

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信/海外/株式	
信託期間	無期限	
運用方針	主として、日本を除く世界各国の株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。	
主要投資対象	ハリス世界株ファンド (毎月決算型)	ALAMCO ハリス グローバルバリュース株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	ALAMCOハリスグローバルバリュース株マザーファンド	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	ハリス世界株ファンド (毎月決算型)	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ALAMCOハリスグローバルバリュース株マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎月9日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、分配対象額の範囲内で、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。	

ハリス世界株ファンド (毎月決算型)

第65期(決算日	2015年10月9日)
第66期(決算日	2015年11月9日)
第67期(決算日	2015年12月9日)
第68期(決算日	2016年1月12日)
第69期(決算日	2016年2月9日)
第70期(決算日	2016年3月9日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております「ハリス世界株ファンド(毎月決算型)」は、第65期から第70期までの決算を行いましたので、当期間の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも、一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

東京都杉並区和泉一丁目22番19号

<お問い合わせ先>

ホームページ：<http://www.alamco.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-283-104

〔受付時間〕 営業日の午前9時～午後5時

○本報告書の表記について

・原則として、数量、額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数で表記する場合があります。－印は、組入れ、異動などの該当がないことを示します。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配	み 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
41期(2013年10月9日)	13,289	100	△ 0.8	148,097.32	△ 1.2	94.6	—	6,008
42期(2013年11月11日)	13,836	100	4.9	158,893.37	7.3	95.3	—	6,341
43期(2013年12月9日)	14,452	100	5.2	167,058.95	5.1	96.1	—	6,739
44期(2014年1月9日)	14,972	100	4.3	173,744.63	4.0	96.2	—	7,224
45期(2014年2月10日)	14,208	100	△ 4.4	166,572.02	△ 4.1	96.7	—	6,886
46期(2014年3月10日)	14,792	100	4.8	175,223.63	5.2	97.6	—	7,131
47期(2014年4月9日)	14,339	100	△ 2.4	171,786.82	△ 2.0	98.0	—	6,901
48期(2014年5月9日)	14,336	100	0.7	173,994.82	1.3	95.5	—	3,928
49期(2014年6月9日)	14,748	100	3.6	180,063.57	3.5	95.7	—	6,075
50期(2014年7月9日)	14,373	100	△ 1.9	178,475.14	△ 0.9	96.8	—	6,887
51期(2014年8月11日)	13,719	100	△ 3.9	174,455.86	△ 2.3	98.2	—	6,583
52期(2014年9月9日)	14,581	100	7.0	187,011.47	7.2	98.1	—	6,821
53期(2014年10月9日)	13,903	100	△ 4.0	183,262.42	△ 2.0	96.0	—	6,488
54期(2014年11月10日)	14,900	100	7.9	197,530.60	7.8	96.1	—	6,923
55期(2014年12月9日)	16,282	100	9.9	211,337.01	7.0	96.8	—	7,395
56期(2015年1月9日)	15,348	100	△ 5.1	205,937.86	△ 2.6	92.9	—	8,492
57期(2015年2月9日)	15,257	100	0.1	207,142.41	0.6	97.6	—	9,482
58期(2015年3月9日)	15,769	100	4.0	211,907.15	2.3	95.9	—	10,276
59期(2015年4月9日)	15,849	100	1.1	213,622.44	0.8	97.1	—	10,865
60期(2015年5月11日)	15,992	100	1.5	216,279.07	1.2	94.0	—	11,017
61期(2015年6月9日)	16,309	100	2.6	219,373.88	1.4	95.1	—	11,337
62期(2015年7月9日)	15,059	100	△ 7.1	206,936.22	△ 5.7	95.8	—	10,438
63期(2015年8月10日)	15,837	150	6.2	218,038.58	5.4	97.6	—	10,995
64期(2015年9月9日)	13,849	100	△11.9	197,381.59	△ 9.5	96.6	—	9,620
65期(2015年10月9日)	13,997	100	1.8	201,038.45	1.9	97.7	—	9,658
66期(2015年11月9日)	14,835	100	6.7	211,596.26	5.3	97.5	—	10,232
67期(2015年12月9日)	14,120	100	△ 4.1	206,390.02	△ 2.5	95.8	—	9,718
68期(2016年1月12日)	12,100	100	△13.6	183,742.08	△11.0	96.6	—	8,341
69期(2016年2月9日)	11,288	100	△ 5.9	173,010.00	△ 5.8	98.0	—	7,784
70期(2016年3月9日)	11,794	100	5.4	180,421.59	4.3	95.5	—	8,199

(注) 基準価額および分配金は1万口当たりの値です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みで計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率、株式先物比率は実質比率で記載しています。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注) 参考指数は、MSCI KOKUSAIインデックス(US\$ベース)をもとに、当社で対顧客電信売買相場仲値(円/ドルレート)を使って円換算したもので、当該外貨建指数については基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています(以下同じです)。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		参 考 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
			騰 落 率		騰 落 率		
第65期	(期 首) 2015年9月9日	円 13,849	% —	197,381.59	% —	% 96.6	% —
	9月末	12,861	△ 7.1	187,465.09	△ 5.0	97.2	—
	(期 末) 2015年10月9日	14,097	1.8	201,038.45	1.9	97.7	—
第66期	(期 首) 2015年10月9日	13,997	—	201,038.45	—	97.7	—
	10月末	14,542	3.9	207,645.75	3.3	97.0	—
	(期 末) 2015年11月9日	14,935	6.7	211,596.26	5.3	97.5	—
第67期	(期 首) 2015年11月9日	14,835	—	211,596.26	—	97.5	—
	11月末	14,499	△ 2.3	209,782.70	△ 0.9	94.7	—
	(期 末) 2015年12月9日	14,220	△ 4.1	206,390.02	△ 2.5	95.8	—
第68期	(期 首) 2015年12月9日	14,120	—	206,390.02	—	95.8	—
	12月末	13,905	△ 1.5	204,372.44	△ 1.0	96.8	—
	(期 末) 2016年1月12日	12,200	△13.6	183,742.08	△11.0	96.6	—
第69期	(期 首) 2016年1月12日	12,100	—	183,742.08	—	96.6	—
	1月末	12,185	0.7	186,165.18	1.3	98.5	—
	(期 末) 2016年2月9日	11,388	△ 5.9	173,010.00	△ 5.8	98.0	—
第70期	(期 首) 2016年2月9日	11,288	—	173,010.00	—	98.0	—
	2月末	11,520	2.1	178,016.41	2.9	96.8	—
	(期 末) 2016年3月9日	11,894	5.4	180,421.59	4.3	95.5	—

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

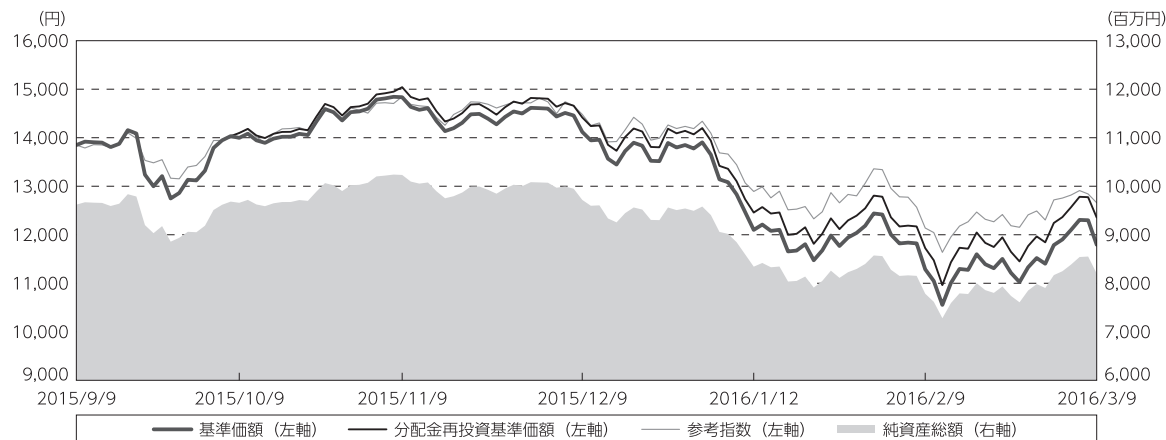
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率、株式先物比率は実質比率で記載しています。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◎運用経過

作成期間中の基準価額等の推移 (2015年9月10日～2016年3月9日)



第65期首： 13,849円

第70期末： 11,794円 (既払分配金(税込み)：600円)

騰落率：△ 10.8% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、作成期首(2015年9月9日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

○基準価額の主な変動要因

主な上昇要因としては、FRB(米連邦準備理事会)による利上げ観測が後退したことや、ECB(欧州中央銀行)による金融緩和への期待などから、株式市場が2015年10月や2016年2月後半以降に反発したことなどが挙げられます。

主な下落要因としては、世界経済の減速や原油価格の下落に対する懸念からリスク回避の動きが強まったことや、主要通貨に対して円高が進んだことなどが挙げられます。

○投資環境

当作成期の海外株式市場は、各国の金融政策に対する期待と、世界経済の減速や原油価格の下落に対する懸念から、変動の大きい展開となりました。

当作成期初は、中国をはじめ世界景気に対する不透明感が広がったことや、ドイツのフォルクスワーゲン社の排ガスをめぐる不正問題などを受けて下落して始まりました。しかし、2015年10月に入ると、米雇用統計が市場予想を下回り早期の利上げ観測が後退したことや、公開された2015年9月16-17日のFOMC(米連邦公開市場委員会)議事録で利上げに慎重な姿勢が示されたことなどを受けて、上昇しました。中旬以降も、ECBによる追加金融緩和への言及があったことや、中国人民銀行による利下げが行われたこと、米国の主要テクノロジー企業の決算が予想を上回ったことなどから10月末までは上昇基調を維持しました。

その後、11月は一進一退の動きとなりましたが、12月以降は、原油価格の下落が続いたことや、ECBの金融緩和が市場の期待を下回ったこと、中国の貿易統計が弱かったことなどから、海外株式市場は下落に転じました。2016年年明け後は、中国株式市場および人民元が急落したことや、原油価格の下落が続いたことなどを受けて、リスク回避の動きが強まり、海外株式市場は大きく下落しました。1月下旬に、ECBが追加金融緩和を示唆したことや、OPEC(石油輸出国機構)がロシアと原油の減産について協議するとの観測が強まり原油価格が反発したことなどから、値を戻す局面もありましたが、2月に入ると、米国や中国の経済指標が予想を下回ったことや、原油価格が下落したこと、ドイツ銀行の経営不安が高まったことなどを受けて、海外株式市場は再び下落し、2月半ばに当作成期中の安値を付けました。当作成期末にかけては、イエレンFRB議長の議会証言を受けて利上げ観測が後退したことや、原油価格が反発したこと、ECBの追加金融緩和への期待などから、海外株式市場は持ち直しましたが、前作成期末との比較では下落して当作成期末を迎えました。地域別では米国株式市場は小幅な上昇となったものの、欧州株式市場は下落となりました。

為替市場では、米国の利上げ観測の後退や、ECBの金融緩和、リスク回避の動きなどから、対ドル、対ユーロとも円高となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

主要投資対象であるALAMCO ハリス グローバル バリューストックマザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行っています。マザーファンドは主として日本を除く世界各国の株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。

バリューストック投資で評価の高い米ハリス・アソシエイツ・エル・ピー(以下「ハリス・アソシエイツ社」といいます。)に運用を委託しています。

作成期首に保有していた銘柄のうち当作成期中に全売却したのは以下のとおりです。これらは売却目標に達したか、ポートフォリオの価値を高める、より魅力的な銘柄を組入れるために売却したものです。

銘柄	投資国	業種
アップル	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
フランクリン・リソースズ	アメリカ	各種金融
ハリバートン	アメリカ	エネルギー
マスターカード	アメリカ	ソフトウェア・サービス
ネスレ	スイス	食品・飲料・タバコ
VISA	アメリカ	ソフトウェア・サービス

(注) 業種はGICS(世界産業分類基準)に基づく24産業グループによります(以下同じです。)

一方、当作成期に新規に組入れを行った主な銘柄と概要は以下のとおりです。

銘柄、投資国、業種	概要
アプライド・マテリアルズ アメリカ 半導体・半導体製造装置	世界各国の半導体産業を対象に、半導体ウエハー製造装置と関連部品の開発、製造、販売を行っています。
アトラス・コプコ スウェーデン 資本財	コンプレッサー、産業機械、鉱山機械、建設機械の製造・販売および関連サービスを行っています。
チャーター・コミュニケーションズ アメリカ メディア	高速インターネット・サービス、インターネット電話、ビデオや音楽配信等のブロードバンド・インターネット通信サービスを提供しています。
グルポ・テレビサ アメリカ メディア	スペイン語圏最大のメディア企業で、一般のテレビ放送や、ケーブルテレビや衛星放送を通じた有料テレビ放送、通信事業などを行っています。

○当ファンドのベンチマークとの差異

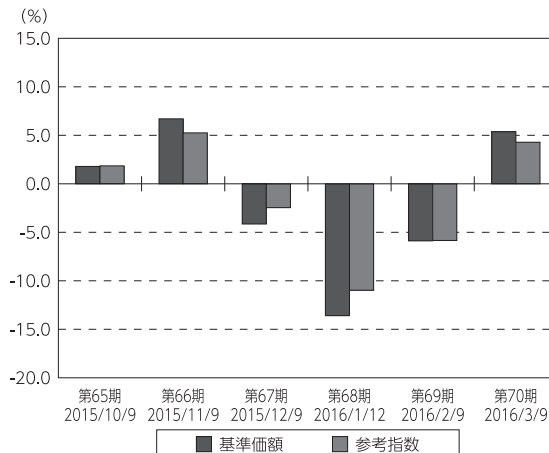
当ファンドは運用の目標となるベンチマークはありません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数が作成期首比8.6%下落したのに対し、基準価額は10.8%の下落となり、参考指数を2.2%下回る結果となりました。個別銘柄選択効果がマイナスに働いたことや、ファンドから控除される信託報酬等のコストが、マイナスの乖離要因となりました。

個別銘柄では、バイドゥ(アメリカ、ソフトウェア・サービス)、グレンコア(イギリス、素材)、ダノン(フランス、食品・飲料・タバコ)などがプラスに寄与しましたが、クレディ・スイス・グループ(スイス、各種金融)、ラファージュホルシム(スイス、素材)、BNPパリバ(フランス、銀行)などがマイナスに寄与しました。

基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込み(税込み)です。

○分配金

当作成期の分配金につきましては、収益分配方針に基づき、基準価額水準などを勘案して、それぞれ1万口当たり、第65期は100円、第66期は100円、第67期は100円、第68期は100円、第69期は100円、第70期は100円とさせていただきます。

なお、収益分配にあてず信託財産内に留保した利益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期
	2015年9月10日～ 2015年10月9日	2015年10月10日～ 2015年11月9日	2015年11月10日～ 2015年12月9日	2015年12月10日～ 2016年1月12日	2016年1月13日～ 2016年2月9日	2016年2月10日～ 2016年3月9日
当期分配金 (対基準価額比率)	100 0.709%	100 0.670%	100 0.703%	100 0.820%	100 0.878%	100 0.841%
当期の収益	16	8	—	—	—	19
当期の収益以外	83	91	100	100	100	80
翌期繰越分配対象額	6,826	6,734	6,635	6,535	6,435	6,354

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益および当期の収益以外は、小数点以下を切捨てて表示しているため、合計した額が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

マザーファンドへの投資により、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。ハリス・アソシエイツ社では、独自の集中したファンダメンタルズ調査に基づき、企業の持つ本来価値から相当割安な価格で取引されており、かつ経営陣が実質オーナーとしての自覚を持って行動しているような企業を探し出して投資します。ポートフォリオは、厳格な基準に基づいて絞り込まれ、構築され、モニタリングされています。どのような市場環境においても、投資は長期的な視野に立ち、常に優れたリターンを得ることを目的に行われます。今後とも徹底したバリュー哲学に基づいてポートフォリオの運用を続けてまいります。ハリス・アソシエイツ社では、ポートフォリオは引き続き投資魅力度の高い銘柄で構成されており、長期的に優れたリターンをご提供できるものと考えています。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年9月10日～2016年3月9日)

項 目	第65期～第70期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 132	% 0.994	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(80)	(0.602)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(46)	(0.349)	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、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(6)	(0.043)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.018	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数
(株 式)	(2)	(0.018)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際に支払う手数料です。
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.010	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数
(株 式)	(1)	(0.010)	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金です。
(d) そ の 他 費 用	5	0.041	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0.039)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用です。
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用です。
合 計	140	1.063	
作成期間の平均基準価額は、13,252円です。			

(注) 作成期間の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2015年9月10日～2016年3月9日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第65期～第70期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
ALAMCO	ハリス グローバル バリュース株マザーファンド	—	—	335,535	510,000

○株式売買比率

(2015年9月10日～2016年3月9日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第65期～第70期	
	ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	9,236,884千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	22,182,400千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2015年9月10日～2016年3月9日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2016年3月9日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第64期末	第70期末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
ALAMCO	ハリス グローバル バリュース株マザーファンド	6,082,048	5,746,513	8,122,696

(注) 親投資信託の当作成期末の受益権総口数は、13,984,458千口です。

○投資信託財産の構成

(2016年3月9日現在)

項 目	第70期末	
	評 価 額	比 率
ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド	千円 8,122,696	% 98.1
コール・ローン等、その他	159,005	1.9
投資信託財産総額	8,281,701	100.0

(注) ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(19,639,652千円)の投資信託財産総額(19,767,204千円)に対する比率は99.4%です。

(注) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=112.49円、1ユーロ=123.67円、1英ポンド=159.77円、1スイスフラン=112.81円、1スウェーデンクローナ=13.24円、100韓国ウォン=9.30円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第65期末	第66期末	第67期末	第68期末	第69期末	第70期末
	2015年10月9日現在	2015年11月9日現在	2015年12月9日現在	2016年1月12日現在	2016年2月9日現在	2016年3月9日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	9,743,038,079	10,321,767,726	9,813,132,710	8,428,480,987	7,865,955,212	8,281,701,984
コール・ローン等	154,325,707	129,513,503	107,962,202	99,461,484	105,388,786	159,005,746
ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド(調議)	9,588,712,330	10,192,254,188	9,705,170,479	8,329,019,476	7,760,566,398	8,122,696,238
未収利息	42	35	29	27	28	—
(B) 負債	84,505,924	89,270,675	94,824,197	86,494,060	81,804,573	82,256,652
未払収益分配金	69,003,793	68,977,176	68,824,311	68,942,902	68,958,563	69,524,461
未払解約金	—	3,484,421	9,522,366	17,205	39,897	27,114
未払信託報酬	15,460,355	16,722,118	16,346,391	17,355,927	12,594,061	12,489,077
その他未払費用	41,776	86,960	131,129	178,026	212,052	216,000
(C) 純資産総額(A-B)	9,658,532,155	10,232,497,051	9,718,308,513	8,341,986,927	7,784,150,639	8,199,445,332
元本	6,900,379,323	6,897,717,654	6,882,431,139	6,894,290,256	6,895,856,360	6,952,446,151
次期繰越損益金	2,758,152,832	3,334,779,397	2,835,877,374	1,447,696,671	888,294,279	1,246,999,181
(D) 受益権総口数	6,900,379,323口	6,897,717,654口	6,882,431,139口	6,894,290,256口	6,895,856,360口	6,952,446,151口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,997円	14,835円	14,120円	12,100円	11,288円	11,794円

(注) 第65期首元本額は6,946,556,783円、第65～70期中追加設定元本額は111,024,836円、第65～70期中一部解約元本額は105,135,468円です。

○損益の状況

項 目	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期
	2015年9月10日～ 2015年10月9日	2015年10月10日～ 2015年11月9日	2015年11月10日～ 2015年12月9日	2015年12月10日～ 2016年1月12日	2016年1月13日～ 2016年2月9日	2016年2月10日～ 2016年3月9日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	638	666	364	194	118	33
受取利息	638	666	364	194	118	33
(B) 有価証券売買損益	186,395,194	663,195,668	△ 405,975,881	△ 1,306,022,746	△ 478,233,987	432,106,952
売買益	191,860,649	663,541,858	1,052,245	125,817	215,533	432,130,714
売買損	△ 5,465,455	△ 346,190	△ 407,028,126	△ 1,306,148,563	△ 478,449,520	△ 23,762
(C) 信託報酬等	△ 15,502,131	△ 16,767,302	△ 16,390,560	△ 17,402,824	△ 12,628,087	△ 12,493,025
(D) 当期損益金 (A + B + C)	170,893,701	646,429,032	△ 422,366,077	△ 1,323,425,376	△ 490,861,956	419,613,960
(E) 前期繰越損益金	21,142,987	122,924,445	697,503,995	206,199,398	△ 1,184,929,847	△ 1,744,466,828
(F) 追加信託差損益金	2,635,119,937	2,634,403,096	2,629,563,767	2,633,865,551	2,633,044,645	2,641,376,510
(配当等相当額)	(3,292,841,665)	(3,292,606,184)	(3,288,110,296)	(3,296,807,306)	(3,299,092,997)	(3,335,706,053)
(売買損益相当額)	(△ 657,721,728)	(△ 658,203,088)	(△ 658,546,529)	(△ 662,941,755)	(△ 666,048,352)	(△ 694,329,543)
(G) 計 (D + E + F)	2,827,156,625	3,403,756,573	2,904,701,685	1,516,639,573	957,252,842	1,316,523,642
(H) 収益分配金	△ 69,003,793	△ 68,977,176	△ 68,824,311	△ 68,942,902	△ 68,958,563	△ 69,524,461
次期繰越損益金 (G + H)	2,758,152,832	3,334,779,397	2,835,877,374	1,447,696,671	888,294,279	1,246,999,181
追加信託差損益金	2,635,119,937	2,634,403,096	2,629,563,767	2,633,865,551	2,633,044,645	2,641,376,510
(配当等相当額)	(3,292,863,648)	(3,292,611,955)	(3,288,118,549)	(3,296,832,125)	(3,299,107,256)	(3,335,781,567)
(売買損益相当額)	(△ 657,743,711)	(△ 658,208,859)	(△ 658,554,782)	(△ 662,966,574)	(△ 666,062,611)	(△ 694,405,057)
分配準備積立金	1,417,777,584	1,352,869,948	1,278,379,124	1,208,634,141	1,138,462,992	1,082,005,326
繰越損益金	△ 1,294,744,689	△ 652,493,647	△ 1,072,065,517	△ 2,394,803,021	△ 2,883,213,358	△ 2,476,382,655

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 親投資信託の運用の指図にかかる権限の一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額は29,438,269円です。

(注) 分配金の計算過程

第65期計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,241,733円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(－円)、信託約款に規定する収益調整金(3,292,863,648円)および分配準備積立金(1,475,539,644円)より分配可能額は4,779,645,025円(10,000口当たり6,926円)であり、うち69,003,793円(10,000口当たり100円)を分配金額としています。

第66期計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,602,061円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(－円)、信託約款に規定する収益調整金(3,292,611,955円)および分配準備積立金(1,416,245,063円)より分配可能額は4,714,459,079円(10,000口当たり6,834円)であり、うち68,977,176円(10,000口当たり100円)を分配金額としています。

第67期計算期間末における費用控除後の配当等収益(－円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(－円)、信託約款に規定する収益調整金(3,288,118,549円)および分配準備積立金(1,347,203,435円)より分配可能額は4,635,321,984円(10,000口当たり6,735円)であり、うち68,824,311円(10,000口当たり100円)を分配金額としています。

第68期計算期間末における費用控除後の配当等収益(－円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(－円)、信託約款に規定する収益調整金(3,296,832,125円)および分配準備積立金(1,277,577,043円)より分配可能額は4,574,409,168円(10,000口当たり6,635円)であり、うち68,942,902円(10,000口当たり100円)を分配金額としています。

第69期計算期間末における費用控除後の配当等収益(－円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(－円)、信託約款に規定する収益調整金(3,299,107,256円)および分配準備積立金(1,207,421,555円)より分配可能額は4,506,528,811円(10,000口当たり6,535円)であり、うち68,958,563円(10,000口当たり100円)を分配金額としています。

第70期計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,246,273円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(－円)、信託約款に規定する収益調整金(3,335,781,567円)および分配準備積立金(1,138,283,514円)より分配可能額は4,487,311,354円(10,000口当たり6,454円)であり、うち69,524,461円(10,000口当たり100円)を分配金額としています。

○分配金のお知らせ

	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期
1万円当たり分配金(税込み)	100円	100円	100円	100円	100円	100円

◇収益分配金のお支払いは、各決算日から起算して5営業日までに開始します。

◇収益分配金を再投資する方のお手取り収益分配金は、各決算日の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰入れて再投資しました。

◇課税上の取扱い

- ・追加型株式投資信託の収益分配金には、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)とがあります。
- ・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ます。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。
- ・受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、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。
- ・個人の受益者の普通分配金については、20.315%(所得税および復興特別所得税15.315%、地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除の適用はありません。)または申告分離課税を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合は、税率が異なります。

※上記は、作成日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

※税金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。

親投資信託 ALAMCO ハリス グローバル バリューストックマザーファンド

第9期（決算日：2016年3月9日）

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

運用方針	主として、日本を除く世界各国の株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	MSCI KOKUSAI	騰落率		
5期(2012年3月9日)	7,788	△2.2	105,271.51	△4.5	97.8	25,110
6期(2013年3月11日)	10,790	38.5	138,065.91	31.2	97.1	18,477
7期(2014年3月10日)	14,383	33.3	175,223.63	26.9	97.9	20,432
8期(2015年3月9日)	16,978	18.0	211,907.15	20.9	96.3	24,294
9期(2016年3月9日)	14,135	△16.7	180,421.59	△14.9	96.4	19,767

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注) 参考指数は、MSCI KOKUSAIインデックス(US\$ベース)をもとに、当社で対顧客電信売買相場仲値(円/ドルレート)を使って円換算したもので、当該外貨建指数については基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています(以下同じです)。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式先物比率
	円	騰落率	MSCI KOKUSAI	騰落率	
(期首) 2015年3月9日	16,978	—	211,907.15	—	96.3
3月末	17,118	0.8	212,524.25	0.3	96.9
4月末	17,411	2.6	214,423.72	1.2	95.2
5月末	18,139	6.8	222,711.53	5.1	96.0
6月末	17,600	3.7	213,618.92	0.8	96.0
7月末	17,846	5.1	219,460.25	3.6	97.5
8月末	16,112	△5.1	201,567.18	△4.9	97.1
9月末	14,587	△14.1	187,465.09	△11.5	97.9
10月末	16,655	△1.9	207,645.75	△2.0	97.5
11月末	16,748	△1.4	209,782.70	△1.0	95.0
12月末	16,200	△4.6	204,372.44	△3.6	96.9
2016年1月末	14,328	△15.6	186,165.18	△12.1	98.5
2月末	13,686	△19.4	178,016.41	△16.0	97.5
(期末) 2016年3月9日	14,135	△16.7	180,421.59	△14.9	96.4

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

(注) 騰落率は期首比で計算しています。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◎運用経過

期中の基準価額等の推移(2015年3月10日～2016年3月9日)

○基準価額の主な変動要因



(注) 参考指数は、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

主な上昇要因としては、FRB(米連邦準備理事会)による利上げ観測が後退したことや、ECB(欧州中央銀行)による金融緩和への期待などから、株式市場が2015年10月や2016年2月後半以降に反発したことなどが挙げられます。

主な下落要因としては、中国をはじめとする世界経済の減速や原油価格の下落に対する懸念からリスク回避の動きが強まったことや、主要通貨に対して円高が進んだことなどが挙げられます。

○投資環境(2015年3月10日～2016年3月9日)

当期の海外株式市場は、2015年7月までは一進一退の動きとなりましたが、その後は中国経済や原油価格に対する懸念から下落しました。

期初から7月までは、中国経済に対する懸念は続いたものの、中国政府が様々な株価対策を発表したことや、米国の利上げ観測が後退したことなどから、一進一退の動きとなりました。

しかし、8月に入ってから、中国が人民元の切り下げを行ったことや、中国株式市場が大幅に下落したことから、中国経済の先行きに対する警戒感が強まったことを受けて、海外株式市場は大きく下落しました。

その後、中国人民銀行が緊急利下げを行い中国株式市場が反発したことや、予想を上回る米国経済指標が発表されたこと、中国が財政政策の発動の可能性を示唆したことなどから、海外株式市場は落ち着きを取り戻しました。10月に入ると、米雇用統計が市場予想を下回り早期の利上げ観測が後退したことや、ECBによる追加金融緩和への言及があったこと、中国人民銀行による利下げが行われたこと、米国の主要テクノロジー企業の決算が予想を上回ったことなどから10月末までは戻り基調となりました。

しかし、12月以降は、原油価格の下落が続いたことや、ECBの金融緩和が市場の期待を下回ったこと、中国の貿易統計が弱かったことなどから、海外株式市場は再び下落に転じました。2016年年明け後は、中国株式市場および人民元が急落したことや、原油価格の下落が続いたことなどを受けて、リスク回避の動きが強まり、海外株式市場は大きく下落しました。2月に入

ると、ドイツ銀行の経営不安が高まったことなども悪材料となり、2月半ばに期中の安値を付けました。当期末にかけては、イエレンFRB議長の議会証言を受けて利上げ観測が後退したことや、原油価格が反発したこと、ECBの追加金融緩和への期待などから、海外株式市場は持ち直しましたが、前期末との比較では下落して当期末を迎えました。

為替市場では、米国の利上げ観測の後退や、ECBの金融緩和、リスク回避の動きなどから、対ドル、対ユーロとも円高となりました。

○当ファンドのポートフォリオ (2015年3月10日～2016年3月9日)

主として日本を除く世界各国の株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。

バリュー株投資で評価の高い米ハリス・アソシエイツ・エル・ピー(以下「ハリス・アソシエイツ社」といいます。)に運用を委託しています。

当期は、アルファベット(アメリカ、ソフトウェア・サービス)、バイドゥ(アメリカ、ソフトウェア・サービス)、マイクロソフト(アメリカ、ソフトウェア・サービス)などがプラスに寄与しましたが、グレンコア(イギリス、素材)、クレディ・スイス・グループ(スイス、各種金融)、ラファージュホルシム(スイス、素材)などがマイナスに寄与しました。

期首に保有していた銘柄のうち当期中に全売却したのは以下のとおりです。これらは売却目標に達したか、ポートフォリオの価値を高める、より魅力的な銘柄を組入れるために売却したものです。

銘柄	投資国	業種
アデコ	スイス	商業・専門サービス
アップル	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
アブライド・マテリアルズ	アメリカ	半導体・半導体製造装置
フランクリン・リソース	アメリカ	各種金融
グラクソ・スミスクライン	イギリス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ハリバートン	アメリカ	エネルギー
マスターカード	アメリカ	ソフトウェア・サービス
ナショナル・オイルウエル・パーコ	アメリカ	エネルギー
ネスレ	スイス	食品・飲料・タバコ
スターウッド・ホテル・アンド・リゾート・ワールドワイド	アメリカ	消費者サービス
VISA	アメリカ	ソフトウェア・サービス

(注) 業種はGICS(世界産業分類基準)に基づく24産業グループによります(以下同じです。)

一方、当期に新規に組入れを行った主な銘柄と概要は以下のとおりです。なお、アプライド・マテリアルズについては、2015年3月に全て売却しましたが、その後、株価下落により割安度が高まったことから、9月に再び組入れました。

銘柄、投資国、業種	概要
アナダルコ・ペトロリアム アメリカ エネルギー	石油、ガスの探査および生産を世界で手掛けています。
アプライド・マテリアルズ アメリカ 半導体・半導体製造装置	世界各国の半導体産業を対象に、半導体ウエハー製造装置と関連部品の開発、製造、販売を行っています。
アトラス・コプコ スウェーデン 資本財	コンプレッサー、産業機械、鉱山機械、建設機械の製造・販売および関連サービスを行っています。
バイドゥ アメリカ ソフトウェア・サービス	インターネット検索サイトを運営しています。
キャタピラー アメリカ 資本財	建設、鉱業、農業、林業向け機械の設計・製造・販売を手掛ける重機メーカーです。
チャーター・コミュニケーションズ アメリカ メディア	高速インターネット・サービス、インターネット電話、ビデオや音楽配信等のブロードバンド・インターネット通信サービスを提供しています。
カミンズ アメリカ 資本財	ディーゼルや天然ガスエンジンの設計・製造・販売・サービスを手掛けるエンジン・メーカーです。
グルポ・テレビサ アメリカ メディア	スペイン語圏最大のメディア企業で、一般のテレビ放送や、ケーブルテレビや衛星放送を通じた有料テレビ放送、通信事業などを行っています。
マイクロソフト アメリカ ソフトウェア・サービス	コンピュータの基本ソフト、サーバー用アプリケーション・ソフト、ビデオ・ゲーム機、タブレット端末などを提供しています。

○今後の運用方針

ハリス・アソシエイツ社では、独自の集中したファンダメンタルズ調査に基づき、企業の持つ本来価値から相当割安な価格で取引されていて、かつ経営陣が実質オーナーとしての自覚を持って行動しているような企業を探し出して投資します。ポートフォリオは、厳格な基準に基づいて絞り込まれ、構築され、モニタリングされています。どのような市場環境においても、投資は長期的な視野に立ち、常に優れたリターンを得ることを目的に行われます。今後とも徹底したバリュー哲学に基づいてポートフォリオの運用を続けてまいります。ハリス・アソシエイツ社では、ポートフォリオは引き続き投資魅力度の高い銘柄で構成されており、長期的に優れたリターンをご提供できるものと考えています。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年3月10日～2016年3月9日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 6 (6)	% 0.037 (0.037)	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際に支払う手数料です。
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	4 (4)	0.022 (0.022)	(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金です。
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	13 (13) (0)	0.078 (0.078) (0.000)	(c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および 資金の送金・資産の移転等に要する費用です。 信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	23	0.137	
期中の平均基準価額は、16,369円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2015年3月10日～2016年3月9日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 5,731 (626)	千米ドル 36,361 (-)	百株 7,002	千米ドル 39,418
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	934	8,844	284	3,664
	フランス	1,607	11,297	1,089	9,048
	オランダ	3,513 (74)	4,726 (181)	1,588	3,722
	イギリス	38,076 (212)	千英ポンド 6,979 (-)	13,074 (-)	千英ポンド 7,649 (291)
	スイス	3,899 (3,893)	千スイスフラン 14,458 (-)	6,805 (-)	千スイスフラン 20,809 (648)
	スウェーデン	1,523	千スウェーデンクローナ 28,168	107	千スウェーデンクローナ 1,869
	韓国	48	千韓国ウォン 6,097,476	36	千韓国ウォン 4,375,895

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

○株式売買比率

(2015年3月10日～2016年3月9日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	23,107,633千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,729,666千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.97

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月10日～2016年3月9日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2016年3月9日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
ALPHABET INC-CL A	—	74	5,315	597,974	ソフトウェア・サービス	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,310	1,356	7,041	792,121	保険	
ANADARKO PETROLEUM CORP	—	610	2,511	282,483	エネルギー	
APPLE INC	275	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS	469	1,408	2,644	297,448	半導体・半導体製造装置	
BAIDU INC - SPON ADR	—	252	4,358	490,261	ソフトウェア・サービス	
BLACKROCK INC	31	73	2,367	266,348	各種金融	
CATERPILLAR INC	—	605	4,341	488,410	資本財	
CHARTER COMMUNICATION-A	—	91	1,670	187,865	メディア	
CUMMINS INC	—	404	4,120	463,464	資本財	
FRANKLIN RESOURCES INC	1,022	—	—	—	各種金融	
GENERAL MOTORS CO	2,311	2,408	7,387	831,047	自動車・自動車部品	
GOOGLE INC-CL A	72	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
GRUPO TELEVISIA SA-SPON ADR	—	385	1,049	118,016	メディア	
HALLIBURTON CORP	490	—	—	—	エネルギー	
INTEL CORP	2,417	1,038	3,172	356,832	半導体・半導体製造装置	
JPMORGAN CHASE & CO	934	903	5,307	597,078	銀行	
MASTERCARD INC-CLASS A	409	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
MICROSOFT CORP	—	509	2,631	295,966	ソフトウェア・サービス	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	501	—	—	—	エネルギー	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	383	—	—	—	消費者サービス	
TIFFANY & CO	207	387	2,686	302,192	小売	
VISA INC-CLASS A SHARES	201	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
WELLS FARGO & CO	1,405	1,272	6,239	701,843	銀行	
AON PLC	468	482	4,746	533,964	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,905	12,261	67,591	7,603,320	
	銘柄 数 < 比 率 >	17	17	—	< 38.5% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ALLIANZ SE	417	449	6,324	782,180	保険	
DAIMLER AG-REG	587	1,205	7,842	969,873	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,005	1,654	14,167	1,752,053	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 8.9% >	
(ユーロ…フランス)						
KERING	269	239	3,889	480,969	耐久消費財・アパレル	
BNP PARIBAS	1,414	2,075	9,477	1,172,072	銀行	
DANONE	415	302	1,913	236,694	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,099	2,617	15,280	1,889,735	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 9.6% >	
(ユーロ…オランダ)						
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,921	1,565	3,728	461,150	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV	9,489	11,844	7,307	903,749	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,410	13,409	11,036	1,364,899	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 6.9% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	14,514	17,682	40,484	5,006,688	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 25.3% >	
(イギリス)			千英ポンド			
DIAGEO PLC	2,432	1,244	2,321	370,974	食品・飲料・タバコ	
GLAXOSMITHKLINE PLC	422	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 千円	邦貨換算金額
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円
EXPERIAN PLC	3,036	2,027	2,418	386,357
GLENCORE PLC	19,148	46,981	6,565	1,048,985
小 計	株 数 ・ 金 額	25,038	50,252	11,305
	銘柄 数 < 比 率 >	4	3	< 9.1% >
(スイス)			千スイスフラン	
ADECCO SA-REG	708	911	—	—
LAFARGEHOLCIM LTD	897	1,911	7,996	902,057
NESTLE SA-REG	732	—	—	—
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,688	5,258	7,898	890,998
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	387	182	2,458	277,379
JULIUS BAER GROUP LTD	1,658	1,639	6,970	786,360
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	846	913	6,184	697,661
小 計	株 数 ・ 金 額	8,916	9,904	31,508
	銘柄 数 < 比 率 >	7	5	< 18.0% >
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ	
ATLAS COPCO AB-B SHS	—	1,416	26,932	356,583
小 計	株 数 ・ 金 額	—	1,416	26,932
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	< 1.8% >
(韓国)			千韓国ウォン	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	54	65	7,861,240	731,095
小 計	株 数 ・ 金 額	54	65	7,861,240
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	< 3.7% >
合 計	株 数 ・ 金 額	61,429	91,581	19,058,462
	銘柄 数 < 比 率 >	36	34	< 96.4% >

(注) 銘柄コードの変更等があった場合は、別銘柄として掲載しています。

(注) 評価額(邦貨換算金額)は、期末の評価額(外貨建金額)をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 小計欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額(邦貨換算金額)の比率です。

(注) 合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の比率です。

○投資信託財産の構成

(2016年3月9日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	19,058,462	96.4
コール・ローン等、その他	708,742	3.6
投資信託財産総額	19,767,204	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(19,639,652千円)の投資信託財産総額(19,767,204千円)に対する比率は99.4%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=112.49円、1ユーロ=123.67円、1英ポンド=159.77円、1スイスフラン=112.81円、1スウェーデンクローナ=13.24円、100韓国ウォン=9.30円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月9日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,774,086,886
コール・ローン等	615,874,925
株式(評価額)	19,058,462,763
未収入金	78,601,931
未収配当金	21,147,267
(B) 負債	6,881,985
未払金	6,881,985
(C) 純資産総額(A-B)	19,767,204,901
元本	13,984,458,209
次期繰越損益金	5,782,746,692
(D) 受益権総口数	13,984,458,209口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,135円

(注) 期首元本額は14,309,678,897円、期中追加設定元本額は1,529,201,077円、期中一部解約元本額は1,854,421,765円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、【元本の内訳】の通りです。

【元本の内訳】

ALAMCO ハリス 年金グローバルバリューストックファンド2007(道格機関投資家専用)	5,000,510,825円
ハリス世界株ファンド(毎月決算型)	5,746,513,080円
ALAMCO ハリス グローバルバリューストックファンド2007(道格機関投資家専用)	3,237,434,304円

○損益の状況 (2015年3月10日～2016年3月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	417,081,622
受取配当金	417,000,449
受取利息	81,173
(B) 有価証券売買損益	△4,698,634,208
売買益	787,890,303
売買損	△5,486,524,511
(C) 保管費用等	△ 19,185,983
(D) 当期損益金(A+B+C)	△4,300,738,569
(E) 前期繰越損益金	9,985,264,573
(F) 追加信託差損益金	1,050,798,923
(G) 解約差損益金	△ 952,578,235
(H) 計(D+E+F+G)	5,782,746,692
次期繰越損益金(H)	5,782,746,692

(注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。