99,838	69.680	6,956,711.840
SCHWAB (CHARLES) CORP	88,020	41.290	3,634,345.800
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	125.010	1,772,016.750
BUNGE LTD	10,334	79.060	817,006.040
SEI INVESTMENTS CO	11,107	52.030	577,897.210
ANTHEM INC	19,543	186.920	3,652,977.560
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	92.100	1,128,869.700
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	64.910	1,391,800.220
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	352.910	2,102,637.780
CENTENE CORP	12,713	77.500	985,257.500
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	180.660	626,528.880
SMITH (A.O.) CORP	9,565	56.040	536,022.600
VCA INC	5,491	92.460	507,697.860
ACUITY BRANDS INC	3,087	177.180	546,954.660
SNAP-ON INC	3,932	157.510	619,329.320
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,741	107.750	3,312,342.750
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	128.360	676,842.280
EDISON INTERNATIONAL	24,139	81.290	1,962,259.310
SOUTHERN CO	73,354	50.680	3,717,580.720
BB&T CORP	59,828	44.110	2,639,013.080
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	59.460	674,989.920
AT&T INC	443,959	38.790	17,221,169.610
CHEVRON CORP	136,394	106.400	14,512,321.600
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,629	139.990	1,487,953.710

STAPLES INC	52,662	9.250	487,123.500
STATE STREET CORP	27,099	87.350	2,367,097.650
STARBUCKS CORP	106,191	62.190	6,604,018.290
STEEL DYNAMICS INC	15,309	36.030	551,583.270
STRYKER CORP	25,117	141.870	3,563,348.790
NETFLIX INC	30,997	158.030	4,898,455.910
STERICYCLE INC	6,853	79.010	541,455.530
SUNTRUST BANKS INC	34,756	56.550	1,965,451.800
SYMANTEC CORP	46,581	29.710	1,383,921.510
SYNOPSYS INC	10,656	74.930	798,454.080
SYSCO CORP	38,654	55.190	2,133,314.260
INTUITIVE SURGICAL INC	2,837	916.340	2,599,656.580
TELEFLEX INC	3,203	200.000	640,600.000
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	67,717	30.220	2,046,407.740
TESORO CORP	9,395	91.780	862,273.100
TEXAS INSTRUMENTS INC	71,769	80.900	5,806,112.100
TEXTRON INC	19,076	47.290	902,104.040
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,346	174.930	4,958,565.780
TIFFANY & CO	8,733	94.690	826,927.770
TOLL BROTHERS INC	9,526	37.840	360,463.840
TORCHMARK CORP	7,699	76.760	590,975.240
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	59.470	670,762.130
DAVITA INC	12,245	64.470	789,435.150
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	57.020	528,917.520
TRIMBLE INC	20,073	36.320	729,051.360
TYSON FOODS INC	21,621	60.750	1,313,475.750
UGI CORP	12,068	49.740	600,262.320
MARATHON OIL CORP	66,702	12.540	836,443.080
UNION PACIFIC CORP	58,542	109.750	6,424,984.500
UNITED TECHNOLOGIES CORP	55,039	120.640	6,639,904.960
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,576	181.460	12,625,260.960
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	113.430	720,393.930
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	102.270	700,344.960
VF CORP	24,309	55.330	1,345,016.970
CBS CORP	26,212	60.710	1,591,330.520
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	122.660	2,176,233.720
VULCAN MATERIALS CO	9,977	130.330	1,300,302.410
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66,096	80.990	5,353,115.040
WAL-MART STORES INC	111,141	79.420	8,826,818.220
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	72.650	2,340,492.400
WATERS CORP	5,963	184.990	1,103,095.370
ALLERGAN PLC	24,096	232.360	5,598,946.560
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	127.160	1,113,285.800

VAIL RESORTS INC	2,598	202.100	525,055.800
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	86.010	1,764,581.160
WABTEC CORP	5,497	86.070	473,126.790
WHIRLPOOL CORP	5,553	190.980	1,060,511.940
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	107.010	1,447,738.290
WYNN RESORTS LTD	6,279	129.590	813,695.610
WHOLE FOODS MARKET INC	22,675	35.730	810,177.750
NASDAQ INC	9,132	70.540	644,171.280
CME GROUP INC	25,149	124.390	3,128,284.110
WILLIAMS COS INC	61,081	29.390	1,795,170.590
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	40.020	299,709.780
LKQ CORP	22,948	31.970	733,647.560
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	41.260	675,962.580
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	63.130	1,459,376.210
FOOT LOCKER INC	9,476	54.780	519,095.280
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	39.760	740,768.560
CARMAX INC	13,513	59.610	805,509.930
XEROX CORP	69,821	6.940	484,557.740
XILINX INC	18,777	65.400	1,228,015.800
YAHOO! INC	66,277	54.020	3,580,283.540
CIMAREX ENERGY CO	7,003	99.890	699,529.670
TJX COMPANIES INC	46,499	73.680	3,426,046.320
ZIONS BANCORP	12,690	42.340	537,294.600
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	7.810	739,607.000
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	66.600	1,045,620.000
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	42.400	725,040.000
SIGNATURE BANK	4,171	152.690	636,869.990
CBRE GROUP INC	20,976	34.940	732,901.440
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	29.350	471,742.550
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	14.400	1,216,598.400
DOMINO'S PIZZA INC	3,935	206.190	811,357.650
T-MOBILE US INC	21,188	63.840	1,352,641.920
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	63.690	1,807,968.030
MOSAIC CO/THE	26,525	23.510	623,602.750
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	30,914	27.700	856,317.800
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	28.160	2,121,574.400
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	76.250	417,316.250
CELANESE CORP	10,766	90.120	970,231.920
DEXCOM INC	6,161	68.990	425,047.390
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	26.100	272,040.300
EXPEDIA INC	8,709	143.590	1,250,525.310

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	27.250	503,443.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,627	126.490	1,470,699.230	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	47,162	28.240	1,331,854.880	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,489	63.970	2,845,961.330	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	21.880	321,548.480	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	35.400	871,264.800	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	460.850	832,755.950	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	78.830	488,036.530	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	269.930	1,028,973.160	
MASTERCARD INC	68,783	123.040	8,463,060.320	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	23.790	702,542.490	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	98.900	735,420.400	
HANESBRANDS INC	27,619	22.070	609,551.330	
WESTERN UNION CO	35,222	19.010	669,570.220	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	55.370	516,159.140	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	45.410	526,120.260	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	22.530	407,770.470	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	74.240	618,419.200	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,440	17.670	325,834.800	
DELTA AIR LINES INC	14,611	53.010	774,529.110	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	35.240	223,914.960	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	60.570	1,646,110.890	
TE CONNECTIVITY LTD	25,036	79.590	1,992,615.240	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	123.880	1,307,181.760	
WABCO HOLDING INC	3,176	124.210	394,490.960	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,052	51.700	467,988.400	
VMWARE INC	5,491	87.630	481,176.330	
MERCADOLIBRE INC	2,861	275.070	786,975.270	
ULTA BEAUTY INC	4,332	307.870	1,333,692.840	
INVESCO LTD	29,824	34.320	1,023,559.680	
MSCI INC	6,462	104.020	672,177.240	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	112,129	120.120	13,468,935.480	
VISA INC	134,141	94.560	12,684,372.960	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	91.400	1,149,080.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	79.260	950,485.920	

SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	67.200	442,512.000	
SIGNET JEWELERS LTD	4,205	59.490	250,155.450	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- C	16,085	25.270	406,467.950	
MARATHON PETROLEUM CORP	39,747	54.710	2,174,558.370	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	63.310	735,915.440	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	131.930	240,904.180	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	140,475	19.080	2,680,263.000	
XYLEM INC	11,630	53.970	627,671.100	
ALKERMES PLC	12,053	61.660	743,187.980	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,129	81.880	1,975,682.520	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	193.470	673,082.130	
SPLUNK INC	10,674	58.270	621,973.980	
HCA HEALTHCARE INC	21,493	83.570	1,796,170.010	
VERISK ANALYTICS INC	12,227	80.070	979,015.890	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,846	154.910	750,693.860	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	143.940	941,943.360	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,697	89.970	1,232,319.090	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,555	100.150	1,057,083.250	
CIT GROUP INC	13,659	46.050	628,996.950	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	108.580	2,459,554.160	
TARGA RESOURCES CORP	12,532	45.770	573,589.640	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.405	164,268.000	
LEAR CORP	5,132	145.630	747,373.160	
CBOE HOLDINGS INC	6,176	89.750	554,296.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	37.230	395,866.590	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	75.220	1,455,883.100	
FORTINET INC	11,399	37.320	425,410.680	
AON PLC	19,411	132.640	2,574,675.040	
TESLA INC	9,357	357.320	3,343,443.240	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	42.180	480,514.560	
GENERAL MOTORS CO	99,173	34.340	3,405,600.820	
VANTIV INC	12,141	63.120	766,339.920	
TRIPADVISOR INC	9,263	37.480	347,177.240	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	19.690	618,443.210	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	35.700	425,651.100	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	36.970	500,019.250	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,069	85.690	1,634,022.610	
PHILLIPS 66	30,976	79.570	2,464,760.320	

FACEBOOK INC	170,014	149.600	25,434,094.400
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,051	86.150	865,893.650
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	90.150	635,918.100
SERVICENOW INC	12,640	103.740	1,311,273.600
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	134.040	944,713.920
TESARO INC	2,646	138.780	367,211.880
WORKDAY INC	8,710	97.970	853,318.700
ABBVIE INC	114,842	69.670	8,001,042.140
ZOETIS INC	34,481	62.590	2,158,165.790
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	51.130	625,013.120
COTY INC	38,871	18.740	728,442.540
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.650	413,089.950
MALLINCKRODT PLC	7,835	40.290	315,672.150
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	31.510	406,195.410
CDW CORP	9,877	60.790	600,422.830
SPRINT CORP	63,882	8.120	518,721.840
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	50.270	512,703.730
ARCONIC INC	27,513	27.360	752,755.680
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	56.150	488,055.800
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.250	201,491.500
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	40.080	535,789.440
XL GROUP LTD	20,259	42.570	862,425.630
BROADCOM LTD	28,885	243.340	7,028,875.900
DELL TECHNOLOGIES INC	17,283	62.560	1,081,224.480
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	20.210	311,436.100
TECHNIPFMC LTD	32,556	28.540	929,148.240
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	21.500	283,004.500
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	61.660	430,386.800
TWITTER INC	43,692	16.900	738,394.800
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	26.270	205,877.990
COMMScope HOLDING CO INC	12,920	37.530	484,887.600
ALLEGION PLC	5,646	77.230	436,040.580
PERRIGO CO PLC	10,322	71.520	738,229.440
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	64.750	958,041.000
ARAMARK	17,307	39.540	684,318.780
SABRE CORP	17,624	22.660	399,359.840
NAVIENT CORP	22,636	15.260	345,425.360
PARSLEY ENERGY INC	17,454	28.050	489,584.700
ARISTA NETWORKS INC	3,158	149.460	471,994.680
IHS MARKIT LTD	26,741	46.320	1,238,643.120
FNF GROUP	17,760	42.690	758,174.400
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	28.700	1,649,819.500
MOBILEYE NV	14,001	62.300	872,262.300
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	39,020	36.340	1,417,986.800

CDK GLOBAL INC	8,309	60.460	502,362.140	
QORVO INC	8,784	75.270	661,171.680	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	32.230	367,067.470	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	86.820	678,758.760	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	33.590	494,108.900	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	37.670	1,011,062.800	
WESTROCK CO	17,744	57.300	1,016,731.200	
KRAFT HEINZ CO	43,818	90.830	3,979,988.940	
FORTIVE CORP	23,758	63.090	1,498,892.220	
WASTE CONNECTIONS INC	12,586	95.540	1,202,466.440	
ALPHABET INC-CL A	21,352	970.120	20,714,002.240	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	16.990	2,065,814.100	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,567	53.400	4,302,277.800	
FIRST DATA CORP	22,035	18.620	410,291.700	
DXC TECHNOLOGY CO	21,001	75.100	1,577,175.100	
CARS.COM INC	5,654	25.810	145,929.740	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	44.440	361,474.960	
ALPHABET INC-CL C	22,612	949.830	21,477,555.960	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	166.290	979,780.680	
ATHENE HOLDING LTD	4,651	50.030	232,689.530	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,531	332.840	5,169,338.040	
アメリカ・ドル 小計	22,892,759		1,548,502,419.680 (170,691,421,722)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.912	207,744.990	
ANTOFAGASTA PLC	25,905	8.250	213,716.250	
ASHTED GROUP	35,233	16.350	576,059.550	
SEVERN TRENT PLC	14,897	25.030	372,871.910	
BHP BILLITON PLC	153,323	12.075	1,851,375.220	
BARCLAYS PLC	1,247,081	2.066	2,576,469.340	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,682	5.765	476,661.730	
BT GROUP PLC	621,220	2.947	1,830,735.340	
SKY PLC	72,210	9.805	708,019.050	
BUNZL PLC	22,241	24.080	535,563.280	
EASYJET PLC	13,628	13.290	181,116.120	
CAPITA PLC	54,894	5.335	292,859.490	
AVIVA PLC	285,738	5.320	1,520,126.160	
CRODA INTERNATIONAL	8,407	39.500	332,076.500	
DIAGEO PLC	180,700	23.260	4,203,082.000	
SCHRODERS PLC	7,188	31.390	225,631.320	
DCC PLC	5,936	73.250	434,812.000	
NATIONAL GRID PLC	222,404	10.200	2,268,520.800	
GKN PLC	134,180	3.462	464,531.160	
KINGFISHER PLC	165,680	3.100	513,608.000	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.770	1,524,441.520	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	29.800	357,212.600	

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	134,403	55.180	7,416,357.540	
COBHAM PLC	142,739	1.302	185,846.170	
NEXT PLC	9,731	42.760	416,097.560	
IMPERIAL BRANDS PLC	70,388	35.625	2,507,572.500	
IMI PLC	21,218	12.500	265,225.000	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	29.840	373,805.680	
ANGLO AMERICAN PLC	93,573	10.810	1,011,524.130	
COMPASS GROUP PLC	119,716	16.690	1,998,060.040	
HSBC HOLDINGS PLC	1,432,243	6.957	9,964,114.550	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.582	1,093,861.710	
CENTRICA PLC	392,766	1.988	780,818.800	
UNILEVER PLC	93,397	43.285	4,042,689.140	
MEGGITT PLC	62,181	4.973	309,226.110	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.443	380,331.120	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	9.935	552,376.060	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.255	505,804.320	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	29.410	744,308.280	
PEARSON PLC	65,009	7.175	466,439.570	
PERSIMMON PLC	23,150	23.790	550,738.500	
PRUDENTIAL PLC	185,764	17.950	3,334,463.800	
RIO TINTO PLC	90,216	32.645	2,945,101.320	
VODAFONE GROUP PLC	1,906,649	2.210	4,213,694.290	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	46,978	79.540	3,736,630.120	
RELX PLC	80,689	16.940	1,366,871.660	
OLD MUTUAL PLC	339,296	1.972	669,091.710	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	9.085	1,062,636.110	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.509	701,119.970	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.850	484,475.400	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	15.570	316,958.490	
SSE PLC	73,043	14.950	1,091,992.850	
BP PLC	1,387,131	4.678	6,488,998.810	
SHIRE PLC	65,457	43.455	2,844,433.930	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.975	594,765.220	
SMITHS GROUP PLC	31,720	16.150	512,278.000	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	7.802	1,853,232.460	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,092,030	0.700	3,564,421.000	
TATE & LYLE PLC	39,915	7.290	290,980.350	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.775	449,114.050	
TESCO PLC	624,703	1.807	1,128,838.320	
3I GROUP PLC	66,784	9.305	621,425.120	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.600	899,708.000	
GLAXOSMITHKLINE PLC	356,577	16.980	6,054,677.460	

WEIR GROUP	18,336	19.010	348,567.360
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	34.540	756,011.520
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	8.825	187,990.150
WPP PLC	90,628	16.730	1,516,206.440
WOLSELEY PLC	18,238	48.820	890,379.160
ASTRAZENECA PLC	90,970	53.370	4,855,068.900
WHITBREAD PLC	12,159	39.830	484,292.970
CARNIVAL PLC	13,153	50.350	662,253.550
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.601	433,164.290
INTERTEK GROUP PLC	10,500	43.480	456,540.000
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.430	521,034.990
INVESTEC PLC	50,655	5.775	292,532.620
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	44.330	548,007.460
ITV PLC	247,210	1.840	454,866.400
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.650	289,936.500
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	76.000	531,848.000
G4S PLC	122,250	3.374	412,471.500
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.700	328,985.100
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	30.930	331,755.180
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	324,139	21.065	6,827,988.030
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	265,581	21.520	5,715,303.120
INMARSAT PLC	34,127	8.240	281,206.480
PETROFAC LTD	21,809	3.538	77,160.240
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	16.310	186,863.670
TUI AG-DI	30,153	11.550	348,267.150
STANDARD LIFE PLC	130,178	3.881	505,220.810
EXPERIAN PLC	71,516	16.230	1,160,704.680
MONDI PLC	24,061	20.580	495,175.380
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	13.800	293,802.000
FRESNILLO PLC NPR	15,639	17.250	269,772.750
GLENCORE PLC	899,043	2.950	2,652,176.850
DIXONS CARPHONE PLC	84,639	3.137	265,512.540
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.542	399,162.140
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	7.955	243,550.280
COCA-COLA HBC AG	13,406	23.290	312,225.740
CONVATEC GROUP PLC	73,187	3.235	236,759.940
ROYAL MAIL PLC	55,060	4.363	240,226.780
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	5.050	252,686.850
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.200	320,661.600
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC- C	9,694,695	0.001	9,694.690
WORLDPAY GROUP PLC	112,202	3.129	351,080.050
イギリス・ポンド 小計	31,737,514		136,205,453.410

イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	23.390	1,834,430.920
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	17.160	2,132,473.200
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	6.186	1,164,390.780
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	442.300	778,448.000
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	230.900	600,340.000
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.330	757,470.630
	NICE LTD	5,638	275.000	1,550,450.000
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	63.800	666,327.200
イスラエル・シュケル 小計	460,781		9,484,330.730 (296,195,649)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	68.250	758,598.750
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	212,895	27.710	5,899,320.450
	AMCOR LTD	80,741	15.940	1,287,011.540
	WESTPAC BANKING CORPORATION	241,541	29.970	7,238,983.770
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.890	332,896.410
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.860	554,647.500
	TELSTRA CORP LTD	314,574	4.370	1,374,688.380
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.570	412,377.980
	AMP LTD	200,498	4.990	1,000,485.020
	ASX LTD	11,408	50.520	576,332.160
	BHP BILLITON LTD	232,053	23.540	5,462,527.620
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	31.650	662,940.900
	COMPUTERSHARE LT	38,040	14.290	543,591.600
	CSL LIMITED	33,499	135.050	4,524,039.950
	REA GROUP LTD	4,119	63.600	261,968.400
	TRANSURBAN GROUP	149,591	12.430	1,859,416.130
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.900	432,548.900
	COCHLEAR LTD	3,992	151.040	602,951.680
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	7.320	890,997.720
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	124,101	79.190	9,827,558.190
	BORAL LIMITED	86,101	6.870	591,513.870
	RIO TINTO LIMITED	28,604	62.940	1,800,335.760
	APA GROUP	73,253	9.340	684,183.020
	ARISTOCRAT LEISU	44,406	22.260	988,477.560
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.260	1,073,408.460
	TPG TELECOM LTD	28,719	5.600	160,826.400
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	19.690	704,705.100
ORICA LTD	25,308	20.180	510,715.440	

	CIMIC GROUP LTD	8,709	39.240	341,741.160	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	12.010	443,661.410	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	7.350	625,705.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	21,869	86.510	1,891,887.190	
	SUNCORP GROUP LTD	93,181	14.120	1,315,715.720	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	29.400	5,670,730.800	
	NEWCREST MINING LTD	51,533	21.740	1,120,327.420	
	OIL SEARCH LTD	93,715	6.800	637,262.000	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.520	480,219.520	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	12.850	1,225,761.500	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.720	581,393.040	
	SANTOS LTD	133,862	3.120	417,649.440	
	SONIC HEALTHCARE	26,192	23.090	604,773.280	
	TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.540	321,323.040	
	WESFARMERS LTD	81,021	40.060	3,245,701.260	
	ALUMINA LIMITED	184,613	1.970	363,687.610	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	30.310	1,755,646.130	
	WOOLWORTHS LTD	96,523	25.950	2,504,771.850	
	SEEK LTD	25,899	16.380	424,225.620	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	54.690	250,534.890	
	TATTS GROUP LTD	109,937	4.140	455,139.180	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.670	275,660.220	
	AGL ENERGY LTD	46,315	25.320	1,172,695.800	
	BRAMBLES LTD	115,255	10.210	1,176,753.550	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.860	422,592.460	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	5.440	757,160.960	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	13.130	666,859.570	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.100	312,998.700	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.780	652,880.220	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	2.670	980,042.190	
	オーストラリア・ドル 小計	5,480,028		82,113,549.890 (6,816,245,776)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	64.850	1,046,743.850	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	62.240	1,912,510.720	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	21.960	1,836,910.080	
	ATCO LTD	7,193	50.520	363,390.360	
	BANK OF MONTREAL	47,743	93.900	4,483,067.700	
	BANK OF NOVA SCOTIA	86,583	78.570	6,802,826.310	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	54.540	1,295,652.240	
	BCE INC	11,568	60.590	700,905.120	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,043	51.340	3,339,307.620	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	16.830	434,533.770	

BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.370	359,327.550
SAPUTO INC	14,101	43.220	609,445.220
BLACKBERRY LTD	39,652	14.850	588,832.200
CGI GROUP INC	15,228	67.140	1,022,407.920
CCL INDUSTRIES INC	11,340	65.310	740,615.400
CAE INC	23,000	22.180	510,140.000
CAMECO CORP	32,627	12.810	417,951.870
ROGERS COMM-CL B	25,967	62.750	1,629,429.250
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	27,976	107.430	3,005,461.680
CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	39.340	3,124,382.800
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	149.170	725,264.540
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	40.870	372,693.530
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,387	106.550	5,794,934.850
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.680	236,103.560
AGRIUM INC	9,382	127.740	1,198,456.680
YAMANA GOLD INC	67,520	3.530	238,345.600
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	40.860	569,179.800
OPEN TEXT CORP	19,756	44.030	869,856.680
EMPIRE CO LTD	15,093	20.640	311,519.520
KINROSS GOLD CORP	99,741	5.820	580,492.620
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	26.540	262,533.680
FORTIS INC	29,002	45.170	1,310,020.340
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	11.930	659,681.280
TELUS CORP	18,945	44.740	847,599.300
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	34.150	848,183.550
IMPERIAL OIL LTD	21,542	37.990	818,380.580
ENBRIDGE INC	67,399	52.120	3,512,835.880
IGM FINANCIAL INC	8,426	40.000	337,040.000
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.590	315,902.050
MANULIFE FINANCIAL CORP	144,196	24.090	3,473,681.640
LINAMAR CORP	3,827	62.560	239,417.120
LOBLAW CO LTD	15,354	76.010	1,167,057.540
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	50.140	327,113.360
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	61.200	1,550,746.800
SUN LIFE FINANCIAL INC	46,405	45.890	2,129,525.450
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,805	585.470	1,056,773.350
METRO INC	14,275	44.330	632,810.750
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.470	444,747.030
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	11.750	469,906.000
METHANEX CORP	7,381	56.620	417,912.220
ONEX CORP	6,646	100.190	665,862.740

GOLDCORP INC	56,071	18.070	1,013,202.970
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	22.890	1,398,029.640
POWER CORP OF CANADA	25,052	29.190	731,267.880
POWER FINANCIAL CORP	17,484	33.070	578,195.880
ROYAL BANK OF CANADA	106,285	95.280	10,126,834.800
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,459	52.600	655,343.400
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	206.370	2,188,966.590
SHAW COMM INC-B	27,548	28.750	792,005.000
SUNCOR ENERGY INC	120,732	41.250	4,980,195.000
ENCANA CORP	69,257	12.630	874,715.910
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	24.140	990,126.240
THOMSON REUTERS CORP	20,469	59.170	1,211,150.730
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	133,609	65.690	8,776,775.210
TRANSCANADA CORP	62,895	63.890	4,018,361.550
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	60.250	343,184.000
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	120.860	375,270.300
INTACT FINANCIAL CORP	8,301	94.360	783,282.360
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	27.040	917,818.720
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	696.550	1,040,645.700
FRANCO-NEVADA CORP NPR	13,919	97.550	1,357,798.450
CI FINANCIAL CORP	20,695	26.710	552,763.450
VERESEN INC	24,982	18.620	465,164.840
TOURMALINE OIL CORP	15,779	27.720	437,393.880
KEYERA CORP	13,728	42.130	578,360.640
ALTAGAS LTD	12,538	30.040	376,641.520
PEMBINA PIPELINE CORP	30,719	44.200	1,357,779.800
DOLLARAMA INC	7,504	125.060	938,450.240
CENOVUS ENERGY INC W/I	59,124	11.100	656,276.400
VERMILION ENERGY INC	8,291	44.650	370,193.150
ARC RESOURCES LTD	22,997	17.280	397,388.160
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	24.630	356,962.590
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	9.800	300,183.800
INTER PIPELINE LTD	24,083	26.330	634,105.390
TRISURA GROUP LTD	382	21.980	8,396.360
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	29.590	442,695.990
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	24.520	422,504.120
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,390	77.280	1,343,899.200
SHOPIFY INC	5,021	122.800	616,578.800
HYDRO ONE LTD	16,612	23.390	388,554.680
カナダ・ドル 小計	2,976,361		120,405,883.040

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.770	471,250.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	3.130	254,782.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.250	402,025.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.370	256,091.800	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	133,100	20.720	2,757,832.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	10.950	317,550.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	43.450	445,101.800	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.150	217,845.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.380	508,482.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.600	692,694.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.190	495,516.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	6.410	764,713.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.410	428,739.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	10.680	2,407,838.040	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.740	2,213,788.280	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.080	478,800.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	23.600	2,230,200.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	151,000	3.460	522,460.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	2.960	509,416.000		
シンガポール・ドル 小計	3,494,274		16,375,123.920	(1,304,278,620)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	145,106	13.430	1,948,773.580	
	NESTLE SA-REGISTERED	224,790	80.950	18,196,750.500	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	79.300	2,968,833.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	50,742	247.800	12,573,867.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	205.300	582,025.500	
	SIKA INHABER	151	6,330.000	955,830.000	
	SGS SA-REG	405	2,320.000	939,600.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	161,207	78.800	12,703,111.600	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	149.100	615,335.700	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,370.000	197,280.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	458.600	823,187.000	
	ABB LTD	137,622	24.580	3,382,748.760	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	73.250	903,978.250	
	GEBERIT AG	2,801	450.400	1,261,570.400	
	LONZA GROUP AG-REG	5,096	203.200	1,035,507.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,830.000	437,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	6	70,260.000	421,560.000	
GIVAUDAN-REG	692	1,966.000	1,360,472.000		

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,053	284.900	3,148,999.700	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	57.000	1,862,532.000	
	SONOVA HOLDING AG	3,410	164.500	560,945.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	159.100	708,472.300	
	STRAUMANN HOLDING AG	600	546.000	327,600.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	362.300	708,296.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	71.500	328,328.000	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	200.300	333,098.900	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	322.900	718,452.500	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	105.700	322,385.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	677.500	374,657.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	90.400	541,496.000	
	DUFREY GROUP	2,390	162.300	387,897.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	600.000	763,200.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	50.000	761,350.000	
	SWISS RE LTD	23,838	87.250	2,079,865.500	
	ACTELION LTD-NEW LINE	7,435	279.000	2,074,365.000	
	UBS GROUP AG	266,995	15.490	4,135,752.550	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	145,101	0.470	68,197.470	
	スイス・フラン 小計	1,321,851		81,513,572.410 (9,276,244,540)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	330.700	15,998,273.900	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	296.300	8,639,219.100	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	63.400	14,058,823.200	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	182.600	2,401,737.800	
	SKF AB-B SHS	24,866	184.100	4,577,830.600	
	SANDVIK AB	75,199	142.600	10,723,377.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	103,683	105.900	10,980,029.700	
	SKANSKA AB-B SHS	27,150	207.600	5,636,340.000	
	SWEDBANK AB	66,507	211.600	14,072,881.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,024	302.100	13,903,850.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	123.800	13,418,434.400	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	147.600	16,777,987.200	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	304.500	3,495,964.500	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	89.950	2,426,491.200	
	NORDEA AB	218,620	112.300	24,551,026.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	211.000	2,406,033.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	284.100	5,452,163.100	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	145.300	3,501,439.400	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	408.700	13,655,484.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	206.600	13,728,156.800	
	ASSA ABLOY AB-B	75,670	195.100	14,763,217.000	
	TELIA CO AB	184,927	39.110	7,232,494.970	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	165.400	2,777,066.000	

	BOLIDEN AB	21,855	244.600	5,345,733.000	
	ALFA LAVAL AB	24,553	174.200	4,277,132.600	
	KINNEVIK AB-B	18,310	259.200	4,745,952.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	503.000	2,681,996.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	317.600	1,880,192.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	86.600	2,917,727.200	
	HEXAGON AB	16,702	385.500	6,438,621.000	
スウェーデン・クローナ 小計		1,693,304		253,465,675.070 (3,208,875,446)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	712.500	5,222,625.000	
	A P MOLLER A/S	481	12,610.000	6,065,410.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	12,050.000	3,289,650.000	
	DANSKE BANK A/S	52,545	252.000	13,241,340.000	
	GENMAB A/S	4,633	1,404.000	6,504,732.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	300.000	4,771,200.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	130,001	284.900	37,037,284.900	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	614.500	9,714,016.000	
	TDC A/S	68,939	37.650	2,595,553.350	
	COLOPLAST-B	8,286	573.500	4,752,021.000	
	DSV A/S	13,040	408.300	5,324,232.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	172.300	1,126,325.100	
	H LUNDBECK A/S	4,840	349.500	1,691,580.000	
	TRYG A/S	11,107	137.300	1,524,991.100	
	PANDORA A/S	8,251	628.500	5,185,753.500	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	472.500	3,642,030.000	
ISS A/S	11,125	273.100	3,038,237.500		
DONG ENERGY A/S	11,600	296.000	3,433,600.000		
デンマーク・クローネ 小計		378,408		118,160,581.450 (1,962,647,259)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	7.100	695,743.200	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	7.660	576,652.460	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.680	773,392.480	
ニュージーランド・ドル 小計		383,434		2,045,788.140 (162,415,120)	
ノルウェー・ク ローネ	MARINE HARVEST	24,816	146.600	3,638,025.600	
	DNB ASA	70,426	143.800	10,127,258.800	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	46.470	4,269,617.130	
	TELENOR ASA	53,178	136.300	7,248,161.400	
	SCHIBSTED ASA	9,131	190.000	1,734,890.000	
	ORKLA ASA	61,421	84.600	5,196,216.600	
	STATOIL ASA	81,414	146.500	11,927,151.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,576	315.100	4,592,897.600	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	135.500	2,260,546.500		
ノルウェー・クローネ 小計		423,524		50,994,764.630	

(661,912,045)

ユーロ	CRH PLC	62,222	32.725	2,036,214.950
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	96.680	603,863.280
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	78.640	910,336.640
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.230	505,686.510
	UMICORE	7,660	62.870	481,584.200
	AIR LIQUIDE	28,615	109.800	3,141,927.000
	AIRBUS SE	42,705	75.410	3,220,384.050
	AXA	139,550	24.025	3,352,688.750
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	19.265	666,992.830
	ADIDAS AG	13,503	170.000	2,295,510.000
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	14.070	1,209,949.650
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	41,829	16.335	683,276.710
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,319.000	207,083.000
	DANONE	43,220	66.910	2,891,850.200
	SAFRAN SA	22,050	79.200	1,746,360.000
	INTESA SANPAOLO	934,915	2.586	2,417,690.190
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.414	123,543.690
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,055	84.430	2,030,963.650
	ACCOR SA	10,385	41.560	431,600.600
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	29.775	225,188.320
	BOUYGUES	13,996	38.335	536,536.660
	BNP PARIBAS	80,741	64.510	5,208,601.910
	RELX NV	70,826	18.480	1,308,864.480
	THALES SA	8,128	98.220	798,332.160
	CAPGEMINI SA	11,481	92.930	1,066,929.330
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	54.050	230,469.200
	CHRISTIAN DIOR SE	3,940	255.650	1,007,261.000
	INGENICO GROUP	4,334	80.910	350,663.940
	UNICREDIT SPA	142,664	16.130	2,301,170.320
	NATIXIS	70,166	6.063	425,416.450
	KONINKLIJKE DSM NV	12,285	66.070	811,669.950
	COMMERZBANK AG	72,573	9.483	688,209.750
	EIFFAGE	4,777	81.780	390,663.060
	FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	77.760	2,344,930.560
	UNITED INTERNET	9,882	48.885	483,081.570
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	50.440	279,740.240
	PUBLICIS GROUPE	15,068	65.430	985,899.240
	MAN SE	3,396	94.240	320,039.040
	IBERDROLA SA	400,533	7.150	2,863,810.950
	ENI SPA	188,983	13.900	2,626,863.700
	IMERYSA SA	2,256	78.300	176,644.800
	JERONIMO MARTINS	19,517	17.725	345,938.820
	KBC GROUPE	18,378	69.410	1,275,616.980
	HANNOVER RUECK SE	3,642	106.100	386,416.200
	WARTSILA OYJ	11,645	53.700	625,336.500
	L'OREAL	18,067	190.050	3,433,633.350

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,407	227.900	4,650,755.300
LAGARDERE S.C.A.	9,600	27.990	268,704.000
GEA GROUP AG	14,635	37.120	543,251.200
BOLLORE	71,347	4.075	290,739.020
MEDIOBANCA SPA	42,404	8.590	364,250.360
MICHELIN(CGDE) -B	12,118	118.000	1,429,924.000
CONTINENTAL AG	7,776	198.700	1,545,091.200
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	31.910	2,231,913.040
GAMESA	14,426	20.320	293,136.320
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	36.720	345,131.280
AXEL SPRINGER SE	3,067	55.370	169,819.790
OMV AG	9,766	48.215	470,867.690
PERNOD-RICARD	14,983	121.000	1,812,943.000
PEUGEOT SA	32,906	17.990	591,978.940
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,066	50.910	614,280.060
RENAULT SA	12,442	84.110	1,046,496.620
REPSOL SA	80,153	14.830	1,188,668.990
REMY COINTREAU	1,860	101.600	188,976.000
MERCK KGAA	9,551	106.800	1,020,046.800
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	49.970	1,784,228.820
SAIPEM	46,575	3.440	160,218.000
RWE AG	39,183	19.730	773,080.590
SEB SA	1,405	159.250	223,746.250
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	53.550	621,287.100
SOCIETE GENERALE-A	56,243	48.000	2,699,664.000
VINCI S.A.	35,769	78.010	2,790,339.690
SODEXO	7,368	120.450	887,475.600
SOLVAY SA	5,036	119.600	602,305.600
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,136	68.920	2,835,093.120
VIVENDI SA	78,086	20.050	1,565,624.300
SAP SE	70,874	96.000	6,803,904.000
TELEFONICA S.A	322,715	10.060	3,246,512.900
TOTAL SA	166,329	45.695	7,600,403.650
VALEO	17,731	61.380	1,088,328.780
E.ON SE	142,688	8.797	1,255,226.330
VOEST-ALPINE AG	9,875	40.900	403,887.500
ZODIAC AEROSPACE	15,282	23.600	360,655.200
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	111.050	835,651.250
METRO AG	10,774	28.955	311,961.170
SIEMENS AG-REG	55,044	129.400	7,122,693.600
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	25.810	952,827.770
ING GROEP NV-CVA	278,212	15.520	4,317,850.240
BAYER AG	59,478	119.050	7,080,855.900
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	11.870	502,136.610
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,253	125.700	1,665,902.100
DAIMLER AG	68,940	65.460	4,512,812.400

BASF SE	65,856	86.590	5,702,471.040
BEIERSDORF AG	6,780	96.290	652,846.200
HOCHTIEF AG	1,707	166.800	284,727.600
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	84.440	929,599.960
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	86.830	1,306,617.840
ORANGE	141,819	15.270	2,165,576.130
SAMPO OYJ-A SHS	33,059	45.640	1,508,812.760
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	52.280	407,470.320
ALLIANZ SE	32,809	173.850	5,703,844.650
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.271	625,068.470
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	19.280	1,762,693.280
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	36.910	649,689.820
HERMES INTL	1,529	439.550	672,071.950
ENDESA S.A.	21,037	22.170	466,390.290
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	18.600	367,312.800
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	33.400	779,021.600
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,346	177.300	2,011,645.800
ARCELOR MITTAL (NL)	43,582	19.000	828,058.000
SOCIETE BIC SA	2,478	109.350	270,969.300
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	83.280	746,272.080
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,742	35.950	529,974.900
HEINEKEN NV	17,373	87.270	1,516,141.710
AKZO NOBEL	18,209	76.750	1,397,540.750
ASML HOLDING NV	27,566	119.900	3,305,163.400
AEGON NV	120,404	4.503	542,179.210
BANKINTER S.A.	57,960	8.295	480,778.200
VOLKSWAGEN AG	2,794	137.850	385,152.900
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	132.600	1,741,568.400
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	490,423	7.458	3,657,574.730
KERING	5,479	295.700	1,620,140.300
CNP ASSURANCES	13,987	19.885	278,131.490
FORTUM OYJ	29,739	14.470	430,323.330
AGEAS	12,993	36.200	470,346.600
UCB SA	8,747	62.560	547,212.320
THYSSENKRUPP AG	29,215	24.270	709,048.050
UNILEVER NV-CVA	117,106	50.250	5,884,576.500
CARREFOUR SA	39,144	23.135	905,596.440
GAS NATURAL SDG SA	29,010	21.950	636,769.500
ATOS SE	7,050	130.750	921,787.500
NOKIA OYJ	417,248	5.810	2,424,210.880
KONINKLIJKE PHILIPS NV	65,961	32.020	2,112,071.220
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	38.410	789,632.780
SANOFI	83,825	86.140	7,220,685.500
STMICROELECTRONICS NV	45,866	15.320	702,667.120

ELISA OYJ	9,517	34.820	331,381.940
BANCO SANTANDER SA	1,047,057	6.120	6,407,988.840
METSO OYJ	8,585	31.460	270,084.100
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	20.370	704,720.520
QIAGEN N.V.	13,642	30.840	420,719.280
LINDE AG	13,375	179.300	2,398,137.500
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	15.815	2,360,293.860
BMW VORZUG	4,116	73.530	302,649.480
K & S	14,982	23.320	349,380.240
ENEL SPA	551,867	4.898	2,703,044.560
COLRUYT NV	4,673	47.655	222,691.810
VOPAK (KON.)	5,364	40.950	219,655.800
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	234,611	17.125	4,017,713.370
LEONARDO SPA	34,431	16.040	552,273.240
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	20.385	1,666,962.990
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	3.022	691,938.270
EUROFINS SCIENTIFIC	794	491.250	390,052.500
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.977	181,868.180
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	92.770	1,284,307.880
EURAZEO	2,427	64.330	156,128.910
BANCO SABADELL	367,753	1.756	645,774.260
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	86.450	502,620.300
FRAPORT AG	3,149	75.840	238,820.160
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	81.990	657,067.860
INDITEX	79,821	36.405	2,905,883.500
JC DECAUX SA	6,058	28.250	171,138.500
ANDRITZ AG	6,265	54.500	341,442.500
MAPFRE SA	84,474	3.218	271,837.330
ESSILOR INTL	14,632	118.250	1,730,234.000
SNAM SPA	158,419	4.198	665,042.960
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	14.250	1,219,586.250
ENAGAS	18,095	26.485	479,246.070
WENDEL	2,220	136.950	304,029.000
TENARIS SA	38,237	13.770	526,523.490
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.825	653,534.470
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.680	338,365.280
ATLANTIA SPA	27,920	26.000	725,920.000
ILIAD SA	2,102	225.850	474,736.700
PROXIMUS	8,922	32.725	291,972.450
SES FDR	24,585	22.650	556,850.250
TERNA SPA	117,108	5.150	603,106.200
GRIFOLS SA	18,800	25.005	470,094.000
FERROVIAL SA	35,610	19.915	709,173.150
LANXESS AG	6,856	70.470	483,142.320
NESTE OYJ	10,692	34.880	372,936.960
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	24.185	233,167.580

RECORDATI SPA	6,859	36.520	250,490.680
KONE OYJ	23,717	45.200	1,072,008.400
ENGIE	118,752	13.930	1,654,215.360
ALSTOM	12,046	31.260	376,557.960
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	61.150	222,219.100
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	24.065	301,823.230
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	9.677	336,333.810
IPSEN SA	2,487	119.550	297,320.850
DEUTSCHE WOHNEN AG	26,714	35.170	939,531.380
ARKEMA SA	4,241	96.080	407,475.280
LEGRAND SA	19,920	60.970	1,214,522.400
ADP	2,313	138.200	319,656.600
ORION OYJ	8,051	58.000	466,958.000
RTL GROUP SA	3,446	68.660	236,602.360
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	13.535	513,260.730
SYMRISE AG	7,926	64.330	509,879.580
SCOR SE	13,875	34.850	483,543.750
REXEL SA	23,245	14.880	345,885.600
PRYSMIAN SPA	14,925	25.940	387,154.500
CAIXABANK	262,372	4.193	1,100,125.790
BUREAU VERITAS SA	21,480	20.430	438,836.400
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	10.265	386,436.190
SUEZ SA	25,406	16.400	416,658.400
AMADEUS IT GROUP SA	33,099	53.380	1,766,824.620
BRENNTAG AG	12,331	52.200	643,678.200
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.666	298,283.500
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	5.552	268,189.360
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.180	349,333.500
EDENRED	13,195	23.995	316,614.020
BANKIA SA	92,659	4.243	393,152.130
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.408	271,272.720
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	65.460	341,570.280
OSRAM LICHT AG	7,017	70.720	496,242.240
GEMALTO	6,103	52.190	318,515.570
VONOVIA SE	35,271	35.995	1,269,579.640
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	36.515	587,526.350
FERRARI NV	8,338	81.700	681,214.600
INNOGY SE	9,769	35.720	348,948.680
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	10.320	811,616.400
NN GROUP NV	21,965	31.820	698,926.300
ZALANDO SE	6,674	44.840	299,262.160

	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	9.710	680,768.100	
	AENA SA	5,256	183.700	965,527.200	
	ABN AMRO GROUP NV	19,363	23.005	445,445.810	
	EXOR NV	9,441	50.150	473,466.150	
	ALTICE NV-A	33,913	23.260	788,816.380	
	COVESTRO AG	5,966	64.400	384,210.400	
	FERROVIAL SA-RTS	35,563	0.326	11,593.530	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	54,813	101.550	5,566,260.150	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.300	252,094.500	
	SCHAEFFLER AG	12,644	14.985	189,470.340	
	UNIPER SE	16,058	17.220	276,518.760	
ユーロ 小計		16,071,714		284,654,170.830 (35,157,636,639)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	119.000	1,975,400.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	21.150	3,468,600.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	33.800	2,577,588.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	84.150	10,055,925.000	
	PCCW LTD	331,000	4.440	1,469,640.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	2.990	1,591,876.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	66.250	3,246,250.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	82,940	205.400	17,035,876.000	
	MTR CORP	118,500	44.100	5,225,850.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	33.800	2,129,400.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	163.900	9,178,400.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	46.000	3,856,824.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	70.450	6,798,425.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	69.550	6,659,412.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	610,046	15.000	9,150,690.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	38.000	1,900,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	47.100	7,724,400.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	33,000	27.700	914,100.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	287,000	35.150	10,088,050.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	31.700	1,600,850.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	10.700	4,721,546.200	
	SINO LAND CO	255,400	13.580	3,468,332.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	121.500	12,514,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	79.000	2,370,000.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	36.300	4,120,050.000	
	WHEELOCK & CO LTD	56,000	63.300	3,544,800.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	17.780	2,211,832.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	16.420	1,064,016.000	

AIA GROUP LTD	865,227	56.300	48,712,280.100	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.260	2,893,320.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	36.100	6,108,120.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	26.500	2,761,300.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.180	1,651,400.000	
WH GROUP LTD	530,500	7.360	3,904,480.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	100.000	19,933,200.000	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	198,832	61.050	12,138,693.600	
香港・ドル 小計	6,847,497		238,765,426.400 (3,376,143,129)	
合計	94,161,449		261,922,388,422 (261,922,388,422)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年6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	63,819.000	650,953.800	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,014,302.460	
		GPT GROUP	144,955.000	736,371.400	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	598,555.260	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	653,680.430	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,603,815.840	
		STOCKLAND	193,279.000	900,680.140	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	741,013.820	
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,176,294.000	
	オーストラリア・ドル 小計		1,650,984.000	8,075,667.150 (670,361,131)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	542,176.200	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	66,100.000	108,404.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	383,075.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		192,100.000	353,464.000		
シンガポール・ドル 小計		658,006.000	1,387,119.200 (110,484,045)		
投資信託受益証券 合計		2,308,990	780,845,176 (780,845,176)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	549,570.350	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,587.000	662,785.810	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	3,998,684.040	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	940,414.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,191.000	1,987,143.090	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,398,680.320	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	414,668.250	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	544,406.700	

	COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	557,823.090	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	25,678.000	2,620,696.680	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,787.000	1,335,702.840	
	DUKE REALTY TRUST	24,470.000	696,171.500	
	EQUINIX INC	5,241.000	2,301,899.610	
	EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,830,744.100	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,204,424.520	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	9,980.000	743,709.600	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,505.000	561,683.400	
	GGP INC	43,463.000	1,013,557.160	
	HCP INC	34,130.000	1,064,173.400	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	940,081.860	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	641,717.150	
	KIMCO REALTY	32,980.000	611,779.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	486,811.710	
	MID AMERICA	8,123.000	870,785.600	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	398,774.080	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,226,127.580	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,314,501.560	
	REALTY INCOME CORP	20,047.000	1,108,799.570	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	704,406.780	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,156.000	1,229,650.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,664.000	3,526,518.400	
	SL GREEN	7,722.000	819,921.960	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	525,966.900	
	UDR INC	17,458.000	702,160.760	
	VENTAS INC	25,041.000	1,674,491.670	
	VEREIT INC	72,429.000	602,609.280	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	1,143,560.150	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,947,600.200	
	WEYERHAEUSER CO	52,691.000	1,750,921.930	
	アメリカ・ドル 小計	889,395.000	48,654,126.040 (5,363,144,313)	
	イギリス・ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	454,584.070	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	345,541.320	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	198,285.640	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	50,519.000	535,501.400	
	SEGRO PLC	61,113.000	305,870.560	
	イギリス・ポンド 小計	316,831.000	1,839,782.990 (258,563,101)	
	カナダ・ドル			
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	248,063.840	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	246,712.500	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,582.000	82,701.460	
	カナダ・ドル 小計	23,005.000	577,477.800	

			(47,318,531)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	195,007.890	
	GECINA SA	3,212.000	440,686.400	
	ICADE	2,234.000	166,500.020	
	KLEPIERRE	17,042.000	643,079.870	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,686,464.550	
ユーロ 小計		32,052.000	3,131,738.730	(386,801,051)
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	10,341,375.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	10,341,375.000	(146,227,043)
投資証券 合計		1,424,783	6,202,054,039	(6,202,054,039)
合計			6,982,899,215	(6,982,899,215)

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 610銘柄	62.14%	-%	-%	65.47%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	1.95%	
イギリス・ポンド	株式 105銘柄	6.97%	-%	-%	7.21%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.09%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	2.48%	-%	-%	2.78%
	投資信託受 益証券 9銘柄	-%	0.24%	-%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	3.59%	-%	-%	3.69%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 19銘柄	0.47%	-%	-%	0.53%
	投資信託受 益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	3.38%	-%	-%	3.45%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.17%	-%	-%	1.19%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.71%	-%	-%	0.73%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
ユーロ	株式 234銘柄	12.80%	-%	-%	13.22%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 36銘柄	1.23%	-%	-%	1.31%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		245,394,615
コール・ローン		50,970,512
投資信託受益証券		4,720,517,725
投資証券		37,519,537,477
未収入金		366,282
未収配当金		36,346,476
流動資産合計		42,573,133,087
資産合計		42,573,133,087
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		104
未払金		165,282,234
未払解約金		18,228,000
流動負債合計		183,510,338
負債合計		183,510,338
純資産の部		
元本等		
元本	1	36,587,045,283
剰余金		
剰余金又は欠損金()		5,802,577,466
元本等合計		42,389,622,749
純資産合計		42,389,622,749
負債純資産合計		42,573,133,087

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29年6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	30,812,691,404円 12,792,115,580円 7,017,761,701円
元本の内訳 ファンド名 D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ） D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ） M I T O ラップ型ファンド（安定型） M I T O ラップ型ファンド（中立型） M I T O ラップ型ファンド（積極型）	148,099,096円 49,262,456円 7,190,802円 18,673,980円 54,028,832円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	10,567,281円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	17,208,529円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	30,710,019円
たわらノーロード 先進国リート	1,271,367,700円
たわらノーロード 先進国リート <ラップ向け>	172,054,982円
たわらノーロード 先進国リート <為替ヘッジあり>	66,428,715円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	24,915,671円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	559,206,654円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	56,673,619円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	22,955,315円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	65,018,641円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	140,608,841円
投資のソムリエ	3,410,793,616円
投資のソムリエ<DC年金>	159,006,554円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	77,772,113円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	84,977,131円
ダイナミック・ナビゲーション	272,679円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	822,655,504円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	487,108,825円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	876,797,151円
D I A Mパッシブ資産分散ファン ド	1,345,356,407円
D I A M外国リートインデックス ファンド<DC年金>	13,263,134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)	210,882,076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)	169,827,949円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	4,033,069,656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)	34,702,295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)	12,274,255,185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)	2,576,737,128円
D I A Mグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンドI I (適格機関投資家限定)	3,246,647,485円
P - O n e マルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限定)	3,486,991,305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)	560,957,957円
計	36,587,045,283円
2 . 受益権の総数	36,587,045,283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29年1月18日 至 平成29年6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29年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年6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	12,865,062
投資証券	85,423,834
合計	72,558,772

(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29年6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29年6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	6,422,624	-	6,422,520	104
ユーロ	6,422,624	-	6,422,520	104
合計	6,422,624	-	6,422,520	104

（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29年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.1586円
（1万口当たり純資産額）	（11,586円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年6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	59,168.850	
		ABACUS PROPERTY GROUP	97,700.000	329,249.000	
		ALE PROPERTY GROUP	60,500.000	279,510.000	
		ARENA REIT	80,130.000	177,888.600	
		ASPEN GROUP	31,613.000	35,406.560	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	17,500.000	116,375.000	
		BWP TRUST	163,730.000	509,200.300	
		CENTURIA URBAN REIT	20,000.000	49,000.000	
		CHARTER HALL GROUP	156,430.000	894,779.600	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	54,160.000	227,472.000	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	111,640.000	480,052.000	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	434,980.000	432,805.100	
		DEXUS	328,880.000	3,354,576.000	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	69,610.000	192,819.700	
		GDI PROPERTY GROUP	173,070.000	180,858.150	
		GENERATION HEALTHCARE REIT	49,490.000	111,847.400	
		GOODMAN GROUP	544,970.000	4,545,049.800	
		GPT GROUP	614,900.000	3,123,692.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	84,270.000	285,675.300	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	46,560.000	138,283.200	
		INDUSTRIA REIT	43,830.000	98,617.500	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	73,368.000	196,626.240	
		INVESTA OFFICE FUND	207,460.000	968,838.200	
		MIRVAC GROUP	1,264,400.000	2,794,324.000	
		NATIONAL STORAGE REIT	172,150.000	253,060.500	
		PROPERTYLINK GROUP	209,180.000	171,527.600	
		SCENTRE GROUP	1,820,230.000	7,608,561.400	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	244,210.000	566,567.200			
STOCKLAND	823,410.000	3,837,090.600			
VICINITY CENTRES	1,114,600.000	3,054,004.000			
VIVA ENERGY REIT	140,570.000	333,150.900			
WESTFIELD CORP	653,920.000	5,492,928.000			
	オーストラリア・ドル	小計	9,969,744.000	40,899,004.700 (3,395,026,380)	

カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	13,280.000	168,390.400	
カナダ・ドル 小計		13,280.000	168,390.400 (13,797,910)	
シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	200,095.000	284,134.900	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	268,000.000	214,400.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	826,660.000	2,231,982.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	406,015.000	464,887.170	
	CACHE LOGISTICS TRUST	306,000.000	270,810.000	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	356,000.000	204,700.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	733,010.000	1,202,136.400	
	CAPITALAND MALL TRUST	918,960.000	1,768,998.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	239,080.000	375,355.600	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	227,000.000	365,470.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	273,000.000	178,815.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	187,000.000	246,840.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	193,000.000	399,510.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	205,480.000	285,617.200	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	353,000.000	370,650.000	
	KEPPEL DC REIT	267,000.000	343,095.000	
	KEPPEL REIT	605,000.000	689,700.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	647,000.000	274,975.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	616,000.000	957,880.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	623,000.000	682,185.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	402,020.000	733,686.500	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	515,020.000	615,448.900	
	QUE COMMERCIAL REIT	195,500.000	139,782.500	
	QUE HOSPITALITY TRUST	394,020.000	287,634.600	
	PARKWAY LIFE REIT	129,500.000	340,585.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	335,900.000	144,437.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	236,000.000	165,200.000	
	SPH REIT	274,000.000	272,630.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	475,500.000	356,625.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	869,590.000	1,600,045.600	
シンガポール・ドル 小計		12,277,350.000	16,468,216.370 (1,311,693,435)	

投資信託受益証券 合計			22,260,374	4,720,517,725 (4,720,517,725)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	28,460.000	796,880.000	
		AGREE REALTY CORP	9,110.000	432,816.100	
		ALEXANDER'S INC.	1,220.000	523,258.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30,410.000	3,607,538.300	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,067.000	569,994.840	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	45,371.000	2,149,224.270	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	79,378.000	1,746,316.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO- A	53,433.000	2,370,287.880	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	53,590.000	1,020,353.600	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	15,260.000	205,399.600	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	10,900.000	109,872.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25,980.000	173,286.600	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	46,920.000	9,148,930.800	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	7,500.000	96,000.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	52,590.000	6,586,371.600	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	60,020.000	1,036,545.400	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	89,202.000	1,683,241.740	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	29,778.000	2,579,370.360	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	28,240.000	714,754.400	
		CARETRUST REIT INC	24,330.000	451,078.200	
		CBL & ASSOCIATES	59,390.000	481,059.000	
		CEDAR REALTY TRUST INC	25,410.000	133,656.600	
		CHATHAM LODGING TRUST	13,280.000	266,928.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	20,880.000	508,219.200	
		CITY OFFICE REIT INC	8,100.000	101,817.000	
		COLONY NORTHSTAR INC	188,674.000	2,677,284.060	
		COLONY STARWOOD HOMES	33,230.000	1,149,093.400	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	42,200.000	922,492.000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4,370.000	112,658.600	
		CORECIVIC INC	40,280.000	1,273,653.600	
		CORESITE REALTY CORP	11,610.000	1,235,536.200	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	33,780.000	1,191,082.800	
		COUSINS PROPERTIES INC	143,170.000	1,272,781.300	
		CUBESMART	61,435.000	1,462,767.350	
CYRUSONE INC	26,659.000	1,532,092.730			
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	31,317.000	1,703,331.630			

DDR CORP	106,090.000	972,845.300	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	67,260.000	776,180.400	
DIGITAL REALTY TRUST INC	54,440.000	6,169,140.800	
DOUGLAS EMMETT INC	49,532.000	1,886,178.560	
DUKE REALTY TRUST	121,680.000	3,461,796.000	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	26,432.000	1,607,065.600	
EAST GROUP	11,480.000	974,307.600	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	8,000.000	167,520.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	25,090.000	979,262.700	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	42,450.000	902,062.500	
EPR PROPERTIES	21,840.000	1,577,721.600	
EQUITY COMMONWEALTH	42,440.000	1,344,923.600	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,753.000	2,351,234.160	
EQUITY RESIDENTIAL	125,440.000	8,483,507.200	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	22,410.000	5,966,214.300	
EXTRA SPACE STORAGE INC	43,100.000	3,211,812.000	
FARMLAND PARTNERS INC	10,050.000	97,686.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,680.000	3,077,102.400	
FELCOR LODGING TR INC	42,870.000	323,668.500	
FIRST INDUSTRIAL RT	40,150.000	1,192,455.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	19,440.000	220,449.600	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	73,717.000	1,795,746.120	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	20,780.000	528,227.600	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	37,340.000	428,663.200	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	66,443.000	2,410,552.040	
GEO GROUP INC	42,040.000	1,399,932.000	
GETTY REALTY CORP	9,050.000	233,490.000	
GGP INC	199,760.000	4,658,403.200	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,670.000	186,318.300	
GLOBAL NET LEASE INC	19,850.000	450,793.500	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	24,560.000	551,863.200	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	51,319.000	1,579,085.630	
HCP INC	160,090.000	4,991,606.200	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	39,731.000	1,369,527.570	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	65,147.000	2,047,570.210	

HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,450.000	282,642.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	34,637.000	1,764,062.410	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	55,985.000	1,663,874.200	
HOST HOTELS & RESORTS INC	252,840.000	4,647,199.200	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	52,732.000	1,871,986.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	19,270.000	193,085.400	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	42,120.000	259,880.400	
INVITATION HOMES INC	26,320.000	563,248.000	
IRON MOUNTAIN INC	83,970.000	2,797,040.700	
ISTAR INC	23,730.000	289,031.400	
KILROY REALTY CORP	33,265.000	2,512,172.800	
KIMCO REALTY	144,784.000	2,685,743.200	
KITE REALTY GROUP TRUST	28,990.000	546,751.400	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	38,720.000	1,183,283.200	
LEXINGTON REALTY TRUST	72,670.000	727,426.700	
LIBERTY PROPERTY TRUST	50,040.000	2,091,171.600	
LIFE STORAGE INC	15,910.000	1,176,703.600	
LTC PROPERTIES INC	13,290.000	652,804.800	
MACK CALI	30,190.000	833,847.800	
MANULIFE US REIT	206,000.000	185,400.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	7,390.000	87,645.400	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	122,171.000	1,630,982.850	
MID AMERICA	38,840.000	4,163,648.000	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	24,510.000	374,512.800	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	57,446.000	569,289.860	
NATIONAL HEALTH INVS INC	13,660.000	1,047,312.200	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	50,138.000	1,896,219.160	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	14,200.000	331,996.000	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	28,400.000	274,912.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,900.000	151,689.000	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	18,700.000	239,734.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	66,976.000	2,121,129.920	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,670.000	110,912.500	
PARK HOTELS & RESORTS INC	42,540.000	1,160,916.600	
PARKWAY INC	14,770.000	293,923.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	24,230.000	790,624.900	

PENN REAL ESTATE INVEST TST	23,200.000	261,000.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	51,880.000	1,075,472.400	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	49,790.000	1,065,506.000	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	10,210.000	165,912.500	
PROLOGIS INC	180,850.000	10,331,960.500	
PS BUSINESS PARKS	6,570.000	863,757.900	
PUBLIC STORAGE	51,020.000	10,589,711.200	
QTS REALTY TRUST INC	16,080.000	859,958.400	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	32,229.000	556,272.540	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	26,530.000	354,440.800	
REALTY INCOME CORP	92,700.000	5,127,237.000	
REGENCY CENTERS CORP	49,651.000	3,096,732.870	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	36,720.000	746,517.600	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	81,210.000	1,017,561.300	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	22,370.000	623,899.300	
RLJ LODGING TRUST	42,950.000	920,848.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,470.000	1,137,995.800	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	22,660.000	518,007.600	
SAUL CENTERS INC	4,070.000	241,595.200	
SELECT INCOME REIT	22,030.000	545,462.800	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	80,937.000	1,714,245.660	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	8,230.000	341,051.200	
SIMON PROPERTY GROUP INC	109,230.000	16,996,188.000	
SL GREEN	34,420.000	3,654,715.600	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	165,520.000	1,241,400.000	
STAG INDUSTRIAL INC	29,820.000	839,433.000	
STORE CAPITAL CORP	58,220.000	1,181,866.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	34,420.000	654,324.200	
SUN COMMUNITIES INC	24,074.000	2,118,993.480	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	75,330.000	1,230,138.900	
TANGER FACTORY OUTLET	32,350.000	836,571.000	
TAUBMAN CENTERS INC	20,710.000	1,240,114.800	
TERRENO REALTY CORP	17,200.000	571,040.000	
THE MACERICH COMPANY	41,130.000	2,399,935.500	
TIER REIT INC	16,540.000	286,638.200	

	UDR INC	91,450.000	3,678,119.000	
	UMH PROPERTIES INC	9,330.000	162,342.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,320.000	328,492.800	
	URBAN EDGE PROPERTIES	33,220.000	810,235.800	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10,310.000	198,879.900	
	VENTAS INC	121,190.000	8,103,975.300	
	VEREIT INC	333,610.000	2,775,635.200	
	VORNADO REALTY TRUST	58,860.000	5,512,239.000	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	64,370.000	521,397.000	
	WASHINGTON REIT	25,110.000	824,612.400	
	WEINGARTEN REALTY INVST	40,330.000	1,236,114.500	
	WELLTOWER INC	123,880.000	9,098,986.000	
	WHEELER REIT INC	3,490.000	33,050.300	
	WHITESTONE REIT	13,920.000	169,128.000	
	WP CAREY INC	36,164.000	2,420,818.160	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	35,900.000	712,615.000	
	アメリカ・ドル 小計	7,568,897.000	274,566,834.360 (30,265,502,151)	
イギリス・ポンド	ASSURA PLC	560,020.000	343,852.280	
	BIG YELLOW GROUP PLC	50,190.000	401,770.950	
	BRITISH LAND CO PLC	350,360.000	2,216,027.000	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	149,760.000	84,913.920	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	72,808.000	80,816.880	
	DERWENT LONDON PLC	37,830.000	1,030,489.200	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	168,530.000	189,090.660	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	112,640.000	690,483.200	
	HAMMERSON PLC	270,113.000	1,592,316.130	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	251,910.000	313,879.860	
	INTU PROPERTIES PLC	308,690.000	819,263.260	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	270,560.000	2,867,936.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	234,190.000	387,584.450	
	MCKAY SECURITIES PLC	29,060.000	66,024.320	
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	20,463.000	102,253.610	
	NEWRIVER REIT PLC	81,127.000	289,542.260	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	198,840.000	224,689.200	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	447,860.000	172,426.100	
	REGIONAL REIT LTD	80,970.000	85,990.140	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	70,060.000	309,314.900	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	171,090.000	110,695.230	

	SEGRO PLC	340,750.000	1,705,453.750	
	SHAFTESBURY PLC	95,120.000	924,566.400	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	466,886.000	682,587.330	
	UNITE GROUP PLC	74,990.000	481,810.750	
	WORKSPACE GROUP PLC	40,310.000	365,410.150	
イギリス・ポンド 小計		4,955,127.000	16,539,187.930 (2,324,417,471)	
イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	56,000.000	723,520.000	
イスラエル・シケル 小計		56,000.000	723,520.000 (22,595,530)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	4,900.000	54,929.000	
	ALLIED PROPERTIES REIT	13,990.000	539,454.400	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,120.000	344,000.400	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,917.000	388,803.870	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	4,630.000	150,243.500	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	22,390.000	760,364.400	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	12,090.000	581,166.300	
	CHOICE PROPERTIES REIT	16,320.000	228,806.400	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	29,930.000	391,484.400	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	14,080.000	202,470.400	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,277.000	168,929.460	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,140.000	254,194.200	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	8,770.000	76,737.500	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	18,140.000	360,079.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,780.000	403,782.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	48,300.000	1,114,764.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,700.000	111,655.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4,810.000	73,689.200	
	MORGUARD REAL ESTATE INV TR	8,820.000	131,770.800	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	8,050.000	169,774.500	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,840.000	159,530.000	
	ONEREIT	9,828.000	36,658.440	
PLAZA RETAIL REIT	14,000.000	66,640.000		
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	44,830.000	307,533.800		

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	54,910.000	1,400,205.000	
	SLATE OFFICE REIT	11,022.000	88,396.440	
	SLATE RETAIL REIT	5,860.000	85,731.800	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,510.000	688,965.300	
カナダ・ドル 小計		482,954.000	9,340,759.510 (765,381,834)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	280,510.000	294,535.500	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	352,800.000	437,472.000	
	INVESTORE PROPERTY LTD	65,120.000	88,563.200	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	452,000.000	644,100.000	
	PRECINCT PROPERTIES	338,740.000	413,262.800	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	152,470.000	247,001.400	
	STRIDE STAPLED GROUP	119,270.000	208,722.500	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	115,500.000	257,565.000	
ニュージーランド・ドル 小計		1,876,410.000	2,591,222.400 (205,717,147)	
ユーロ	AEDIFICA	6,010.000	460,906.900	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	34,830.000	436,942.350	
	ALTAREA	902.000	169,801.500	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	22,200.000	345,321.000	
	BEFIMMO	7,710.000	410,557.500	
	BENI STABILI SPA	343,798.000	221,749.710	
	COFINIMMO SA	6,840.000	744,534.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	16,763.000	618,806.140	
	FONCIERE DES REGIONS	18,240.000	1,518,115.200	
	GECINA SA	13,770.000	1,889,244.000	
	GREEN REIT PLC	232,640.000	331,512.000	
	HAMBORNER REIT AG	27,890.000	262,444.900	
	HIBERNIA REIT PLC	230,280.000	309,956.880	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	37,214.000	544,440.820	
	ICADE	15,200.000	1,132,856.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	112,110.000	93,275.520	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,490.000	100,800.500	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	122,990.000	167,266.400	
	KLEPIERRE	70,527.000	2,661,336.340	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	30,000.000	235,560.000	
MERCIALYS	19,060.000	343,747.100		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	159,879.000	1,843,404.870		

	MONTEA SCA	2,231.000	108,203.500	
	NSI NV	48,860.000	190,896.020	
	RETAIL ESTATES	2,080.000	166,400.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	33,940.000	7,926,687.000	
	VASTNED RETAIL	6,260.000	225,986.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	5,340.000	503,401.800	
	WERELDHAVE BELGIUM	780.000	76,947.000	
	WERELDHAVE NV	13,920.000	612,132.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,350.000	49,943.250	
	XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS	1,350.000	3,171.150	
	ユーロ 小計	1,649,454.000	24,706,347.350 (3,051,480,961)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	723,070.000	3,731,041.200	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	462,000.000	4,412,100.000	
	LINK REIT	757,020.000	47,881,515.000	
	PROSPERITY REIT	418,000.000	1,396,120.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	261,000.000	597,690.000	
	SPRING REIT	306,000.000	1,043,460.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	342,000.000	1,778,400.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	362,000.000	1,708,640.000	
	香港・ドル 小計	3,631,090.000	62,548,966.200 (884,442,383)	
投資証券 合計		20,219,932	37,519,537,477 (37,519,537,477)	
合計			42,240,055,202 (42,240,055,202)	

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	-%	71.40%	71.65%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	-%	5.48%	5.50%
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 32銘柄	8.01%	-%	8.04%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.03%	-%	1.84%
	投資証券 28銘柄	-%	1.81%	
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	3.09%	-%	3.11%
ニュージーランド・ドル	投資証券 8銘柄	-%	0.49%	0.49%
ユーロ	投資証券 32銘柄	-%	7.20%	7.22%
香港・ドル	投資証券 8銘柄	-%	2.09%	2.09%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		129,219,270
コール・ローン		2,576,910,130
国債証券		170,285,159,138
派生商品評価勘定		917,333,061
未収利息		1,143,703,324
前払費用		132,100,139
流動資産合計		175,184,425,062
資産合計		175,184,425,062
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		97,483,187
未払解約金		50,330,000
流動負債合計		147,813,187
負債合計		147,813,187
純資産の部		
元本等		
元本	1	130,406,252,857
剰余金		
剰余金又は欠損金()		44,630,359,018
元本等合計		175,036,611,875
純資産合計		175,036,611,875
負債純資産合計		175,184,425,062

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29年6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	122,549,694,187円
同期中追加設定元本額	26,449,784,070円
同期中一部解約元本額	18,593,225,400円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	457,598,863円
投資のソムリエ	13,592,051,274円
投資のソムリエ<DC年金>	646,581,709円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	338,762,081円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,210,379,019円
ワールドアセットバランス（基本コース）	2,327,881,799円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	4,148,586,734円
外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	2,676,088,257円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	21,041,008,876円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,134,897,772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)	7,159,780,935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)	33,594,645,752円
D I A Mバランス30VA(適格 機関投資家限定)	32,902,978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)	30,025,369,008円
D I A Mバランス20VA(適格 機関投資家限定)	180,055,740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)	2,967,999,339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)	2,771,576,680円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	3,637,678,831円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	462,407,210円
計	130,406,252,857円
2. 受益権の総数	130,406,252,857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29年1月18日 至 平成29年6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29年6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29年6月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,675,049,811
合計	3,675,049,811

(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29年6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29年6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	172,210,508,242	-	171,390,658,368	819,849,874
アメリカ・ドル	75,855,706,363	-	75,647,563,050	208,143,313
イギリス・ポンド	12,559,052,181	-	12,366,547,956	192,504,225
オーストラリア・ドル	3,633,693,599	-	3,666,581,127	32,887,528
カナダ・ドル	3,502,183,966	-	3,506,316,886	4,132,920
シンガポール・ドル	640,064,542	-	637,737,636	2,326,906
スウェーデン・クローナ	768,741,874	-	763,149,864	5,592,010
デンマーク・クローネ	1,014,152,511	-	1,007,359,958	6,792,553
ノルウェー・クローネ	437,603,821	-	432,719,407	4,884,414
ポーランド・ズロチ	1,123,430,392	-	1,115,700,282	7,730,110
マレーシア・リンギット	659,498,224	-	655,814,500	3,683,724
メキシコ・ペソ	1,509,954,384	-	1,550,873,790	40,919,406
ユーロ	69,597,351,518	-	69,111,675,712	485,675,806
南アフリカ・ランド	909,074,867	-	928,618,200	19,543,333
合計	172,210,508,242	-	171,390,658,368	819,849,874

(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取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取相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.3422円
(1万口当たり純資産額)	(13,422円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年6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 0.75 07/15/19	11,000,000.000	10,862,830.000	
		US T N/B 0.75 08/15/19	7,000,000.000	6,908,370.000	
		US T N/B 0.75 08/31/18	10,000,000.000	9,939,400.000	
		US T N/B 0.875 05/15/19	6,200,000.000	6,146,432.000	
		US T N/B 0.875 05/31/18	4,000,000.000	3,986,400.000	
		US T N/B 0.875 06/15/19	5,000,000.000	4,953,700.000	
		US T N/B 0.875 09/15/19	3,500,000.000	3,461,570.000	
		US T N/B 1.0 09/15/18	10,800,000.000	10,764,036.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	10,700,000.000	10,612,153.000	
		US T N/B 1.0 11/15/19	10,000,000.000	9,906,600.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	9,400,000.000	9,309,666.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	8,000,000.000	7,928,400.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,788,200.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	8,500,000.000	8,440,500.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	4,700,000.000	4,695,770.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,072,484.000	
		US T N/B 1.25 10/31/18	12,500,000.000	12,498,000.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	9,000,000.000	8,973,270.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	7,500,000.000	7,352,925.000	
		US T N/B 1.25 11/30/18	13,500,000.000	13,492,035.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	12,000,000.000	11,900,520.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,898,400.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,160,000.000	3,149,382.400	
		US T N/B 1.5 02/28/19	8,500,000.000	8,526,520.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	5,900,000.000	5,919,588.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	9,244,144.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	7,100,000.000	7,121,016.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	7,700,000.000	7,375,753.000	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,651,432.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	6,000,000.000	5,735,100.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	7,900,000.000	7,832,060.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	6,380,000.000	6,310,202.800	
		US T N/B 1.75 02/28/22	7,500,000.000	7,500,525.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	7,270,000.000	7,266,583.100	
		US T N/B 1.75 05/15/23	6,000,000.000	5,950,260.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	7,600,000.000	7,570,892.000	
US T N/B 1.875 03/31/22	8,200,000.000	8,244,198.000			
US T N/B 2.0 02/15/22	7,000,000.000	7,084,700.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	6,000,000.000	6,043,560.000			
US T N/B 2.0 02/15/25	6,600,000.000	6,561,324.000			

US T N/B 2.0 05/31/21	8,060,000.000	8,165,102.400	
US T N/B 2.0 07/31/20	10,500,000.000	10,650,885.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,000,000.000	4,952,700.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	5,200,000.000	5,264,168.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	7,660,000.000	7,769,461.400	
US T N/B 2.0 11/15/21	8,900,000.000	9,012,229.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	6,000,000.000	5,903,400.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,900,000.000	5,908,260.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	7,680,000.000	7,819,161.600	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,972,186.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,000,000.000	12,208,080.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	6,000,000.000	6,085,740.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	13,400,000.000	13,628,202.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	4,400,000.000	4,417,160.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	5,920,000.000	6,055,035.200	
US T N/B 2.25 07/31/18	6,100,000.000	6,166,673.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	3,600,000.000	3,157,020.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	6,600,000.000	6,688,638.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,700,000.000	7,764,295.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	11,300,000.000	11,431,532.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	6,410,000.000	6,559,224.800	
US T N/B 2.375 12/31/20	11,950,000.000	12,275,757.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	4,185,675.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,650,000.000	3,387,638.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	5,990,000.000	6,183,716.600	
US T N/B 2.5 05/15/46	3,550,000.000	3,292,341.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,926,125.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	9,350,000.000	9,665,562.500	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	12,274,151.200	
US T N/B 2.75 02/15/19	3,700,000.000	3,789,170.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	4,630,000.000	4,856,036.600	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	3,175,467.400	
US T N/B 2.75 11/15/23	11,100,000.000	11,642,790.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,348,456.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,800,000.000	2,817,920.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	3,970,000.000	3,982,704.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,000,000.000	4,010,280.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,000,000.000	5,142,550.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,710,000.000	2,799,755.200	
US T N/B 3.0 05/15/45	3,550,000.000	3,650,110.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	3,800,000.000	3,907,730.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	4,300,000.000	4,420,228.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,260,000.000	1,332,046.800	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,800,000.000	2,949,828.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,653,765.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	105,593.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,460,000.000	4,699,368.200	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,850,000.000	1,956,948.500	
US T N/B 3.375 05/15/44	4,800,000.000	5,290,464.000	

US T N/B 3.5 02/15/39	1,200,000.000	1,361,340.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	8,000,000.000	8,460,240.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	3,770,000.000	4,335,500.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	6,200,000.000	6,501,010.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	3,100,000.000	3,561,125.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,340,000.000	1,568,416.400	
US T N/B 3.75 11/15/43	3,400,000.000	3,989,662.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,650,000.000	1,966,717.500	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,090,000.000	1,369,901.100	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,650,000.000	2,076,030.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	610,000.000	781,037.900	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,460,000.000	1,867,427.600	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,600,000.000	2,051,872.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,300,000.000	1,661,348.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,750,000.000	2,273,215.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	700,000.000	911,694.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,080,000.000	1,403,740.800	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,120,000.000	2,803,021.600	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,530,000.000	2,064,536.100	
US T N/B 5.0 05/15/37	690,000.000	952,683.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,082,950.800	
US T N/B 5.25 11/15/28	700,000.000	909,944.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,400,000.000	1,902,250.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	630,000.000	831,940.200	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,046,560.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,295,933.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	900,000.000	1,295,712.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,505,052.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	684,645.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,661,246.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	3,900,000.000	4,466,865.000	
アメリカ・ドル 小計	669,890,000.000 (73,841,974,700)	682,923,847.700 (75,278,695,732)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,800,000.000	1,805,760.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	1,950,000.000	1,974,375.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	450,000.000	456,930.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,500,000.000	2,615,375.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,250,000.000	2,358,675.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,450,000.000	1,387,360.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,150,000.000	4,294,959.500	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	950,000.000	998,070.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,720,000.000	2,908,224.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	500,000.000	506,250.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	2,150,000.000	2,273,066.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,150,000.000	2,355,002.500	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,850,000.000	2,041,253.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,570,000.000	2,085,085.600	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,400,000.000	1,604,442.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,290,000.000	3,027,609.000	

UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,150,000.000	2,986,780.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,460,000.000	2,474,408.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,530,000.000	2,399,499.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	1,170,000.000	1,266,291.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,300,000.000	2,569,330.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,000,000.000	1,148,170.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,360,000.000	2,394,280.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,200,000.000	1,409,280.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	3,003,630.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,450,000.000	2,003,030.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,440,000.000	2,122,992.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,500,000.000	1,982,400.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,600,000.000	2,390,400.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,580,000.000	2,509,672.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,280,000.000	2,111,616.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,600,000.000	2,827,200.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	1,200,000.000	1,292,160.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,000,000.000	2,896,000.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,830,000.000	2,889,570.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,800,000.000	2,029,680.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,250,000.000	1,785,875.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,500,000.000	2,340,900.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,550,000.000	2,049,565.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,000,000.000	1,530,200.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,991,960.000	
イギリス・ポンド 小計	68,500,000.000 (9,626,990,000)	87,097,324.600 (12,240,657,999)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,200,000.000	2,369,114.000
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,000,000.000	2,125,300.000
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	2,600,000.000	2,982,174.000
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,700,000.000	2,694,708.000
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,200,000.000	1,204,344.000
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,650,000.000	1,605,615.000
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	2,510,000.000	2,599,556.800
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	730,000.000	709,348.300
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	2,700,000.000	2,767,824.000
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,950,000.000	1,998,906.000
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,250,000.000	1,277,812.500
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	800,000.000	746,976.000
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,700,000.000	2,887,407.000
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,450,000.000	1,552,848.500
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	450,000.000	458,212.500
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	1,100,000.000	1,124,475.000
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	950,000.000	1,051,697.500
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,950,000.000	3,396,010.500
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,070,000.000	1,304,565.400
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,750,000.000	3,314,245.000
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,550,000.000	3,030,522.000
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,250,000.000	2,660,332.500

オーストラリア・ドル 小計		40,510,000.000 (3,362,735,100)	43,861,994.500 (3,640,984,163)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	350,000.000	564,007.500	
	CANADA 0.5 02/01/19	1,900,000.000	1,893,768.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	1,000,000.000	979,200.000	
	CANADA 0.5 08/01/18	2,400,000.000	2,395,008.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	900,000.000	895,923.000	
	CANADA 0.75 05/01/19	1,000,000.000	1,000,300.000	
	CANADA 0.75 08/01/19	300,000.000	299,916.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	1,700,000.000	1,694,560.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	1,800,000.000	1,788,102.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,400,000.000	1,346,030.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	1,950,000.000	1,963,377.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,250,000.000	2,293,110.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,300,000.000	1,332,643.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,220,000.000	1,238,995.400	
	CANADA 1.75 03/01/19	400,000.000	407,108.000	
	CANADA 1.75 09/01/19	2,000,000.000	2,043,860.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,250,000.000	1,346,937.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,250,000.000	1,363,450.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	2,008,878.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,030,000.000	1,202,113.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	510,000.000	627,657.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,400,000.000	1,529,178.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,430,000.000	1,543,141.600	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,540,000.000	2,017,276.800	
CANADA 3.75 06/01/19	1,350,000.000	1,429,204.500		
CANADA 4.0 06/01/41	1,470,000.000	2,015,458.200		
CANADA 4.25 06/01/18	300,000.000	310,335.000		
CANADA 5.0 06/01/37	1,280,000.000	1,921,497.600		
CANADA 5.75 06/01/29	990,000.000	1,437,291.900		
CANADA 5.75 06/01/33	1,200,000.000	1,853,496.000		
カナダ・ドル 小計		38,720,000.000 (3,172,716,800)	42,741,823.000 (3,502,264,977)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	792,400.000	
	SINGAPORE 1.625 10/01/19	500,000.000	503,900.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	300,000.000	308,700.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	250,000.000	268,350.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	420,000.000	450,660.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	214,500.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	396,529.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,240,000.000	1,330,768.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	600,000.000	642,900.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,037,624.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	270,000.000	308,340.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	740,000.000	830,642.600	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	830,000.000	858,884.000	
シンガポール・ドル 小計		7,500,000.000 (597,375,000)	7,944,197.600 (632,755,339)	

スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,600,000.000	4,847,986.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	7,400,000.000	8,099,596.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,500,000.000	6,487,470.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,210,000.000	7,236,481.600	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	9,580,000.000	11,357,952.200	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	9,580,000.000	10,418,824.800	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	9,240,000.000	11,016,852.000	
スウェーデン・クローナ 小計		51,110,000.000 (647,052,600)	59,465,162.600 (752,828,959)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	1,000,000.000	1,012,410.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	6,570,000.000	7,223,715.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	7,300,000.000	8,239,729.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,830,000.000	10,133,308.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	11,310,000.000	12,571,065.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	12,300,000.000	20,769,534.000	
デンマーク・クローネ 小計		47,310,000.000 (785,819,100)	59,949,761.000 (995,765,530)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	3,000,000.000	3,032,520.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,600,000.000	1,642,592.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,100,000.000	3,203,013.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	5,600,000.000	5,888,792.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	4,400,000.000	4,913,700.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	6,560,000.000	7,300,624.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,200,000.000	6,667,790.000	
ノルウェー・クローネ 小計		30,460,000.000 (395,370,800)	32,649,031.000 (423,784,422)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	1,500,000.000	1,475,700.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,000,000.000	1,947,600.000	
	POLAND 10/25/18	1,500,000.000	1,465,050.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	2,500,000.000	2,465,500.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,500,000.000	3,346,875.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	1,600,000.000	1,510,000.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	5,800,000.000	5,960,080.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,600,000.000	3,665,340.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,570,000.000	2,751,570.500	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,157,344.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,110,000.000	2,280,699.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	900,000.000	1,134,072.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,894,436.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	1,780,000.000	2,020,656.000	
ポーランド・ズロチ 小計		35,620,000.000 (1,050,790,000)	37,074,922.500 (1,093,710,214)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.48 03/15/23	2,190,000.000	2,152,967.100	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,580,000.000	1,505,771.600	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	2,170,000.000	2,179,895.200	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	340,000.000	321,932.400	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,145,780.000	

	MALAYSIA 4.16 07/15/21	3,960,000.000	4,039,596.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	690,000.000	704,993.700	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	5,760,000.000	5,886,950.400	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,519,190.400	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,858,718.600	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,720,000.000	1,764,118.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,630,027.600	
マレーシア・リンギット 小計		25,370,000.000 (655,814,500)	25,709,941.000 (664,601,975)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	9,880,000.000	12,775,334.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	25,720,000.000	30,093,943.200	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	18,450,000.000	18,034,875.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	8,000,000.000	7,620,400.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	10,000,000.000	9,150,500.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	7,500,000.000	7,324,425.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	35,860,000.000	35,161,805.800	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	12,000,000.000	12,341,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	13,940,000.000	14,665,577.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,880,000.000	22,151,800.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	20,000,000.000	20,502,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	12,500,000.000	13,106,875.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	9,000,000.000	9,996,030.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,820,000.000	13,469,481.000	
MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	24,000,000.000	24,478,800.000		
メキシコ・ペソ 小計		239,550,000.000 (1,454,068,500)	250,873,246.800 (1,522,800,608)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	730,000.000	745,074.500	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,590,000.000	1,634,440.500	
	AUSTRIA 07/15/23	750,000.000	753,600.000	
	AUSTRIA 1.15 10/19/18	420,000.000	430,290.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	830,000.000	894,192.200	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	360,000.000	362,538.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	930,000.000	1,034,876.100	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	830,000.000	927,774.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	660,000.000	694,557.600	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	630,000.000	765,090.900	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	650,000.000	911,488.500	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	980,000.000	1,174,373.200	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,390,000.000	1,622,825.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,050,000.000	1,253,122.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	360,000.000	610,138.800	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,350,000.000	1,536,637.500	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,100,000.000	1,681,900.000		

AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,030,000.000	1,121,041.700	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	950,000.000	1,327,853.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	760,000.000	1,200,108.400	
BELGIUM 0.2 10/22/23	360,000.000	365,976.000	
BELGIUM 0.5 10/22/24	300,000.000	307,209.000	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,650,000.000	1,719,069.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	500,000.000	509,105.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,400,000.000	1,470,154.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,090,000.000	1,088,245.100	
BELGIUM 1.25 06/22/18	900,000.000	917,271.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	350,000.000	354,942.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	480,000.000	470,097.600	
BELGIUM 1.9 06/22/38	800,000.000	878,504.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	440,000.000	466,356.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,250,000.000	1,431,987.500	
BELGIUM 2.25 06/22/57	200,000.000	218,550.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,500,000.000	1,765,365.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	580,000.000	748,217.400	
BELGIUM 3.0 09/28/19	1,130,000.000	1,224,242.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	830,000.000	1,231,985.600	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,000,000.000	2,285,060.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,080,000.000	1,170,147.600	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,830,000.000	2,215,398.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	710,000.000	1,005,800.200	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,670,000.000	2,616,839.900	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,450,000.000	1,743,799.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,550,000.000	1,924,061.500	
BELGIUM 4.5 03/28/26	850,000.000	1,160,241.500	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,850,000.000	3,007,896.500	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,000,000.000	3,035,860.000	
BUNDESUBL 0.25 10/11/19	2,300,000.000	2,352,647.000	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	1,700,000.000	1,751,731.000	
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	1,750,000.000	1,790,530.000	
BUNDESUBL 04/08/22	300,000.000	306,690.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,250,000.000	2,302,200.000	
BUNDESUBL 04/17/20	2,250,000.000	2,296,080.000	
BUNDESUBL 1.0 02/22/19	1,200,000.000	1,236,324.000	
BUNDESUBL 1.0 10/12/18	1,050,000.000	1,075,399.500	
BUNDESUBL 10/08/21	2,600,000.000	2,661,100.000	
BUNDESSCHAT 09/14/18	4,000,000.000	4,040,080.000	
BUNDESSCHAT 12/14/18	2,000,000.000	2,023,620.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,450,000.000	2,449,020.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,770,000.000	2,889,110.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,400,000.000	2,485,560.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,320,000.000	2,281,812.800	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,750,000.000	1,892,590.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,150,000.000	2,324,365.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,800,000.000	1,989,072.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,970,000.000	2,181,676.500	

DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,500,000.000	1,673,175.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,500,000.000	1,650,735.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,350,000.000	1,527,430.500	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,450,000.000	2,723,150.500	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,000,000.000	2,232,200.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,800,000.000	2,053,710.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	1,900,000.000	2,081,260.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,600,000.000	1,793,280.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,300,000.000	2,560,590.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,000,000.000	2,670,200.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,210,000.000	2,960,228.700	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	1,400,000.000	1,560,160.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,537,820.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	1,700,000.000	1,968,770.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,420,000.000	2,126,876.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	1,410,000.000	1,534,785.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	2,400,000.000	2,571,144.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,260,000.000	3,545,849.600	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	1,200,000.000	1,264,452.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,310,000.000	2,191,106.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,200,000.000	1,772,520.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,810,000.000	2,989,758.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,550,000.000	2,786,125.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,690,000.000	2,792,725.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,300,000.000	2,019,160.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,683,152.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	850,000.000	1,452,650.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,170,000.000	1,898,208.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	380,000.000	391,316.400	
FINLAND 0.5 04/15/26	430,000.000	436,849.900	
FINLAND 0.75 04/15/31	400,000.000	398,028.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	520,000.000	547,762.800	
FINLAND 04/15/22	450,000.000	456,817.500	
FINLAND 09/15/23	490,000.000	491,857.100	
FINLAND 1.125 09/15/18	330,000.000	337,788.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	600,000.000	658,260.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	450,000.000	494,644.500	
FINLAND 2.0 04/15/24	500,000.000	568,460.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	420,000.000	555,781.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	440,000.000	544,878.400	
FINLAND 3.375 04/15/20	730,000.000	813,088.600	
FINLAND 3.5 04/15/21	560,000.000	646,144.800	
FINLAND 4.0 07/04/25	470,000.000	615,822.200	
FINLAND 4.375 07/04/19	460,000.000	508,217.200	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,235,924.800	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,000,000.000	4,100,640.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,400,000.000	3,300,074.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,350,000.000	3,406,581.500	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,500,000.000	2,505,275.000	

FRANCE OAT 0.5 11/25/19	3,100,000.000	3,181,530.000	
FRANCE OAT 02/25/19	3,150,000.000	3,181,500.000	
FRANCE OAT 05/25/20	3,700,000.000	3,757,461.000	
FRANCE OAT 05/25/21	3,200,000.000	3,250,880.000	
FRANCE OAT 05/25/22	1,900,000.000	1,924,073.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	3,570,000.000	3,681,491.100	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	3,800,000.000	3,888,274.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,500,000.000	3,682,455.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,900,000.000	1,874,160.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,210,000.000	3,404,782.800	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,850,000.000	4,276,811.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,340,000.000	1,272,785.600	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	610,000.000	642,555.700	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,200,000.000	3,574,496.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,400,000.000	3,915,406.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,000,000.000	2,265,080.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,050,000.000	3,630,506.500	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	2,900,000.000	3,195,684.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,950,000.000	4,770,731.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	3,600,000.000	4,182,300.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,350,000.000	3,185,918.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	3,600,000.000	4,175,460.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,000,000.000	3,350,610.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,870,000.000	3,646,335.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	3,050,000.000	3,550,657.500	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	2,460,000.000	2,715,667.800	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,380,000.000	2,196,822.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,250,000.000	2,039,475.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,500,000.000	3,709,275.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	1,990,000.000	2,171,965.600	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,560,000.000	4,541,064.800	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,150,000.000	5,047,276.500	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,500,000.000	3,920,350.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,750,000.000	4,220,177.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,950,000.000	4,911,455.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,300,000.000	3,395,720.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	1,801,885.200	
IRISH 0.8 03/15/22	790,000.000	827,872.600	
IRISH 1.0 05/15/26	800,000.000	822,288.000	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.000	304,605.000	
IRISH 2.0 02/18/45	630,000.000	646,361.100	
IRISH 2.4 05/15/30	860,000.000	987,821.800	
IRISH 3.4 03/18/24	770,000.000	935,026.400	
IRISH 3.9 03/20/23	550,000.000	674,740.000	
IRISH 4.4 06/18/19	590,000.000	648,292.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,070,000.000	1,221,544.100	
IRISH 4.5 10/18/18	490,000.000	522,727.100	
IRISH 5.0 10/18/20	780,000.000	922,435.800	
IRISH 5.4 03/13/25	1,020,000.000	1,404,529.800	

IRISH 5.9 10/18/19	740,000.000	851,777.000	
ITALY BTPS 0.1 04/15/19	5,100,000.000	5,124,480.000	
ITALY BTPS 0.3 10/15/18	3,150,000.000	3,174,097.500	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	1,100,000.000	1,103,498.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	3,100,000.000	3,069,992.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,751,125.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,300,000.000	2,218,235.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	2,300,000.000	2,332,890.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,200,000.000	2,187,020.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	4,800,000.000	4,916,832.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,800,000.000	1,694,646.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,150,000.000	1,180,946.500	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,350,000.000	1,387,138.500	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,000,000.000	1,973,620.000	
ITALY BTPS 1.5 08/01/19	2,500,000.000	2,582,250.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,000,000.000	1,953,200.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,000,000.000	1,808,840.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,100,000.000	2,136,351.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,500,000.000	1,516,050.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,400,000.000	1,292,900.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	700,000.000	682,241.000	
ITALY BTPS 2.5 05/01/19	1,000,000.000	1,049,330.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,050,000.000	2,180,175.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,250,000.000	1,124,875.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	589,890.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.000	1,615,920.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,680,000.000	2,997,821.200	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,450,000.000	2,757,646.500	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,500,000.000	2,817,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	2,000,000.000	2,263,800.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,186,881.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,400,000.000	2,814,720.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	2,660,000.000	2,979,200.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	2,520,000.000	2,700,910.800	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,100,000.000	2,332,890.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	1,820,000.000	2,029,118.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	2,700,000.000	2,915,514.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,000,000.000	2,397,080.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,550,000.000	1,882,630.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	3,100,734.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,100,000.000	2,546,460.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,200,000.000	2,585,000.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,200,000.000	2,742,784.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,800,000.000	2,281,860.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,200,000.000	2,632,740.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,000,000.000	2,487,420.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,370,000.000	3,090,954.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,100,000.000	2,761,500.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,080,000.000	2,711,488.000	

ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,230,000.000	2,921,969.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,360,000.000	2,915,095.600	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,700,000.000	2,103,971.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,600,000.000	2,231,360.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,650,000.000	3,736,765.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,400,000.000	3,378,240.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	900,000.000	1,312,920.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,871,980.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	1,550,000.000	1,588,285.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,500,000.000	1,510,785.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,390,000.000	1,413,908.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	750,000.000	769,852.500	
NETHERLANDS 01/15/22	1,830,000.000	1,863,068.100	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	1,500,000.000	1,547,700.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,440,000.000	1,609,488.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,580,000.000	1,805,734.600	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,660,000.000	1,882,191.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,250,000.000	1,568,625.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,120,000.000	1,560,171.200	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,450,000.000	1,675,765.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,380,000.000	1,558,158.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,090,000.000	1,337,321.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,540,000.000	2,436,711.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,430,000.000	2,227,225.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	1,290,000.000	1,356,951.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,170,000.000	1,286,181.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,220,000.000	1,860,012.000	
SPAIN 0.25 01/31/19	2,600,000.000	2,623,660.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,100,000.000	2,116,590.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	2,300,000.000	2,371,990.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	1,900,000.000	1,978,223.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,990,000.000	1,988,348.300	
SPAIN 1.4 01/31/20	3,100,000.000	3,234,044.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,050,000.000	2,060,865.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,900,000.000	1,984,645.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	2,100,000.000	2,224,383.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,840,000.000	1,863,202.400	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,160,000.000	2,330,424.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	600,000.000	612,600.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	2,500,000.000	2,644,700.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,300,000.000	2,602,910.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,070,000.000	1,096,108.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	450,000.000	482,580.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	2,950,000.000	3,121,306.500	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,950,000.000	2,344,485.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	2,070,000.000	2,319,310.800	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,900,000.000	2,445,604.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	1,720,000.000	1,906,534.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,070,000.000	2,562,390.900	

	SPAIN 4.6 07/30/19	1,810,000.000	1,998,674.400	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,950,000.000	2,491,807.500	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,500,000.000	2,068,350.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,480,000.000	1,874,627.200	
	SPAIN 4.85 10/31/20	1,400,000.000	1,634,430.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,520,000.000	2,135,600.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,250,000.000	3,057,975.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,080,000.000	1,585,548.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,900,000.000	2,430,214.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,000,000.000	2,431,660.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,900,000.000	2,832,824.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,550,000.000	1,959,990.500	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,340,000.000	1,874,941.400	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,800,000.000	2,634,534.000	
	ユーロ 小計	477,870,000.000 (59,021,723,700)	555,801,649.300 (68,647,061,705)	
	南アフリカ・ランド			
	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	24,940,000.000	28,195,667.600	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	12,410,000.000	9,022,814.600	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,780,000.000	5,578,571.200	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	16,150,000.000	15,748,672.500	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	8,690,000.000	7,290,910.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	6,020,000.000	5,580,058.400	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,000,000.000	5,565,540.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	5,100,000.000	4,651,557.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	13,000,000.000	11,890,450.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	11,460,000.000	10,481,316.000	
	南アフリカ・ランド 小計	111,550,000.000 (953,752,500)	104,005,557.300 (889,247,515)	
国債証券 合計		155,566,183,300 (155,566,183,300)	170,285,159,138 (170,285,159,138)	
合計		155,566,183,300 (155,566,183,300)	170,285,159,138 (170,285,159,138)	

- (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 120銘柄	43.01%	44.21%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	6.99%	7.19%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	2.08%	2.14%
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	2.00%	2.06%
シンガポール・ドル	国債証券 13銘柄	0.36%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.43%	0.44%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.57%	0.58%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.24%	0.25%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.62%	0.64%
マレーシア・リンギット	国債証券 12銘柄	0.38%	0.39%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.87%	0.89%
ユーロ	国債証券 276銘柄	39.22%	40.31%

南アフリカ・ランド	国債証券	10銘柄	0.51%	0.52%
-----------	------	------	-------	-------

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		2,991,700,894
コール・ローン		66,586,781
株式		42,699,588,530
投資信託受益証券		291,275,124
投資証券		102,048,943
派生商品評価勘定		128,490,151
未収入金		1,806,993
未収配当金		67,698,132
差入委託証拠金		519,000,399
流動資産合計		46,868,195,947
資産合計		46,868,195,947
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		654,215
未払解約金		38,268,000
流動負債合計		38,922,215
負債合計		38,922,215
純資産の部		
元本等		
元本	1	43,308,447,537
剰余金		
剰余金又は欠損金()		3,520,826,195
元本等合計		46,829,273,732
純資産合計		46,829,273,732
負債純資産合計		46,868,195,947

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>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29年6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	41,562,622,591円
	同期中追加設定元本額	9,052,320,659円
	同期中一部解約元本額	7,306,495,713円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	D I A M新興国株式インデックス ファンド< D C 年金 >	2,074,768,247円
	D I A M新興国株式インデックス ファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	156,330,882円
	M I T O ラップ型ファンド(安 定型)	8,886,002円
	M I T O ラップ型ファンド(中 立型)	22,658,297円
	M I T O ラップ型ファンド(積 極型)	28,468,171円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	12,654,635円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	20,934,286円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,698,905円
	たわらノーロード 新興国株式	1,507,700,322円
	たわらノーロード 新興国株式< ラップ向け >	462,665,596円
	マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	475,842,627円
	D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	40,721,535円
	D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	116,034,334円
	D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	249,750,952円
	投資のソムリエ	3,112,365,436円
	クルーズコントロール	2,416,961,015円
	投資のソムリエ< D C 年金 >	146,209,361円
	D I A M 8資産バランスファン ドN< D C 年金 >	137,601,301円
	クルーズコントロール< D C 年金 >	696,689円
	D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	23,987,502円
	D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	63,003,087円
	投資のソムリエ< D C 年金 >リス ク抑制型	69,991,169円
	ダイナミック・ナビゲーション	1,767,449円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド	673,346,539円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	781,824,653円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	1,293,297,893円
エマージング株式パッシブファン ドVA(適格機関投資家専用)	5,932,765,214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)	2,133,378,511円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	13,020,542,312円
DIAM世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資家 限定)	8,307,594,615円
計	43,308,447,537円
2. 受益権の総数	43,308,447,537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29年1月18日 至 平成29年6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、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。
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29年6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	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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29年6月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	2,127,048,027	
投資信託受益証券	6,126,540	
投資証券	3,905,523	
合計	2,137,080,090	

（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29年4月19日から平成29年6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29年6月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち		時価 （円）
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買 建	3,584,132,859	-	3,711,968,795	127,835,936
合計	3,584,132,859	-	3,711,968,795	127,835,936

（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29年6月12日現在	
1口当たり純資産額	1.0813円
（1万口当たり純資産額）	（10,813円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年6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	CTIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	30,600	55.830	1,708,398.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	21,773	12.730	277,170.290	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PEF	65,400	4.760	311,304.000	
	CREDICORP LTD	5,449	173.630	946,109.870	
	SINA CORP	4,600	87.650	403,190.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	41,925	9.450	396,191.250	
	NETEASE INC-ADR	6,600	303.620	2,003,892.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,680	36.270	242,283.600	
	LUKOIL SPON ADR	36,509	47.965	1,751,154.180	
	GAZPROM PAO ADR	457,219	4.147	1,896,087.190	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	93,476	4.545	424,848.420	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	79,280	1.614	127,957.920	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	26,843	2.720	73,012.960	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	66,314	4.498	298,280.370	
	SISTEMA PJSC GDR	15,837	4.530	71,741.610	
	NOVATEK PJSC GDR	7,964	110.100	876,836.400	
	BAIDU INC -SPON ADR	22,700	181.070	4,110,289.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,285	18.950	232,800.750	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	49,394	14.050	693,985.700	
	ROSTELECOM SPON ADR	22,558	7.500	169,185.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	105,281	5.290	556,936.490	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	11,000	72.470	797,170.000	
	SEVERSTAL GDR	16,907	12.750	215,564.250	
	TATNEFT ADR	21,909	37.020	811,071.180	
	VTB BANK OJSC GDR	243,997	2.209	538,989.370	
	DP WORLD LTD	13,696	22.950	314,323.200	
	MAGNIT PJSC GDR	26,052	36.130	941,258.760	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	33,100	12.610	417,391.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	103,138	1.350	139,236.300	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	3,800	121.400	461,320.000	
	SBERBANK ADR	229,514	10.870	2,494,817.180	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,464	13.900	187,149.600	
YY INC-ADR	2,400	58.850	141,240.000		
58.COM INC ADR	7,500	43.790	328,425.000		
AUTOHOME INC ADR	4,400	44.990	197,956.000		

	WEIBO CORP ADR	3,160	74.910	236,715.600	
	JD.COM INC ADR	54,600	39.000	2,129,400.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	94,100	139.440	13,121,304.000	
	MOMO INC SPON ADR	7,300	37.440	273,312.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	32,000	39.790	1,273,280.000	
アメリカ・ドル 小計		2,100,724		42,591,578.440 (4,694,869,690)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	101,220	5.750	582,015.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	143,415	17.500	2,509,762.500	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	171,759	7.280	1,250,405.520	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	116,628	10.800	1,259,582.400	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	293,819	7.600	2,233,024.400	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	274,203	2.250	616,956.750	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.550	454,323.300	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	272,783	0.751	204,860.030	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	144,727	2.920	422,602.840	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,696,720		9,533,532.740 (286,577,994)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	108,163	1,335.700	144,473,319.100	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	42,425	703.750	29,856,593.750	
	ASIAN PAINTS LTD	24,369	1,155.750	28,164,471.750	
	EICHER MOTORS LTD	1,122	29,764.850	33,396,161.700	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	23,731	1,113.700	26,429,214.700	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	30,428	1,426.700	43,411,627.600	
	SHREE CEMENT LTD	709	18,154.300	12,871,398.700	
	ICICI BANK LTD	180,100	322.150	58,019,215.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	34,292	539.650	18,505,677.800	
	STATE BANK OF INDIA LTD	132,533	288.550	38,242,397.150	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,657	1,180.750	4,318,002.750	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	24,616	760.100	18,710,621.600	
	TATA STEEL LTD	25,328	507.050	12,842,562.400	
	TATA MOTORS LTD	128,886	467.100	60,202,650.600	
	JSW STEEL LTD	65,122	202.000	13,154,644.000	
	TATA POWER CO LTD	91,986	77.800	7,156,510.800	
	NESTLE INDIA LTD	1,963	6,667.500	13,088,302.500	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	138.750	6,812,486.250	
	GAIL INDIA LTD	40,128	381.150	15,294,787.200	
	VEDANTA LTD	88,360	244.750	21,626,110.000	
AXIS BANK LTD	136,982	513.650	70,360,804.300		
TITAN COMPANY LTD	25,302	525.450	13,294,935.900		

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	94,254	169.200	15,947,776.800	
LUPIN LTD	18,320	1,160.100	21,253,032.000	
ACC LTD	3,300	1,618.750	5,341,875.000	
BAJAJ FINANCE LTD	13,840	1,376.850	19,055,604.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	125,598	1,647.200	206,885,025.600	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	47,419	522.000	24,752,718.000	
INFOSYS LTD	153,275	948.600	145,396,665.000	
WIPRO LTD	51,511	536.950	27,658,831.450	
INDIAN OIL CORP LTD	49,407	420.050	20,753,410.350	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	53,674	1,095.350	58,791,815.900	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,454	1,352.500	8,729,035.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	46,434	860.750	39,968,065.500	
DABUR INDIA LTD	44,319	282.150	12,504,605.850	
HERO MOTOCORP LTD	4,116	3,780.100	15,558,891.600	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,467	2,628.800	24,886,849.600	
BHARTI AIRTEL LTD	100,658	367.800	37,022,012.400	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	2,376.100	12,935,488.400	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	78,758	524.700	41,324,322.600	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,709	7,464.850	65,011,378.650	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,618	647.250	7,519,750.500	
AUROBINDO PHARMA LTD	19,251	608.600	11,716,158.600	
HAVELLS INDIA LTD	20,340	506.350	10,299,159.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	36,187	460.350	16,658,685.450	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	12,785	991.900	12,681,441.500	
CIPLA LTD/INDIA	28,876	551.100	15,913,563.600	
LARSEN & TOUBRO LTD	26,618	1,778.200	47,332,127.600	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,446	4,111.950	30,617,579.700	
ASHOK LEYLAND LTD	97,960	94.900	9,296,404.000	
BOSCH LTD	629	23,863.450	15,010,110.050	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	38,733	2,507.000	97,103,631.000	
NTPC LTD	140,454	157.800	22,163,641.200	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,590	2,947.100	19,421,389.000	
YES BANK LTD	27,741	1,488.800	41,300,800.800	
AMBUJA CEMENTS LTD	50,174	235.050	11,793,398.700	
BHARAT FORGE LTD	8,786	1,175.300	10,326,185.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	98,773	202.150	19,966,961.950	
ITC LTD	279,977	306.000	85,672,962.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	29,211	856.650	25,023,603.150	
SIEMENS INDIA LTD	6,219	1,335.750	8,307,029.250	

	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,072	1,884.500	18,980,684.000	
	TECH MAHINDRA LTD	43,655	386.800	16,885,754.000	
	CAIRN INDIA LTD	37,231	285.350	10,623,865.850	
	IDEA CELLULAR LTD	103,591	78.950	8,178,509.450	
	MARICO LTD	38,600	316.550	12,218,830.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	51,530	128.400	6,616,452.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	61,629	359.850	22,177,195.650	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	59,932	187.850	11,258,226.200	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,305	4,242.200	14,020,471.000	
	BAJAJ AUTO LTD	7,213	2,865.800	20,671,015.400	
	COAL INDIA LTD	52,177	261.500	13,644,285.500	
	TATA MOTORS LTD	31,568	290.850	9,181,552.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	357.100	8,468,626.500	
	BHARTI INFRATEL LTD	47,337	382.650	18,113,503.050	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,750	1,155.250	30,902,937.500	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	540.850	9,814,264.100	
	IDFC BANK LTD	114,421	58.700	6,716,512.700	
	インド・ルピー 小計	3,853,498		2,250,607,167.800 (3,893,550,400)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	6,450.000	970,080,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	142,301	26,500.000	3,770,976,500.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	375,500	8,500.000	3,191,750,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	126,300	47,550.000	6,005,565,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,657,300	8,650.000	14,335,645,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,130,900	4,330.000	17,886,797,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	620,900	3,030.000	1,881,327,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	40,500	75,500.000	3,057,750,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	782,000	3,840.000	3,002,880,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	156,900	17,900.000	2,808,510,000.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	870,500	1,235.000	1,075,067,500.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	4,930.000	1,431,750,880.000	
	BANK MANDIRI	763,000	12,225.000	9,327,675,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	199,400	14,600.000	2,911,240,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	907,100	14,375.000	13,039,562,500.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	787,600	2,340.000	1,842,984,000.000	

	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	636,800	6,400.000	4,075,520,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,748,400	1,550.000	2,710,020,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	241,600	9,375.000	2,265,000,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	831,000	17,700.000	14,708,700,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	3,350.000	973,845,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,560,300	635.000	990,790,500.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	1,900.000	890,150,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	5,125.000	1,025,640,625.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	1,800.000	1,067,040,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,223,000	1,555.000	1,901,765,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	605.000	1,157,244,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	182,600	8,400.000	1,533,840,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	6,200.000	1,120,960,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	2,210.000	866,320,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,740.000	1,400,962,000.000	
	インドネシア・ルビア 小計	22,973,742		123,227,357,505.000 (1,022,787,067)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	11,462	66.000	756,492.000	
	QATAR NATIONAL BANK	19,229	135.000	2,595,915.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	16,651	30.500	507,855.500	
	OOREDOO QSC	6,737	91.000	613,067.000	
	DOHA BANK QSC	10,679	29.550	315,564.450	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,406	186.000	447,516.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	13,442	97.500	1,310,595.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,054	91.700	463,451.800	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	16,079	16.810	270,287.990	
	MASRAF AL RAYAN	30,792	39.350	1,211,665.200	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	31.400	248,562.400	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	66,339	11.350	752,947.650	
	DOHA BANK QSC-RTS	1,284	4.710	6,047.640	
カタール・リアル 小計	208,070		9,499,967.630 (287,564,020)		
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	30,075	13,480.000	405,411,000.000	
	ECOPETROL SA	413,049	1,370.000	565,877,130.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	38,000.000	385,244,000.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	247,861	1,240.000	307,347,640.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,847	12,240.000	463,247,280.000	

	GRUPO ARGOS SA	27,199	21,240.000	577,706,760.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,700	30,520.000	540,204,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,285	32,600.000	1,248,091,000.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	19,160	38,900.000	745,324,000.000	
コロンビア・ペソ	小計	841,314		5,238,452,810.000 (198,013,517)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	187.000	3,683,900.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	20.600	1,775,720.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	100,100	46.000	4,604,600.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	293,900	18.800	5,525,320.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	39,400	58.500	2,304,900.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	142,100	153.500	21,812,350.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	863,055	6.050	5,221,482.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	49,000	189.000	9,261,000.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.160	2,181,600.000	
	IRPC PCL NVDR	863,400	5.050	4,360,170.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	169,100	17.500	2,959,250.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	10,100	210.000	2,121,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	229,000	25.250	5,782,250.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	84,300	173.500	14,626,050.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	238,220	9.650	2,298,823.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	93.500	4,132,700.000	
	PTT PCL	88,200	383.000	33,780,600.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	164,100	21.100	3,462,510.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,650	520.000	6,058,000.000	
	KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	24,900	107.000	2,664,300.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL- NVDR	355,000	44.500	15,797,500.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	22,700	518.000	11,758,600.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	92,100	189.000	17,406,900.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	113,600	69.500	7,895,200.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	323,800	19.200	6,216,960.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	30,300	176.000	5,332,800.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	185,310	37.000	6,856,470.000	
	THAI OIL PCL NVDR	70,200	77.500	5,440,500.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	78.000	3,244,800.000	
	CP ALL PCL NVDR	407,500	62.000	25,265,000.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	8.500	4,630,800.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	115,245	87.000	10,026,315.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	69,622	38.250	2,663,041.500	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	38.250	2,101,187.250	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	182,908	67.750	12,392,017.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	93,000	30.500	2,836,500.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	578,400	7.200	4,164,480.000	
タイ・パーツ 小計		7,811,643		282,645,596.500 (912,945,276)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,707	930.000	5,307,510.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	282.000	1,600,914.000	
	CEZ	13,560	452.800	6,139,968.000	
	MONETA MONEY BANK AS	35,735	77.400	2,765,889.000	
チェコ・コルナ 小計		60,679		15,814,281.000 (74,643,406)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,373,843	40.610	218,231,764.230	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,083	37,744.000	116,364,752.000	
	BANCO DE CHILE	2,049,363	85.940	176,122,256.220	
	EMPRESAS CMPC SA	103,149	1,613.500	166,430,911.500	
	EMPRESAS COPEC SA	36,935	7,731.800	285,574,033.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	12,454	8,593.100	107,018,467.400	
	ENTEL CHILE SA	12,543	7,468.600	93,678,649.800	
	ENEL GENERACION CHILE SA	275,680	503.650	138,846,232.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,450,054	126.590	310,152,335.860	
	COLBUN SA	616,527	148.130	91,326,144.510	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	376.770	84,440,185.320	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,720.500	58,164,290.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	27,396	7,517.300	205,943,950.800	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,047	23,829.000	191,751,963.000	
	SACI FALABELLA	50,696	5,693.200	288,622,467.200	
	ITAU CORPBANCA	9,380,182	6.280	58,907,542.960	
	CENCOSUD SA	117,984	1,833.100	216,276,470.400	
AES GENER SA	257,135	252.990	65,052,583.650		
ENEL CHILE SA	1,664,838	74.320	123,730,760.160		
チリ・ペソ 小計		22,685,405		2,996,635,760.010 (497,741,199)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	183,772	9.610	1,766,048.920	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	16,570	20.820	344,987.400	
	ARCELIK	20,062	26.300	527,630.600	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	22.060	389,954.620	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	112,625	6.440	725,305.000	

	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	42.400	236,761.600	
	KOC HOLDING AS	63,206	16.600	1,049,219.600	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	47,602	5.990	285,135.980	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	56,871	4.800	272,980.800	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	10,370	29.780	308,818.600	
	TURK HAVA YOLLARI	39,958	7.390	295,289.620	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	74,860	12.040	901,314.400	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	192,990	9.600	1,852,704.000	
	TURKIYE IS BANKASI	133,056	7.100	944,697.600	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,559	98.600	1,041,117.400	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	19.630	257,565.230	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	73,599	4.430	326,043.570	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	79,625	10.840	863,135.000	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	37.820	243,976.820	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,094	63.650	1,151,683.100	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	6.460	410,907.680	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	18.300	251,350.500	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	51,480	13.200	679,536.000	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	39,975	6.290	251,442.750	
トルコ・リラ 小計		1,345,450		15,377,606.790 (479,473,779)	
ハンガリー・フォ リント	RICHTER GEDEON NYRT	12,249	7,045.000	86,294,205.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,501	22,300.000	78,072,300.000	
	OTP BANK NYRT	20,037	8,906.000	178,449,522.000	
ハンガリー・フォリント 小計		35,787		342,816,027.000 (137,572,072)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	611,900	41.900	25,638,610.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	157,720	75.300	11,876,316.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	59,486	105.900	6,299,567.400	
	AYALA CORP	21,163	869.000	18,390,647.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	340,600	14.440	4,918,264.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	14.500	5,101,825.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,152.000	5,993,320.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	105.800	4,303,944.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	238,790	80.000	19,103,200.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	36,030	215.800	7,775,274.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	47,451	86.800	4,118,746.800	

	BDO UNIBANK INC	165,213	123.800	20,453,369.400	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.680	4,502,160.000	
	PLDT INC	6,975	1,881.000	13,119,975.000	
	ROBINSONS LAND CORP	172,400	24.600	4,241,040.000	
	SECURITY BANK CORP	9,450	221.600	2,094,120.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	722,075	35.000	25,272,625.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	72,860	163.200	11,890,752.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,988	798.000	15,950,424.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	809,000	6.030	4,878,270.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,180,800	6.190	7,309,152.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	38.750	4,762,375.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	7,440	1,198.000	8,913,120.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,159,556		236,907,096.600 (528,302,826)	
ブラジル・リアル	BRF SA	37,292	42.000	1,566,264.000	
	VALE SA	108,327	27.300	2,957,327.100	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	25.020	200,610.360	
	VALE SA-PREF A	158,996	25.720	4,089,377.120	
	RAIA DROGASIL SA	19,500	74.300	1,448,850.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	9.300	648,210.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	16.520	321,314.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	24,500	12.930	316,785.000	
	BANCO DO BRASIL SA	70,200	27.840	1,954,368.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	341,386	8.810	3,007,610.660	
	LOJAS AMERICANAS SA	61,874	14.400	890,985.600	
	LOJAS AMERICANAS SA	14,670	12.690	186,162.300	
	GERDAU SA	68,030	9.670	657,850.100	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	13,106	68.760	901,168.560	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	242,010	13.780	3,334,897.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	322,412	12.850	4,142,994.200	
	KROTON EDUCACIONAL SA	112,968	14.410	1,627,868.880	
	CCR SA	98,620	16.630	1,640,050.600	
	WEG SA	47,940	18.410	882,575.400	
	BANCO BRADESCO SA PREF	253,896	26.770	6,796,795.920	
	BANCO BRADESCO SA	77,235	26.490	2,045,955.150	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	29.940	443,112.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	50,506	6.710	338,895.260	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	14.720	462,208.000	
	CPFL ENERGIA SA	22,674	26.320	596,779.680	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	269,698	35.650	9,614,733.700	
	PORTO SEGURO SA	9,400	30.110	283,034.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	21,490	36.650	787,608.500	

	BRASKEM SA	12,030	33.800	406,614.000	
	ENGIE BRASIL SA	13,970	33.300	465,201.000	
	LOCALIZA RENT A CAR	13,760	44.140	607,366.400	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	36,128	45.850	1,656,468.800	
	LOJAS RENNEN SA	59,870	27.580	1,651,214.600	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,064	13.400	349,257.600	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	29,052	78.300	2,274,771.600	
	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	14,000	32.290	452,060.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	16,700	51.880	866,396.000	
	EMBRAER SA	55,960	15.580	871,856.800	
	M DIAS BRANCO SA	8,400	51.450	432,180.000	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	16,300	21.850	356,155.000	
	ODONTOPREV SA	22,300	12.000	267,600.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	69,965	12.240	856,371.600	
	JBS SA	69,100	7.280	503,048.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	64,349	7.650	492,269.850	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	29,398	30.200	887,819.600	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,380	66.100	487,818.000	
	DURATEX SA	27,734	8.050	223,258.700	
	SUL AMERICA SA	17,869	17.560	313,779.640	
	HYPERMARCAS SA	29,800	28.820	858,836.000	
	BM&FBOVESPA SA	173,916	18.550	3,226,141.800	
	QUALICORP SA	17,800	29.610	527,058.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	34,900	24.610	858,889.000	
	CIELO SA	99,507	22.800	2,268,759.600	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	59,000	29.760	1,755,840.000	
	AMBEV SA	390,795	18.110	7,077,297.450	
	KLABIN SA	46,700	16.480	769,616.000	
	RUMO SA	68,700	7.880	541,356.000	
ブラジル・リアル	小計	4,121,545		84,449,692.930 (2,823,153,235)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	52,647	7.200	379,058.400	
	MBANK	1,260	447.850	564,291.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	70.090	181,953.640	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,774	114.500	1,348,123.000	
	BANK PEKAO SA	13,110	132.000	1,730,520.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	4.830	283,038.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,078	111.250	2,901,177.500	
	LPP SA	112	6,602.000	739,424.000	

	BANK ZACHODNI WBK SA	2,593	349.000	904,957.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	78,070	35.850	2,798,809.500	
	CCC SA	2,638	216.200	570,335.600	
	SYNTHOS SA	46,508	4.680	217,657.440	
	EUROCASH SA	9,500	31.750	301,625.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,746	56.000	433,776.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	146,377	6.410	938,276.570	
	CYFROWY POLSAT SA	16,740	26.200	438,588.000	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	69.270	266,897.310	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	61,251	11.710	717,249.210	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	89,318	3.490	311,719.820	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	50,502	45.450	2,295,315.900	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,403	70.200	309,090.600	
	ALIOR BANK SA	7,434	66.500	494,361.000	
ポーランド・ズロチ	小計	693,110		19,126,244.490 (564,224,213)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	138,900	5.000	694,500.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	11.120	251,312.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	296,700	6.630	1,967,121.000	
	DIGI.COM BHD	289,900	4.990	1,446,601.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	9.280	641,433.600	
	RHB BANK BHD	68,080	5.130	349,250.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	54,700	9.200	503,240.000	
	GAMUDA BHD	135,700	5.400	732,780.000	
	GENTING BHD	187,500	9.760	1,830,000.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.500	555,015.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	16,656	17.500	291,480.000	
	HONG LEONG BANK BHD	48,008	15.200	729,721.600	
	IJM CORP BHD	239,360	3.480	832,972.800	
	IOI CORP BHD	189,613	4.540	860,843.020	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	39,900	24.800	989,520.000	
	MALAYAN BANKING BHD	295,275	9.570	2,825,781.750	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	86,100	3.980	342,678.000	
	MISC BHD	108,880	7.430	808,978.400	
	PPB GROUP BHD	40,000	16.940	677,600.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	24.320	425,600.000	
	PETRONAS GAS BHD	58,700	19.200	1,127,040.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	251,100	5.700	1,431,270.000	

	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	45.600	519,840.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.530	620,350.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	284,050	14.400	4,090,320.000	
	UMW HOLDINGS BHD	39,000	6.020	234,780.000	
	DIALOG GROUP BHD	243,444	1.950	474,715.800	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	241,330	20.380	4,918,305.400	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.480	215,877.240	
	AIRASIA BHD	107,200	3.320	355,904.000	
	SIME DARBY BERHAD	192,100	9.590	1,842,239.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	57,600	7.000	403,200.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	225,100	4.970	1,118,747.000	
	MAXIS BHD	154,200	6.190	954,498.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	196,300	7.200	1,413,360.000	
	SAPURA ENERGY BHD	319,200	1.890	603,288.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	125,500	2.520	316,260.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	177,700	6.080	1,080,416.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	126,400	1.660	209,824.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	83,500	3.850	321,475.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	2.110	368,296.280	
	マレーシア・リンギット 小計	6,023,737		40,376,434.290 (1,043,730,827)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	256,100	27.100	6,940,310.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	42,300	152.540	6,452,442.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	15,600	141.950	2,214,420.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	152,500	33.970	5,180,425.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	199,500	88.090	17,573,955.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	138,100	45.820	6,327,742.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,060	241.430	3,877,365.800	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,845	192.860	3,441,586.700	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,900	77.450	2,935,355.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	208,300	108.140	22,525,562.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	87,625	49.090	4,301,511.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,155	421.110	5,539,702.050	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	130,300	38.470	5,012,641.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,600	364.180	6,409,568.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	314,452	50.580	15,904,982.160	

	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,783,778	14.750	41,060,725.500	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	193,600	32.440	6,280,384.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	37,300	132.300	4,934,790.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	427,200	42.200	18,027,840.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	30,000	183.750	5,512,500.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	22.510	1,580,202.000	
	GENTERA SAB DE CV	84,900	28.770	2,442,573.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	45,500	87.990	4,003,545.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	50,400	32.950	1,660,680.000	
メキシコ・ペソ 小計		5,370,215		200,140,807.460 (1,214,854,701)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	500,000	0.208	104,000.000	
	ALPHA BANK A.E.	100,000	2.130	213,000.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.329	1,315.340	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	26.690	93,895.420	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	9.750	97,539.000	
	FF GROUP	3,130	19.900	62,287.000	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	0.856	1,395.280	
	OPAP SA	8,501	9.250	78,634.250	
	JUMBO SA	5,623	15.700	88,281.100	
ユーロ 小計		636,404		740,347.390 (91,440,306)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	18,800.000	133,423,600.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,142	87,000.000	99,354,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,205	114,000.000	365,370,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,577	288,000.000	742,176,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,192	70,700.000	296,374,400.000	
	COWAY CO LTD	4,482	104,500.000	468,369,000.000	
	KT&G CORP	9,652	114,000.000	1,100,328,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,579	102,500.000	161,847,500.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	49,650.000	148,801,050.000	
	CJ CORP	1,224	211,000.000	258,264,000.000	
	KAKAO CORP	2,569	109,800.000	282,076,200.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,658	246,000.000	407,868,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,356	89,000.000	209,684,000.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	30,731	10,300.000	316,529,300.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,449	406,000.000	588,294,000.000	
LG UPLUS CORP	11,086	16,150.000	179,038,900.000		
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	23,300.000	94,365,000.000		

DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	8,516	7,140.000	60,804,240.000	
POSCO DAEWOO CORP	3,600	23,150.000	83,340,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	781	971,000.000	758,351,000.000	
LG CHEM LTD	3,828	292,500.000	1,119,690,000.000	
LG CHEM LTD	641	197,500.000	126,597,500.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	177	630,000.000	111,510,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	36,151	49,900.000	1,803,934,900.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	4,815	48,700.000	234,490,500.000	
S-OIL CORP	3,768	97,100.000	365,872,800.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	29,500.000	229,244,500.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,530	41,250.000	228,112,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,295	352,000.000	455,840,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	61,100.000	180,550,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,590	177,000.000	458,430,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,573	264,500.000	1,474,058,500.000	
SK HYNIX INC	48,583	58,300.000	2,832,388,900.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,056	45,750.000	277,062,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,907	109,000.000	207,863,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	12,844	160,000.000	2,055,040,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,668	60,300.000	402,080,400.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,431	13,600.000	250,661,600.000	
KCC CORP	483	401,000.000	193,683,000.000	
KIA MOTORS CORP	21,467	39,000.000	837,213,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	718	448,000.000	321,664,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,755	43,650.000	949,605,750.000	
HANWHA CORP	3,785	48,300.000	182,815,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	3,652	37,950.000	138,593,400.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	88,300.000	132,450,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	591	196,000.000	115,836,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,423	75,800.000	107,863,400.000	
KT CORP	2,048	31,850.000	65,228,800.000	
LG ELECTRONICS INC	8,725	88,300.000	770,417,500.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	430	213,500.000	91,805,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	47	1,898,000.000	89,206,000.000	
HANSSEM CO LTD	869	204,000.000	177,276,000.000	
LG CORP	7,950	85,400.000	678,930,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	14,950.000	173,270,500.000	

GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	29,650.000	116,969,250.000	
NAVER CORP	2,302	960,000.000	2,209,920,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,187	117,000.000	138,879,000.000	
DONGSUH CO INC	2,798	30,700.000	85,898,600.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,287	67,000.000	220,229,000.000	
OTTOGI CORP	112	884,000.000	99,008,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,412	150,000.000	361,800,000.000	
KANGWON LAND INC	9,890	35,300.000	349,117,000.000	
POSCO	6,204	275,000.000	1,706,100,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,513	155,500.000	701,771,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,716	86,100.000	406,047,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,154	2,305,000.000	18,794,970,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	20,301	12,050.000	244,627,050.000	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,141	46,750.000	146,841,750.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,473	1,858,000.000	2,736,834,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	248,000.000	165,912,000.000	
HYOSUNG CORP	1,781	172,000.000	306,332,000.000	
ORION CORP	299	798,000.000	238,602,000.000	
YUHAN CORP	733	249,000.000	182,517,000.000	
HANON SYSTEMS	18,967	10,500.000	199,153,500.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,281	38,350.000	202,526,350.000	
GS HOLDINGS CORP	4,279	70,800.000	302,953,200.000	
LG DISPLAY CO LTD	19,137	36,700.000	702,327,900.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	7,250.000	74,530,000.000	
CELLTRION INC	6,583	101,400.000	667,516,200.000	
HANA FINANCIAL GROUP	24,344	42,650.000	1,038,271,600.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,373	153,000.000	210,069,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,058	308,000.000	325,864,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,770	119,500.000	689,515,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,627	326,500.000	857,715,500.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	207,000.000	155,664,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	41,400.000	119,107,800.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,283	157,000.000	829,431,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	669	380,000.000	254,220,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	5,110.000	93,998,450.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	52,700.000	96,177,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,196	155,500.000	185,978,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,643	283,000.000	747,969,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	32,680	55,900.000	1,826,812,000.000	
MEDY-TOX INC	365	564,100.000	205,896,500.000	

	HYUNDAI WIA CORP	1,454	67,000.000	97,418,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,721	63,600.000	363,855,600.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	21,890	10,600.000	232,034,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	470	414,500.000	194,815,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	16,882	6,910.000	116,654,620.000	
	O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,537	80,300.000	123,421,100.000	
	E-MART CO LTD	1,752	242,500.000	424,860,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	11,600.000	157,052,400.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	56,800.000	140,977,600.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,262	66,700.000	417,675,400.000	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	550	420,000.000	231,000,000.000	
	NETMARBLE GAMES CORP	1,466	149,000.000	218,434,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	1,876	126,500.000	237,314,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,914	173,500.000	505,579,000.000	
	WOORI BANK	25,432	16,750.000	425,986,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,259	137,500.000	860,612,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,333	224,500.000	299,258,500.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,980	35,950.000	107,131,000.000	
韓国・ウォン	小計	720,659		68,746,094,610.000 (6,737,117,271)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	100,000	11.860	1,186,000.000	
	JIANGSU EXPRESS	102,000	11.260	1,148,520.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	6.390	1,035,180.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	511,000	84.000	42,924,000.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	101,000	26.400	2,666,400.000	
	BEIJING ENTERPRISES	42,000	37.750	1,585,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	5.850	2,094,300.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	4.000	1,104,000.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	158,000	5.990	946,420.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	63,500	54.000	3,429,000.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	67,020	9.980	668,859.600	
	CNOOC LTD	1,480,000	8.660	12,816,800.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	244,000	15.000	3,660,000.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	354,000	11.840	4,191,360.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	313,120	23.700	7,420,944.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	226,888	23.000	5,218,424.000	
	CITIC LTD	482,000	12.540	6,044,280.000	

BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	126,000	11.040	1,391,040.000	
LENOVO GROUP LTD	588,000	5.140	3,022,320.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,758,000	5.080	8,930,640.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	488,742	11.320	5,532,559.440	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	131,790	20.350	2,681,926.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,125,200	6.440	13,686,288.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	22.900	1,763,300.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	62,000	41.650	2,582,300.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	270,000	6.670	1,800,900.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	130,000	8.960	1,164,800.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	104,000	21.900	2,277,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	326,000	3.680	1,199,680.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	17.960	1,400,880.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	140,000	12.600	1,764,000.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	410,000	15.480	6,346,800.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	76,000	23.700	1,801,200.000	
BYD CO LTD	53,000	46.850	2,483,050.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,130,000	3.770	4,260,100.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	146,000	6.680	975,280.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	950,000	1.260	1,197,000.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	201,000	9.680	1,945,680.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	373,192	12.780	4,769,393.760	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	164,000	4.710	772,440.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	165,200	15.540	2,567,208.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	260,000	9.080	2,360,800.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	621,000	25.450	15,804,450.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	583,000	2.570	1,498,310.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	6.200	992,000.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	205,700	7.880	1,620,916.000	
WEICHAH POWER CO LTD	84,720	12.060	1,021,723.200	

SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	4.300	1,277,100.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	43,000	24.050	1,034,150.000	
TINGYI HOLDING CORP	164,000	9.550	1,566,200.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	36.300	1,089,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	232,000	11.020	2,556,640.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	137,333	20.750	2,849,659.750	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	10.060	1,166,960.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	376,000	7.160	2,692,160.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	234,000	15.840	3,706,560.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	473,400	277.400	131,321,160.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	431,500	52.050	22,459,575.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	406,000	5.980	2,427,880.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	970,240	1.000	970,240.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	2.830	769,760.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	7.980	1,292,760.000	
ZTE CORP	58,488	17.260	1,009,502.880	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.530	882,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	283,500	19.500	5,528,250.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	732,205	5.870	4,298,043.350	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	146,000	12.900	1,883,400.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	60,500	99.500	6,019,750.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,003,530	6.460	45,242,803.800	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	47,000	52.200	2,453,400.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	9.420	2,147,760.000	
MINTH GROUP LTD	56,000	32.300	1,808,800.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	114,000	9.550	1,088,700.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	238,000	4.570	1,087,660.000	
BANK OF CHINA LTD	6,617,200	3.880	25,674,736.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	102,000	13.840	1,411,680.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	84,400	12.600	1,063,440.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	317,970	22.800	7,249,716.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,143,235	5.220	32,067,686.700	

CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	199,600	4.610	920,156.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	367,000	10.100	3,706,700.000	
CHINA COAL ENERGY CO	162,000	3.410	552,420.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	20.700	1,117,800.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	46,100	40.800	1,880,880.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	20.550	2,157,750.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	448,142	9.480	4,248,386.160	
CHINA CITIC BANK-H	747,800	4.800	3,589,440.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	528,000	6.090	3,215,520.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	58,000	65.800	3,816,400.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	90,000	23.250	2,092,500.000	
FOSUN INTERNATIONAL	215,528	12.840	2,767,379.520	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	316,000	2.440	771,040.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	249,500	3.760	938,120.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	3.770	671,060.000	
KINGSOFT CORP LTD	67,000	21.400	1,433,800.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,096,000	0.760	832,960.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	301,000	6.350	1,911,350.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	161,000	10.340	1,664,740.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	420,000	5.740	2,410,800.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	215,200	31.100	6,692,720.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	349,000	16.640	5,807,360.000	
CRRC CORP LTD - H	316,450	7.270	2,300,591.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	104,000	13.860	1,441,440.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	200,500	7.200	1,443,600.000	
SINOPHARM GROUP CO	98,400	35.500	3,493,200.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	177,805	13.920	2,475,045.600	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	212,000	5.220	1,106,640.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	266,000	5.930	1,577,380.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	56,800	22.750	1,292,200.000	

	HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	2.500	855,000.000	
	SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	3.290	1,069,250.000	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	163,000	13.600	2,216,800.000	
	LONGFOR PROPERTIES CO LTD	121,500	15.020	1,824,930.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	65,700	42.300	2,779,110.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	454,880	7.810	3,552,612.800	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.620	930,340.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,146,000	3.590	7,704,140.000	
	FAR EAST HORIZON LTD	166,000	6.850	1,137,100.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	192,500	16.280	3,133,900.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD	273,600	12.980	3,551,328.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	595,000	3.300	1,963,500.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	41,500	32.850	1,363,275.000	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	107,500	7.530	809,475.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	282,500	7.190	2,031,175.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.420	135,660.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	745,000	2.990	2,227,550.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	137,000	15.000	2,055,000.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	99,561	21.200	2,110,693.200	
	CGN POWER CO LTD	900,000	2.260	2,034,000.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	575,000	3.130	1,799,750.000	
	GF SECURITIES CO LTD	103,000	15.640	1,610,920.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	31.500	1,373,400.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	139,000	15.100	2,098,900.000	
	3SBIO INC	90,000	10.920	982,800.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	536,000	3.220	1,725,920.000	
香港・ドル	小計	61,871,239		641,113,373.760 (9,065,343,105)	
台湾・ドル	ACER INC	248,532	16.350	4,063,498.200	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,554	284.500	16,374,113.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	37,616	110.500	4,156,568.000	

ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	533,806	38.250	20,418,079.500	
ASIA CEMENT CORP	197,928	27.200	5,383,641.600	
TAIWAN BUSINESS BANK	326,380	8.290	2,705,690.200	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	58,000	40.550	2,351,900.000	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	58.600	4,570,800.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,000	70.300	4,007,100.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,312	78.700	3,644,754.400	
QUANTA COMPUTER INC	222,858	70.200	15,644,631.600	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	68,070	50.100	3,410,307.000	
EVA AIRWAYS CORP	153,555	14.550	2,234,225.250	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	53,760	358.000	19,246,080.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	411,196	17.350	7,134,250.600	
CHINA AIRLINES	232,156	9.070	2,105,654.920	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	159,169	61.800	9,836,644.200	
CHINA STEEL CORP	1,018,058	24.350	24,789,712.300	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	295,162	29.250	8,633,488.500	
ADVANTECH CO LTD	26,264	247.000	6,487,208.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	357,304	20.400	7,289,001.600	
DELTA ELECTRONICS INC	168,663	165.500	27,913,726.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	57,000	52.000	2,964,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	313,327	108.000	33,839,316.000	
AU OPTRONICS CORP	733,194	12.150	8,908,307.100	
TAIWAN MOBILE CO LTD	133,800	113.000	15,119,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	14.850	2,381,821.200	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	266,824	24.300	6,483,823.200	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	120.000	3,579,000.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,022	320.000	4,807,040.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	49,285	124.500	6,135,982.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	339,633	90.000	30,566,970.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	65,000	30.850	2,005,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	244,594	90.100	22,037,919.400	
TRANSCEND INFORMATION INC	12,897	101.000	1,302,597.000	
GIANT MANUFACTURING	23,151	174.500	4,039,849.500	
MEDIATEK INC	122,507	250.500	30,688,003.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	558,936	45.800	25,599,268.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	613,632	17.100	10,493,107.200	

HOTAI MOTOR CO LTD	22,000	387.000	8,514,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	134,000	76.300	10,224,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	873,141	12.950	11,307,175.950	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	673,920	46.800	31,539,456.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,091,403	8.240	8,993,160.720	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	702,951	18.550	13,039,741.050	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,299,532	105.000	136,450,860.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	909,495	24.650	22,419,051.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	4,840.000	39,784,800.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	717,748	13.700	9,833,147.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	694,724	7.730	5,370,216.520	
INVENTEC CO LTD	207,005	24.000	4,968,120.000	
HTC CORPORATION	56,832	70.700	4,018,022.400	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	179,845	50.200	9,028,219.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	834,332	9.240	7,709,227.680	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,444,048	19.400	28,014,531.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	752,282	19.450	14,631,884.900	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	16,950	157.000	2,661,150.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	55,560	92.900	5,161,524.000	
NAN YA PLASTICS CORP	390,828	72.000	28,139,616.000	
WISTRON CORP	209,110	29.750	6,221,022.500	
POU CHEN CORP	183,990	41.850	7,699,981.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	402,297	58.800	23,655,063.600	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,392	276.000	13,080,192.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,480	107.000	11,714,360.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	338.000	4,278,404.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	34.350	2,595,039.450	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,715	44.000	2,099,460.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	76,588	86.200	6,601,885.600	
SILICONWARE PRECISION INDS	163,743	50.300	8,236,272.900	
STANDARD FOODS CORP	49,653	80.700	4,006,997.100	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	114,899	35.500	4,078,914.500	

	TAIWAN CEMENT CORP	273,874	34.600	9,476,040.400	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	156,000	28.600	4,461,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,051,083	212.000	434,829,596.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	987,525	12.250	12,097,181.250	
	YULON MOTOR CO	65,149	26.950	1,755,765.550	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	142,000	25.800	3,663,600.000	
	INNOLUX CORPORATION	755,345	13.800	10,423,761.000	
	WPG HOLDINGS CO LTD	122,526	40.300	4,937,797.800	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	17,216	205.500	3,537,888.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	185.000	2,405,000.000	
	PEGATRON CORP	162,554	93.200	15,150,032.800	
	CHAILLEASE HOLDING CO LTD	89,076	77.800	6,930,112.800	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	9.970	1,874,360.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	76.200	2,620,137.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	643,523	15.750	10,135,487.250	
	OBI PHARMA INC	9,000	254.500	2,290,500.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	238.500	3,100,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	12,000	313.000	3,756,000.000	
	台湾・ドル 小計	26,839,506		1,442,873,788.540 (5,280,918,066)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	28,101	161.000	4,524,261.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	36,673	74.500	2,732,138.500	
	DISCOVERY LTD	30,162	127.710	3,851,989.020	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	417,547	10.530	4,396,769.910	
	MASSMART HOLDINGS LTD	7,992	110.730	884,954.160	
	GOLD FIELDS LTD	78,154	47.970	3,749,047.380	
	REMGRO LTD	43,423	209.000	9,075,407.000	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	141.590	2,449,648.590	
	MMI HOLDINGS LTD	82,706	20.090	1,661,563.540	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	173,291	24.800	4,297,616.800	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,985	96.700	1,932,549.500	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	778.500	2,478,744.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	8,524	112.600	959,802.400	
	MTN GROUP LTD	141,364	113.200	16,002,404.800	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,366	155.950	5,671,277.700	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	68.000	1,375,436.000	
	FIRSTRAND LTD	276,863	47.260	13,084,545.380	
	PSG GROUP LTD	8,084	233.000	1,883,572.000	
	NASPERS LTD	36,477	2,683.030	97,868,885.310	

CORONATION FUND MANAGERS LTD	19,000	68.050	1,292,950.000	
NEDBANK GROUP LTD	18,726	209.250	3,918,415.500	
NETCARE LTD	77,025	24.840	1,913,301.000	
PICK'N PAY STORES LTD	30,212	56.800	1,716,041.600	
RMB HOLDINGS LTD	60,439	58.370	3,527,824.430	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	293.730	1,542,376.230	
SAPPI LTD	46,860	88.000	4,123,680.000	
SASOL LTD	46,057	369.180	17,003,323.260	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,938	199.550	6,971,877.900	
MR PRICE GROUP LTD	20,254	163.100	3,303,427.400	
BRAIT SE	28,931	66.750	1,931,144.250	
STANDARD BANK GROUP LTD	107,981	142.000	15,333,302.000	
SPAR GROUP LTD/THE	16,126	155.150	2,501,948.900	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	80,018	64.440	5,156,359.920	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,278	156.460	2,077,475.880	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	32,472	278.780	9,052,544.160	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	56,403	146.400	8,257,399.200	
TIGER BRANDS LTD	13,375	374.440	5,008,135.000	
SANLAM LTD	113,459	67.020	7,604,022.180	
INVESTEC LTD	21,436	94.790	2,031,918.440	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	57,577	36.700	2,113,075.900	
PIONEER FOODS LTD	10,707	138.460	1,482,491.220	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	18,685	167.000	3,120,395.000	
MONDI LTD	9,985	333.440	3,329,398.400	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	109,804	26.540	2,914,198.160	
RMI HOLDINGS	52,887	38.890	2,056,775.430	
VODACOM GROUP PTY LTD	43,506	166.300	7,235,047.800	
SIBANYE GOLD LTD	72,004	17.020	1,225,508.080	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	16.620	1,312,099.140	
FORTRESS INCOME FUND LTD	65,113	34.500	2,246,398.500	
SIBANYE GOLD LTD-RTS	92,576	5.580	516,574.080	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	247,731	66.050	16,362,632.550	
BID CORP LTD	27,164	294.420	7,997,624.880	
南アフリカ・ランド 小計	3,195,351		335,060,299.380 (2,864,765,560)	
合計	179,244,354		42,699,588,530 (42,699,588,530)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年6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	1,195,075.000	20,077,260.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	162,100.000	27,908,757.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,357,175.000	47,986,017.000 (291,275,124)	
投資信託受益証券 合計			1,357,175	291,275,124 (291,275,124)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	488,202.000	
		トルコ・リラ 小計	162,734.000	488,202.000 (15,222,139)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	216,100.000	7,412,230.000	
	メキシコ・ペソ	小計	216,100.000	7,412,230.000 (44,992,237)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,095.000	2,392,108.800	
		RESILIENT REIT LTD	20,512.000	2,500,823.040	
	南アフリカ・ランド	小計	40,607.000	4,892,931.840 (41,834,567)	
投資証券 合計			419,441	102,048,943 (102,048,943)	
合計				393,324,067 (393,324,067)	

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 40銘柄	10.03%	-%	-%	10.89%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.61%	-%	-%	0.67%
インド・ルピー	株式 78銘柄	8.31%	-%	-%	9.04%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.18%	-%	-%	2.37%
カタール・リアル	株式 13銘柄	0.61%	-%	-%	0.67%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.42%	-%	-%	0.46%
タイ・バーツ	株式 37銘柄	1.95%	-%	-%	2.12%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.16%	-%	-%	0.17%
チリ・ペソ	株式 19銘柄	1.06%	-%	-%	1.16%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.02% -%	-% -%	-% 0.03%	1.15%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.29%	-%	-%	0.32%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.13%	-%	-%	1.23%
ブラジル・リアル	株式 57銘柄	6.03%	-%	-%	6.55%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.20%	-%	-%	1.31%
マレーシア・リングギット	株式 41銘柄	2.23%	-%	-%	2.42%
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	2.59% -% -%	-% 0.62% -%	-% -% 0.10%	3.60%
ユーロ	株式 9銘柄	0.20%	-%	-%	0.21%
韓国・ウォン	株式 112銘柄	14.39%	-%	-%	15.63%
香港・ドル	株式 136銘柄	19.36%	-%	-%	21.04%
台湾・ドル	株式 89銘柄	11.28%	-%	-%	12.25%
南アフリカ・ランド	株式 52銘柄 投資証券 2銘柄	6.12% -%	-% -%	-% 0.09%	6.74%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		3,289,639,610
コール・ローン		48,007,461
国債証券		88,511,415,568
未収利息		1,085,711,853
前払費用		198,637,112
流動資産合計		93,133,411,604
資産合計		93,133,411,604
負債の部		
流動負債		
未払金		776,195,568
未払解約金		10,205,000
流動負債合計		786,400,568
負債合計		786,400,568
純資産の部		
元本等		
元本	1	50,181,058,353
剰余金		
剰余金又は欠損金()		42,165,952,683
元本等合計		92,347,011,036
純資産合計		92,347,011,036
負債純資産合計		93,133,411,604

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 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. 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 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29年6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	33,803,931,113円
同期中追加設定元本額	22,059,331,731円
同期中一部解約元本額	5,682,204,491円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックス ファンド<為替ヘッジなし> （ファンドラップ）	135,013,697円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	78,581,078円
D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国10）	23,892,314円
D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国20）	68,142,189円
D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国30）	146,662,184円
投資のソムリエ	3,649,860,484円
クルーズコントロール	1,367,148,340円
投資のソムリエ<DC年金>	171,577,811円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	80,865,102円
クルーズコントロール<DC年金 >	450,343円
D I A Mコア資産設計ファンド （堅実型）	6,785,171円
D I A Mコア資産設計ファンド （積極型）	17,836,279円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	82,546,928円
ダイナミック・ナビゲーション	172,264円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド	790,091,323円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	309,828,145円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	546,535,858円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	16,072,392,000円
エマージング債券パッシブファン ドVA(適格機関投資家専用)	3,415,454,556円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	7,657,116,920円
DIAM世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資家 限定)	4,888,777,380円
DIAMグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	3,488,959,894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I I(適格機関投資家限定)	4,438,908,008円
P-Oneマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限定)	2,743,460,085円
計	50,181,058,353円
2. 受益権の総数	50,181,058,353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29年1月18日 至 平成29年6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29年6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29年6月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	882,107,212
合計	882,107,212

(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29年4月19日から平成29年6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29年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.8403円
(1万口当たり純資産額)	(18,403円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年6月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	6,200,000.000	5,775,300.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	13,900,000.000	13,743,625.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	8,600,000.000	9,051,500.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	9,800,000.000	8,746,500.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	6,900,000.000	6,762,000.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	3,800,000.000	3,705,000.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	6,900,000.000	7,342,635.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	7,200,000.000	7,840,800.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	6,100,000.000	7,060,750.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	5,000,000.000	6,266,500.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,200,000.000	2,771,560.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	2,200,000.000	2,526,150.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,700,000.000	3,640,800.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,500,000.000	6,815,250.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	6,000,000.000	6,429,000.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	4,800,000.000	5,197,200.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	12,000,000.000	12,480,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	7,400,000.000	8,336,100.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	7,200,000.000	8,550,000.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	7,100,000.000	7,801,622.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	5,600,000.000	7,406,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,500,000.000	3,215,375.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	4,400,000.000	4,855,136.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,000,000.000	4,547,120.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	3,300,000.000	3,684,615.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	4,600,000.000	5,107,150.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	6,000,000.000	6,560,340.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	3,800,000.000	3,948,542.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	5,500,000.000	6,175,785.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	3,600,000.000	4,098,528.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	7,400,000.000	8,533,384.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	4,700,000.000	5,186,450.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	7,800,000.000	8,853,000.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,000,000.000	4,546,290.000	
		INDONESIA 11.625 03/04/19	6,400,000.000	7,452,800.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,531,680.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	4,200,000.000	4,331,628.000	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	6,800,000.000	7,058,400.000	
		INDONESIA 4.625 04/15/43	3,800,000.000	3,904,272.000	

INDONESIA 4.75 01/08/26	6,000,000.000	6,504,660.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	6,700,000.000	7,220,992.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	4,800,000.000	5,232,144.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	5,500,000.000	6,049,725.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,700,000.000	1,897,064.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	5,600,000.000	6,403,712.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,000,000.000	3,600,420.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	4,300,000.000	5,650,802.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	4,900,000.000	6,870,241.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,000,000.000	5,212,500.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	4,600,000.000	4,784,000.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	5,600,000.000	6,104,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	8,000,000.000	10,475,200.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,200,000.000	5,418,000.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,100,000.000	6,129,500.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,000,000.000	5,537,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	10,400,000.000	12,931,360.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,000,000.000	6,679,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	8,400,000.000	11,065,320.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	4,600,000.000	4,686,250.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,200,000.000	5,462,964.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	4,600,000.000	4,908,614.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	3,800,000.000	4,157,960.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,200,000.000	3,815,744.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,000,000.000	3,604,560.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,800,000.000	3,681,664.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	5,000,000.000	6,758,000.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	895,416.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	4,900,000.000	7,078,197.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	3,100,000.000	3,513,850.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	4,800,000.000	7,716,240.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	3,300,000.000	3,728,604.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	4,800,000.000	5,154,192.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,400,000.000	2,648,424.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	2,800,000.000	3,611,692.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	7,300,000.000	8,534,357.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	8,000,000.000	8,549,920.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	29,542,500.000	35,606,393.550	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	9,000,000.000	9,909,450.000	

RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	9,200,000.000	9,408,564.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	5,600,000.000	5,975,592.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	8,600,000.000	9,101,982.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,200,000.000	8,909,792.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	7,600,000.000	8,586,708.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	3,600,000.000	4,213,872.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	5,400,000.000	5,179,896.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,200,000.000	4,320,792.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,400,000.000	2,301,648.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	2,400,000.000	2,425,512.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	4,200,000.000	4,479,972.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	2,600,000.000	2,862,626.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	5,400,000.000	5,927,688.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	5,500,000.000	5,972,285.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	3,500,000.000	5,633,950.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	6,500,000.000	6,136,845.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	4,400,000.000	4,218,104.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	7,900,000.000	7,112,765.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	7,800,000.000	7,776,600.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	3,700,000.000	3,847,001.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	4,300,000.000	4,580,360.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	7,100,000.000	7,570,162.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	4,700,000.000	4,889,551.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,800,000.000	3,059,336.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	7,300,000.000	8,190,600.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	8,500,000.000	9,607,295.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	7,600,000.000	8,636,640.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	6,100,000.000	6,526,329.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	8,700,000.000	9,557,820.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	2,400,000.000	2,856,048.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	8,300,000.000	9,628,000.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	2,800,000.000	3,081,064.000	
TURKEY 8.0 02/14/34	4,100,000.000	5,155,422.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	2,200,000.000	2,296,800.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	6,600,000.000	6,761,700.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	7,300,000.000	7,610,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	9,900,000.000	10,446,975.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,200,000.000	8,634,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	4,800,000.000	4,612,800.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,000,000.000	7,978,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	12,400,000.000	12,598,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	6,800,000.000	7,395,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	8,200,000.000	9,325,450.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	7,600,000.000	7,961,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	9,300,000.000	11,128,380.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	4,600,000.000	5,862,700.000	
	アメリカ・ドル 小計	720,442,500.000 (79,414,376,775)	802,970,294.550 (88,511,415,568)	
国債証券	合計	79,414,376,775 (79,414,376,775)	88,511,415,568 (88,511,415,568)	
合計		79,414,376,775 (79,414,376,775)	88,511,415,568 (88,511,415,568)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 124銘柄	95.85%	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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成29年6月30日現在

資産総額	6,667,931,326円
負債総額	45,085,244円
純資産総額（ - ）	6,622,846,082円
発行済数量	6,437,860,908口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0287円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

平成29年6月30日現在

資産総額	12,836,224,770円
負債総額	113,273,605円
純資産総額（ - ）	12,722,951,165円
発行済数量	12,369,903,271口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0285円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産総額	278,045,306,609円
負債総額	455,833,806円
純資産総額（ - ）	277,589,472,803円
発行済数量	88,170,849,242口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1483円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産総額	43,607,207,773円
負債総額	74,668,643円
純資産総額（ - ）	43,532,539,130円
発行済数量	36,791,240,467口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1832円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産総額	180,931,816,636円
負債総額	3,967,903,952円
純資産総額（ - ）	176,963,912,684円
発行済数量	132,580,626,948口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3348円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産総額	48,569,098,609円
負債総額	117,083,360円
純資産総額(-)	48,452,015,249円
発行済数量	44,136,396,607口
1口当たり純資産額(/)	1.0978円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年6月30日現在

資産総額	93,744,289,601円
負債総額	533,000円
純資産総額(-)	93,743,756,601円
発行済数量	50,416,959,995口
1口当たり純資産額(/)	1.8594円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第4 内国投資信託受益証券事務の概要」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 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) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得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。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 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】

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

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額(平成29年6月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(平成29年6月30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】

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

<更新・訂正後>

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

平成29年6月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,162,050,834,686
追加型株式投資信託	870	11,771,560,838,182
単位型公社債投資信託	58	311,985,282,037
単位型株式投資信託	122	822,065,642,237
合計	1,088	14,067,662,597,142

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne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。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29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株式会社に変更いたしました。

委託会社の財務諸表に引き続き、D I A Mアセットマネジメント株式会社の第32期中間会計期間の中間財務諸表、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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

（単位：千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
（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	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	-	17,124,479
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	24,580,000
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	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

（単位：千円）

	第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）		第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
時効成立後支払分配金・償還金		-		39
時効後支払損引当金繰入額		-		209,210
営業外費用計		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

（３）【株主資本等変動計算書】

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				
		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	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	-	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
当期変動額									
剰余金の配当									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
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
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
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	-	-			-
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)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期(自平成28年4月1日至平成29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	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	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による 増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
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	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による 増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

重要な会計方針

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. 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。 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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 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っております。</p>
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、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。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 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、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分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、退職一時金制度及び確定給付型企業年金制度（キャッシュバランスタイプ）について、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 過去勤務費用については、そ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年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、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年または10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しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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> <p>(5) 時効後支払損引当金は、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。</p> <p>(6) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</p>
6. 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き方式によっております。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、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。

この結果、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42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	-	942,315
旧本社不動産賃借料	-	418,583
賃貸借契約解約損	-	150,723

(株主資本等変動計算書関係)

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) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

（注）普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29年6月21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29年6月21日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種 類株式					

(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、短期的な預金等に限定してあります。

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、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っている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。当該デリバティブ取引は、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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（為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

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あります。

有価証券及び投資有価証券は、主に其他有価証券（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あります。

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。

(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

預金の預入先については、余資運用規程に従い、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。

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把握する体制としています。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、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（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り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) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期（平成29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	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

(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) 未収委託者報酬及び(4) 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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

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、「(5) 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。

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。

(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) 現金・預金	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

第32期(平成29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) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)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、記載していません。

2. その他有価証券

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
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	-	-	-
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。

第32期(平成29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	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)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. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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)
株式	5,927	3,377	-

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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)
投資信託	717,905	2	79,146

(注) 投資信託の「売却額」、「売却の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(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、確定給付型の制度として確定給付企業年金制度(積立型制度であります)及び退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。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。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、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(複数事業主制度を含む)

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の発生額	-	1,894
事業主からの拠出額	-	37,402
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
年金資産の期末残高	-	1,363,437

(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

(千円)

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	1,275,346
年金資産	-	1,363,437
	-	88,090
非積立型制度の退職給付債務	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
前払年金費用	-	325,140
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(5) 年金資産に関する事項

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。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
株式	-	31.5%
債券	-	29.0%
共同運用資産	-	24.1%
生命保険一般勘定	-	10.5%
現金及び預金	-	4.6%
合計	-	100.0%

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

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(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

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
退職給付引当金の期末残高	-	300,927

(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

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	789,261
年金資産	-	1,150,443
		361,181
非積立型制度の退職給付債務	-	60,254
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927
退職給付引当金	-	60,254
前払年金費用	-	361,181
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927

(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 - 千円 当事業年度22,562千円

4. 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44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

（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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額（一括償却資産）	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額（税法上）	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
繰延税金負債		
前払年金費用	-	210,151
その他有価証券評価差額金	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

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。

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」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しております。

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. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（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、MHFG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。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM （存続会社）	MHAM （消滅会社）
合併比率（*）	1	0.0154

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 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MHFG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IA種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 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MHFG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。

10. 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しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千円が含まれております。

(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、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。

2. 関連情報

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、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

営業収益

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

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%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

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

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

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) 子会社及び関連会社等

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	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	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、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	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイ ナンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言 金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払費 用 未払金	292,861 7,581
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻（純 額） 信託報酬の 支払	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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				
親会社 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	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	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） 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	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	-	-	投資一任契 約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

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) 当社預り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) 業務委託料は、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4) 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。
- (注5) 運用受託報酬は、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6) 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せん。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 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)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株主及び普通株主と同等の 株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の 株式に係る当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(参考)DIAMアセットマネジメント株式会社の経理状況

1. 委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という。)の中間財務諸表は、「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. 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。

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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

(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

(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 其他有価証券」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 其他有価証券

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 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭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。

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】**

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

<更新・訂正後>

(1) 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29年3月末日現在 247,369百万円

c . 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(注) 資本金の額は平成29年3月末日現在

(3) 投資顧問会社**a . 名称**

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

b . 資本金の額

平成29年3月末日現在 200百万円

c . 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

独立監査人の監査報告書

平成29年7月26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 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（基本コース）の平成29年1月18日から平成29年6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、ワールドアセットバランス（基本コース）の平成29年6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

(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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年7月26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 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の平成29年1月18日から平成29年6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、ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の平成29年6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

(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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年6月7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、アセットマネジメントOne株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。