

DIAMバランス・ファンド ＜DC年金＞

DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞1安定型
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞2安定・成長型
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞3成長型

追加型投信／内外／資産複合(インデックス型)

アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。
ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

委託会社への照会先

【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)

【ホームページ】 <http://www.am-one.co.jp/>

- 「D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型」 「D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」 「D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型」 の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和 23 年法律第 25 号）第 5 条の規定により、有価証券届出書を 2016 年 5 月 25 日に関東財務局長に提出しており、2016 年 5 月 26 日にその効力が発生しております。
- 「D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型」 「D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」 「D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型」 の受益権の価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動きのほか、為替変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家の皆様に帰属します。したがって、当ファンドは、元本が保証されているものではありません。

この投資信託は、実質的に国内外の株式および公社債を主要投資対象としています。この投資信託の基準価額は、組入る有価証券の値動きおよび為替相場の変動等の影響により上下しますので、これにより、投資元本を割り込むことがあります。
また、組入れた株式および公社債の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあります。

発行者：アセットマネジメント One 株式会社
代表者の役職氏名：取締役社長 西 惠 正
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目 8 番 2 号

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所：該当事項はありません。

届出の対象とした募集

募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称：

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

募集内国投資信託受益証券の金額：各ファンドにつき、1 兆円を上限とします。

目 次	頁
第一部 証券情報	1
第二部 ファンド情報	4
第1 ファンドの状況	4
1 ファンドの性格	4
2 投資方針	10
3 投資リスク	28
4 手数料等及び税金	33
5 運用状況	36
第2 管理及び運営	68
1 申込（販売）手続等	68
2 換金（解約）手続等	69
3 資産管理等の概要	70
4 受益者の権利等	73
第3 ファンドの経理状況	75
1 財務諸表	77
2 ファンドの現況	289
第4 内国投資信託受益証券事務の概要	291
第三部 委託会社等の情報	293
第1 委託会社等の概況	293
1 委託会社等の概況	293
2 事業の内容及び営業の概況	294
3 委託会社等の経理状況	296
4 利害関係人との取引制限	370
5 その他	370
約款	371

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

(以上を総称して、または個別に「バランス・ファンド<DC年金>」、「ファンド」、「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また各々、「D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」を「バランス・ファンド<DC年金> 1」、「D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」を「バランス・ファンド<DC年金> 2」、「D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」を「バランス・ファンド<DC年金> 3」という場合もあります。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

<基準価額の照会方法等>

基準価額は、当ファンド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。

※当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）

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

※収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成28年5月26日から平成29年5月26日まで

※お申込みの取扱いは、販売会社の毎営業日に行われます。

※ニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

※販売会社は、下記の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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）

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で全額再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

なお、海外休業日には、お申込みの受付を行いません。

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。

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

○振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①当ファンドは、3本のファンドから構成され、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- ②各ファンドの信託金の限度額は1兆円とします。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

●ライフサイクルにあわせた分散投資

●主としてマザーファンド*を通じて実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券の4つのアセット(資産)に投資します。

*国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

●個々のアセット(資産)において、数多くの銘柄に分散して投資することにより、より一層の分散投資効果を追求します。

●基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス(注)に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

●各資産につき、基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。

●運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

●実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

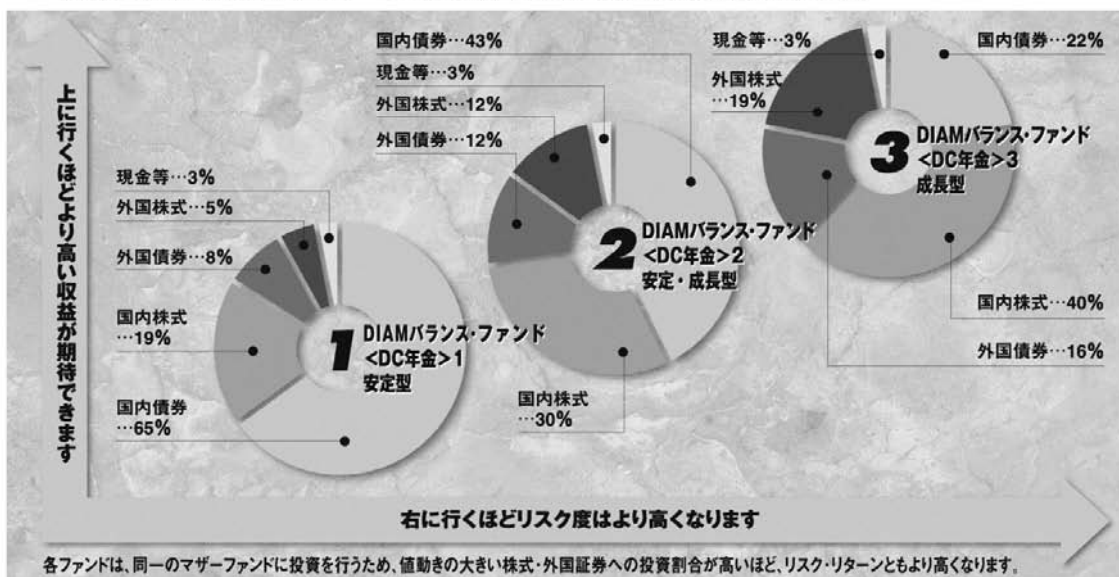
2

●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

ご投資家の皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じて、3種類の組み合わせ(資産配分)からご選択いただけます。

3ファンドの基本アロケーション

(注)運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。



- DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型
比較的リスクの低い資産(国内債券)を中心に組入れ、安定運用を行います。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型
各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスク・ミドルリターンをめざします。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

分配方針

年1回の決算時(2月25日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(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

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型」

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外 内外	不動産投信 その他資産 () 資産複合	特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

※単位型投信・追加型投信

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

※投資対象地域

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

※投資対象資産

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

※補足分類

「インデックス型」とは目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

○属性区分表

「D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」

「D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」

「D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」

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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル (日本を含む)			
大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
債券 一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
公債 社債	年6回 (隔月)	欧州			
その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア オセアニア			TOPIX
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 (MSCI コク サイ・インデッ クス、NOMU RA-BPI 総 合、シティ世界国 債インデックス)
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

※投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）へ実質的に投資し、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

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

※決算頻度

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

※投資対象地域

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

※投資形態

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

※為替ヘッジ

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

※対象インデックス

「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

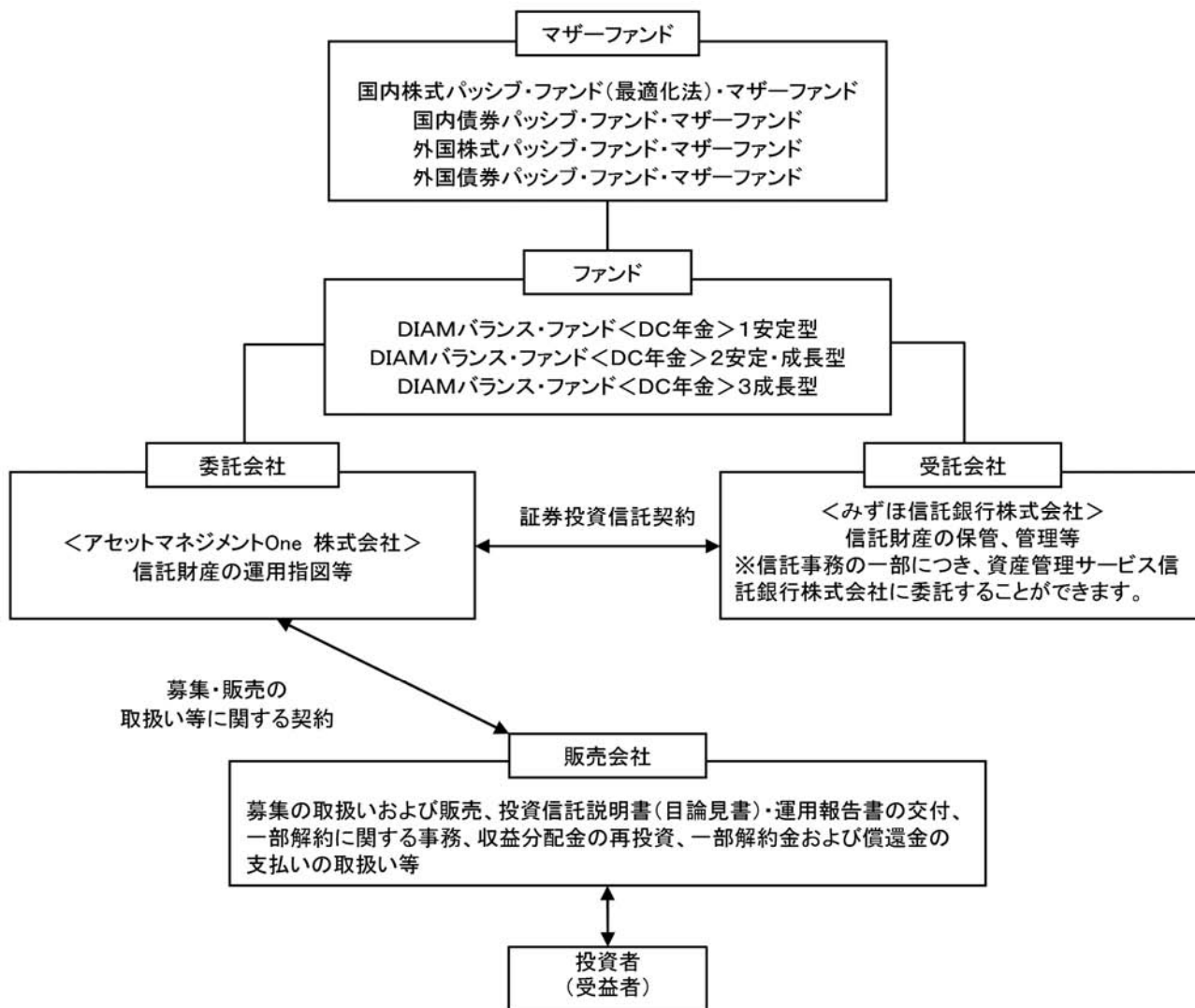
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

（２）【ファンドの沿革】

平成14年12月13日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
平成17年10月1日	信託報酬率の変更

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

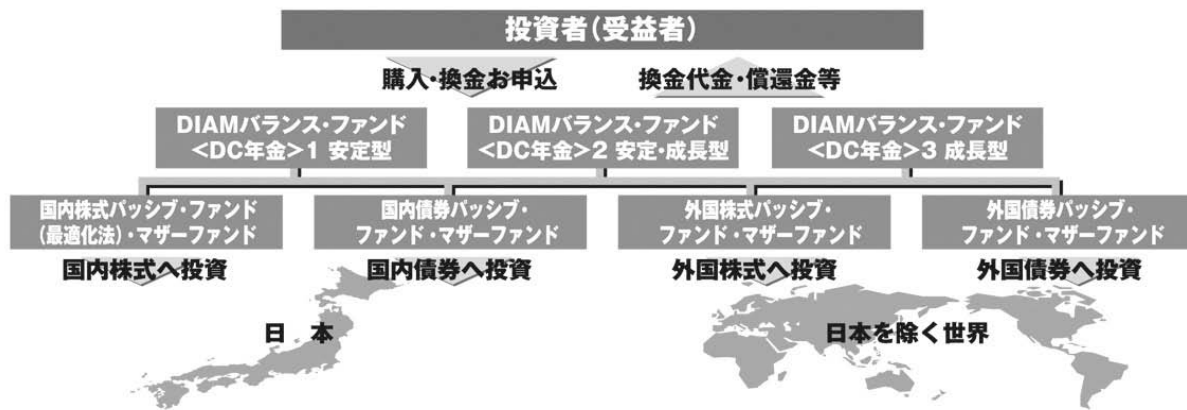
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

①資本金の額

20億円（平成28年10月1日現在）

②委託会社の沿革

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

③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%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

<投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。

2) ①「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が40%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が30%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス※に概ね連動する投資成果をめざして運用します。

②「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が60%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が50%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス※に概ね連動する投資成果をめざして運用します。

③「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が80%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が55%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス※に概ね連動する投資成果をめざして運用します。

※委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)^(注1)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合^(注2)、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)^(注3)、外国債券についてはシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)^(注4)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

(注1) T O P I Xの指数値及びT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利及びT O P I Xの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

㈱東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の停止又はT O P I Xの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

㈱東京証券取引所は、T O P I Xの商標の使用もしくはT O P I Xの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

㈱東京証券取引所は、T O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドはT O P I Xの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの基準価額とT O P I Xの指数値の動向が乖離することがあります。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

㈱東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、当社又は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

(注2) N O M U R A - B P I 総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注3) M S C I コクサイ・インデックスは、M S C I Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I Inc. に属しており、また、M S C I 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。

(注4) シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

- 3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

■対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成インデックスに連動させるため、以下の対応を行います。

基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針 (2)投資対象 (参考) ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要をご参照ください。

(2) 【投資対象】

1. 投資の対象とする資産 (約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲 (約款第16条第1項)

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(4)までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券ならびに(5)以降の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

(1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(5) 株券または新株引受権証書

(6) 国債証券

- (7) 地方債証券
 - (8) 特別の法律により法人の発行する債券
 - (9) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - (10) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - (11) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - (12) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - (13) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 - (14) コマーシャル・ペーパー
 - (15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - (16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
 - (17) 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
 - (18) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - (19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - (20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - (21) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - (23) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - (24) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 - (25) 貸付債権信託受益権であつて金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - (26) 外国の者に対する権利で上記(25)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

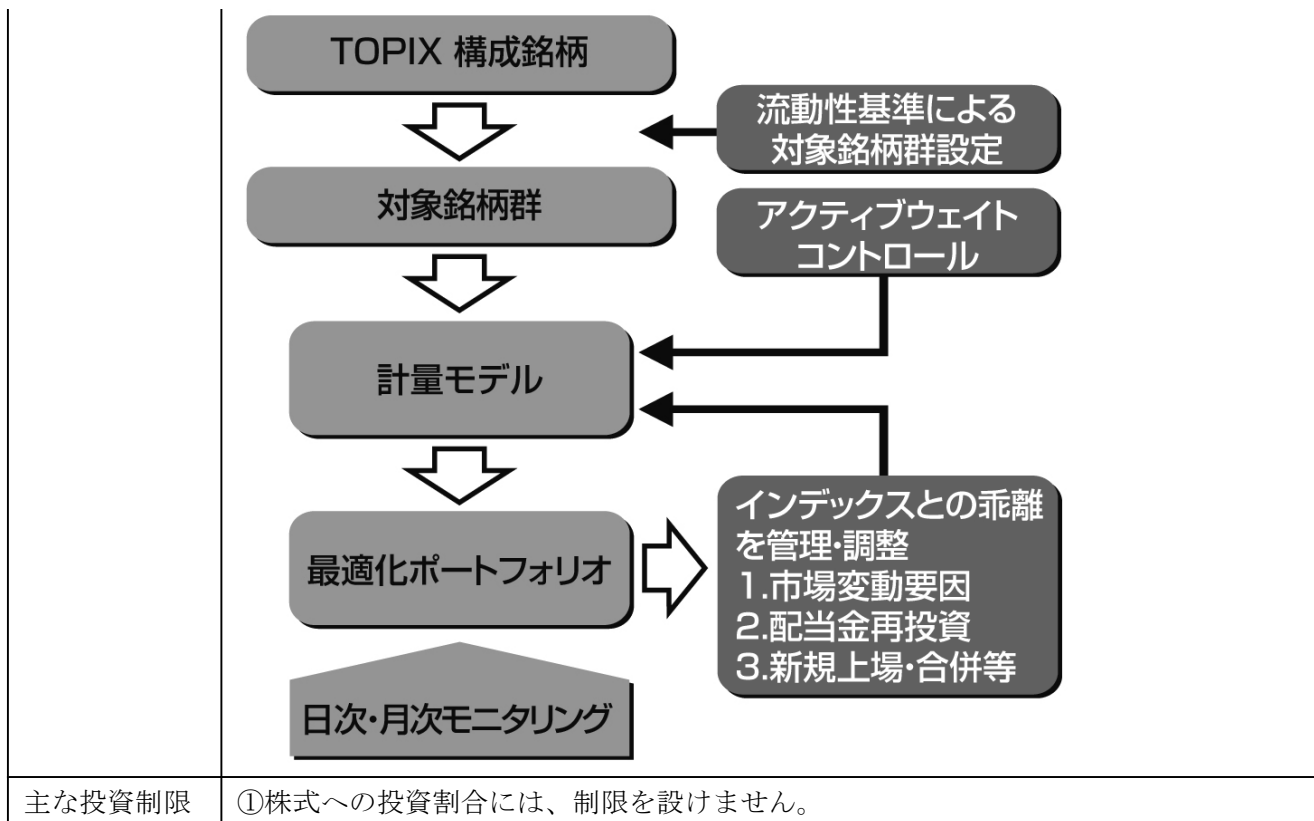
委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

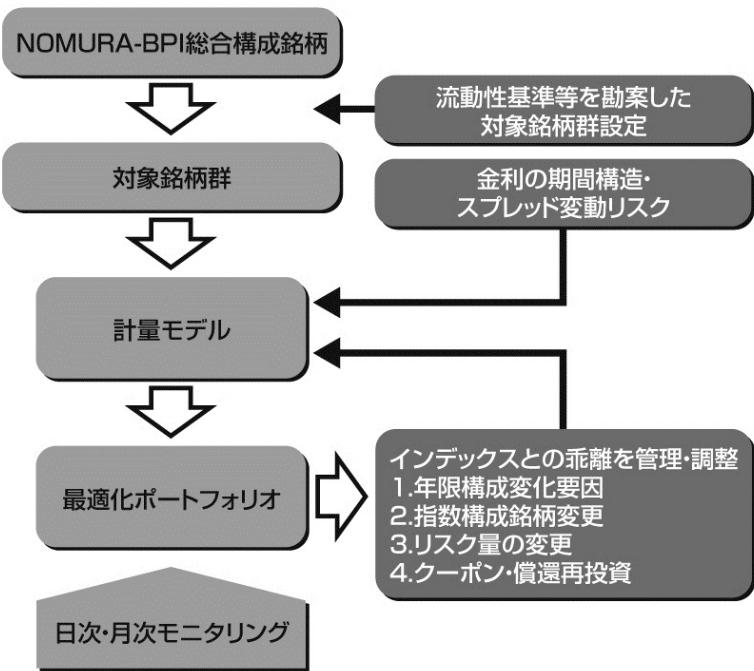
4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3. の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

(参考) ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

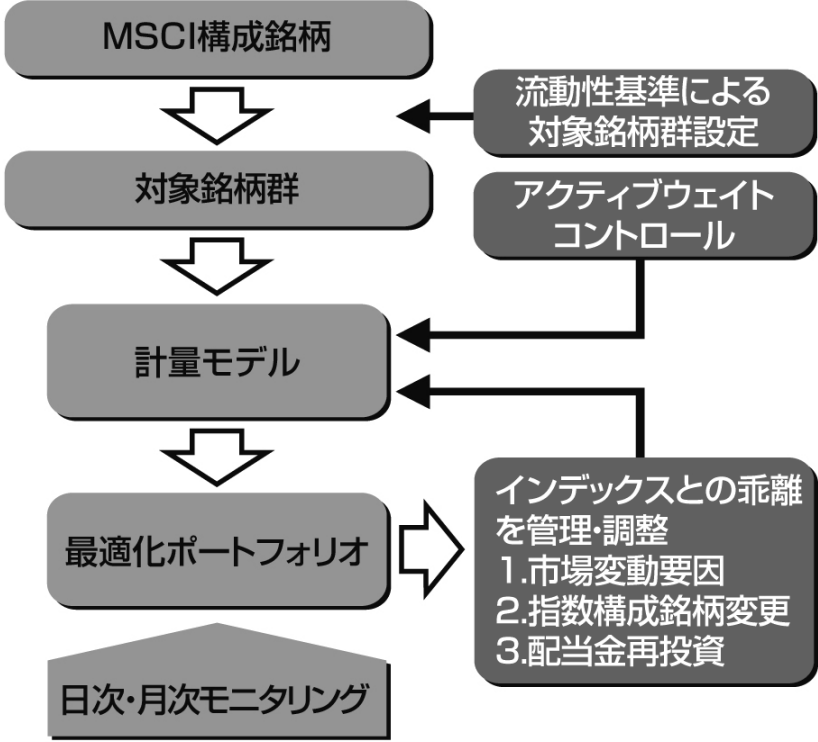
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> 1)流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

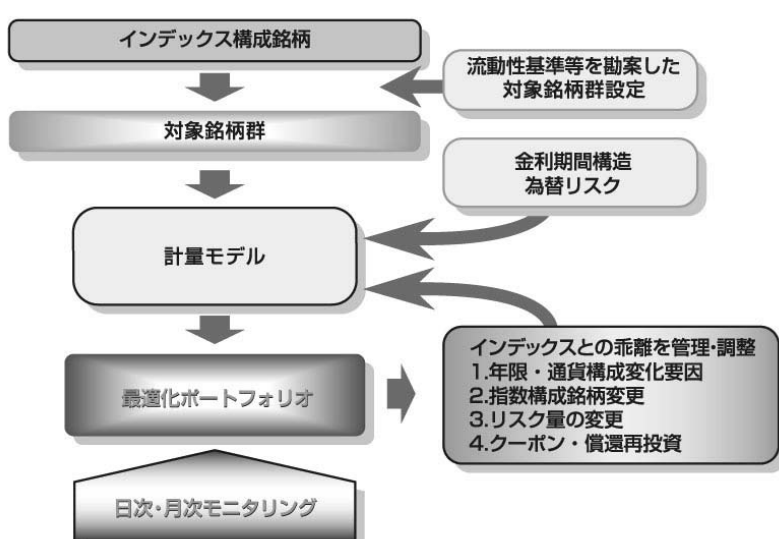


ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA-BPI 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 最適化法によるポートフォリオの構築 <ol style="list-style-type: none"> 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 ①、②が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更

	<ul style="list-style-type: none"> ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資 
<p>主な投資制限</p>	<p>①株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>②株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>③同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑤外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

<p>ファンド名</p>	<p>外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の株式を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>

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

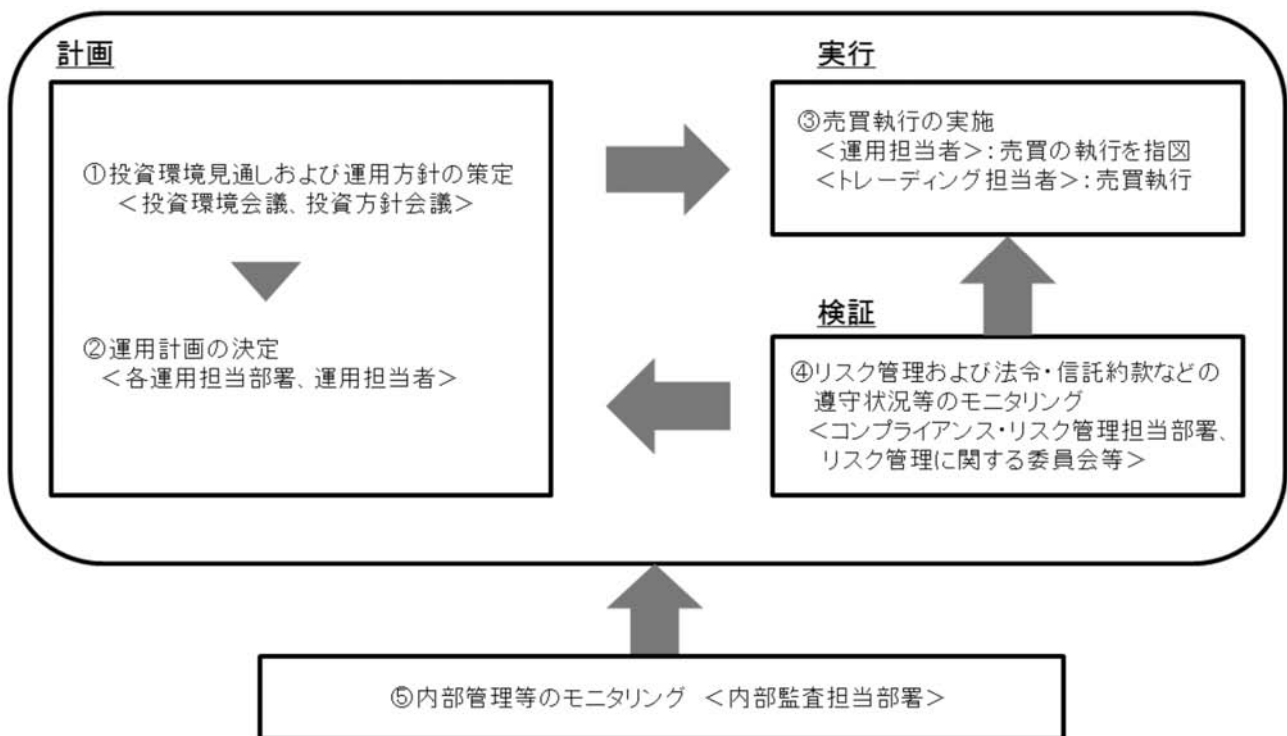
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
運用プロセス	<p>1) 流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資 
主な投資制限	<p>① 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

- ②同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④外貨建資産への投資には、制限を設けません。

資金動向、市況動向によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、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。

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は平成28年10月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。

（4）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則2月25日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を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、別に定める契約に基づき、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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。

（５）【投資制限】

①「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」

(1) 株式への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

②「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」

(1) 株式への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

③「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」

(1) 株式への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。

①②③共通

(3) 投資信託証券への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限）

各マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(4) 新株引受権証券等への実質投資割合（約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の15%以下とします。

(5) 投資する株式等の範囲（約款第18条）

(a) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

(b) 上記(a)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

(6) 同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資制限（約款第19条）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(7) 同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第20条）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(8) 信用取引の指図範囲（約款第21条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

(b) 上記(a)の信用取引の指図は、次の1)～6)に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1)～6)に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2) 株式分割により取得する株券

- 3) 有償増資により取得する株券
- 4) 売出しにより取得する株券
- 5) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
- 6) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(9) 先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第22条）

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

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

2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

- 3) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。
- 1) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。
- 2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- 3) コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- (10) スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第23条）
- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属すると

みなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(e) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

(f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供を要求され委託会社が必要と認めるときあるいは担保の受入れが必要と委託会社が認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(11) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(c) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(e) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項におい

て同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(f) 上記(e)においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(g) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(h) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(12) デリバティブ取引等にかかる投資制限 (約款第24条の2)

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

(13) 有価証券の貸付の指図および範囲 (約款第25条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価総額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(b) 上記(a) 1)～2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入の指図を行うものとします。

(14) 公社債の空売りの指図範囲 (約款第26条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債(信託財産により借り入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(b) 上記(a)の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(15) 公社債の借入れ (約款第27条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- (b) 上記(a)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d) 上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- (16) 特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第29条）
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- (17) 外国為替予約の指図（約款第30条）
(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (c) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (d) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (18) 資金の借入れ（約款第37条）
(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (b) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (c) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(d)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

当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。

(1)株式投資リスク

当ファンドは実質的に株式に投資します。株式には一般的に次に掲げるリスクがあります。

1)価格変動リスク

株式の価格は、一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

2)信用リスク

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

(2)債券投資リスク

当ファンドは実質的に公社債に投資します。公社債では、一般的に次に掲げるリスクがあります。

1)金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に、金利が上昇した場合には、債券の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

2)信用リスク

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

(3) 為替リスク

当ファンドは実質的に外貨建資産を保有します。外貨建資産に投資する場合には、一般的に為替リスクがあります。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。従いまして、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替変動リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としており、円と投資対象国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に影響します。

(4) 資産配分リスク

当ファンドの各資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産）の資産配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

(5) カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落する場合があります。

< 分配金に関する留意点 >

- 収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。
- 分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

< その他の留意点 >

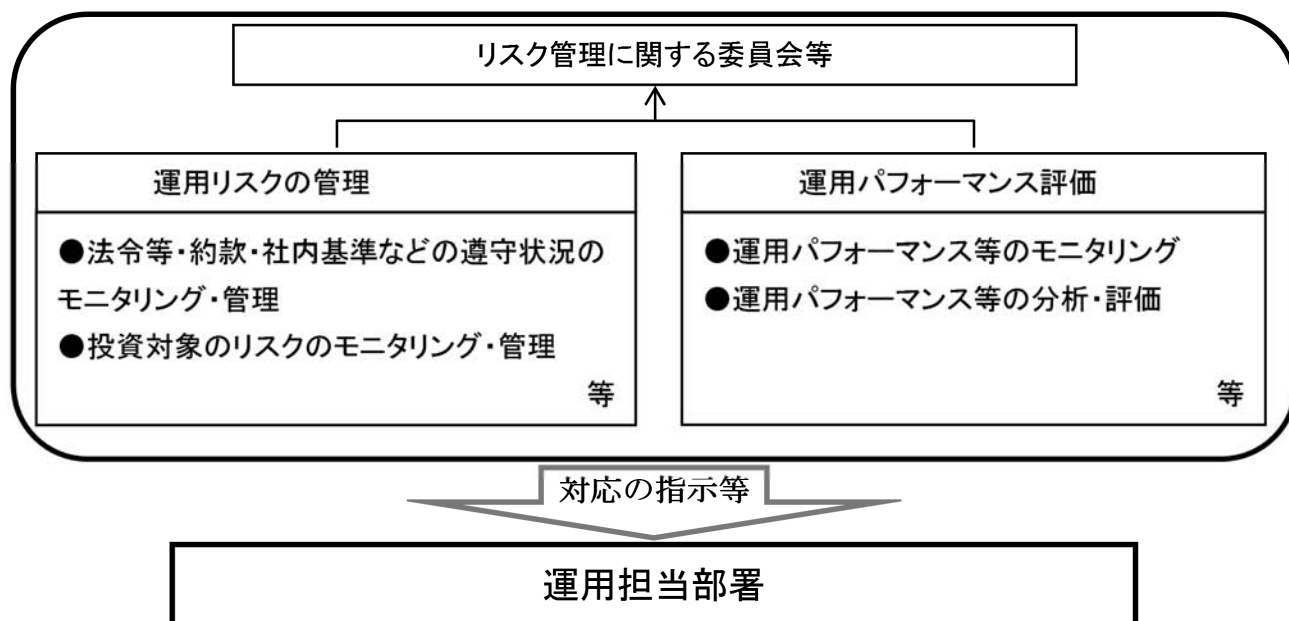
- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

- 当ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成インデックスが乖離する場合があります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当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に、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。
- 当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。
- 資金動向、市況動向等によっては、上記の投資態度に従った運用ができない場合があります。
- 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができます。
- 各ファンドにつき、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。
- 注意事項
 - イ. 当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（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、基準価額は変動します。
 - ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
 - ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
 - ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

＜リスク管理体制＞

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

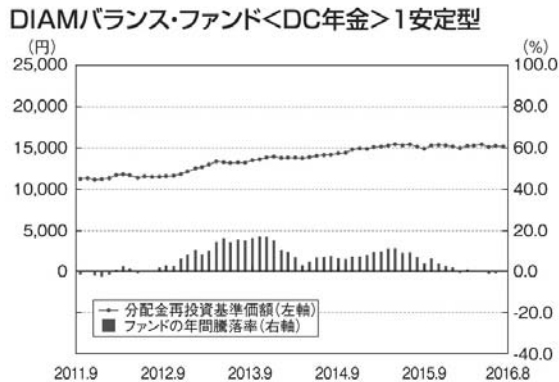
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



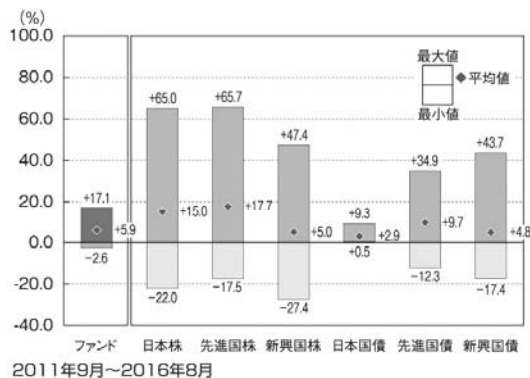
※上記体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

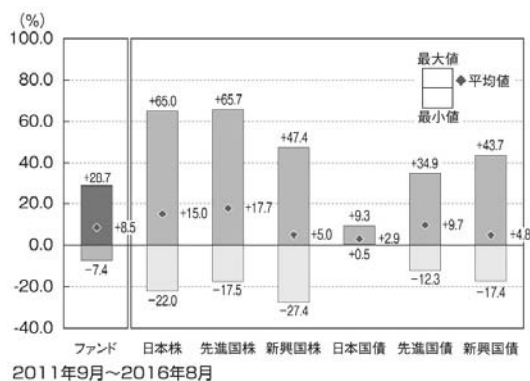
ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移



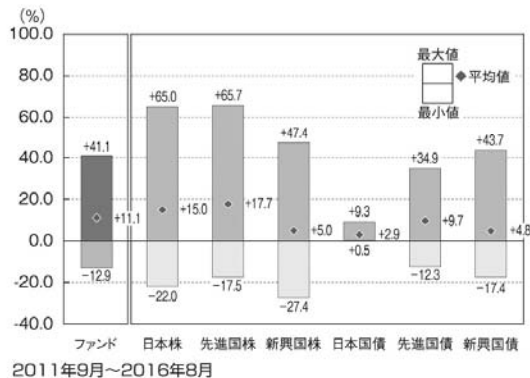
ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較



DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型



DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



* 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。
* ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

* 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
* 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

* 各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
日本国債…NOMURA-BPI国債
先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの信託報酬およびその配分は、日々の純資産総額に対して以下の通りとします。

ファンド名	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
D I AMバランス・ファンド <DC年金> 1 安定型 年率0.2808%（税抜0.26%）	0.100%	0.130%	0.030%
D I AMバランス・ファンド <DC年金> 2 安定・成長型 年率0.3132%（税抜0.29%）	0.115%	0.145%	0.030%
D I AMバランス・ファンド <DC年金> 3 成長型 年率0.3456%（税抜0.32%）	0.130%	0.160%	0.030%
主な役務	委託した資金の運用の対価	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	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、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

※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】

◇当ファンドは、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

①収益分配時

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

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

②換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

※上記は、平成28年8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>

- ①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ②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、個別元本の算出が行われる場合があります。
- ③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、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1 安定型

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	8,943,780,241	97.02
内 日本	8,943,780,241	97.02
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	274,249,140	2.98
純資産総額	9,218,029,381	100.00

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

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

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	19,367,843,099	97.04
内 日本	19,367,843,099	97.04
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	589,767,117	2.96
純資産総額	19,957,610,216	100.00

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

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

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3 成長型

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	14,814,662,664	97.06
内 日本	14,814,662,664	97.06
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	448,132,511	2.94
純資産総額	15,262,795,175	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	278,721,714,360	98.69
内 日本	278,721,714,360	98.69
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	3,704,639,094	1.31
純資産総額	282,426,353,454	100.00

その他資産の投資状況

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	3,499,215,000	1.24
内 日本	3,499,215,000	1.24

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	320,317,847,500	83.26
内 日本	320,317,847,500	83.26
地方債証券	23,784,731,349	6.18
内 日本	23,784,731,349	6.18
特殊債券	20,196,467,712	5.25
内 日本	20,196,467,712	5.25
社債券	18,359,961,280	4.77
内 日本	18,058,974,280	4.69
内 オランダ	201,118,000	0.05
内 イギリス	99,869,000	0.03
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	2,061,885,190	0.54
純資産総額	384,720,893,031	100.00

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	244,387,672,396	95.36
内 アメリカ	150,318,594,693	58.65
内 イギリス	18,351,240,402	7.16
内 スイス	9,910,234,608	3.87
内 カナダ	9,817,015,907	3.83
内 ドイツ	9,202,365,048	3.59
内 フランス	8,924,354,739	3.48
内 オーストラリア	6,508,489,973	2.54
内 オランダ	4,458,159,763	1.74
内 アイルランド	4,220,652,829	1.65
内 スペイン	3,052,958,605	1.19
内 スウェーデン	2,808,120,151	1.10
内 香港	2,390,423,833	0.93
内 デンマーク	1,876,158,460	0.73
内 イタリア	1,770,660,161	0.69
内 シンガポール	1,743,702,362	0.68

	内 ジェージー	1,498,885,112	0.58
	内 ベルギー	1,360,179,591	0.53
	内 バミューダ	1,038,855,600	0.41
	内 フィンランド	990,234,432	0.39
	内 オランダ領キュラソー	921,230,264	0.36
	内 イスラエル	686,705,793	0.27
	内 ノルウェー	637,656,907	0.25
	内 ケイマン諸島	637,614,456	0.25
	内 ルクセンブルグ	281,610,890	0.11
	内 オーストリア	189,332,939	0.07
	内 ニュージーランド	185,788,781	0.07
	内 パナマ	165,038,327	0.06
	内 ポルトガル	156,506,524	0.06
	内 リベリア	98,170,993	0.04
	内 イギリス領バージン諸島	73,612,274	0.03
	内 パプアニューギニア	62,477,893	0.02
	内 マン島	32,052,148	0.01
	内 モーリシャス	18,587,938	0.01
投資信託受益証券		875,029,212	0.34
	内 オーストラリア	756,373,800	0.30
	内 シンガポール	118,655,412	0.05
投資証券		6,161,237,997	2.40
	内 アメリカ	5,333,909,289	2.08
	内 フランス	374,452,870	0.15
	内 イギリス	265,010,148	0.10
	内 香港	134,086,610	0.05
	内 カナダ	53,779,080	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,859,538,517	1.90
純資産総額		256,283,478,122	100.00

その他資産の投資状況

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	40,639,900	△0.02
—	40,639,900	△0.02
株価指数先物取引（買建）	4,736,589,028	1.85
内 アメリカ	3,198,229,188	1.25
内 ドイツ	822,798,306	0.32
内 イギリス	349,940,043	0.14
内 オーストラリア	190,407,190	0.07
内 カナダ	175,214,301	0.07

（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。

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	254,100,288,436	97.36
内 アメリカ	109,276,805,463	41.87
内 フランス	25,852,755,585	9.91
内 イタリア	25,193,508,403	9.65
内 イギリス	20,838,249,322	7.98
内 ドイツ	19,068,710,058	7.31
内 スペイン	14,129,969,642	5.41
内 ベルギー	6,597,448,452	2.53
内 オランダ	5,942,751,534	2.28
内 カナダ	5,277,735,805	2.02
内 オーストラリア	4,849,450,152	1.86
内 オーストリア	3,890,318,515	1.49
内 メキシコ	2,132,647,378	0.82
内 アイルランド	1,945,156,020	0.75
内 デンマーク	1,623,218,827	0.62
内 フィンランド	1,450,605,312	0.56
内 ポーランド	1,385,119,237	0.53
内 スウェーデン	1,151,161,857	0.44
内 マレーシア	1,124,173,443	0.43
内 南アフリカ	1,014,423,449	0.39
内 シンガポール	811,786,824	0.31
内 ノルウェー	544,293,158	0.21
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	6,894,127,616	2.64
純資産総額	260,994,416,052	100.00

その他資産の投資状況

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引 (買建)	8,563,110	0.00
—	8,563,110	0.00

(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。

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	4,558,855,060	1.2843 5,855,163,793	1.3014 5,932,893,975	— —	64.36%
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	921,848,056	1.8882 1,740,637,051	1.9476 1,795,391,273	— —	19.48%
3	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	441,245,181	1.7642 778,452,568	1.6916 746,410,348	— —	8.10%
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	183,832,208	2.4360 447,816,351	2.5517 469,084,645	— —	5.09%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.02%
合計	97.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	6,491,172,492	1.2835 8,331,857,041	1.3014 8,447,611,881	— —	42.33%
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	3,129,777,926	1.8916 5,920,320,597	1.9476 6,095,555,488	— —	30.54%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	948,006,195	2.4343 2,307,780,182	2.5517 2,419,027,407	— —	12.12%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,422,114,166	1.7664 2,512,098,709	1.6916 2,405,648,323	— —	12.05%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.04%
合計	97.04%

(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。

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	3,165,563,184	1.8952 5,999,595,402	1.9476 6,165,250,857	— —	40.39%
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,554,420,292	1.2830 3,277,495,064	1.3014 3,324,322,568	— —	21.78%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,136,234,337	2.4381 2,770,314,331	2.5517 2,899,329,157	— —	19.00%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,434,003,359	1.7692 2,537,163,084	1.6916 2,425,760,082	— —	15.89%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.06%
合計	97.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,805,300	6,489.85 11,716,136,836	6,238.00 11,261,461,400	— —	3.99%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	11,214,900	534.86 5,998,455,918	564.10 6,326,325,090	— —	2.24%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	792,000	5,150.50 4,079,197,434	6,756.00 5,350,752,000	— —	1.89%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,080,500	5,282.81 5,708,076,661	4,546.00 4,911,953,000	— —	1.74%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,382,800	3,195.64 4,418,936,889	3,036.00 4,198,180,800	— —	1.49%

6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,119,200	3,397.39 3,802,363,731	3,621.00 4,052,623,200	— —	1.43%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,274,500	3,106.46 3,959,193,600	3,170.00 4,040,165,000	— —	1.43%
8	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	20,091,300	180.08 3,618,209,584	179.70 3,610,406,610	— —	1.28%
9	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	879,400	4,635.41 4,076,388,197	4,008.00 3,524,635,200	— —	1.25%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	999,400	2,584.05 2,582,507,576	3,325.00 3,323,005,000	— —	1.18%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,044,500	2,834.82 2,960,978,696	2,603.00 2,718,833,500	— —	0.96%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	590,800	5,780.65 3,415,209,710	4,560.00 2,694,048,000	— —	0.95%
13	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	584,700	5,108.70 2,987,060,804	4,361.00 2,549,876,700	— —	0.90%
14	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,609,900	1,658.53 2,670,073,678	1,580.50 2,544,446,950	— —	0.90%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	143,600	16,400.39 2,355,096,206	17,630.00 2,531,668,000	— —	0.90%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	32,100	58,581.30 1,880,459,996	72,530.00 2,328,213,000	— —	0.82%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	566,300	3,927.24 2,224,001,260	4,064.00 2,301,443,200	— —	0.81%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	256,800	10,802.28 2,774,025,608	8,860.00 2,275,248,000	— —	0.81%
19	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,048,800	1,871.61 1,962,954,713	2,155.50 2,260,688,400	— —	0.80%
20	キャノン 日本	株式 電気機器	762,400	3,349.96 2,554,014,116	2,964.00 2,259,753,600	— —	0.80%
21	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	126,800	22,228.54 2,818,579,524	16,990.00 2,154,332,000	— —	0.76%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	149,400	13,863.72 2,071,239,782	13,905.00 2,077,407,000	— —	0.74%
23	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,511,000	1,146.04 1,731,681,480	1,350.50 2,040,605,500	— —	0.72%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,039,000	2,236.36 2,323,583,200	1,957.00 2,033,323,000	— —	0.72%
25	花王 日本	株式 化学	376,700	6,189.12 2,331,444,652	5,377.00 2,025,515,900	— —	0.72%
26	信越化学工業 日本	株式 化学	266,000	5,982.11 1,591,241,686	7,594.00 2,020,004,000	— —	0.72%
27	任天堂 日本	株式 その他製品	87,200	17,229.54 1,502,416,552	22,675.00 1,977,260,000	— —	0.70%
	ダイキン工業	株式		7,741.00	9,589.00	—	

28	日本	機械	206,200	1,596,195,040	1,977,251,800	—	0.70%
29	日産自動車	株式	1,930,500	1,075.90	1,015.00	—	0.69%
	日本	輸送用機器		2,077,026,483	1,959,457,500	—	
30	富士重工業	株式	447,500	4,148.02	4,098.00	—	0.65%
	日本	輸送用機器		1,856,242,867	1,833,855,000	—	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
株式	98.69%
合計	98.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.20%
輸送用機器		9.86%
情報・通信業		8.29%
銀行業		7.95%
化学		6.39%
医薬品		5.12%
機械		4.94%
食料品		4.65%
小売業		4.54%
卸売業		4.17%
陸運業		4.10%
サービス業		3.77%
建設業		2.99%
不動産業		2.50%
保険業		2.41%
電気・ガス業		1.81%
その他製品		1.80%
精密機器		1.50%
その他金融業		1.28%
鉄鋼		1.25%
証券、商品先物取引業		1.01%
ガラス・土石製品		0.91%
非鉄金属		0.91%
ゴム製品		0.86%
繊維製品		0.74%
金属製品		0.65%
空運業		0.57%
石油・石炭製品		0.45%
鋳業		0.31%
パルプ・紙		0.25%
海運業		0.22%
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.09%	
合計		98.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	103.47 4,656,285,000	103.70 4,666,725,000	0.300000 2025/12/20	1.21%

2	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	102.99 4,634,870,000	101.67 4,575,465,000	0.100000 2026/6/20	1.19%
3	124回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	101.02 4,546,125,000	101.08 4,549,005,000	0.100000 2020/6/20	1.18%
4	122回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	100.96 4,543,290,000	0.100000 2019/12/20	1.18%
5	116回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	100.93 4,239,270,000	0.200000 2018/12/20	1.10%
6	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	102.02 4,081,115,000	101.73 4,069,240,000	0.100000 2026/3/20	1.06%
7	128回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.62 4,065,155,000	101.35 4,054,160,000	0.100000 2021/6/20	1.05%
8	125回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.06 4,042,440,000	101.16 4,046,480,000	0.100000 2020/9/20	1.05%
9	117回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	101.01 4,040,400,000	0.200000 2019/3/20	1.05%
10	366回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.57 4,023,110,000	100.58 4,023,200,000	0.100000 2018/7/15	1.05%
11	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	103.19 3,611,720,000	104.61 3,661,455,000	0.400000 2025/9/20	0.95%
12	118回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,650,000	101.11 3,538,850,000	0.200000 2019/6/20	0.92%
13	114回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.03 3,536,365,000	0.300000 2018/9/20	0.92%
14	123回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,210,000	101.03 3,536,225,000	0.100000 2020/3/20	0.92%
15	107回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.64 3,321,285,000	100.55 3,318,249,000	0.200000 2017/12/20	0.86%
16	289回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.03 3,297,024,000	102.24 3,271,872,000	1.500000 2017/12/20	0.85%
17	126回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,044,000	101.23 3,239,488,000	0.100000 2020/12/20	0.84%

18	313回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	106.73 3,201,990,000	1.300000 2021/3/20	0.83%
19	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	103.25 3,097,560,000	104.53 3,135,900,000	0.400000 2025/6/20	0.82%
20	127回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	3,000,000,000	101.57 3,047,255,000	101.28 3,038,490,000	0.100000 2021/3/20	0.79%
21	301回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	104.76 3,038,243,000	1.500000 2019/6/20	0.79%
22	310回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	104.83 2,935,352,000	1.000000 2020/9/20	0.76%
23	321回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	106.82 2,670,535,000	106.57 2,664,475,000	1.000000 2022/3/20	0.69%
24	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	105.48 2,637,240,000	105.69 2,642,250,000	0.600000 2023/12/20	0.69%
25	305回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	104.92 2,623,200,000	1.300000 2019/12/20	0.68%
26	143回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	123.11 2,585,331,000	1.600000 2033/3/20	0.67%
27	149回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	2,100,000,000	113.46 2,382,670,000	122.02 2,562,546,000	1.500000 2034/6/20	0.67%
28	365回 利付国庫債券 (2 年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.84 2,521,025,000	100.55 2,513,850,000	0.100000 2018/6/15	0.65%
29	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	105.26 2,421,080,000	105.91 2,436,091,000	0.600000 2024/6/20	0.63%
30	297回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	104.41 2,401,614,000	103.68 2,384,686,000	1.400000 2018/12/20	0.62%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.26%
地方債証券	6.18%
特殊債証券	5.25%
社債証券	4.77%
合計	99.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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	443,951	9,704.99 4,308,541,394	10,937.07 4,855,527,603	— —	1.89%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	601,435	5,212.96 3,135,262,336	5,973.09 3,592,425,504	— —	1.40%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	332,419	8,410.80 2,795,912,817	9,030.31 3,001,847,816	— —	1.17%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	221,142	10,574.51 2,338,469,536	12,326.91 2,725,998,548	— —	1.06%
5	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・カタ ログ販売	32,021	53,153.83 1,702,039,006	79,198.90 2,536,028,117	— —	0.99%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリ ット	746,641	2,926.83 2,185,296,973	3,236.75 2,416,695,184	— —	0.94%
7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	183,515	10,634.94 1,951,671,555	12,984.17 2,382,790,177	— —	0.93%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	255,377	7,552.74 1,928,796,584	8,216.56 2,098,321,592	— —	0.82%
9	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	492,775	3,781.45 1,863,407,311	4,219.03 2,079,032,606	— —	0.81%
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	293,456	5,947.73 1,745,399,729	6,964.64 2,043,818,330	— —	0.80%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	386,036	4,877.59 1,882,927,777	5,222.97 2,016,255,064	— —	0.79%
12	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	24,944	70,521.55 1,759,089,548	79,354.70 1,979,423,791	— —	0.77%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	216,693	8,371.47 1,814,040,262	9,032.37 1,957,252,912	— —	0.76%
14	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	23,367	73,009.30 1,706,008,494	81,710.30 1,909,324,710	— —	0.75%
15	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	494,350	3,051.94 1,508,727,216	3,598.91 1,779,125,311	— —	0.69%
	VERIZON COMM INC	株式		5,190.72	5,393.21	—	

16	アメリカ	各種電気通信 サービス	325,987	1,692,110,280	1,758,119,151	—	0.69%
17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	150,426	8,899.24 1,338,677,652	10,493.40 1,578,481,090	— —	0.62%
18	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	182,053	7,493.98 1,364,302,726	8,190.34 1,491,077,242	— —	0.58%
19	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	95,531	13,294.97 1,270,082,118	15,500.73 1,480,800,371	— —	0.58%
20	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	329,545	4,453.67 1,467,685,576	4,461.50 1,470,266,072	— —	0.57%
21	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	222,237	5,091.16 1,131,446,039	6,470.41 1,437,966,240	— —	0.56%
22	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	56,214	25,650.32 1,441,907,113	25,472.92 1,431,934,893	— —	0.56%
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	101,309	12,105.88 1,226,435,467	13,836.43 1,401,755,697	— —	0.55%
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	377,945	2,976.13 1,124,816,092	3,683.52 1,392,170,234	— —	0.54%
25	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	824,162	1,236.00 1,018,667,709	1,670.48 1,376,749,599	— —	0.54%
26	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	194,702	5,887.00 1,146,212,395	6,763.44 1,316,857,047	— —	0.51%
27	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	401,169	2,601.89 1,043,797,857	3,254.29 1,305,523,153	— —	0.51%
28	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	153,349	7,278.26 1,116,115,169	8,375.12 1,284,316,368	— —	0.50%
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	115,706	10,187.22 1,178,723,558	11,061.92 1,279,931,418	— —	0.50%
30	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	123,943	9,229.12 1,143,885,445	10,314.90 1,278,460,220	— —	0.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
株式	95.36%
投資信託受益証券	0.34%
投資証券	2.40%
合計	98.10%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.21%
医薬品		6.33%
石油・ガス・消耗燃料		6.32%
保険		3.91%
ソフトウェア		3.36%
インターネットソフトウェア・サービス		2.89%
各種電気通信サービス		2.77%
化学		2.64%
情報技術サービス		2.62%
メディア		2.53%
バイオテクノロジー		2.46%
食品		2.42%
飲料		2.41%
コンピュータ・周辺機器		2.40%
半導体・半導体製造装置		2.37%
食品・生活必需品小売り		2.07%
航空宇宙・防衛		2.03%
ヘルスケア機器・用品		1.99%
コングロマリット		1.97%
専門小売り		1.90%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.90%
電力		1.88%
資本市場		1.88%
ホテル・レストラン・レジャー		1.77%
タバコ		1.61%
家庭用品		1.59%
各種金融サービス		1.51%
インターネット販売・カタログ販売		1.46%
機械		1.39%
金属・鉱業		1.34%
繊維・アパレル・贅沢品		1.20%
総合公益事業		1.14%
自動車		0.94%
通信機器		0.87%
陸運・鉄道		0.84%
電気設備		0.76%
エネルギー設備・サービス		0.72%
パーソナル用品		0.70%
専門サービス		0.64%
航空貨物・物流サービス		0.59%
不動産管理・開発		0.56%
自動車部品	0.55%	
消費者金融	0.51%	
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.48%	

複合小売り	0.46%
家庭用耐久財	0.46%
商業サービス・用品	0.44%
電子装置・機器・部品	0.40%
無線通信サービス	0.39%
建設資材	0.36%
建設・土木	0.33%
容器・包装	0.32%
商社・流通業	0.31%
建設関連製品	0.28%
運送インフラ	0.24%
ガス	0.21%
旅客航空輸送業	0.13%
販売	0.10%
水道	0.10%
レジャー用品	0.08%
紙製品・林産品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
海運業	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.05%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	95.36%

(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。

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	2,115,190,000	101.46 2,146,214,678	101.14 2,139,303,166	1.375000 2018/9/30	0.82%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,857,240,000	109.69 2,037,299,418	108.84 2,021,475,733	3.625000 2020/2/15	0.77%
3	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,960,420,000	99.98 1,960,027,916	99.99 1,960,341,583	0.750000 2017/12/31	0.75%
4	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	1,857,240,000	101.71 1,889,135,001	101.29 1,881,309,830	1.875000 2017/9/30	0.72%
5	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,702,470,000	106.17 1,807,529,423	105.89 1,802,745,483	2.625000 2020/8/15	0.69%
6	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,754,060,000	101.72 1,784,335,075	101.50 1,780,493,684	1.500000 2018/12/31	0.68%
7	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,754,060,000	99.70 1,748,920,604	99.88 1,751,990,209	0.500000 2017/7/31	0.67%
8	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	105.93 1,639,525,041	103.89 1,607,967,438	4.750000 2017/8/15	0.62%
9	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	103.65 1,604,231,290	102.87 1,592,242,806	2.375000 2018/6/30	0.61%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	101.82 1,575,868,140	102.50 1,586,392,500	1.750000 2022/5/15	0.61%
11	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	102.58 1,587,768,921	102.17 1,581,424,383	1.750000 2023/5/15	0.61%
12	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	100.54 1,556,107,106	101.70 1,574,057,331	1.625000 2022/8/15	0.60%
13	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,444,520,000	109.57 1,582,760,564	108.83 1,572,143,342	3.500000 2020/5/15	0.60%
14	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,444,520,000	105.34 1,521,758,484	103.96 1,501,722,992	3.500000 2018/2/15	0.58%
15	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,379,400,000	108.32 1,494,193,553	106.55 1,469,805,876	4.500000 2018/2/1	0.56%
16	US T N/B 1.875 08/31/17 アメリカ	国債証券	1,444,520,000	101.71 1,469,279,072	101.20 1,461,955,356	1.875000 2017/8/31	0.56%
17	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,392,930,000	102.29 1,424,911,672	103.71 1,444,607,703	2.000000 2025/2/15	0.55%
18	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,341,340,000	106.89 1,433,865,633	105.96 1,421,283,864	3.125000 2019/5/15	0.54%
19	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,341,340,000	104.20 1,397,698,979	105.85 1,419,929,110	2.250000 2025/11/15	0.54%
20	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,392,930,000	100.85 1,404,783,834	101.14 1,408,809,402	1.375000 2020/5/31	0.54%
21	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,392,930,000	99.95 1,392,331,556	99.98 1,392,651,414	0.750000 2018/2/28	0.53%
	US T N/B 2.125 12/31/21			104.09	104.44	2.125000	

22	アメリカ	国債証券	1,310,386,000	1,364,020,098	1,368,632,657	2021/12/31	0.52%
23	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,341,340,000	101.06 1,355,665,511	101.23 1,357,945,789	1.375000 2019/2/28	0.52%
24	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,310,386,000	101.79 1,333,900,102	101.35 1,328,089,314	1.500000 2018/8/31	0.51%
25	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	108.00 1,337,212,800	106.33 1,316,597,436	4.000000 2018/8/15	0.50%
26	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	105.27 1,303,528,657	104.60 1,295,177,268	2.750000 2019/2/15	0.50%
27	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	103.48 1,281,347,020	103.72 1,284,293,841	2.000000 2021/5/31	0.49%
28	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	101.92 1,262,019,343	103.68 1,283,810,959	2.000000 2025/8/15	0.49%
29	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	100.88 1,249,068,189	101.17 1,252,757,906	1.375000 2020/4/30	0.48%
30	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,186,570,000	104.38 1,238,566,013	104.80 1,243,572,822	2.250000 2021/3/31	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.36%
合計	97.36%

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2809月	買建	263	3,430,173,812	3,499,215,000	1.24%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	—	オーストラリア・ドル 売/円買 2016年 09月	売建	380,000	29,449,240	29,446,200	△0.01%
		ユーロ売/円買 2016年09月	売建	70,000	8,046,514	8,046,500	△0.00%
		カナダ・ドル売/円買 2016年09月	売建	40,000	3,147,320	3,147,200	△0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P 500 FU TURE Sep 16	買建	57	3,179,630,993	3,198,229,188	1.25%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 16	買建	236	805,892,609	822,798,306	0.32%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep 16	買建	38	343,315,778	349,940,043	0.14%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Sep 16	買建	18	188,591,518	190,407,190	0.07%
	モントリオ ール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep 16	買建	13	172,680,483	175,214,301	0.07%

(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場で評価しています。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	—	アメリカ・ドル買/円 売 2016年09月	買建	83,000	8,563,151	8,563,110	0.00%

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

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

直近日（平成28年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	2,669	2,669	1.2585	1.2585
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	3,305	3,305	1.2076	1.2076
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	3,259	3,259	1.0599	1.0599
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	3,884	3,884	1.1365	1.1365
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	4,419	4,419	1.1651	1.1651
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	4,993	4,993	1.1720	1.1720
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	5,846	5,846	1.2689	1.2689
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	6,797	6,797	1.3874	1.3874
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	8,185	8,185	1.5056	1.5056
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	8,608	8,608	1.4954	1.4954
平成27年8月末日	8,633	—	1.5133	—
9月末日	8,552	—	1.4896	—
10月末日	8,757	—	1.5289	—
11月末日	8,796	—	1.5335	—
12月末日	8,823	—	1.5301	—
平成28年1月末日	8,767	—	1.5156	—
2月末日	8,607	—	1.4963	—
3月末日	8,825	—	1.5237	—
4月末日	8,887	—	1.5265	—
5月末日	9,043	—	1.5402	—
6月末日	8,968	—	1.5096	—
7月末日	9,233	—	1.5247	—
8月末日	9,218	—	1.5154	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	6,979	6,979	1.4627	1.4627
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	8,199	8,199	1.3419	1.3419
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	7,395	7,395	1.0433	1.0433
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	9,529	9,529	1.1659	1.1659
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	10,826	10,826	1.2065	1.2065
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	11,905	11,905	1.1984	1.1984
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	14,251	14,251	1.3506	1.3506
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	16,454	16,454	1.5495	1.5495
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	19,545	19,545	1.7503	1.7503
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	18,932	18,932	1.6738	1.6738
平成27年8月末日	19,851	—	1.7597	—
9月末日	19,246	—	1.7084	—
10月末日	20,089	—	1.7827	—
11月末日	20,089	—	1.7921	—
12月末日	19,975	—	1.7779	—
平成28年1月末日	19,636	—	1.7326	—
2月末日	18,973	—	1.6770	—
3月末日	19,663	—	1.7215	—
4月末日	19,658	—	1.7177	—
5月末日	19,979	—	1.7393	—
6月末日	19,273	—	1.6659	—
7月末日	19,965	—	1.7047	—
8月末日	19,957	—	1.6980	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	6,033	6,033	1.6848	1.6848
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	7,103	7,103	1.4810	1.4810
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	5,656	5,656	1.0219	1.0219
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	7,667	7,667	1.1890	1.1890
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	8,673	8,673	1.2395	1.2395
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	9,234	9,234	1.2166	1.2166
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	11,326	11,326	1.4236	1.4236
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	13,230	13,230	1.7075	1.7075
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	15,889	15,889	2.0030	2.0030
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	14,524	14,524	1.8463	1.8463
平成27年8月末日	15,707	—	2.0121	—
9月末日	15,070	—	1.9266	—
10月末日	16,015	—	2.0446	—
11月末日	16,026	—	2.0598	—
12月末日	15,861	—	2.0321	—
平成28年1月末日	15,352	—	1.9481	—
2月末日	14,573	—	1.8523	—
3月末日	15,255	—	1.9151	—
4月末日	15,213	—	1.9032	—
5月末日	15,502	—	1.9333	—
6月末日	14,547	—	1.8113	—
7月末日	15,220	—	1.8770	—
8月末日	15,262	—	1.8733	—

②【分配の推移】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	—

③【収益率の推移】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

	収益率(%)
第4計算期間	5.0
第5計算期間	△4.0
第6計算期間	△12.2
第7計算期間	7.2
第8計算期間	2.5
第9計算期間	0.6
第10計算期間	8.3
第11計算期間	9.3
第12計算期間	8.5
第13計算期間	△0.7
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	1.0

(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。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	収益率(%)
第4計算期間	8.2
第5計算期間	△8.3
第6計算期間	△22.3
第7計算期間	11.8
第8計算期間	3.5
第9計算期間	△0.7
第10計算期間	12.7
第11計算期間	14.7
第12計算期間	13.0
第13計算期間	△4.4
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	0.5

(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。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

	収益率(%)
第4計算期間	11.3
第5計算期間	△12.1
第6計算期間	△31.0
第7計算期間	16.4
第8計算期間	4.2
第9計算期間	△1.8
第10計算期間	17.0
第11計算期間	19.9
第12計算期間	17.3
第13計算期間	△7.8
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	0.0

(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。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型

	設定口数	解約口数
第4計算期間	746,595,858	341,955,723
第5計算期間	1,023,536,793	407,728,822
第6計算期間	808,835,748	470,954,147
第7計算期間	717,089,255	374,538,190
第8計算期間	717,088,658	341,609,549
第9計算期間	891,096,153	423,802,872
第10計算期間	792,020,789	445,175,024
第11計算期間	1,211,792,457	920,086,264
第12計算期間	1,286,101,728	748,268,806
第13計算期間	1,428,568,208	1,108,983,410
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	593,292,118	300,567,693

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型

	設定口数	解約口数
第4計算期間	1,520,234,750	462,264,605
第5計算期間	1,986,010,161	647,207,655
第6計算期間	1,694,085,942	716,280,777
第7計算期間	1,585,255,449	499,713,782
第8計算期間	1,458,689,281	659,115,611
第9計算期間	1,799,986,538	838,294,174
第10計算期間	1,442,236,754	824,908,601
第11計算期間	1,713,460,271	1,646,999,165
第12計算期間	1,739,079,770	1,190,841,426
第13計算期間	1,697,863,637	1,553,640,036
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	766,569,826	374,242,992

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型

	設定口数	解約口数
第4計算期間	1,327,156,219	491,810,911
第5計算期間	1,854,832,281	639,682,536
第6計算期間	1,377,219,073	638,023,646
第7計算期間	1,360,590,692	447,612,668
第8計算期間	1,167,657,064	618,314,729
第9計算期間	1,241,120,741	648,446,247
第10計算期間	1,210,113,248	844,741,332
第11計算期間	1,548,578,623	1,756,263,299
第12計算期間	1,448,206,115	1,263,916,173
第13計算期間	1,425,335,822	1,490,982,099
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	548,616,446	305,571,526

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

基準価額・純資産の推移

〈2006年8月31日～2016年8月31日〉



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

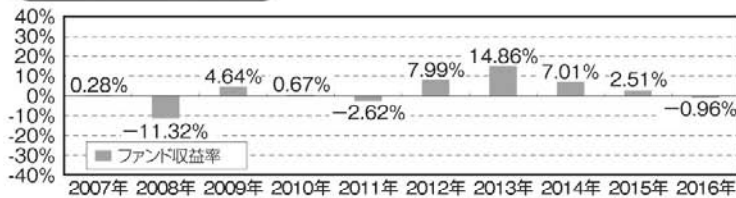
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	64.36%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.48%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.10%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.09%

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

基準価額・純資産の推移

〈2006年8月31日～2016年8月31日〉



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

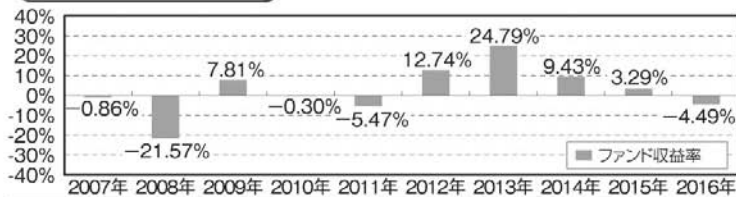
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	42.33%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30.54%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.12%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.05%

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

年間収益率の推移



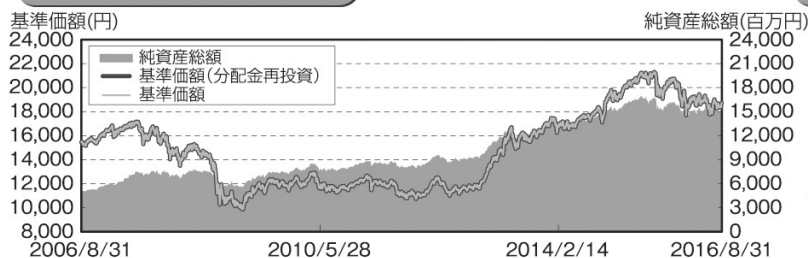
※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
 ○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

基準価額・純資産の推移

(2006年8月31日～2016年8月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

期	日	金額
第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

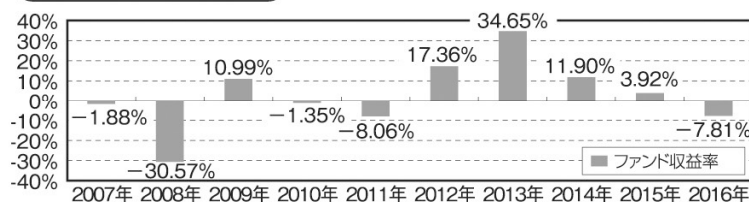
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	40.39%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.78%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.00%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.89%

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

各マザーファンドの主要な資産の状況

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.69
内 日本	98.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.31
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.24

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.20%
2	輸送用機器	9.86%
3	情報・通信業	8.29%
4	銀行業	7.95%
5	化学	6.39%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.99%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.24%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.89%
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.74%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.49%
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.43%
7	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.43%
8	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.28%
9	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.25%
10	ソニー	株式	日本	電気機器	1.18%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.36
内 アメリカ	58.65
内 イギリス	7.16
内 スイス	3.87
内 カナダ	3.83
内 ドイツ	3.59
内 その他	18.26
投資信託受益証券	0.34
内 オーストラリア	0.30
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.40
内 アメリカ	2.08
内 フランス	0.15
内 イギリス	0.10
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.90
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	1.89%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.40%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.17%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.06%
5	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・カタログ販売	0.99%
6	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.94%
7	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	0.93%
8	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.82%
9	AT&T INC	株式	アメリカ	各種電気通信サービス	0.81%
10	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.80%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	8.21%
2	医薬品	6.33%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.32%
4	保険	3.91%
5	ソフトウェア	3.36%

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)	△0.02
株価指数先物取引(買建)	1.85

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	83.26
内 日本	83.26
地方債証券	6.18
内 日本	6.18
特殊債券	5.25
内 日本	5.25
社債券	4.77
内 日本	4.69
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	0.54
純資産総額	100.00

組入上位10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	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	1.21%
2	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/6/20	1.19%
3	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.18%
4	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.18%
5	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.10%
6	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	1.06%
7	128回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2021/6/20	1.05%
8	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.05%
9	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.05%
10	366回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2018/7/15	1.05%

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.36
内 アメリカ	41.87
内 フランス	9.91
内 イタリア	9.65
内 イギリス	7.98
内 ドイツ	7.31
内 その他	20.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.64
純資産総額	100.00

組入上位10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 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	0.82%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.77%
3	US T N/B 0.75 12/31/17	国債証券	アメリカ	0.750000	2017/12/31	0.75%
4	US T N/B 1.875 09/30/17	国債証券	アメリカ	1.875000	2017/9/30	0.72%
5	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.69%
6	US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	アメリカ	1.500000	2018/12/31	0.68%
7	US T N/B 0.5 07/31/17	国債証券	アメリカ	0.500000	2017/7/31	0.67%
8	US T N/B 4.75 08/15/17	国債証券	アメリカ	4.750000	2017/8/15	0.62%
9	US T N/B 2.375 06/30/18	国債証券	アメリカ	2.375000	2018/6/30	0.61%
10	US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	アメリカ	1.750000	2022/5/15	0.61%

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

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度による取得のみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。ただし、ニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額（発行価格）はお申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

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

基準価額は、当ファンド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。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

※収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

・お申込手数料はありません。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求
をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求
を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の請求の受付は、原則として販売会
社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完
了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約
請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

- ・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・解約価額の照会方法等

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・換金（解約）単位は1口単位とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入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従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
株式	国内株式 原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。 外国株式 原則として金融商品取引所等における計算日*の最終相場で評価します。 ※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日
公社債等	次に掲げるいずれかの価額で評価します。 (1) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） (2) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。） (3) 価格情報会社の提供する価額

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

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社への問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（2）【保管】

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

（3）【信託期間】

信託期間は平成14年12月13日から無期限です。

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

（4）【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（5）【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は各ファンドについて受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

- c. 委託会社は上記a. b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記a. b. につき、上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記c. ～e. の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であつて、上記c. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは信託約款の変更をしません。

- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。
- h. 上記b.に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

ニ. 公告

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

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年2月25日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

4 【受益者の権利等】

①収益分配金受領権

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性質を有します。

委託会社は受託会社から交付を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、別に定める契約に基づき、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者にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

②償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

③一部解約請求権

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

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

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成27年2月26日から平成28年2月25日まで）の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書


平成28年4月6日

DIAMアセットマネジメント株式会社


取締役会 御中

PwCあらた監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士

石本 貴司 

指定社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 栄夫 

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DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成27年2月26日から平成28年2月25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、DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成28年2月25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

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

以上

1【財務諸表】

【D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	281,775,214
コール・ローン	283,025,420	—
親投資信託受益証券	7,941,428,767	8,351,998,256
未収入金	5,422,000	11,082,000
流動資産合計	8,229,876,187	8,644,855,470
資産合計	8,229,876,187	8,644,855,470
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,813,069	23,791,516
未払受託者報酬	1,278,423	1,418,199
未払委託者報酬	9,801,573	10,873,110
その他未払費用	202,325	224,467
流動負債合計	44,095,390	36,307,292
負債合計	44,095,390	36,307,292
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,436,916,498	※1 5,756,501,296
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,748,864,299	2,852,046,882
(分配準備積立金)	1,385,304,521	1,137,498,160
元本等合計	8,185,780,797	8,608,548,178
純資産合計	8,185,780,797	8,608,548,178
負債純資産合計	8,229,876,187	8,644,855,470

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	自	平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
営業収益				
受取利息		132,132		148,692
有価証券売買等損益		649,687,097		△43,154,511
営業収益合計		649,819,229		△43,005,819
営業費用				
受託者報酬		2,416,721		2,780,475
委託者報酬		18,528,812		21,317,448
その他費用		382,481		440,066
営業費用合計		21,328,014		24,537,989
営業利益又は営業損失(△)		628,491,215		△67,543,808
経常利益又は経常損失(△)		628,491,215		△67,543,808
当期純利益又は当期純損失(△)		628,491,215		△67,543,808
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(△)		36,145,874		11,777,196
期首剰余金又は期首欠損金(△)		1,898,071,047		2,748,864,299
剰余金増加額又は欠損金減少額		550,280,270		745,668,467
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		550,280,270		745,668,467
剰余金減少額又は欠損金増加額		291,832,359		563,164,880
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		291,832,359		563,164,880
分配金		※1 ー		※1 ー
期末剰余金又は期末欠損金(△)		2,748,864,299		2,852,046,882

(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	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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1. ※1 期首元本額	4,899,083,576円	5,436,916,498円
期中追加設定元本額	1,286,101,728円	1,428,568,208円
期中一部解約元本額	748,268,806円	1,108,983,410円
2. 受益権の総数	5,436,916,498口	5,756,501,296口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. ※1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(125,935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(592,219,406円)、信託約款に規定される収益調整金(1,363,559,778円)及び分配準備積立金(792,959,180円)より分配対象収益は2,748,864,299円(1万口当たり5,055.93円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,714,548,722円)及び分配準備積立金(1,137,498,160円)より分配対象収益は2,852,046,882円(1万口当たり4,954.48円)ですが、分配を行っておりません。

(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12期	第13期
	自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	612,554,436	△71,988,237
合計	612,554,436	△71,988,237

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	1,5056円	1,4954円
(1万口当たり純資産額)	(15,056円)	(14,954円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化 法）・マザーファンド	856,679,246	1,621,950,816	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	4,397,137,375	5,641,087,538	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	169,874,284	413,032,334	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	381,621,256	675,927,568	
親投資信託受益証券 合計		5,805,312,161	8,351,998,256	
合計		5,805,312,161	8,351,998,256	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(平成27年2月26日から平成28年2月25日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。


独立監査人の監査報告書

平成28年4月6日


DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

佐々木 貴之 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

鶴田 光夫 

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DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成27年2月26日から平成28年2月25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、DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成28年2月25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

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

以上

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	607,708,568
コール・ローン	633,971,932	—
親投資信託受益証券	18,969,348,001	18,367,994,608
未収入金	14,204,000	1,757,000
流動資産合計	19,617,523,933	18,977,460,176
資産合計	19,617,523,933	18,977,460,176
負債の部		
流動負債		
未払解約金	42,393,268	12,962,513
未払受託者報酬	3,028,503	3,206,512
未払委託者報酬	26,247,343	27,790,146
その他未払費用	479,421	507,606
流動負債合計	72,148,535	44,466,777
負債合計	72,148,535	44,466,777
純資産の部		
元本等		
元本	※1 11,167,153,451	※1 11,311,377,052
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	8,378,221,947	7,621,616,347
(分配準備積立金)	4,828,001,454	4,205,323,682
元本等合計	19,545,375,398	18,932,993,399
純資産合計	19,545,375,398	18,932,993,399
負債純資産合計	19,617,523,933	18,977,460,176

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	自	平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
営業収益				
受取利息		311,111		339,806
有価証券売買等損益		2,283,498,149		△808,148,393
営業収益合計		2,283,809,260		△807,808,587
営業費用				
受託者報酬		5,743,392		6,451,258
委託者報酬		49,776,832		55,911,633
その他費用		909,198		1,021,276
営業費用合計		56,429,422		63,384,167
営業利益又は営業損失(△)		2,227,379,838		△871,192,754
経常利益又は経常損失(△)		2,227,379,838		△871,192,754
当期純利益又は当期純損失(△)		2,227,379,838		△871,192,754
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(△)		87,381,935		28,909,690
期首剰余金又は期首欠損金(△)		5,835,480,775		8,378,221,947
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,059,807,795		1,312,909,567
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,059,807,795		1,312,909,567
剰余金減少額又は欠損金増加額		657,064,526		1,169,412,723
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		657,064,526		1,169,412,723
分配金		※1 ー		※1 ー
期末剰余金又は期末欠損金(△)		8,378,221,947		7,621,616,347

(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	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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1. ※1 期首元本額	10,618,915,107円	11,167,153,451円
期中追加設定元本額	1,739,079,770円	1,697,863,637円
期中一部解約元本額	1,190,841,426円	1,553,640,036円
2. 受益権の総数	11,167,153,451口	11,311,377,052口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. ※1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(303,852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(2,139,694,051円)、信託約款に規定される収益調整金(3,550,220,493円)及び分配準備積立金(2,688,003,551円)より分配対象収益は8,378,221,947円(1万口当たり7,502.56円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,177,758,096円)及び分配準備積立金(4,205,323,682円)より分配対象収益は8,383,081,778円(1万口当たり7,411.19円)ですが、分配を行っておりません。

(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12期	第13期
	自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	2,203,850,803	△884,405,348
合計	2,203,850,803	△884,405,348

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.7503円	1.6738円
(1万口当たり純資産額)	(17,503円)	(16,738円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化 法）・マザーファンド	2,984,860,292	5,651,235,990	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	6,424,462,977	8,241,943,553	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	905,415,134	2,201,426,356	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,283,530,211	2,273,388,709	
親投資信託受益証券 合計		11,598,268,614	18,367,994,608	
合計		11,598,268,614	18,367,994,608	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(平成27年2月26日から平成28年2月25日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。


独立監査人の監査報告書

平成28年4月6日

DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

佐々木 貴之 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

鶴田 興彦 

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DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成27年2月26日から平成28年2月25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、DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成28年2月25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

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

以上

【D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	469,831,116
コール・ローン	519,489,353	—
親投資信託受益証券	15,418,780,380	14,090,232,030
未収入金	11,433,000	—
流動資産合計	15,949,702,733	14,560,063,146
資産合計	15,949,702,733	14,560,063,146
負債の部		
流動負債		
未払解約金	34,171,561	7,908,084
未払受託者報酬	2,437,196	2,529,402
未払委託者報酬	23,560,006	24,451,297
その他未払費用	385,807	400,401
流動負債合計	60,554,570	35,289,184
負債合計	60,554,570	35,289,184
純資産の部		
元本等		
元本	※1 7,932,612,026	※1 7,866,965,749
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,956,536,137	6,657,808,213
(分配準備積立金)	4,480,901,966	3,708,200,293
元本等合計	15,889,148,163	14,524,773,962
純資産合計	15,889,148,163	14,524,773,962
負債純資産合計	15,949,702,733	14,560,063,146

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	自	平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
営業収益				
受取利息		253,206		277,563
有価証券売買等損益		2,400,303,827		△1,166,735,350
営業収益合計		2,400,557,033		△1,166,457,787
営業費用				
受託者報酬		4,600,154		5,169,266
委託者報酬		44,469,069		49,970,401
その他費用		728,195		818,293
営業費用合計		49,797,418		55,957,960
営業利益又は営業損失(△)		2,350,759,615		△1,222,415,747
経常利益又は経常損失(△)		2,350,759,615		△1,222,415,747
当期純利益又は当期純損失(△)		2,350,759,615		△1,222,415,747
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(△)		145,017,108		46,115,348
期首剰余金又は期首欠損金(△)		5,481,994,045		7,956,536,137
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,168,729,899		1,471,216,245
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,168,729,899		1,471,216,245
剰余金減少額又は欠損金増加額		899,930,314		1,501,413,074
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		899,930,314		1,501,413,074
分配金		※1 ー		※1 ー
期末剰余金又は期末欠損金(△)		7,956,536,137		6,657,808,213

(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	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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1. ※1 期首元本額	7,748,322,084円	7,932,612,026円
期中追加設定元本額	1,448,206,115円	1,425,335,822円
期中一部解約元本額	1,263,916,173円	1,490,982,099円
2. 受益権の総数	7,932,612,026口	7,866,965,749口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. ※1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(244,086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(2,205,498,421円)、信託約款に規定される収益調整金(3,558,455,879円)及び分配準備積立金(2,275,159,459円)より分配対象収益は8,039,357,845円(1万口当たり10,134.57円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,264,635,308円)及び分配準備積立金(3,708,200,293円)より分配対象収益は7,972,835,601円(1万口当たり10,134.58円)ですが、分配を行っておりません。

(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12期	第13期
	自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	2,309,302,254	△1,241,919,402
合計	2,309,302,254	△1,241,919,402

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 平成27年2月25日現在	第13期 平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	2.0030円	1.8463円
(1万口当たり純資産額)	(20,030円)	(18,463円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化 法）・マザーファンド	3,003,978,386	5,687,432,278	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	2,637,655,262	3,383,847,935	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,068,407,169	2,597,725,190	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,366,997,870	2,421,226,627	
親投資信託受益証券 合計		8,077,038,687	14,090,232,030	
合計		8,077,038,687	14,090,232,030	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「D I A M バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		—	3,319,697,186
コール・ローン		6,529,907,207	—
株式	※2	323,712,344,980	266,950,636,500
派生商品評価勘定		230,359,500	16,762,460
未収入金		10,073,456,661	—
未収配当金		480,294,446	477,553,356
前払金		—	256,490,000
流動資産合計		341,026,362,794	271,021,139,502
資産合計		341,026,362,794	271,021,139,502
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		—	199,635,772
前受金		238,906,000	—
未払解約金		7,100,316,000	131,488,000
流動負債合計		7,339,222,000	331,123,772
負債合計		7,339,222,000	331,123,772
純資産の部			
元本等			
元本	※1	155,777,350,252	142,969,149,329
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		177,909,790,542	127,720,866,401
元本等合計		333,687,140,794	270,690,015,730
純資産合計		333,687,140,794	270,690,015,730
負債純資産合計		341,026,362,794	271,021,139,502

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25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	188,809,272,100円	155,777,350,252円
同期中追加設定元本額	22,731,111,433円	39,180,158,135円
同期中一部解約元本額	55,763,033,281円	51,988,359,058円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	3,916,623,435円	5,696,126,195円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,411,544,861円	1,699,376,937円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	－円	6,524,503円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	－円	13,299,631円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	－円	31,387,977円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	－円	15,547,145円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	－円	11,269,512円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	－円	11,755,011円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	35,645,328,124円	38,084,258,210円

D I A M バランス・ファン ド<DC年金>1安定 型	760,827,655円	856,679,246円
D I A M バランス・ファン ド<DC年金>2安 定・成長型	2,858,843,867円	2,984,860,292円
D I A M バランス・ファン ド<DC年金>3成長 型	3,046,248,134円	3,003,978,386円
D I A M DC バラン ス30インデックスファン ド	384,627,133円	368,862,991円
D I A M DC バラン ス50インデックスファン ド	1,297,087,701円	1,225,176,057円
D I A M DC バラン ス70インデックスファン ド	1,129,670,818円	1,095,709,664円
マネックス資産設計ファン ド<隔月分配型>	77,696,556円	60,788,627円
マネックス資産設計ファン ド<育成型>	1,241,110,316円	1,229,112,654円
マネックス資産設計ファン ド エボリューション	28,078,282円	27,113,958円
D I A M DC 8資産 バランスファンド(新興 国10)	16,078,346円	25,953,986円
D I A M DC 8資産 バランスファンド(新興 国20)	32,233,265円	51,128,058円
D I A M DC 8資産 バランスファンド(新興 国30)	81,358,474円	108,496,820円
投資のソムリエ	207,006,506円	1,057,072,049円
クルーズコントロール	705,575,334円	292,854,639円
投資のソムリエ<DC年 金>	3,030,563円	20,915,913円
D I A M 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	34,666,087円	76,867,727円
D I A M DC バラン ス・F(成長型)	6,788,927円	60,755,446円
クルーズコントロール< DC年金>	212,653円	73,605円
D I A M コア資産設計フ ァンド(堅実型)	－円	3,971,426円
D I A M コア資産設計フ ァンド(積極型)	－円	7,035,679円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	－円	762,065円

D I AM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)	—円	199,876,126円
D I AMワールドバラン ス25VA (適格機関投 資家限定)	127,247,686円	113,636,589円
D I AMグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,965,284,782円	492,301,556円
D I AMグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	586,008,304円	474,003,080円
D I AM国際分散バラン スファンド30VA (適 格機関投資家限定)	64,423,090円	39,526,570円
D I AM国際分散バラン スファンド50VA (適 格機関投資家限定)	281,728,600円	166,681,120円
D I AM国内重視バラン スファンド30VA (適 格機関投資家限定)	56,864,102円	39,752,947円
D I AM国内重視バラン スファンド50VA (適 格機関投資家限定)	109,097,529円	58,181,496円
D I AM世界バランスマ ンダ40VA (適格機 関投資家限定)	9,684,470,541円	5,219,612,585円
D I AM世界バランスマ ンダ50VA (適格機 関投資家限定)	3,420,390,133円	1,982,163,464円
D I AMバランスマン ダ25VA (適格機関投 資家限定)	2,783,902,029円	1,997,353,962円
D I AMバランスマン ダ37.5VA (適格機 関投資家限定)	1,923,494,326円	1,598,529,122円
D I AMバランスマン ダ50VA (適格機関投 資家限定)	4,886,749,268円	4,159,227,906円
D I AMグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	415,360,894円	319,046,954円
D I AMグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	1,107,957,901円	847,270,983円
D I AM アクサ グロ ーバル バランスマン ダ30VA (適格機関投 資家限定)	1,206,730,476円	999,463,797円

D I AM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)	5,254,130,543円	4,058,272,373円
D I AMグローバルβ私 募ファンド(適格機関投 資家向け)	92,409,818円	46,003,219円
D I AM世界バランスフ ァンド5 5 V A (適格機 関投資家限定)	1,868,209,643円	1,326,335,640円
D I AM世界バランスフ ァンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	6,273,150,235円	5,832,541,011円
D I AMグローバル分散 ファンドV A (適格機関 投資家限定)	178,472,559円	—円
D I AM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)	23,203,221,664円	20,951,975,557円
D I AM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)	967,970,136円	793,931,787円
D I AM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)	2,677,293,646円	2,393,749,966円
D I AM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)	14,599,521,643円	13,362,055,990円
D I AMバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	38,223円	4,455,809円
D I AMバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	10,776,546円	7,115,578円
D I AMバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	47,591,162円	5,949,384円
D I AM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)	13,030,501,833円	12,007,265,860円
D I AM世界バランス 2 5 V A (適格機関投資 家限定)	123,934,533円	112,585,022円
D I AM国内バランス 3 0 V A (適格機関投資 家限定)	43,783,675円	42,353,931円
D I AMバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	1,718,173円	39,006,138円
D I AMバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	103,705,160円	12,076,611円

	D I A M バランス 6 0 V A (適格機関投資家限 定)	120,223円	120,493円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 2 1 2) (適格機関 投資家限定)	818,354,088円	670,998,289円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 3 0 3) (適格機関 投資家限定)	2,114,709,804円	1,887,540,594円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 3 0 6) (適格機関 投資家限定)	2,751,007,520円	2,485,634,300円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 3 0 9) (適格機関 投資家限定)	112,382,727円	94,839,111円
	計	155,777,350,252円	142,969,149,329円
2.	受益権の総数	155,777,350,252口	142,969,149,329口
3.	※2 差入代用有価証券	株式 4,063,500,000円	株式 2,965,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	17,758,862,010	△14,881,124,320
合計	17,758,862,010	△14,881,124,320

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年2月10日から平成27年2月25日まで及び平成28年2月9日から平成28年2月25日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成28年2月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	9,219,438,000	—	9,450,000,000	230,562,000	3,945,500,000	—	3,762,720,000	△182,780,000
合計	9,219,438,000	—	9,450,000,000	230,562,000	3,945,500,000	—	3,762,720,000	△182,780,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	2.1421円	1.8933円
(1万口当たり純資産額)	(21,421円)	(18,933円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	67,000	261.00	17,487,000	
日本水産	178,200	535.00	95,337,000	
マルハニチロ	31,600	2,228.00	70,404,800	
ハウスイ	12,000	110.00	1,320,000	
サカタのタネ	22,800	2,810.00	64,068,000	
ホクト	15,800	2,042.00	32,263,600	
ショーボンドホールディングス	16,300	3,855.00	62,836,500	
ミライト・ホールディングス	47,600	816.00	38,841,600	
タマホーム	12,000	430.00	5,160,000	
サンヨーホームズ	3,400	513.00	1,744,200	
住石ホールディングス	45,900	92.00	4,222,800	
日鉄鉱業	43,000	420.00	18,060,000	
三井松島産業	102,000	119.00	12,138,000	
国際石油開発帝石	814,800	832.70	678,483,960	
日本海洋掘削	4,600	2,019.00	9,287,400	
石油資源開発	24,500	2,468.00	60,466,000	
K&Oエナジーグループ	10,400	1,190.00	12,376,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,005.00	3,618,000	
安藤・間	103,200	520.00	53,664,000	
東急建設	50,300	816.00	41,044,800	
コムシスホールディングス	66,500	1,715.00	114,047,500	
ミサワホーム	18,300	678.00	12,407,400	
高松コンストラクショングループ	11,700	2,270.00	26,559,000	
東建コーポレーション	6,400	8,460.00	54,144,000	
ヤマウラ	7,200	461.00	3,319,200	
大成建設	803,000	711.00	570,933,000	
大林組	463,900	1,051.00	487,558,900	
清水建設	473,000	872.00	412,456,000	
飛島建設	117,300	154.00	18,064,200	
長谷工コーポレーション	180,500	964.00	174,002,000	
松井建設	17,100	677.00	11,576,700	
銭高組	22,000	462.00	10,164,000	
鹿島建設	725,000	667.00	483,575,000	
不動テトラ	109,600	114.00	12,494,400	
大末建設	5,800	731.00	4,239,800	
鉄建建設	94,000	264.00	24,816,000	
西松建設	179,000	442.00	79,118,000	
三井住友建設	592,500	93.00	55,102,500	
大豊建設	60,000	427.00	25,620,000	
前田建設工業	95,000	759.00	72,105,000	

佐田建設	10,700	398.00	4,258,600
ナカノフドー建設	11,800	516.00	6,088,800
奥村組	147,000	573.00	84,231,000
東鉄工業	18,600	3,125.00	58,125,000
イチケン	17,000	291.00	4,947,000
浅沼組	50,000	223.00	11,150,000
戸田建設	180,000	470.00	84,600,000
熊谷組	226,000	297.00	67,122,000
青木あすなろ建設	10,300	690.00	7,107,000
北野建設	33,000	263.00	8,679,000
植木組	19,000	217.00	4,123,000
三井ホーム	20,000	526.00	10,520,000
矢作建設工業	21,100	744.00	15,698,400
ピーエス三菱	18,600	405.00	7,533,000
日本ハウスホールディングス	31,600	407.00	12,861,200
大東建託	57,800	15,295.00	884,051,000
新日本建設	18,400	524.00	9,641,600
N I P P O	36,000	1,715.00	61,740,000
東亜道路工業	29,000	349.00	10,121,000
前田道路	48,000	1,729.00	82,992,000
日本道路	46,000	531.00	24,426,000
東亜建設工業	135,000	242.00	32,670,000
若築建設	90,000	116.00	10,440,000
東洋建設	48,700	433.00	21,087,100
五洋建設	171,700	473.00	81,214,100
大林道路	18,000	764.00	13,752,000
世紀東急工業	24,400	467.00	11,394,800
福田組	25,000	933.00	23,325,000
日本ドライケミカル	1,900	2,083.00	3,957,700
住友林業	106,500	1,267.00	134,935,500
日本基礎技術	17,200	442.00	7,602,400
日成ビルド工業	43,000	375.00	16,125,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	70.00	5,600,000
巴コーポレーション	19,700	377.00	7,426,900
パナホーム	58,000	825.00	47,850,000
大和ハウス工業	456,900	3,170.00	1,448,373,000
ライト工業	29,800	1,108.00	33,018,400
積水ハウス	517,100	1,871.50	967,752,650
日特建設	17,200	403.00	6,931,600
北陸電気工事	5,700	756.00	4,309,200
ユアテック	24,000	777.00	18,648,000
西部電気工業	12,000	412.00	4,944,000
四電工	6,000	379.00	2,274,000
中電工	22,400	2,386.00	53,446,400
関電工	62,000	820.00	50,840,000
きんでん	93,600	1,430.00	133,848,000
東京エネシス	18,000	936.00	16,848,000

トーエネック	22,000	683.00	15,026,000
住友電設	12,300	1,327.00	16,322,100
日本電設工業	25,200	2,186.00	55,087,200
協和エクシオ	60,700	1,276.00	77,453,200
新日本空調	13,200	957.00	12,632,400
日本工営	48,000	363.00	17,424,000
NDS	25,000	293.00	7,325,000
九電工	28,000	2,483.00	69,524,000
三機工業	34,400	913.00	31,407,200
日揮	155,000	1,808.00	280,240,000
中外炉工業	47,000	179.00	8,413,000
ヤマト	14,100	425.00	5,992,500
太平電業	23,000	958.00	22,034,000
高砂熱学工業	46,200	1,577.00	72,857,400
三晃金属工業	16,000	263.00	4,208,000
NEC ネットエスアイ	17,200	1,774.00	30,512,800
朝日工業社	16,000	435.00	6,960,000
明星工業	28,300	451.00	12,763,300
大気社	19,000	2,561.00	48,659,000
ダイダン	20,000	733.00	14,660,000
日比谷総合設備	18,700	1,650.00	30,855,000
東芝プラントシステム	25,100	1,256.00	31,525,600
日本製粉	102,000	826.00	84,252,000
日清製粉グループ本社	169,600	1,906.00	323,257,600
日東富士製粉	8,000	359.00	2,872,000
昭和産業	64,000	471.00	30,144,000
鳥越製粉	12,600	631.00	7,950,600
中部飼料	14,400	777.00	11,188,800
フィード・ワン	93,700	119.00	11,150,300
東洋精糖	25,000	103.00	2,575,000
日本甜菜製糖	80,000	188.00	15,040,000
三井製糖	61,000	496.00	30,256,000
塩水港精糖	17,200	231.00	3,973,200
日新製糖	6,600	1,421.00	9,378,600
ネクスト	40,700	1,037.00	42,205,900
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	1,079.00	7,121,400
日本M&Aセンター	22,300	5,220.00	116,406,000
ノバレーゼ	3,800	826.00	3,138,800
アコーディア・ゴルフ	40,000	1,105.00	44,200,000
中広	1,400	669.00	936,600
タケエイ	12,400	753.00	9,337,200
トラスト・テック	2,900	2,381.00	6,904,900
パソナグループ	12,500	642.00	8,025,000
CDS	3,300	855.00	2,821,500
リンクアンドモチベーション	29,200	119.00	3,474,800
GCAサヴィアン	12,700	878.00	11,150,600
エス・エム・エス	17,900	1,868.00	33,437,200

テンプホールディングス	101,000	1,460.00	147,460,000
リニカル	8,500	1,569.00	13,336,500
クックパッド	32,000	2,035.00	65,120,000
エスクリ	6,100	569.00	3,470,900
アイ・ケイ・ケイ	7,800	652.00	5,085,600
森永製菓	139,000	640.00	88,960,000
中村屋	35,000	477.00	16,695,000
江崎グリコ	35,700	6,150.00	219,555,000
名糖産業	7,100	1,278.00	9,073,800
不二家	90,000	191.00	17,190,000
山崎製パン	113,000	2,226.00	251,538,000
第一屋製パン	26,000	102.00	2,652,000
モロゾフ	24,000	414.00	9,936,000
亀田製菓	8,600	4,540.00	39,044,000
寿スピリッツ	3,700	5,720.00	21,164,000
カルビー	57,300	4,600.00	263,580,000
森永乳業	139,000	533.00	74,087,000
六甲バター	6,900	1,785.00	12,316,500
ヤクルト本社	83,000	5,530.00	458,990,000
明治ホールディングス	91,600	9,400.00	861,040,000
雪印メグミルク	36,400	2,688.00	97,843,200
プリマハム	98,000	272.00	26,656,000
日本ハム	114,000	2,463.00	280,782,000
伊藤ハム	74,000	707.00	52,318,000
林兼産業	50,000	102.00	5,100,000
丸大食品	80,000	425.00	34,000,000
米久	5,000	2,562.00	12,810,000
S Foods	9,700	2,257.00	21,892,900
学情	5,300	1,000.00	5,300,000
スタジオアリス	6,700	2,268.00	15,195,600
シミックホールディングス	6,500	1,446.00	9,399,000
システナ	13,300	1,558.00	20,721,400
N J S	3,000	1,171.00	3,513,000
デジタルアーツ	6,600	1,912.00	12,619,200
新日鉄住金ソリューションズ	22,700	2,065.00	46,875,500
総合警備保障	48,100	5,830.00	280,423,000
キューブシステム	6,100	511.00	3,117,100
いちごグループホールディングス	112,900	373.00	42,111,700
日本駐車場開発	148,700	123.00	18,290,100
コア	5,800	1,248.00	7,238,400
カカクコム	104,500	2,015.00	210,567,500
アイロムグループ	4,100	838.00	3,435,800
ルネサンス	7,400	1,220.00	9,028,000
ディップ	15,900	2,070.00	32,913,000
SBSホールディングス	13,600	689.00	9,370,400
オプトホールディング	9,000	591.00	5,319,000
新日本科学	13,600	354.00	4,814,400

ツクイ	17,100	1,356.00	23,187,600
キャリアデザインセンター	3,900	824.00	3,213,600
エムスリー	124,800	2,757.00	344,073,600
ツカダ・グローバルホールディング	10,600	676.00	7,165,600
アウトソーシング	6,700	2,947.00	19,744,900
ウェルネット	5,400	3,095.00	16,713,000
ディー・エヌ・エー	64,600	1,783.00	115,181,800
博報堂DYホールディングス	199,900	1,289.00	257,671,100
ぐるなび	16,700	2,587.00	43,202,900
エスアールジータカミヤ	11,700	342.00	4,001,400
ジャパンベストレスキューシステム	16,700	236.00	3,941,200
ファンコミュニケーションズ	33,200	682.00	22,642,400
ジェイコムホールディングス	3,300	2,055.00	6,781,500
WDBホールディングス	5,200	875.00	4,550,000
ティア	6,100	639.00	3,897,900
バリューコマース	13,300	338.00	4,495,400
インフォマート	20,800	1,038.00	21,590,400
サッポロホールディングス	237,000	545.00	129,165,000
アサヒグループホールディングス	290,200	3,350.00	972,170,000
キリンホールディングス	626,900	1,500.00	940,350,000
宝ホールディングス	112,100	845.00	94,724,500
オエノンホールディングス	44,000	210.00	9,240,000
養命酒製造	4,900	1,921.00	9,412,900
コカ・コーラウエスト	52,400	2,609.00	136,711,600
コカ・コーライーストジャパン	54,800	2,013.00	110,312,400
サントリー食品インターナショナル	106,000	4,950.00	524,700,000
ダイドードリンコ	7,900	5,110.00	40,369,000
伊藤園	45,900	3,280.00	150,552,000
キーコーヒー	13,700	1,828.00	25,043,600
ユニカフェ	4,500	941.00	4,234,500
ジャパンフーズ	2,600	1,151.00	2,992,600
日清オイリオグループ	82,000	458.00	37,556,000
不二製油グループ本社	41,300	1,947.00	80,411,100
J-オイルミルズ	65,000	336.00	21,840,000
ローソン	51,600	8,830.00	455,628,000
サンエー	9,300	4,835.00	44,965,500
ダイユーエイト	3,700	691.00	2,556,700
カワチ薬品	10,600	1,913.00	20,277,800
エービーシー・マート	17,400	6,580.00	114,492,000
ハードオフコーポレーション	6,600	1,605.00	10,593,000
高千穂交易	5,400	891.00	4,811,400
アスクル	16,600	3,450.00	57,270,000
ゲオホールディングス	25,800	1,688.00	43,550,400
アダストリア	25,000	2,912.00	72,800,000
ジーフット	8,100	815.00	6,601,500
シー・ヴィ・エス・バイエリア	20,000	84.00	1,680,000
伊藤忠食品	3,300	4,215.00	13,909,500

くらコーポレーション	8,000	5,150.00	41,200,000
キャンドウ	7,300	1,485.00	10,840,500
エレマテック	6,300	2,165.00	13,639,500
パル	7,900	2,529.00	19,979,100
JALUX	4,400	2,049.00	9,015,600
エディオン	57,600	884.00	50,918,400
あらた	6,100	2,282.00	13,920,200
サーラコーポレーション	11,700	606.00	7,090,200
ワッツ	5,400	797.00	4,303,800
トーマンデバイス	1,900	1,790.00	3,401,000
ハローズ	4,100	2,571.00	10,541,100
J Pホールディングス	35,800	256.00	9,164,800
あみやき亭	2,600	4,295.00	11,167,000
東京エレクトロン デバイス	5,000	1,542.00	7,710,000
ひらまつ	18,800	655.00	12,314,000
フィールズ	8,900	1,696.00	15,094,400
双日	857,900	224.00	192,169,600
ゲンキー	2,700	2,863.00	7,730,100
アルフレッサ ホールディングス	171,300	2,064.00	353,563,200
サッポロドラッグストア	1,300	2,045.00	2,658,500
大黒天物産	3,300	4,780.00	15,774,000
ハニーズ	11,900	1,197.00	14,244,300
ファーマライズホールディングス	2,900	568.00	1,647,200
キッコーマン	117,000	3,820.00	446,940,000
味の素	331,000	2,829.00	936,399,000
キューピー	78,700	2,566.00	201,944,200
ハウス食品グループ本社	52,900	2,189.00	115,798,100
カゴメ	55,600	2,144.00	119,206,400
焼津水産化学工業	7,800	1,019.00	7,948,200
アリアケジャパン	12,700	6,300.00	80,010,000
ピエトロ	1,400	1,879.00	2,630,600
エバラ食品工業	3,900	1,942.00	7,573,800
ニチレイ	165,000	867.00	143,055,000
横浜冷凍	33,900	1,014.00	34,374,600
東洋水産	76,100	4,150.00	315,815,000
イトアンド	1,700	2,309.00	3,925,300
日清食品ホールディングス	65,500	5,420.00	355,010,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,025.00	7,175,000
一正蒲鉾	5,500	870.00	4,785,000
フジッコ	15,000	2,309.00	34,635,000
ロック・フィールド	8,100	2,990.00	24,219,000
日本たばこ産業	914,400	4,481.00	4,097,426,400
ケンコーマヨネーズ	5,100	2,309.00	11,775,900
わらべや日洋	8,300	2,289.00	18,998,700
なとり	7,800	1,582.00	12,339,600
北の達人コーポレーション	2,100	486.00	1,020,600
ユウグレナ	52,200	1,495.00	78,039,000

片倉工業	18,200	1,164.00	21,184,800
グンゼ	117,000	297.00	34,749,000
ヒューリック	284,000	1,021.00	289,964,000
神栄	19,000	109.00	2,071,000
山下医科器械	1,200	1,620.00	1,944,000
ラサ商事	6,700	584.00	3,912,800
アルペン	12,200	1,817.00	22,167,400
クオール	13,800	1,514.00	20,893,200
アルコニックス	7,700	1,404.00	10,810,800
神戸物産	8,800	2,415.00	21,252,000
ジェイアイエヌ	9,200	4,730.00	43,516,000
ビックカメラ	70,400	868.00	61,107,200
DCMホールディングス	66,900	825.00	55,192,500
MonotaRO	48,000	2,563.00	123,024,000
東京一番フーズ	2,100	525.00	1,102,500
ダイヤモンドダイニング	2,100	1,023.00	2,148,300
あいホールディングス	24,300	2,989.00	72,632,700
ディーブイエックス	3,700	1,053.00	3,896,100
きちり	3,700	652.00	2,412,400
アークランドサービス	4,300	3,015.00	12,964,500
J. フロントリテイリング	172,400	1,331.00	229,464,400
ドトール・日レスホールディングス	23,900	1,810.00	43,259,000
マツモトキヨシホールディングス	28,100	5,020.00	141,062,000
ブロンコビリー	5,300	2,626.00	13,917,800
スタートトゥデイ	41,400	3,425.00	141,795,000
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,123.00	4,267,400
物語コーポレーション	3,700	5,270.00	19,499,000
ココカラファイン	14,200	4,430.00	62,906,000
三越伊勢丹ホールディングス	270,900	1,329.00	360,026,100
東洋紡	573,000	163.00	93,399,000
ユニチカ	420,000	50.00	21,000,000
富士紡ホールディングス	70,000	213.00	14,910,000
日清紡ホールディングス	76,600	1,094.00	83,800,400
倉敷紡績	148,000	189.00	27,972,000
ダイワボウホールディングス	124,000	200.00	24,800,000
シキボウ	89,000	107.00	9,523,000
日東紡績	96,000	367.00	35,232,000
トヨタ紡織	48,200	1,794.00	86,470,800
マクニカ・富士エレホールディングス	24,500	1,363.00	33,393,500
ウエルシアホールディングス	11,800	5,550.00	65,490,000
クリエイトSDホールディングス	20,000	2,501.00	50,020,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,800	957.00	22,776,600
八洲電機	10,700	517.00	5,531,900
UKCホールディングス	8,700	2,123.00	18,470,100
丸善CHIホールディングス	16,000	339.00	5,424,000
OCHIホールディングス	3,300	1,007.00	3,323,100

TOKAIホールディングス	60,000	553.00	33,180,000
ミサワ	1,800	464.00	835,200
エー・ピーカンパニー	2,300	1,133.00	2,605,900
三洋貿易	7,500	1,275.00	9,562,500
チムニー	3,300	2,750.00	9,075,000
シュッピン	3,800	1,166.00	4,430,800
ウイン・パートナーズ	4,900	1,445.00	7,080,500
ネクステージ	2,200	599.00	1,317,800
ジョイフル本田	22,100	2,212.00	48,885,200
キリン堂ホールディングス	4,400	990.00	4,356,000
ホットランド	3,500	1,200.00	4,200,000
すかいらく	41,700	1,458.00	60,798,600
綿半ホールディングス	3,800	1,356.00	5,152,800
日本毛織	44,000	772.00	33,968,000
大東紡織	22,000	57.00	1,254,000
トーア紡コーポレーション	6,300	466.00	2,935,800
ダイドーリミテッド	16,600	471.00	7,818,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,200	947.00	42,804,400
三栄建築設計	5,400	1,172.00	6,328,800
野村不動産ホールディングス	90,300	2,054.00	185,476,200
三重交通グループホールディングス	24,500	463.00	11,343,500
サムティ	7,200	1,008.00	7,257,600
ディア・ライフ	6,800	286.00	1,944,800
エー・ディー・ワークス	92,000	43.00	3,956,000
日本商業開発	4,500	1,815.00	8,167,500
プレサンスコーポレーション	4,600	3,625.00	16,675,000
ユニゾホールディングス	8,500	4,185.00	35,572,500
日本管理センター	8,900	1,687.00	15,014,300
サンセイラディック	3,100	845.00	2,619,500
エストラスト	2,400	564.00	1,353,600
フージャースホールディングス	18,900	438.00	8,278,200
オープンハウス	19,700	2,069.00	40,759,300
東急不動産ホールディングス	329,600	732.00	241,267,200
飯田グループホールディングス	126,200	2,124.00	268,048,800
帝国繊維	15,100	1,497.00	22,604,700
ブックオフコーポレーション	7,700	888.00	6,837,600
日本コークス工業	117,000	76.00	8,892,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,800	696.00	1,948,800
ミタチ産業	3,600	623.00	2,242,800
あさひ	10,100	1,308.00	13,210,800
日本調剤	3,400	3,605.00	12,257,000
コスモス薬品	6,900	17,260.00	119,094,000
シップヘルスケアホールディングス	27,700	2,965.00	82,130,500
トーエル	7,200	705.00	5,076,000
一六堂	3,600	327.00	1,177,200
ソフトクリエイイトホールディングス	5,000	757.00	3,785,000

セブン&アイ・ホールディングス	569,900	4,502.00	2,565,689,800
葉王堂	1,900	2,761.00	5,245,900
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	36,600	961.00	35,172,600
明治電機工業	4,300	1,019.00	4,381,700
ツルハホールディングス	31,300	9,690.00	303,297,000
デリカフーズ	3,100	952.00	2,951,200
スターティア	2,600	534.00	1,388,400
サンマルクホールディングス	10,700	2,905.00	31,083,500
フェリシモ	3,900	998.00	3,892,200
トリドール	16,700	2,184.00	36,472,800
クスリのアオキ	12,100	4,890.00	59,169,000
帝人	591,000	380.00	224,580,000
東レ	1,049,000	921.30	966,443,700
クラレ	228,200	1,249.00	285,021,800
旭化成	902,000	652.40	588,464,800
サカイオーベックス	38,000	166.00	6,308,000
稲葉製作所	7,800	1,156.00	9,016,800
宮地エンジニアリンググループ	45,000	138.00	6,210,000
トーカロ	10,200	1,908.00	19,461,600
アルファ	4,900	1,071.00	5,247,900
SUMCO	113,100	734.00	83,015,400
川田テクノロジーズ	2,700	3,255.00	8,788,500
住江織物	36,000	285.00	10,260,000
日本フェルト	7,800	462.00	3,603,600
イチカワ	10,000	270.00	2,700,000
エコナックホールディングス	43,000	46.00	1,978,000
日東製網	18,000	129.00	2,322,000
芦森工業	31,000	149.00	4,619,000
アツギ	118,000	114.00	13,452,000
ダイニック	28,000	150.00	4,200,000
共和レザー	9,500	813.00	7,723,500
セーレン	36,000	1,084.00	39,024,000
東海染工	22,000	121.00	2,662,000
小松精練	22,100	578.00	12,773,800
ワコールホールディングス	86,000	1,298.00	111,628,000
ホギメディカル	9,100	5,560.00	50,596,000
レナウン	38,800	103.00	3,996,400
クラウドシア	3,600	502.00	1,807,200
T S I ホールディングス	64,500	714.00	46,053,000
I T ホールディングス	45,200	2,552.00	115,350,400
ネオス	4,000	445.00	1,780,000
電算システム	4,700	1,500.00	7,050,000
グリー	82,600	533.00	44,025,800
コーエーテクモホールディングス	32,300	1,766.00	57,041,800
三菱総合研究所	5,300	3,480.00	18,444,000
ボルテージ	2,600	1,400.00	3,640,000

電算	1,600	2,427.00	3,883,200
AGS	2,400	841.00	2,018,400
ファインデックス	8,900	1,080.00	9,612,000
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	1,689.00	5,235,900
ブレインパッド	2,000	695.00	1,390,000
KL a b	21,000	494.00	10,374,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,900	962.00	8,561,800
イーブックイニシアティブジャパン	3,000	504.00	1,512,000
ネクソン	130,200	1,652.00	215,090,400
アイスタイル	22,400	719.00	16,105,600
エムアップ	3,500	475.00	1,662,500
エイチーム	5,000	1,408.00	7,040,000
テクノスジャパン	1,500	2,599.00	3,898,500
e n i s h	4,000	486.00	1,944,000
コロプラ	37,600	1,954.00	73,470,400
モバイルクリエイト	8,900	398.00	3,542,200
オルトプラス	5,000	378.00	1,890,000
ブロードリーフ	14,100	1,271.00	17,921,100
ハーツユナイテッドグループ	4,100	1,821.00	7,466,100
ブイキューブ	6,600	1,226.00	8,091,600
サイバーリンクス	1,500	748.00	1,122,000
VOYAGE GROUP	3,000	1,335.00	4,005,000
オブティム	900	4,295.00	3,865,500
特種東海製紙	84,000	380.00	31,920,000
ベリサーブ	1,500	2,477.00	3,715,500
ティーガイア	13,500	1,295.00	17,482,500
日本アジアグループ	11,500	514.00	5,911,000
豆蔵ホールディングス	10,600	647.00	6,858,200
テクマトリックス	5,800	1,677.00	9,726,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	238,000	277.00	65,926,000
GMOペイメントゲートウェイ	11,800	6,560.00	77,408,000
ザップラス	7,800	387.00	3,018,600
インターネットイニシアティブ	22,000	2,151.00	47,322,000
さくらインターネット	6,700	1,741.00	11,664,700
GMOクラウド	3,000	760.00	2,280,000
SRAホールディングス	7,800	2,480.00	19,344,000
MINORIソリューションズ	2,000	864.00	1,728,000
システムインテグレーター	1,800	755.00	1,359,000
朝日ネット	12,600	481.00	6,060,600
コムチュア	2,300	2,172.00	4,995,600
王子ホールディングス	593,000	435.00	257,955,000
日本製紙	74,700	1,932.00	144,320,400
三菱製紙	221,000	80.00	17,680,000
北越紀州製紙	89,700	638.00	57,228,600
中越パルプ工業	57,000	172.00	9,804,000

巴川製紙所	21,000	176.00	3,696,000
大王製紙	64,000	916.00	58,624,000
g u m i	14,000	568.00	7,952,000
パイブドHD	1,700	1,123.00	1,909,100
レンゴー	128,000	559.00	71,552,000
トーモク	46,000	253.00	11,638,000
ザ・パック	10,200	2,726.00	27,805,200
昭和電工	963,000	111.00	106,893,000
住友化学	1,064,000	501.00	533,064,000
日本化成	28,000	113.00	3,164,000
住友精化	30,000	591.00	17,730,000
日産化学工業	86,900	2,598.00	225,766,200
ラサ工業	55,000	100.00	5,500,000
クレハ	109,000	379.00	41,311,000
多木化学	8,000	626.00	5,008,000
テイカ	24,000	507.00	12,168,000
石原産業	260,000	72.00	18,720,000
片倉コープアグリ	18,000	223.00	4,014,000
日東エフシー	8,500	837.00	7,114,500
日本曹達	93,000	511.00	47,523,000
東ソー	390,000	432.00	168,480,000
トクヤマ	240,000	157.00	37,680,000
セントラル硝子	157,000	645.00	101,265,000
東亜合成	90,600	867.00	78,550,200
大阪ソーダ	62,000	419.00	25,978,000
関東電化工業	34,000	881.00	29,954,000
デンカ	300,000	416.00	124,800,000
イビデン	84,500	1,359.00	114,835,500
信越化学工業	259,300	5,877.00	1,523,906,100
日本カーバイド工業	49,000	118.00	5,782,000
堺化学工業	59,000	291.00	17,169,000
エア・ウォーター	119,000	1,625.00	193,375,000
大陽日酸	111,400	1,033.00	115,076,200
日本化学工業	54,000	190.00	10,260,000
日本パーカライジング	73,900	962.00	71,091,800
高压ガス工業	20,000	600.00	12,000,000
チタン工業	18,000	170.00	3,060,000
四国化成工業	20,000	841.00	16,820,000
戸田工業	29,000	311.00	9,019,000
ステラ ケミファ	7,400	2,569.00	19,010,600
保土谷化学工業	43,000	176.00	7,568,000
日本触媒	21,000	6,360.00	133,560,000
大日精化工業	56,000	457.00	25,592,000
カネカ	195,000	882.00	171,990,000
協和発酵キリン	173,000	1,640.00	283,720,000
三菱瓦斯化学	249,000	541.00	134,709,000
三井化学	613,000	376.00	230,488,000

J S R	135,700	1,616.00	219,291,200
東京応化工業	29,000	3,060.00	88,740,000
大阪有機化学工業	10,400	598.00	6,219,200
三菱ケミカルホールディングス	968,500	588.30	569,768,550
日本合成化学工業	34,000	673.00	22,882,000
ダイセル	203,300	1,477.00	300,274,100
住友ベークライト	135,000	473.00	63,855,000
積水化学工業	328,200	1,266.00	415,501,200
日本ゼオン	124,000	681.00	84,444,000
アイカ工業	43,500	2,206.00	95,961,000
宇部興産	774,000	194.00	150,156,000
積水樹脂	22,400	1,341.00	30,038,400
タキロン	34,000	527.00	17,918,000
旭有機材工業	47,000	202.00	9,494,000
日立化成	71,400	1,857.00	132,589,800
ニチバン	14,000	620.00	8,680,000
リケンテクノス	23,500	372.00	8,742,000
大倉工業	35,000	260.00	9,100,000
積水化成品工業	37,000	328.00	12,136,000
群栄化学工業	39,000	261.00	10,179,000
タイガースポリマー	7,200	599.00	4,312,800
ミライアル	5,300	865.00	4,584,500
ダイキアクシス	2,700	846.00	2,284,200
ダイキョーニシカワ	18,600	1,527.00	28,402,200
日本化薬	94,000	1,134.00	106,596,000
カーリットホールディングス	13,600	493.00	6,704,800
E P S ホールディングス	16,100	1,394.00	22,443,400
レグス	2,100	617.00	1,295,700
プレステージ・インターナショナル	12,100	1,277.00	15,451,700
フェイス	3,600	1,263.00	4,546,800
アミューズ	4,000	4,085.00	16,340,000
野村総合研究所	95,500	3,870.00	369,585,000
ドリームインキュベータ	4,800	2,327.00	11,169,600
サイバネットシステム	11,100	723.00	8,025,300
クイック	7,400	730.00	5,402,000
T A C	8,200	179.00	1,467,800
C E ホールディングス	1,800	920.00	1,656,000
ケネディクス	193,400	472.00	91,284,800
電通	160,700	5,340.00	858,138,000
インテージホールディングス	7,100	1,465.00	10,401,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	434.00	2,951,200
東邦システムサイエンス	4,100	586.00	2,402,600
ぴあ	4,300	2,133.00	9,171,900
イオンファンタジー	5,100	2,121.00	10,817,100
ソースネクスト	6,800	448.00	3,046,400
シーティーエス	3,300	719.00	2,372,700
ネクシィーズ	5,000	693.00	3,465,000

メディカルシステムネットワーク	15,400	424.00	6,529,600
ティー・ワイ・オー	18,600	156.00	2,901,600
日本精化	12,000	736.00	8,832,000
扶桑化学工業	9,100	1,428.00	12,994,800
ADEKA	71,100	1,508.00	107,218,800
日油	110,000	817.00	89,870,000
ミヨシ油脂	54,000	121.00	6,534,000
新日本理化	22,400	146.00	3,270,400
ハリマ化成グループ	12,400	504.00	6,249,600
花王	388,900	5,837.00	2,270,009,300
第一工業製薬	32,000	314.00	10,048,000
三洋化成工業	45,000	747.00	33,615,000
武田薬品工業	575,800	5,415.00	3,117,957,000
アステラス製薬	1,619,100	1,597.50	2,586,512,250
大日本住友製薬	102,400	1,267.00	129,740,800
塩野義製薬	210,700	4,839.00	1,019,577,300
田辺三菱製薬	168,500	2,044.00	344,414,000
わかもと製薬	7,000	268.00	1,876,000
あすか製薬	18,400	1,236.00	22,742,400
日本新薬	33,100	3,815.00	126,276,500
ビオフェルミン製薬	2,300	3,510.00	8,073,000
中外製薬	144,000	3,320.00	478,080,000
科研製薬	24,900	7,300.00	181,770,000
エーザイ	178,000	7,089.00	1,261,842,000
理研ビタミン	4,600	4,010.00	18,446,000
ロート製薬	70,800	2,089.00	147,901,200
小野薬品工業	65,700	20,105.00	1,320,898,500
久光製薬	44,900	5,080.00	228,092,000
有機合成薬品工業	10,000	234.00	2,340,000
持田製薬	10,000	8,660.00	86,600,000
参天製薬	266,100	1,743.00	463,812,300
扶桑薬品工業	49,000	257.00	12,593,000
日本ケミファ	18,000	503.00	9,054,000
ツムラ	45,500	2,888.00	131,404,000
日医工	33,800	2,815.00	95,147,000
テルモ	211,600	3,910.00	827,356,000
みらかホールディングス	36,800	4,920.00	181,056,000
キッセイ薬品工業	25,600	2,647.00	67,763,200
生化学工業	27,700	1,342.00	37,173,400
栄研化学	12,100	2,131.00	25,785,100
日水製薬	5,900	1,254.00	7,398,600
鳥居薬品	9,900	2,439.00	24,146,100
JCRファーマ	11,100	2,083.00	23,121,300
東和薬品	6,600	5,350.00	35,310,000
富士製薬工業	4,100	1,988.00	8,150,800
沢井製薬	24,500	7,730.00	189,385,000
ゼリア新薬工業	29,600	1,412.00	41,795,200

第一三共	486,300	2,328.50	1,132,349,550
キョーリン製薬ホールディングス	38,600	2,128.00	82,140,800
大幸薬品	7,100	1,328.00	9,428,800
ダイト	6,200	2,696.00	16,715,200
大塚ホールディングス	310,900	4,030.00	1,252,927,000
大正製薬ホールディングス	34,800	8,970.00	312,156,000
ペプチドリーム	17,800	4,260.00	75,828,000
大日本塗料	83,000	193.00	16,019,000
日本ペイントホールディングス	111,600	2,315.00	258,354,000
関西ペイント	163,600	1,613.00	263,886,800
神東塗料	11,000	170.00	1,870,000
中国塗料	41,000	749.00	30,709,000
日本特殊塗料	10,100	1,007.00	10,170,700
藤倉化成	19,800	513.00	10,157,400
太陽ホールディングス	10,600	3,655.00	38,743,000
D I C	579,000	249.00	144,171,000
サカタインクス	29,500	1,108.00	32,686,000
東洋インキS Cホールディングス	143,000	438.00	62,634,000
T & K T O K A	10,500	907.00	9,523,500
アルプス技研	5,300	2,137.00	11,326,100
サニックス	23,100	174.00	4,019,400
ダイオーズ	2,600	961.00	2,498,600
日本空調サービス	7,100	1,077.00	7,646,700
オリエンタルランド	155,900	7,908.00	1,232,857,200
ダスキン	40,800	2,189.00	89,311,200
パーク24	68,700	3,040.00	208,848,000
明光ネットワークジャパン	16,700	1,124.00	18,770,800
ファルコホールディングス	6,300	1,319.00	8,309,700
クレスコ	3,100	1,727.00	5,353,700
フジ・メディア・ホールディングス	141,900	1,321.00	187,449,900
秀英予備校	2,500	513.00	1,282,500
田谷	3,000	705.00	2,115,000
ラウンドワン	45,000	730.00	32,850,000
リゾートトラスト	60,500	2,572.00	155,606,000
オービック	47,000	5,600.00	263,200,000
ジャストシステム	24,800	874.00	21,675,200
T D C ソフトウェアエンジニアリング	3,000	1,395.00	4,185,000
ヤフー	976,400	445.00	434,498,000
ビー・エム・エル	8,500	4,150.00	35,275,000
ワタベウェディング	4,300	412.00	1,771,600
トレンドマイクロ	66,100	4,095.00	270,679,500
りらいあコミュニケーションズ	23,800	971.00	23,109,800
インフォメーション・ディベロプメント	2,900	836.00	2,424,400
リソー教育	26,700	297.00	7,929,900
日本オラクル	21,800	5,520.00	120,336,000
早稲田アカデミー	2,400	901.00	2,162,400

アルファシステムズ	4,500	1,744.00	7,848,000
フューチャーアーキテクト	16,400	801.00	13,136,400
CAC Holdings	10,200	736.00	7,507,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	1,379.00	5,102,300
トーセ	3,600	719.00	2,588,400
ユー・エス・エス	174,500	1,769.00	308,690,500
オービックビジネスコンサルタント	6,900	4,750.00	32,775,000
伊藤忠テクノソリューションズ	30,800	2,291.00	70,562,800
アイティフォー	17,700	471.00	8,336,700
東京個別指導学院	6,900	681.00	4,698,900
東計電算	2,400	1,910.00	4,584,000
サイバーエージェント	35,200	4,825.00	169,840,000
楽天	674,400	1,028.50	693,620,400
エックスネット	1,600	1,549.00	2,478,400
テー・オー・ダブリュー	8,600	565.00	4,859,000
大塚商会	36,600	5,640.00	206,424,000
総合メディカル	6,600	3,730.00	24,618,000
サイボウズ	18,500	313.00	5,790,500
ソフトブレーン	19,900	148.00	2,945,200
セントラルスポーツ	5,000	2,257.00	11,285,000
パラカ	4,700	1,334.00	6,269,800
電通国際情報サービス	8,400	2,132.00	17,908,800
イーエムシステムズ	2,300	2,565.00	5,899,500
ウェザーニューズ	4,600	3,705.00	17,043,000
C I J	12,300	429.00	5,276,700
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,334.00	2,001,000
日本エンタープライズ	13,800	210.00	2,898,000
WOWOW	6,500	2,502.00	16,263,000
フュージョンパートナー	7,700	522.00	4,019,400
フルキャストホールディングス	13,100	681.00	8,921,100
富士フイルムホールディングス	330,900	4,297.00	1,421,877,300
コニカミノルタ	344,800	944.00	325,491,200
資生堂	274,300	2,446.50	671,074,950
ライオン	167,000	1,229.00	205,243,000
高砂香料工業	9,500	2,308.00	21,926,000
マンダム	13,500	4,815.00	65,002,500
ミルボン	8,500	4,290.00	36,465,000
ファンケル	33,600	1,403.00	47,140,800
コーセー	23,400	9,750.00	228,150,000
コタ	4,500	1,344.00	6,048,000
シーズ・ホールディングス	19,000	1,869.00	35,511,000
シーボン	1,600	2,403.00	3,844,800
ポーラ・オルビスホールディングス	14,700	8,350.00	122,745,000
ノエビアホールディングス	9,100	3,045.00	27,709,500
アジュバンコスメジャパン	2,900	993.00	2,879,700
エステー	10,000	1,094.00	10,940,000
アグロ カネショウ	5,700	880.00	5,016,000

コニシ	11,300	2,704.00	30,555,200
長谷川香料	18,300	1,425.00	26,077,500
星光PMC	7,900	1,026.00	8,105,400
小林製薬	21,900	9,810.00	214,839,000
荒川化学工業	12,400	919.00	11,395,600
メック	11,200	869.00	9,732,800
日本高純度化学	4,200	1,988.00	8,349,600
JCU	4,200	3,255.00	13,671,000
新田ゼラチン	9,700	712.00	6,906,400
OATアグリオ	1,300	1,255.00	1,631,500
デクセリアルズ	32,400	1,009.00	32,691,600
アース製薬	10,400	4,200.00	43,680,000
イハラケミカル工業	22,200	1,280.00	28,416,000
北興化学工業	16,000	290.00	4,640,000
大成ラミック	4,100	2,987.00	12,246,700
クミアイ化学工業	29,800	1,168.00	34,806,400
日本農薬	33,000	616.00	20,328,000
昭和シェル石油	145,400	923.00	134,204,200
富士興産	5,500	433.00	2,381,500
ニチレキ	17,800	736.00	13,100,800
東燃ゼネラル石油	218,000	905.00	197,290,000
ユシロ化学工業	7,800	1,330.00	10,374,000
ビーピー・カストロール	5,900	1,240.00	7,316,000
富士石油	33,500	309.00	10,351,500
MORESCO	4,600	1,320.00	6,072,000
出光興産	75,500	1,792.00	135,296,000
JXホールディングス	1,711,400	450.80	771,499,120
コスモエネルギーホールディングス	43,600	1,222.00	53,279,200
横浜ゴム	87,200	1,864.00	162,540,800
東洋ゴム工業	65,400	1,703.00	111,376,200
ブリヂストン	487,900	4,044.00	1,973,067,600
住友ゴム工業	135,300	1,666.00	225,409,800
藤倉ゴム工業	12,200	450.00	5,490,000
オカモト	45,000	920.00	41,400,000
アキレス	120,000	146.00	17,520,000
フコク	5,300	832.00	4,409,600
ニッタ	15,600	2,943.00	45,910,800
クリエートメディック	4,900	809.00	3,964,100
住友理工	31,200	965.00	30,108,000
三ツ星ベルト	35,000	875.00	30,625,000
バンドー化学	53,000	437.00	23,161,000
鬼怒川ゴム工業	32,000	558.00	17,856,000
旭硝子	763,000	562.00	428,806,000
日本板硝子	696,000	73.00	50,808,000
石塚硝子	20,000	220.00	4,400,000
有沢製作所	21,300	564.00	12,013,200
日本山村硝子	58,000	164.00	9,512,000

日本電気硝子	299,000	555.00	165,945,000
オハラ	5,800	520.00	3,016,000
住友大阪セメント	286,000	423.00	120,978,000
太平洋セメント	902,000	241.00	217,382,000
デイ・シイ	13,200	321.00	4,237,200
リゾートソリューション	14,000	306.00	4,284,000
日本ヒューム	14,000	509.00	7,126,000
日本コンクリート工業	29,800	244.00	7,271,200
三谷セキサン	7,300	1,398.00	10,205,400
アジアパイルホールディングス	17,800	363.00	6,461,400
東海カーボン	125,000	276.00	34,500,000
日本カーボン	71,000	240.00	17,040,000
東洋炭素	8,000	1,467.00	11,736,000
ノリタケカンパニーリミテド	82,000	247.00	20,254,000
TOTO	106,200	3,340.00	354,708,000
日本碍子	183,000	2,049.00	374,967,000
日本特殊陶業	124,600	2,126.00	264,899,600
ダントーホールディングス	17,000	196.00	3,332,000
MARUWA	5,300	2,475.00	13,117,500
品川リフラクトリーズ	37,000	202.00	7,474,000
黒崎播磨	31,000	240.00	7,440,000
ヨータイ	8,000	293.00	2,344,000
イソライト工業	7,100	190.00	1,349,000
東京窯業	17,000	166.00	2,822,000
ニッカトー	5,500	373.00	2,051,500
フジインコーポレーテッド	12,700	1,175.00	14,922,500
エーアンドエーマテリアル	30,000	72.00	2,160,000
ニチアス	74,000	635.00	46,990,000
新日鐵住金	651,700	1,969.50	1,283,523,150
神戸製鋼所	2,655,000	88.00	233,640,000
中山製鋼所	162,000	66.00	10,692,000
合同製鐵	81,000	189.00	15,309,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	395,000	1,393.50	550,432,500
日新製鋼	65,900	1,240.00	81,716,000
東京製鐵	79,700	719.00	57,304,300
共英製鋼	15,400	1,722.00	26,518,800
大和工業	31,900	2,380.00	75,922,000
東京鐵鋼	30,000	375.00	11,250,000
大阪製鐵	9,100	1,853.00	16,862,300
淀川製鋼所	21,500	2,462.00	52,933,000
東洋鋼板	34,600	290.00	10,034,000
丸一鋼管	48,400	3,140.00	151,976,000
モリ工業	21,000	301.00	6,321,000
大同特殊鋼	242,000	433.00	104,786,000
日本高周波鋼業	56,000	73.00	4,088,000
日本冶金工業	106,200	115.00	12,213,000

山陽特殊製鋼	86,000	502.00	43,172,000
愛知製鋼	85,000	423.00	35,955,000
日立金属	165,400	1,211.00	200,299,400
日本金属	38,000	99.00	3,762,000
大平洋金属	101,000	318.00	32,118,000
新日本電工	81,900	166.00	13,595,400
栗本鐵工所	69,000	157.00	10,833,000
虹 技	21,000	156.00	3,276,000
日本鑄鉄管	16,000	136.00	2,176,000
日本製鋼所	239,000	390.00	93,210,000
三菱製鋼	101,000	174.00	17,574,000
日亜鋼業	18,800	268.00	5,038,400
日本精線	10,000	468.00	4,680,000
大紀アルミニウム工業所	23,000	261.00	6,003,000
日本軽金属ホールディングス	327,000	176.00	57,552,000
三井金属鉱業	368,000	177.00	65,136,000
東邦亜鉛	76,000	306.00	23,256,000
三菱マテリアル	902,000	321.00	289,542,000
住友金属鉱山	399,000	1,241.50	495,358,500
DOWAホールディングス	186,000	634.00	117,924,000
古河機械金属	225,000	166.00	37,350,000
エス・サイエンス	65,100	34.00	2,213,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,200	1,724.00	24,480,800
東邦チタニウム	24,400	933.00	22,765,200
UACJ	202,000	229.00	46,258,000
古河電気工業	454,000	232.00	105,328,000
住友電気工業	578,500	1,360.00	786,760,000
フジクラ	201,000	524.00	105,324,000
昭和電線ホールディングス	174,000	55.00	9,570,000
東京特殊電線	1,900	866.00	1,645,400
タツタ電線	30,300	343.00	10,392,900
沖電線	17,000	196.00	3,332,000
カナレ電気	2,300	1,695.00	3,898,500
平河ヒューテック	6,800	939.00	6,385,200
リョービ	88,000	404.00	35,552,000
アーレスティ	16,700	669.00	11,172,300
アサヒホールディングス	21,800	1,479.00	32,242,200
東洋製罐グループホールディングス	102,700	1,979.00	203,243,300
ホッカンホールディングス	35,000	292.00	10,220,000
コロナ	7,700	1,002.00	7,715,400
横河ブリッジホールディングス	27,400	1,046.00	28,660,400
OSJBホールディングス	31,800	218.00	6,932,400
駒井ハルテック	26,000	221.00	5,746,000
高田機工	12,000	185.00	2,220,000
三和ホールディングス	146,400	738.00	108,043,200
文化シャッター	40,300	928.00	37,398,400
三協立山	19,000	1,330.00	25,270,000

アルインコ	8,300	1,014.00	8,416,200
東洋シヤッター	3,600	555.00	1,998,000
L I X I Lグループ	201,300	2,406.00	484,327,800
日本ファイルコン	10,700	407.00	4,354,900
ノーリツ	28,300	1,828.00	51,732,400
長府製作所	15,400	2,648.00	40,779,200
リンナイ	26,900	10,000.00	269,000,000
ユニプレス	28,600	2,011.00	57,514,600
ダイニチ工業	7,700	622.00	4,789,400
日東精工	20,000	296.00	5,920,000
三洋工業	19,000	151.00	2,869,000
岡部	30,100	699.00	21,039,900
ジーテクト	15,100	1,201.00	18,135,100
中国工業	2,500	658.00	1,645,000
東ブレ	27,800	2,147.00	59,686,600
高周波熱錬	26,900	737.00	19,825,300
東京製綱	98,000	141.00	13,818,000
サンコール	7,800	472.00	3,681,600
モリテックスチール	7,500	256.00	1,920,000
パイオラックス	7,300	5,500.00	40,150,000
日本発条	136,000	1,028.00	139,808,000
中央発条	17,000	283.00	4,811,000
アドバネクス	2,700	1,307.00	3,528,900
三浦工業	64,500	1,831.00	118,099,500
タクマ	53,000	918.00	48,654,000
テクノプロ・ホールディングス	23,400	3,075.00	71,955,000
インターワークス	1,900	654.00	1,242,600
リブセンス	9,300	460.00	4,278,000
ジャパンマテリアル	6,000	2,480.00	14,880,000
ベクトル	4,500	2,232.00	10,044,000
ウチヤマホールディングス	7,500	503.00	3,772,500
サクセスホールディングス	1,300	1,116.00	1,450,800
キャリアリンク	1,900	1,466.00	2,785,400
I B J	8,400	446.00	3,746,400
アサンテ	5,300	1,554.00	8,236,200
N・フィールド	5,100	1,128.00	5,752,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	1,622.00	1,946,400
ライドオン・エクスプレス	2,300	1,787.00	4,110,100
E R I ホールディングス	3,800	814.00	3,093,200
アビスト	1,500	2,118.00	3,177,000
ウィルグループ	3,300	912.00	3,009,600
日本ビューホテル	1,600	1,527.00	2,443,200
リクルートホールディングス	290,800	3,305.00	961,094,000
エラン	1,200	1,052.00	1,262,400
ツガミ	42,000	399.00	16,758,000
オークマ	94,000	807.00	75,858,000
東芝機械	79,000	360.00	28,440,000

アマダホールディングス	210,700	1,044.00	219,970,800
アイダエンジニアリング	37,900	902.00	34,185,800
滝澤鉄工所	45,000	122.00	5,490,000
富士機械製造	47,200	1,140.00	53,808,000
牧野フライス製作所	72,000	708.00	50,976,000
オーエスジー	65,800	1,910.00	125,678,000
ダイジェット工業	17,000	131.00	2,227,000
旭ダイヤモンド工業	39,600	1,017.00	40,273,200
DMG森精機	79,700	990.00	78,903,000
ソディック	27,400	736.00	20,166,400
ディスコ	18,400	10,380.00	190,992,000
日東工器	8,400	2,036.00	17,102,400
パンチ工業	5,700	697.00	3,972,900
日本郵政	318,000	1,429.00	454,422,000
ベルシステム24ホールディングス	21,200	950.00	20,140,000
豊田自動織機	125,700	4,840.00	608,388,000
豊和工業	8,100	526.00	4,260,600
OKK	56,000	111.00	6,216,000
石川製作所	35,000	69.00	2,415,000
東洋機械金属	10,800	324.00	3,499,200
津田駒工業	36,000	98.00	3,528,000
エンシュウ	35,000	78.00	2,730,000
島精機製作所	20,400	1,735.00	35,394,000
フリー	2,100	3,120.00	6,552,000
日阪製作所	18,300	822.00	15,042,600
やまびこ	26,500	732.00	19,398,000
ペガサスミシン製造	14,900	484.00	7,211,600
ナブテスコ	75,100	2,230.00	167,473,000
三井海洋開発	16,900	1,482.00	25,045,800
レオン自動機	12,200	594.00	7,246,800
SMC	43,300	26,300.00	1,138,790,000
新川	12,900	429.00	5,534,100
ホソカワミクロン	24,000	545.00	13,080,000
ユニオンツール	6,200	2,415.00	14,973,000
オイレス工業	18,700	1,748.00	32,687,600
日精エー・エス・ビー機械	5,300	1,869.00	9,905,700
サトーホールディングス	19,500	2,479.00	48,340,500
日本エアータック	5,000	650.00	3,250,000
日精樹脂工業	10,500	665.00	6,982,500
ワイエイシイ	5,700	637.00	3,630,900
小松製作所	708,300	1,747.50	1,237,754,250
住友重機械工業	421,000	472.00	198,712,000
日立建機	64,600	1,605.00	103,683,000
日工	19,000	323.00	6,137,000
巴工業	6,000	1,407.00	8,442,000
井関農機	148,000	191.00	28,268,000
TOWA	13,900	670.00	9,313,000

丸山製作所	31,000	165.00	5,115,000
北川鉄工所	66,000	201.00	13,266,000
シンニッタン	13,100	612.00	8,017,200
タカキタ	3,600	523.00	1,882,800
クボタ	693,700	1,432.00	993,378,400
荏原実業	4,400	1,213.00	5,337,200
東洋エンジニアリング	83,000	276.00	22,908,000
三菱化工機	47,000	225.00	10,575,000
月島機械	27,400	966.00	26,468,400
帝国電機製作所	10,500	634.00	6,657,000
東京機械製作所	54,000	39.00	2,106,000
新東工業	32,800	900.00	29,520,000
澁谷工業	12,100	1,344.00	16,262,400
アイチコーポレーション	20,500	757.00	15,518,500
小森コーポレーション	35,100	1,164.00	40,856,400
鶴見製作所	10,700	1,710.00	18,297,000
住友精密工業	23,000	321.00	7,383,000
酒井重工業	28,000	175.00	4,900,000
荏原製作所	319,000	428.00	136,532,000
石井鐵工所	21,000	142.00	2,982,000
西島製作所	15,400	934.00	14,383,600
北越工業	15,600	650.00	10,140,000
千代田化工建設	112,000	884.00	99,008,000
ダイキン工業	201,000	7,696.00	1,546,896,000
オルガノ	25,000	414.00	10,350,000
トーヨーカネツ	77,000	234.00	18,018,000
栗田工業	86,800	2,540.00	220,472,000
椿本チエイン	82,000	632.00	51,824,000
大同工業	27,000	207.00	5,589,000
日本コンベヤ	48,000	116.00	5,568,000
日機装	51,600	827.00	42,673,200
木村化工機	12,400	369.00	4,575,600
新興プランテック	31,800	851.00	27,061,800
アネスト岩田	23,300	911.00	21,226,300
ダイフク	74,200	1,806.00	134,005,200
サムコ	2,300	800.00	1,840,000
加藤製作所	33,000	379.00	12,507,000
油研工業	27,000	181.00	4,887,000
タダノ	67,000	967.00	64,789,000
フジテック	40,200	1,164.00	46,792,800
CKD	38,400	803.00	30,835,200
キトー	17,400	735.00	12,789,000
平和	42,800	2,344.00	100,323,200
理想科学工業	15,300	1,815.00	27,769,500
SANKYO	38,400	4,240.00	162,816,000
日本金銭機械	12,700	981.00	12,458,700
マースエンジニアリング	7,900	1,950.00	15,405,000

福島工業	8,500	2,340.00	19,890,000
オーイズミ	5,800	470.00	2,726,000
ダイコク電機	5,700	1,178.00	6,714,600
竹内製作所	20,500	1,338.00	27,429,000
アマノ	42,700	1,637.00	69,899,900
J U K I	20,500	872.00	17,876,000
サンデンホールディングス	84,000	287.00	24,108,000
蛇の目ミシン工業	13,400	574.00	7,691,600
ブラザー工業	178,500	1,229.00	219,376,500
マックス	20,000	1,210.00	24,200,000
モリタホールディングス	24,200	1,245.00	30,129,000
グローリー	47,100	3,765.00	177,331,500
新晃工業	9,600	1,744.00	16,742,400
大和冷機工業	22,200	955.00	21,201,000
セガサミーホールディングス	148,300	1,209.00	179,294,700
日本ピストンリング	5,800	1,456.00	8,444,800
リケン	64,000	365.00	23,360,000
T P R	17,000	2,768.00	47,056,000
ツバキ・ナカシマ	12,800	1,536.00	19,660,800
ホシザキ電機	30,300	8,780.00	266,034,000
大豊工業	11,100	1,096.00	12,165,600
日本精工	283,500	1,028.00	291,438,000
N T N	342,000	356.00	121,752,000
ジェイテクト	147,100	1,541.00	226,681,100
不二越	128,000	382.00	48,896,000
ミネベア	222,000	809.00	179,598,000
日本トムソン	47,000	368.00	17,296,000
T H K	91,800	1,885.00	173,043,000
ユーシン精機	5,400	1,728.00	9,331,200
前澤給装工業	5,800	1,392.00	8,073,600
イーグル工業	17,100	1,377.00	23,546,700
前澤工業	9,900	272.00	2,692,800
日本ピラー工業	14,000	926.00	12,964,000
キッツ	67,200	480.00	32,256,000
日立製作所	3,522,000	463.30	1,631,742,600
東芝	2,906,000	176.20	512,037,200
三菱電機	1,473,000	1,140.00	1,679,220,000
富士電機	416,000	383.00	159,328,000
東洋電機製造	27,000	324.00	8,748,000
安川電機	171,400	1,341.00	229,847,400
シンフォニア テクノロジー	90,000	147.00	13,230,000
明電舎	127,000	478.00	60,706,000
オリジン電気	20,000	259.00	5,180,000
山洋電気	36,000	512.00	18,432,000
デンヨー	12,700	1,177.00	14,947,900
日立工機	37,000	744.00	27,528,000
三櫻工業	17,600	566.00	9,961,600

マキタ	90,000	6,690.00	602,100,000
東芝テック	99,000	348.00	34,452,000
芝浦メカトロニクス	22,000	192.00	4,224,000
マブチモーター	39,500	4,850.00	191,575,000
日本電産	166,100	7,536.00	1,251,729,600
東光高岳	7,700	1,300.00	10,010,000
ダブル・スコープ	4,100	3,650.00	14,965,000
宮越ホールディングス	4,600	353.00	1,623,800
ダイヘン	81,000	478.00	38,718,000
田淵電機	15,600	445.00	6,942,000
ヤーマン	1,800	1,912.00	3,441,600
JVCケンウッド	101,200	291.00	29,449,200
ミマキエンジニアリング	9,300	437.00	4,064,100
第一精工	5,700	1,173.00	6,686,100
日新電機	32,300	938.00	30,297,400
大崎電気工業	25,000	728.00	18,200,000
オムロン	158,400	3,030.00	479,952,000
日東工業	22,100	1,856.00	41,017,600
I D E C	18,100	1,038.00	18,787,800
不二電機工業	1,500	1,403.00	2,104,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	266,000	470.00	125,020,000
サクサホールディングス	35,000	182.00	6,370,000
メルコホールディングス	7,600	2,280.00	17,328,000
テクノメディカ	3,000	2,203.00	6,609,000
日本電気	1,898,000	280.00	531,440,000
富士通	1,331,000	414.90	552,231,900
沖電気工業	598,000	146.00	87,308,000
岩崎通信機	66,000	75.00	4,950,000
電気興業	36,000	520.00	18,720,000
サンケン電気	75,000	299.00	22,425,000
ナカヨ	13,000	327.00	4,251,000
アイホン	7,800	1,915.00	14,937,000
ルネサスエレクトロニクス	71,500	669.00	47,833,500
セイコーエプソン	205,500	1,807.00	371,338,500
ワコム	108,700	483.00	52,502,100
アルバック	25,400	3,370.00	85,598,000
アクセル	6,500	847.00	5,505,500
E I Z O	13,700	2,897.00	39,688,900
ジャパンディスプレイ	257,700	214.00	55,147,800
日本信号	38,100	864.00	32,918,400
京三製作所	32,000	344.00	11,008,000
能美防災	15,700	1,403.00	22,027,100
ホーチキ	10,000	1,218.00	12,180,000
エレコム	11,900	1,708.00	20,325,200
日本無線	35,000	287.00	10,045,000
パナソニック	1,577,200	927.70	1,463,168,440
シャープ	1,167,000	149.00	173,883,000

アンリツ	82,900	641.00	53,138,900
富士通ゼネラル	42,000	1,513.00	63,546,000
日立国際電気	32,000	1,256.00	40,192,000
ソニー	974,000	2,383.00	2,321,042,000
TDK	83,300	5,710.00	475,643,000
帝国通信工業	33,000	165.00	5,445,000
ミツミ電機	52,500	504.00	26,460,000
タムラ製作所	53,000	269.00	14,257,000
アルプス電気	117,100	1,807.00	211,599,700
池上通信機	44,000	126.00	5,544,000
パイオニア	223,300	247.00	55,155,100
日本電波工業	12,600	677.00	8,530,200
鈴木	4,000	469.00	1,876,000
日本トリム	3,700	4,495.00	16,631,500
ローランド ディー. ジー.	6,800	2,279.00	15,497,200
日本コロムビア	4,800	503.00	2,414,400
フォスター電機	17,300	2,138.00	36,987,400
クラリオン	73,000	346.00	25,258,000
SMK	41,000	519.00	21,279,000
ヨコオ	9,700	508.00	4,927,600
東光	28,000	352.00	9,856,000
ティアック	99,000	43.00	4,257,000
ホシデン	41,800	669.00	27,964,200
ヒロセ電機	22,300	12,710.00	283,433,000
日本航空電子工業	40,000	1,124.00	44,960,000
TOA	16,300	997.00	16,251,100
日立マクセル	22,800	1,658.00	37,802,400
古野電気	16,500	683.00	11,269,500
ユニデンホールディングス	43,000	120.00	5,160,000
アルパイン	32,900	1,267.00	41,684,300
スミダコーポレーション	11,300	709.00	8,011,700
アイコム	7,700	2,219.00	17,086,300
リオン	5,300	1,604.00	8,501,200
船井電機	13,900	984.00	13,677,600
横河電機	138,200	1,092.00	150,914,400
新電元工業	49,000	357.00	17,493,000
アズビル	45,100	2,824.00	127,362,400
東亜ディーケーケー	5,800	501.00	2,905,800
日本光電工業	57,700	2,829.00	163,233,300
チノー	5,100	1,028.00	5,242,800
共和電業	17,000	367.00	6,239,000
日本電子材料	5,500	379.00	2,084,500
堀場製作所	25,500	3,700.00	94,350,000
アドバンテスト	94,100	1,052.00	98,993,200
小野測器	6,700	712.00	4,770,400
エスペック	14,300	1,319.00	18,861,700
パナソニック デバイスSUNX	12,100	559.00	6,763,900

キーエンス	31,300	58,020.00	1,816,026,000
日置電機	7,200	2,246.00	16,171,200
シスメックス	107,100	6,870.00	735,777,000
日本マイクロニクス	18,000	1,019.00	18,342,000
メガチップス	14,400	1,087.00	15,652,800
OBARA GROUP	8,900	3,985.00	35,466,500
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,400	398.00	4,537,200
澤藤電機	8,000	176.00	1,408,000
デンソー	341,000	4,229.00	1,442,089,000
コーセル	19,200	1,094.00	21,004,800
新日本無線	10,000	375.00	3,750,000
オブテックス	10,200	2,909.00	29,671,800
千代田インテグレ	7,300	2,582.00	18,848,600
レーザーテック	16,100	1,500.00	24,150,000
スタンレー電気	99,100	2,518.00	249,533,800
岩崎電気	47,000	177.00	8,319,000
ウシオ電機	83,800	1,558.00	130,560,400
岡谷電機産業	7,800	370.00	2,886,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	382.00	4,507,600
日本セラミック	7,900	1,859.00	14,686,100
遠藤照明	7,000	1,018.00	7,126,000
日本デジタル研究所	11,700	1,519.00	17,772,300
古河電池	10,000	608.00	6,080,000
双信電機	6,900	262.00	1,807,800
山一電機	11,900	563.00	6,699,700
図研	10,000	1,159.00	11,590,000
日本電子	54,000	511.00	27,594,000
カシオ計算機	138,400	2,039.00	282,197,600
ファナック	141,200	16,755.00	2,365,806,000
日本シイエムケイ	29,600	380.00	11,248,000
エンプラス	7,000	3,900.00	27,300,000
大真空	26,000	206.00	5,356,000
ローム	68,000	4,805.00	326,740,000
浜松ホトニクス	107,700	2,792.00	300,698,400
三井ハイテック	20,000	525.00	10,500,000
新光電気工業	52,100	635.00	33,083,500
京セラ	226,600	4,961.00	1,124,162,600
協栄産業	15,000	125.00	1,875,000
太陽誘電	67,100	1,117.00	74,950,700
村田製作所	144,800	13,180.00	1,908,464,000
ユーシン	18,300	678.00	12,407,400
双葉電子工業	23,600	1,422.00	33,559,200
日東電工	111,700	5,811.00	649,088,700
北陸電気工業	55,000	121.00	6,655,000
東海理化電機製作所	40,400	2,310.00	93,324,000
ニチコン	43,500	729.00	31,711,500

日本ケミコン	112,000	145.00	16,240,000	
KOA	19,100	840.00	16,044,000	
三井造船	534,000	147.00	78,498,000	
日立造船	109,500	525.00	57,487,500	
三菱重工業	2,458,000	404.50	994,261,000	
川崎重工業	1,074,000	302.00	324,348,000	
IHI	1,061,000	193.00	204,773,000	
名村造船所	41,400	655.00	27,117,000	
サノヤホールディングス	17,300	211.00	3,650,300	
日本車輛製造	57,000	247.00	14,079,000	
ニチユ三菱フォークリフト	16,100	430.00	6,923,000	
近畿車輛	20,000	313.00	6,260,000	
FPG	40,400	983.00	39,713,200	
島根銀行	3,100	1,148.00	3,558,800	
じもとホールディングス	97,900	145.00	14,195,500	
全国保証	35,400	3,275.00	115,935,000	
足利ホールディングス	99,900	325.00	32,467,500	
東京TYフィナンシャルグループ	18,800	2,560.00	48,128,000	
九州フィナンシャルグループ	208,500	666.00	138,861,000	
かんぽ生命保険	41,600	2,459.00	102,294,400	
ゆうちょ銀行	261,900	1,218.00	318,994,200	
日産自動車	1,937,700	968.70	1,877,049,990	
いすゞ自動車	400,000	1,116.50	446,600,000	
トヨタ自動車	1,716,900	5,931.00	10,182,933,900	*
日野自動車	197,000	1,150.00	226,550,000	
三菱自動車工業	548,200	807.00	442,397,400	
エフテック	7,300	1,053.00	7,686,900	
レシップホールディングス	4,700	798.00	3,750,600	
GMB	2,200	800.00	1,760,000	
ファルテック	2,500	1,318.00	3,295,000	
武蔵精密工業	14,700	2,090.00	30,723,000	
日産車体	67,400	1,190.00	80,206,000	
新明和工業	60,000	779.00	46,740,000	
極東開発工業	27,500	1,046.00	28,765,000	
日信工業	30,900	1,452.00	44,866,800	
トビー工業	114,000	212.00	24,168,000	
ティラド	54,000	170.00	9,180,000	
曙ブレーキ工業	70,000	246.00	17,220,000	
タチエス	21,900	1,538.00	33,682,200	
NOK	66,800	1,835.00	122,578,000	
フタバ産業	42,100	444.00	18,692,400	
KYB	155,000	294.00	45,570,000	
シロキ工業	34,000	340.00	11,560,000	
市光工業	33,000	179.00	5,907,000	
大同メタル工業	19,300	786.00	15,169,800	
プレス工業	73,300	379.00	27,780,700	
ミクニ	13,200	342.00	4,514,400	

カルソニックカンセイ	105,000	818.00	85,890,000
太平洋工業	30,700	1,007.00	30,914,900
ケーヒン	31,700	1,600.00	50,720,000
河西工業	16,900	1,218.00	20,584,200
アイシン精機	138,900	4,615.00	641,023,500
富士機工	16,000	424.00	6,784,000
マツダ	437,100	1,559.50	681,657,450
ダイハツ工業	164,700	1,580.00	260,226,000
今仙電機製作所	12,700	985.00	12,509,500
本田技研工業	1,242,300	2,868.00	3,562,916,400
スズキ	288,600	2,819.00	813,563,400
富士重工業	436,200	3,669.00	1,600,417,800
安永	4,300	502.00	2,158,600
ヤマハ発動機	195,000	1,670.00	325,650,000
ショーワ	35,800	912.00	32,649,600
小糸製作所	82,700	4,970.00	411,019,000
T B K	16,500	374.00	6,171,000
エクセディ	18,800	2,283.00	42,920,400
ミツバ	23,400	1,502.00	35,146,800
豊田合成	50,200	2,309.00	115,911,800
愛三工業	24,200	914.00	22,118,800
盟和産業	1,700	912.00	1,550,400
ヨロズ	12,900	2,213.00	28,547,700
エフ・シー・シー	22,600	1,881.00	42,510,600
新家工業	30,000	126.00	3,780,000
シマノ	55,600	18,090.00	1,005,804,000
タカタ	24,900	484.00	12,051,600
テイ・エス テック	32,100	2,590.00	83,139,000
ジャムコ	6,000	2,429.00	14,574,000
小野建	11,900	975.00	11,602,500
はるやま商事	5,700	765.00	4,360,500
佐鳥電機	10,800	692.00	7,473,600
カッパ・クリエイト	19,100	1,150.00	21,965,000
エコートレーディング	3,400	591.00	2,009,400
伯東	10,400	911.00	9,474,400
コンドーテック	10,900	781.00	8,512,900
中山福	8,700	766.00	6,664,200
ライトオン	10,100	1,534.00	15,493,400
ナガイレーベン	19,600	2,039.00	39,964,400
ジーンズメイト	4,600	167.00	768,200
三菱食品	15,000	3,040.00	45,600,000
良品計画	15,600	23,780.00	370,968,000
三城ホールディングス	17,300	444.00	7,681,200
松田産業	10,000	1,198.00	11,980,000
第一興商	24,100	4,710.00	113,511,000
メディバルホールディングス	136,300	1,731.00	235,935,300
アドヴァン	13,800	1,075.00	14,835,000

S P K	3,200	1,932.00	6,182,400
萩原電気	3,500	1,823.00	6,380,500
アルビス	3,600	1,917.00	6,901,200
アズワン	10,600	3,940.00	41,764,000
スズデン	4,400	1,051.00	4,624,400
尾家産業	4,800	864.00	4,147,200
シモジマ	9,500	1,050.00	9,975,000
ドウシシャ	16,000	2,161.00	34,576,000
小津産業	3,000	2,162.00	6,486,000
コナカ	16,000	529.00	8,464,000
高速	8,200	862.00	7,068,400
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,475.00	2,507,500
G-7ホールディングス	4,000	1,196.00	4,784,000
たけびし	4,900	980.00	4,802,000
イオン北海道	9,400	502.00	4,718,800
コジマ	20,200	227.00	4,585,400
ヒマラヤ	4,300	973.00	4,183,900
コーナン商事	19,300	1,545.00	29,818,500
黒田電気	25,300	1,543.00	39,037,900
ネットワンシステムズ	58,900	594.00	34,986,600
エコス	5,000	1,177.00	5,885,000
ワタミ	16,200	1,120.00	18,144,000
マルシェ	3,700	833.00	3,082,100
ドンキホーテホールディングス	88,100	3,860.00	340,066,000
丸文	12,000	703.00	8,436,000
西松屋チェーン	26,900	987.00	26,550,300
ゼンショーホールディングス	70,100	1,398.00	97,999,800
ハビネット	12,400	913.00	11,321,200
幸楽苑ホールディングス	8,700	1,573.00	13,685,100
ハークスレイ	3,800	1,040.00	3,952,000
橋本総業	2,600	1,503.00	3,907,800
サイゼリヤ	22,400	2,302.00	51,564,800
エクセル	6,600	1,313.00	8,665,800
V Tホールディングス	46,000	596.00	27,416,000
マルカキカイ	4,400	1,343.00	5,909,200
アルゴグラフィックス	6,200	1,717.00	10,645,400
魚力	4,200	1,211.00	5,086,200
ガリバーインターナショナル	36,600	1,157.00	42,346,200
日本エム・ディ・エム	11,400	577.00	6,577,800
ポブラ	3,500	497.00	1,739,500
ユナイテッドアローズ	19,400	5,250.00	101,850,000
進和	8,000	1,350.00	10,800,000
エスケイジャパン	3,200	408.00	1,305,600
ダイトエレクトロン	6,100	737.00	4,495,700
ハイデイ日高	12,360	2,892.00	35,745,120
シークス	8,600	2,860.00	24,596,000
京都きもの友禅	9,400	841.00	7,905,400

コロワイド	45,200	1,720.00	77,744,000
ピーシーデポコーポレーション	11,200	991.00	11,099,200
田中商事	4,400	625.00	2,750,000
オーハシテクニカ	7,700	1,188.00	9,147,600
壺番屋	6,200	5,970.00	37,014,000
白銅	4,000	1,034.00	4,136,000
トップカルチャー	5,900	454.00	2,678,600
P L A N T	3,100	1,167.00	3,617,700
スギホールディングス	24,400	5,400.00	131,760,000
島津製作所	178,000	1,744.00	310,432,000
J M S	24,000	288.00	6,912,000
クボテック	3,000	425.00	1,275,000
モリテックス	3,000	289.00	867,000
長野計器	8,900	599.00	5,331,100
ブイ・テクノロジー	3,300	3,855.00	12,721,500
スター精密	26,200	1,190.00	31,178,000
東京計器	44,000	149.00	6,556,000
愛知時計電機	18,000	301.00	5,418,000
オーバル	13,700	220.00	3,014,000
東京精密	26,600	2,144.00	57,030,400
マニー	12,600	1,652.00	20,815,200
ニコン	257,800	1,740.00	448,572,000
トプコン	46,300	1,185.00	54,865,500
オリンパス	205,600	4,075.00	837,820,000
理研計器	11,200	1,015.00	11,368,000
S C R E E Nホールディングス	141,000	815.00	114,915,000
キヤノン電子	12,700	1,631.00	20,713,700
タムロン	11,100	1,689.00	18,747,900
HOYA	321,200	4,090.00	1,313,708,000
ノーリツ鋼機	12,600	432.00	5,443,200
エー・アンド・デイ	12,600	392.00	4,939,200
キヤノン	743,200	3,269.00	2,429,520,800
リコー	447,100	1,131.00	505,670,100
シチズンホールディングス	170,000	615.00	104,550,000
リズム時計工業	61,000	144.00	8,784,000
大研医器	10,900	840.00	9,156,000
メニコン	6,900	3,390.00	23,391,000
スノーピーク	1,100	3,525.00	3,877,500
パラマウントベッドホールディングス	14,600	3,960.00	57,816,000
トランザクション	2,200	525.00	1,155,000
S H O - B I	5,000	393.00	1,965,000
ニホンフラッシュ	4,000	974.00	3,896,000
前田工織	15,200	1,002.00	15,230,400
永大産業	19,000	395.00	7,505,000
アートネイチャー	11,100	921.00	10,223,100
ダンロップスポーツ	8,800	969.00	8,527,200
バンダイナムコホールディングス	142,700	2,288.00	326,497,600

アイフィスジャパン	2,400	435.00	1,044,000
共立印刷	23,300	281.00	6,547,300
SHOEI	6,600	1,751.00	11,556,600
フランスベッドホールディングス	19,400	986.00	19,128,400
マーベラス	22,900	824.00	18,869,600
パイロットコーポレーション	24,100	4,325.00	104,232,500
萩原工業	2,900	1,951.00	5,657,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,100	1,279.00	32,102,900
トッパン・フォームズ	24,700	1,351.00	33,369,700
フジシールインターナショナル	16,800	3,540.00	59,472,000
タカラトミー	45,400	830.00	37,682,000
廣済堂	12,900	309.00	3,986,100
アーク	58,300	82.00	4,780,600
レック	4,600	1,256.00	5,777,600
タカノ	6,000	596.00	3,576,000
プロネクス	12,900	1,221.00	15,750,900
ホクシン	11,900	110.00	1,309,000
ウッドワン	23,000	243.00	5,589,000
大建工業	54,000	250.00	13,500,000
きもと	23,900	169.00	4,039,100
凸版印刷	390,000	972.00	379,080,000
大日本印刷	408,000	987.00	402,696,000
図書印刷	26,000	485.00	12,610,000
共同印刷	47,000	324.00	15,228,000
日本写真印刷	23,200	1,697.00	39,370,400
光村印刷	3,000	212.00	636,000
藤森工業	12,400	2,495.00	30,938,000
宝印刷	7,000	1,258.00	8,806,000
前澤化成工業	10,300	976.00	10,052,800
アシックス	128,600	2,098.00	269,802,800
ツツミ	6,900	2,435.00	16,801,500
JSP	9,400	2,199.00	20,670,600
ニチハ	19,200	1,536.00	29,491,200
エフピコ	12,800	4,420.00	56,576,000
小松ウオール工業	4,700	1,747.00	8,210,900
ヤマハ	101,500	3,195.00	324,292,500
河合楽器製作所	5,200	1,915.00	9,958,000
クリナップ	16,300	736.00	11,996,800
ピジョン	78,200	2,639.00	206,369,800
天馬	11,100	1,832.00	20,335,200
兼松日産農林	14,000	132.00	1,848,000
キングジム	11,600	762.00	8,839,200
リンテック	32,800	2,151.00	70,552,800
TASAKI	2,600	1,340.00	3,484,000
信越ポリマー	28,400	572.00	16,244,800
東リ	36,000	291.00	10,476,000

イトーキ	29,100	699.00	20,340,900
任天堂	85,000	16,225.00	1,379,125,000
三菱鉛筆	10,300	4,330.00	44,599,000
松風	6,800	1,318.00	8,962,400
タカラスタンダード	57,000	995.00	56,715,000
コクヨ	71,800	1,119.00	80,344,200
ナカバヤシ	28,000	251.00	7,028,000
ニフコ	27,600	5,150.00	142,140,000
立川ブラインド工業	6,100	683.00	4,166,300
グローブライド	6,700	1,426.00	9,554,200
岡村製作所	48,200	1,006.00	48,489,200
日本バルカー工業	57,000	276.00	15,732,000
MUTOHホールディングス	17,000	229.00	3,893,000
伊藤忠商事	1,069,100	1,384.00	1,479,634,400
丸紅	1,340,800	581.00	779,004,800
スクロール	20,500	402.00	8,241,000
高島	26,000	165.00	4,290,000
ヨンドシーホールディングス	10,400	2,503.00	26,031,200
三陽商会	81,000	241.00	19,521,000
長瀬産業	82,000	1,181.00	96,842,000
ナイガイ	52,000	40.00	2,080,000
蝶理	8,700	1,441.00	12,536,700
豊田通商	151,800	2,340.00	355,212,000
オンワードホールディングス	96,000	689.00	66,144,000
三共生興	20,500	385.00	7,892,500
兼松	290,000	159.00	46,110,000
美津濃	74,000	513.00	37,962,000
ツカモトコーポレーション	25,000	107.00	2,675,000
ファミリーマート	41,900	5,530.00	231,707,000
ルック	26,000	146.00	3,796,000
三井物産	1,232,000	1,337.50	1,647,800,000
日本紙パルプ商事	71,000	326.00	23,146,000
東京エレクトロン	123,900	6,790.00	841,281,000
日立ハイテクノロジーズ	47,200	2,985.00	140,892,000
カメイ	17,700	1,000.00	17,700,000
東都水産	24,000	178.00	4,272,000
OUGホールディングス	20,000	218.00	4,360,000
スターゼン	4,900	3,065.00	15,018,500
セイコーホールディングス	89,000	407.00	36,223,000
山善	52,300	919.00	48,063,700
椿本興業	15,000	293.00	4,395,000
住友商事	857,600	1,136.00	974,233,600
日本ユニシス	37,600	1,373.00	51,624,800
内田洋行	34,000	391.00	13,294,000
三菱商事	1,022,300	1,880.00	1,921,924,000
第一実業	31,000	458.00	14,198,000
キヤノンマーケティングジャパン	38,800	1,951.00	75,698,800

西華産業	45,000	215.00	9,675,000
佐藤商事	12,300	610.00	7,503,000
菱洋エレクトロ	15,700	1,100.00	17,270,000
東京産業	13,700	383.00	5,247,100
ユアサ商事	12,900	2,444.00	31,527,600
神鋼商事	31,000	198.00	6,138,000
小林産業	9,800	193.00	1,891,400
阪和興業	136,000	474.00	64,464,000
カナデン	13,100	811.00	10,624,100
菱電商事	22,000	635.00	13,970,000
ニプロ	102,900	1,082.00	111,337,800
フルサト工業	7,500	1,575.00	11,812,500
岩谷産業	162,000	625.00	101,250,000
すてきナイスグループ	59,000	132.00	7,788,000
昭光通商	50,000	76.00	3,800,000
ニチモウ	21,000	172.00	3,612,000
極東貿易	19,000	229.00	4,351,000
イワキ	21,000	182.00	3,822,000
兼松エレクトロニクス	8,600	1,890.00	16,254,000
三愛石油	35,000	929.00	32,515,000
稲畑産業	32,700	1,224.00	40,024,800
G S I クレオス	36,000	117.00	4,212,000
明和産業	12,600	364.00	4,586,400
キムラタン	588,000	6.00	3,528,000
ゴールドウイン	6,100	4,450.00	27,145,000
ユニ・チャーム	292,700	2,466.00	721,798,200
デサント	32,900	1,768.00	58,167,200
キング	6,900	390.00	2,691,000
ワキタ	29,000	804.00	23,316,000
ヤマトインターナショナル	9,200	377.00	3,468,400
東邦ホールディングス	43,600	2,365.00	103,114,000
サンゲツ	49,200	2,048.00	100,761,600
ミツウロコグループホールディングス	22,000	559.00	12,298,000
シナネンホールディングス	28,000	450.00	12,600,000
伊藤忠エネクス	35,100	819.00	28,746,900
サンリオ	42,000	2,189.00	91,938,000
サンワテクノス	8,700	655.00	5,698,500
リョーサン	21,600	2,801.00	60,501,600
新光商事	16,000	1,039.00	16,624,000
トーヨー	6,200	2,282.00	14,148,400
三信電気	18,800	823.00	15,472,400
東陽テクニカ	20,000	1,089.00	21,780,000
モスフードサービス	17,800	3,085.00	54,913,000
加賀電子	12,300	1,327.00	16,322,100
三益半導体工業	10,700	986.00	10,550,200
ソーダニッカ	14,400	446.00	6,422,400
立花エレテック	10,100	1,134.00	11,453,400

木曾路	16,700	2,260.00	37,742,000
サトレストランシステムズ	16,100	792.00	12,751,200
千趣会	27,000	696.00	18,792,000
タカキュー	9,900	174.00	1,722,600
ケーヨー	23,300	496.00	11,556,800
アデランス	23,900	562.00	13,431,800
上新電機	32,000	890.00	28,480,000
日本瓦斯	15,600	2,063.00	32,182,800
ベスト電器	44,200	117.00	5,171,400
ロイヤルホールディングス	22,600	2,099.00	47,437,400
東天紅	10,000	132.00	1,320,000
いなげや	15,200	1,295.00	19,684,000
島忠	35,200	2,397.00	84,374,400
チョダ	16,000	2,856.00	45,696,000
ライフコーポレーション	8,600	2,294.00	19,728,400
リンガーハット	12,300	2,299.00	28,277,700
さが美	10,000	93.00	930,000
MR MAX	11,600	290.00	3,364,000
テナアライド	13,000	359.00	4,667,000
AOKIホールディングス	31,100	1,266.00	39,372,600
オークワ	20,000	1,027.00	20,540,000
コメリ	21,000	2,144.00	45,024,000
青山商事	26,100	4,195.00	109,489,500
しまむら	15,800	12,630.00	199,554,000
はせがわ	4,800	412.00	1,977,600
高島屋	198,000	890.00	176,220,000
松屋	27,400	883.00	24,194,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,800	1,942.00	135,551,600
近鉄百貨店	53,000	287.00	15,211,000
丸栄	29,000	85.00	2,465,000
ニッセンホールディングス	20,400	141.00	2,876,400
パルコ	13,100	846.00	11,082,600
丸井グループ	167,200	1,525.00	254,980,000
クレディセゾン	103,300	1,974.00	203,914,200
アクシアル リテイリング	10,500	3,390.00	35,595,000
井筒屋	75,000	50.00	3,750,000
イオン	560,600	1,481.50	830,528,900
ユニグループ・ホールディングス	130,500	747.00	97,483,500
イズミ	27,100	4,270.00	115,717,000
東武ストア	17,000	293.00	4,981,000
フォーバル	5,200	631.00	3,281,200
平和堂	27,600	2,104.00	58,070,400
フジ	15,200	2,010.00	30,552,000
ヤオコー	15,400	4,350.00	66,990,000
ゼビオホールディングス	18,500	1,798.00	33,263,000
ケーズホールディングス	28,800	3,580.00	103,104,000
PAL TAC	21,800	1,742.00	37,975,600

三谷産業	14,500	313.00	4,538,500
Olympicグループ	7,200	555.00	3,996,000
日産東京販売ホールディングス	22,900	279.00	6,389,100
新生銀行	1,179,000	134.00	157,986,000
あおぞら銀行	862,000	368.00	317,216,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,931,600	487.40	5,328,061,840
りそなホールディングス	1,594,000	401.50	639,991,000
三井住友トラスト・ホールディングス	2,844,000	331.30	942,217,200
三井住友フィナンシャルグループ	1,091,000	3,169.00	3,457,379,000
第四銀行	172,000	374.00	64,328,000
北越銀行	147,000	180.00	26,460,000
西日本シティ銀行	443,000	208.00	92,144,000
千葉銀行	525,000	537.00	281,925,000
横浜銀行	914,000	521.00	476,194,000
常陽銀行	492,000	397.00	195,324,000
群馬銀行	303,000	498.00	150,894,000
武蔵野銀行	21,700	2,962.00	64,275,400
千葉興業銀行	37,300	457.00	17,046,100
筑波銀行	56,600	291.00	16,470,600
七十七銀行	213,000	409.00	87,117,000
青森銀行	100,000	303.00	30,300,000
秋田銀行	89,000	269.00	23,941,000
山形銀行	77,000	385.00	29,645,000
岩手銀行	9,500	3,755.00	35,672,500
東邦銀行	122,000	328.00	40,016,000
東北銀行	70,000	142.00	9,940,000
みちのく銀行	69,000	169.00	11,661,000
ふくおかフィナンシャルグループ	589,000	359.00	211,451,000
静岡銀行	399,000	854.00	340,746,000
十六銀行	171,000	358.00	61,218,000
スルガ銀行	129,300	1,835.00	237,265,500
八十二銀行	246,000	515.00	126,690,000
山梨中央銀行	84,000	407.00	34,188,000
大垣共立銀行	182,000	351.00	63,882,000
福井銀行	117,000	185.00	21,645,000
北國銀行	152,000	281.00	42,712,000
清水銀行	4,700	2,145.00	10,081,500
富山銀行	2,600	2,780.00	7,228,000
滋賀銀行	128,000	463.00	59,264,000
南都銀行	132,000	309.00	40,788,000
百五銀行	123,000	405.00	49,815,000
京都銀行	260,000	740.00	192,400,000
紀陽銀行	53,500	1,248.00	66,768,000
三重銀行	61,000	193.00	11,773,000
ほくほくフィナンシャルグループ	926,000	171.00	158,346,000
広島銀行	402,000	426.00	171,252,000
山陰合同銀行	82,500	679.00	56,017,500

中国銀行	96,500	1,207.00	116,475,500
鳥取銀行	44,000	158.00	6,952,000
伊予銀行	145,600	794.00	115,606,400
百十四銀行	150,000	326.00	48,900,000
四国銀行	105,000	205.00	21,525,000
阿波銀行	112,000	521.00	58,352,000
大分銀行	78,000	333.00	25,974,000
宮崎銀行	91,000	269.00	24,479,000
佐賀銀行	83,000	200.00	16,600,000
十八銀行	84,000	230.00	19,320,000
沖縄銀行	10,800	3,410.00	36,828,000
琉球銀行	28,100	1,210.00	34,001,000
セブン銀行	510,400	497.00	253,668,800
みずほフィナンシャルグループ	19,193,300	170.60	3,274,376,980
高知銀行	53,000	111.00	5,883,000
山口フィナンシャルグループ	127,000	1,077.00	136,779,000
アクリーティブ	11,100	358.00	3,973,800
芙蓉総合リース	15,600	4,690.00	73,164,000
興銀リース	25,600	1,971.00	50,457,600
東京センチュリーリース	32,000	3,835.00	122,720,000
SBIホールディングス	163,600	1,037.00	169,653,200
日本証券金融	60,100	481.00	28,908,100
アイフル	227,900	320.00	72,928,000
日本アジア投資	8,900	289.00	2,572,100
ポケットカード	13,700	438.00	6,000,600
長野銀行	46,000	179.00	8,234,000
名古屋銀行	114,000	359.00	40,926,000
北洋銀行	205,100	284.00	58,248,400
愛知銀行	4,600	4,380.00	20,148,000
第三銀行	78,000	146.00	11,388,000
中京銀行	56,000	195.00	10,920,000
東日本銀行	65,000	279.00	18,135,000
大光銀行	49,000	195.00	9,555,000
愛媛銀行	81,000	214.00	17,334,000
トマト銀行	54,000	145.00	7,830,000
みなと銀行	123,000	156.00	19,188,000
京葉銀行	112,000	430.00	48,160,000
関西アーバン銀行	19,000	1,034.00	19,646,000
栃木銀行	73,000	426.00	31,098,000
北日本銀行	4,300	2,698.00	11,601,400
東和銀行	191,000	86.00	16,426,000
福島銀行	168,000	73.00	12,264,000
大東銀行	82,000	182.00	14,924,000
リコーリース	10,700	3,170.00	33,919,000
イオンフィナンシャルサービス	89,400	2,618.00	234,049,200
アコム	273,600	492.00	134,611,200
ジャックス	75,000	400.00	30,000,000

オリエントコーポレーション	589,000	198.00	116,622,000
日立キャピタル	32,100	2,251.00	72,257,100
アプラスフィナンシャル	65,700	86.00	5,650,200
オリックス	964,700	1,497.00	1,444,155,900
三菱UFJリース	345,600	494.00	170,726,400
ジャフコ	22,800	3,120.00	71,136,000
トモニホールディングス	104,500	333.00	34,798,500
大和証券グループ本社	1,275,000	672.90	857,947,500
野村ホールディングス	2,621,500	490.30	1,285,321,450
岡三証券グループ	116,000	543.00	62,988,000
丸三証券	40,400	1,188.00	47,995,200
東洋証券	53,000	282.00	14,946,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,200	558.00	87,159,600
光世証券	33,000	133.00	4,389,000
水戸証券	42,300	312.00	13,197,600
いちよし証券	30,500	1,069.00	32,604,500
松井証券	69,300	970.00	67,221,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	302,700	3,304.00	1,000,120,800
だいこう証券ビジネス	6,600	775.00	5,115,000
日本取引所グループ	400,100	1,774.00	709,777,400
マネックスグループ	160,100	288.00	46,108,800
カブドットコム証券	120,700	339.00	40,917,300
極東証券	18,300	1,325.00	24,247,500
岩井コスモホールディングス	12,900	1,034.00	13,338,600
藍澤証券	19,100	535.00	10,218,500
フィデアホールディングス	82,900	177.00	14,673,300
池田泉州ホールディングス	144,300	393.00	56,709,900
アニコムホールディングス	9,200	2,562.00	23,570,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	407,200	3,095.00	1,260,284,000
マネースクウェアHD	4,700	1,013.00	4,761,100
ソニーフィナンシャルホールディングス	130,600	1,575.00	205,695,000
マネーパートナーズグループ	12,600	461.00	5,808,600
小林洋行	4,700	235.00	1,104,500
第一生命保険	872,900	1,318.00	1,150,482,200
東京海上ホールディングス	552,000	4,003.00	2,209,656,000
イー・ギャランティ	4,400	2,241.00	9,860,400
アサックス	2,400	1,362.00	3,268,800
NECキャピタルソリューション	5,600	1,616.00	9,049,600
T&Dホールディングス	496,600	1,128.00	560,164,800
三井不動産	722,000	2,651.50	1,914,383,000
三菱地所	1,013,000	2,150.00	2,177,950,000
平和不動産	25,800	1,237.00	31,914,600
東京建物	148,800	1,333.00	198,350,400

ダイビル	35,100	959.00	33,660,900
京阪神ビルディング	22,800	581.00	13,246,800
住友不動産	326,000	3,153.00	1,027,878,000
太平洋興発	58,000	75.00	4,350,000
大京	253,000	183.00	46,299,000
テーオーシー	52,800	942.00	49,737,600
東京楽天地	23,000	478.00	10,994,000
レオパレス21	160,400	659.00	105,703,600
スターツコーポレーション	15,600	2,302.00	35,911,200
フジ住宅	17,500	688.00	12,040,000
空港施設	16,600	488.00	8,100,800
明和地所	7,400	634.00	4,691,600
住友不動産販売	9,800	2,118.00	20,756,400
ゴールドクレスト	10,700	1,594.00	17,055,800
リロ・ホールディング	5,400	13,360.00	72,144,000
日本エスリード	5,400	1,034.00	5,583,600
日神不動産	18,300	367.00	6,716,100
タカラレーベン	60,300	612.00	36,903,600
サンヨーハウジング名古屋	7,700	991.00	7,630,700
イオンモール	87,900	1,626.00	142,925,400
ファースト住建	5,100	1,275.00	6,502,500
ランド	64,400	12.00	772,800
東祥	4,300	4,010.00	17,243,000
トーセイ	20,700	661.00	13,682,700
穴吹興産	13,000	243.00	3,159,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	84,700	1,115.00	94,440,500
サンフロンティア不動産	16,400	996.00	16,334,400
エフ・ジェー・ネクスト	11,900	500.00	5,950,000
ランドビジネス	9,400	276.00	2,594,400
グランディハウス	11,900	351.00	4,176,900
東武鉄道	738,000	604.00	445,752,000
相鉄ホールディングス	237,000	718.00	170,166,000
東京急行電鉄	804,000	966.00	776,664,000
京浜急行電鉄	378,000	1,035.00	391,230,000
小田急電鉄	442,000	1,382.00	610,844,000
京王電鉄	386,000	1,086.00	419,196,000
京成電鉄	207,000	1,642.00	339,894,000
富士急行	38,000	1,265.00	48,070,000
新京成電鉄	18,000	420.00	7,560,000
東日本旅客鉄道	252,400	10,090.00	2,546,716,000
西日本旅客鉄道	132,900	6,893.00	916,079,700
東海旅客鉄道	123,600	20,955.00	2,590,038,000
西武ホールディングス	110,000	2,279.00	250,690,000
鴻池運輸	19,500	1,285.00	25,057,500
西日本鉄道	179,000	870.00	155,730,000
ハマキョウレックス	10,600	1,861.00	19,726,600
サカイ引越センター	5,400	2,594.00	14,007,600

近鉄グループホールディングス	1,390,000	501.00	696,390,000
阪急阪神ホールディングス	927,000	744.00	689,688,000
南海電気鉄道	310,000	691.00	214,210,000
京阪電気鉄道	309,000	811.00	250,599,000
神戸電鉄	33,000	358.00	11,814,000
名古屋鉄道	503,000	559.00	281,177,000
山陽電気鉄道	47,000	463.00	21,761,000
トランコム	4,000	6,380.00	25,520,000
日本通運	534,000	508.00	271,272,000
ヤマトホールディングス	255,100	2,397.50	611,602,250
山九	182,000	533.00	97,006,000
日新	57,000	291.00	16,587,000
丸運	8,600	243.00	2,089,800
丸全昭和運輸	45,000	402.00	18,090,000
センコー	62,000	713.00	44,206,000
トナミホールディングス	28,000	260.00	7,280,000
ニッコンホールディングス	45,200	1,965.00	88,818,000
日本石油輸送	17,000	234.00	3,978,000
福山通運	84,000	538.00	45,192,000
セイノーホールディングス	97,900	1,178.00	115,326,200
神奈川中央交通	16,000	708.00	11,328,000
日立物流	28,700	1,715.00	49,220,500
丸和運輸機関	3,100	2,218.00	6,875,800
C&Fロジホールディングス	13,200	860.00	11,352,000
日本郵船	1,239,000	212.00	262,668,000
商船三井	672,000	212.00	142,464,000
川崎汽船	604,000	191.00	115,364,000
NSユナイテッド海運	62,000	150.00	9,300,000
明治海運	12,300	347.00	4,268,100
飯野海運	71,500	434.00	31,031,000
共栄タンカー	12,000	139.00	1,668,000
日本航空	264,300	4,170.00	1,102,131,000
ANAホールディングス	2,563,000	327.90	840,407,700
パスコ	13,000	397.00	5,161,000
三菱倉庫	98,000	1,514.00	148,372,000
三井倉庫ホールディングス	80,000	280.00	22,400,000
住友倉庫	101,000	533.00	53,833,000
澁澤倉庫	36,000	280.00	10,080,000
ヤマタネ	64,000	157.00	10,048,000
東陽倉庫	24,000	227.00	5,448,000
乾汽船	10,900	730.00	7,957,000
日本トランスシティ	31,000	383.00	11,873,000
ケイヒン	26,000	147.00	3,822,000
中央倉庫	7,900	906.00	7,157,400
安田倉庫	10,800	697.00	7,527,600
東洋埠頭	40,000	146.00	5,840,000
宇徳	11,300	310.00	3,503,000

上組	165,000	1,066.00	175,890,000
サンリツ	1,700	487.00	827,900
キムラユニティー	3,500	1,088.00	3,808,000
キューソー流通システム	3,800	2,116.00	8,040,800
郵船ロジスティクス	12,700	1,221.00	15,506,700
近鉄エクスプレス	24,700	1,555.00	38,408,500
東海運	8,300	274.00	2,274,200
エーアイティー	6,400	963.00	6,163,200
内外トランスライン	3,400	884.00	3,005,600
東京放送ホールディングス	81,600	1,819.00	148,430,400
日本テレビホールディングス	124,400	1,976.00	245,814,400
朝日放送	13,500	696.00	9,396,000
テレビ朝日ホールディングス	37,200	1,975.00	73,470,000
スカパーJ S A Tホールディングス	103,400	691.00	71,449,400
テレビ東京ホールディングス	12,300	1,783.00	21,930,900
日本B S放送	2,300	1,047.00	2,408,100
U-NEXT	3,200	949.00	3,036,800
コネクシオ	12,100	1,107.00	13,394,700
日本通信	72,200	168.00	12,129,600
クロップス	1,400	529.00	740,600
日本電信電話	1,053,100	4,678.00	4,926,401,800
KDDI	1,384,100	2,808.50	3,887,244,850
光通信	16,400	7,820.00	128,248,000
NTTドコモ	1,050,800	2,568.00	2,698,454,400
エムティーアイ	17,400	743.00	12,928,200
GMOインターネット	50,400	1,258.00	63,403,200
カドカワ	42,500	1,917.00	81,472,500
学研ホールディングス	46,000	233.00	10,718,000
ゼンリン	18,000	1,893.00	34,074,000
昭文社	7,400	622.00	4,602,800
インプレスホールディングス	11,100	123.00	1,365,300
東京電力	1,170,900	582.00	681,463,800
中部電力	422,400	1,518.00	641,203,200
関西電力	563,300	1,250.00	704,125,000
中国電力	190,800	1,540.00	293,832,000
北陸電力	135,200	1,703.00	230,245,600
東北電力	344,900	1,489.00	513,556,100
四国電力	124,300	1,651.00	205,219,300
九州電力	304,800	1,102.00	335,889,600
北海道電力	129,200	965.00	124,678,000
沖縄電力	14,700	2,817.00	41,409,900
電源開発	117,700	3,545.00	417,246,500
イーレックス	2,600	1,304.00	3,390,400
東京瓦斯	1,541,000	530.90	818,116,900
大阪瓦斯	1,429,000	439.00	627,331,000
東邦瓦斯	348,000	812.00	282,576,000
北海道瓦斯	34,000	275.00	9,350,000

広島ガス	24,100	411.00	9,905,100
西部瓦斯	156,000	253.00	39,468,000
静岡ガス	39,300	757.00	29,750,100
メタウォーター	8,900	2,494.00	22,196,600
アイネット	7,600	1,111.00	8,443,600
松竹	90,000	1,009.00	90,810,000
東宝	97,200	2,809.00	273,034,800
エイチ・アイ・エス	23,500	3,310.00	77,785,000
東映	51,000	898.00	45,798,000
AOI Pro.	6,900	1,007.00	6,948,300
ラックランド	2,000	1,398.00	2,796,000
エヌ・ティ・ティ・データ	84,200	5,650.00	475,730,000
共立メンテナンス	10,800	8,720.00	94,176,000
イチネンホールディングス	15,200	917.00	13,938,400
建設技術研究所	8,500	906.00	7,701,000
スペース	7,800	1,259.00	9,820,200
アインホールディングス	16,400	5,100.00	83,640,000
燦ホールディングス	2,900	1,332.00	3,862,800
ピー・シー・エー	1,800	1,482.00	2,667,600
スバル興業	3,000	387.00	1,161,000
東京テアトル	57,000	117.00	6,669,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	920.00	1,564,000
ナガワ	2,600	2,742.00	7,129,200
よみうりランド	29,000	414.00	12,006,000
東京都競馬	99,000	214.00	21,186,000
常磐興産	54,000	150.00	8,100,000
カナモト	20,100	2,396.00	48,159,600
東京ドーム	115,000	521.00	59,915,000
DTS	15,100	2,079.00	31,392,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,600	2,921.00	168,249,600
シーイーシー	8,900	1,082.00	9,629,800
カブコン	34,800	2,402.00	83,589,600
西尾レントオール	11,600	2,526.00	29,301,600
アイ・エス・ビー	1,600	731.00	1,169,600
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	72,000	37.00	2,664,000
日本空港ビルデング	43,400	4,080.00	177,072,000
トランス・コスモス	16,700	2,491.00	41,599,700
乃村工藝社	30,800	1,407.00	43,335,600
ジャステック	8,600	887.00	7,628,200
S C S K	32,400	4,290.00	138,996,000
藤田観光	52,000	564.00	29,328,000
KNT-CTホールディングス	70,000	169.00	11,830,000
日本管財	12,400	1,775.00	22,010,000
トーカイ	6,400	3,165.00	20,256,000
白洋舎	5,000	253.00	1,265,000

セコム	150,000	8,204.00	1,230,600,000
日本システムウェア	5,000	852.00	4,260,000
セントラル警備保障	6,400	2,320.00	14,848,000
アイネス	19,300	1,080.00	20,844,000
丹青社	26,900	690.00	18,561,000
メイテック	17,900	3,935.00	70,436,500
TKC	12,600	3,240.00	40,824,000
アサツー ディ・ケイ	25,300	2,984.00	75,495,200
富士ソフト	20,200	2,316.00	46,783,200
応用地質	15,100	1,188.00	17,938,800
船井総研ホールディングス	20,000	1,487.00	29,740,000
NSD	28,900	1,690.00	48,841,000
進学会	6,900	627.00	4,326,300
丸紅建材リース	12,000	181.00	2,172,000
オオバ	7,900	374.00	2,954,600
コナミホールディングス	61,500	2,899.00	178,288,500
学究社	2,100	1,215.00	2,551,500
ベネッセホールディングス	48,300	3,560.00	171,948,000
イオンディライト	13,900	3,525.00	48,997,500
ナック	8,900	843.00	7,502,700
福井コンピュータホールディングス	2,900	1,042.00	3,021,800
ニチイ学館	25,100	790.00	19,829,000
ダイセキ	27,100	1,763.00	47,777,300
ステップ	4,900	962.00	4,713,800
日鉄住金物産	90,000	357.00	32,130,000
元気寿司	3,800	2,155.00	8,189,000
トラスコ中山	15,600	4,055.00	63,258,000
ヤマダ電機	414,200	544.00	225,324,800
オートバックスセブン	52,200	1,944.00	101,476,800
アークランドサカモト	23,000	1,083.00	24,909,000
ニトリホールディングス	58,900	8,780.00	517,142,000
グルメ杵屋	9,000	1,003.00	9,027,000
愛眼	10,800	217.00	2,343,600
ケーユーホールディングス	7,100	702.00	4,984,200
吉野家ホールディングス	50,300	1,404.00	70,621,200
加藤産業	21,300	2,786.00	59,341,800
イノテック	12,400	442.00	5,480,800
イエローハット	12,900	1,989.00	25,658,100
松屋フーズ	6,600	2,803.00	18,499,800
JBCホールディングス	11,500	662.00	7,613,000
JKホールディングス	13,900	465.00	6,463,500
サガミチェーン	18,200	1,235.00	22,477,000
日伝	5,500	2,781.00	15,295,500
関西スーパーマーケット	11,400	775.00	8,835,000
ミロク情報サービス	10,100	931.00	9,403,100
北沢産業	11,000	163.00	1,793,000
杉本商事	7,900	1,195.00	9,440,500

因幡電機産業	19,100	3,390.00	64,749,000
王将フードサービス	10,000	3,955.00	39,550,000
プレナス	15,200	1,857.00	28,226,400
ミニストップ	10,100	1,967.00	19,866,700
アークス	25,500	2,263.00	57,706,500
バローホールディングス	29,400	2,416.00	71,030,400
バイテックホールディングス	4,200	954.00	4,006,800
ミスミグループ本社	152,900	1,514.00	231,490,600
アルテック	11,700	141.00	1,649,700
ベルク	6,700	3,875.00	25,962,500
大 庄	6,500	1,377.00	8,950,500
タキヒヨー	22,000	455.00	10,010,000
ファーストリテイリング	27,300	31,230.00	852,579,000
ソフトバンクグループ	772,000	5,577.00	4,305,444,000
蔵王産業	2,400	1,281.00	3,074,400
スズケン	62,000	3,670.00	227,540,000
サンドラッグ	28,800	7,570.00	218,016,000
サックスパー ホールディングス	12,800	1,475.00	18,880,000
ジェコス	9,400	960.00	9,024,000
ヤマザワ	2,900	1,661.00	4,816,900
やまや	2,800	1,857.00	5,199,600
ルネサスイーストン	8,600	415.00	3,569,000
ベルーナ	34,000	509.00	17,306,000
合計	228,928,760		266,950,636,500

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		—	5,472,962,846
コール・ローン		3,135,975,174	—
国債証券		342,470,616,400	323,036,447,800
地方債証券		27,404,729,235	26,836,345,819
特殊債券		27,546,834,748	22,621,064,661
社債券		23,039,056,100	20,858,587,300
未収入金		—	5,561,648,080
未収利息		1,486,873,383	1,289,905,463
前払費用		29,240,078	21,283,042
流動資産合計		425,113,325,118	405,698,245,011
資産合計		425,113,325,118	405,698,245,011
負債の部			
流動負債			
未払金		712,949,000	—
未払解約金		63,275,000	6,394,594,000
流動負債合計		776,224,000	6,394,594,000
負債合計		776,224,000	6,394,594,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	345,746,995,990	311,246,557,550
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		78,590,105,128	88,057,093,461
元本等合計		424,337,101,118	399,303,651,011
純資産合計		424,337,101,118	399,303,651,011
負債純資産合計		425,113,325,118	405,698,245,011

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25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	369,629,287,107円	345,746,995,990円
同期中追加設定元本額	45,327,581,060円	87,184,744,613円
同期中一部解約元本額	69,209,872,177円	121,685,183,053円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	8,503,262,466円	9,175,982,314円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	－円	184,519,752円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	－円	135,188,893円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	－円	55,433,709円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	－円	439,534,915円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	－円	113,983,594円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	－円	20,718,437円
たわらノーロード 国内債券	－円	352,758,070円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	10,825,044,625円	11,609,907,063円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	4,270,992,250円	4,397,137,375円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	6,629,308,611円	6,424,462,977円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,732,232,561円	2,637,655,262円

D I A M DC バラ ス 3 0 インデックスファ ンド	1, 645, 584, 410円	1, 668, 885, 289円
D I A M DC バラ ス 5 0 インデックスファ ンド	1, 795, 769, 252円	1, 829, 884, 341円
D I A M DC バラ ス 7 0 インデックスファ ンド	254, 649, 242円	275, 586, 880円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	119, 643, 701円	118, 176, 862円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	1, 932, 618, 795円	2, 437, 259, 337円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	10, 557, 102円	7, 449, 695円
D I A M DC 8 資産 バランスファンド (新興 国 1 0)	156, 357, 891円	223, 190, 480円
D I A M DC 8 資産 バランスファンド (新興 国 2 0)	111, 841, 764円	166, 232, 315円
D I A M DC 8 資産 バランスファンド (新興 国 3 0)	34, 671, 990円	41, 960, 388円
投資のソムリエ	1, 484, 320, 221円	5, 533, 410, 782円
クルーズコントロール	1, 388, 385, 757円	604, 204, 415円
投資のソムリエ<DC年 金>	21, 949, 338円	99, 483, 266円
D I A M 8 資産バラ ンスファンドN<DC年金 >	324, 888, 979円	706, 595, 262円
D I A M DC バラ ス・F (成長型)	6, 078, 776円	50, 283, 533円
クルーズコントロール< DC年金>	419, 325円	151, 948円
D I A Mコア資産設計フ ァンド (堅実型)	—円	2, 220, 634円
D I A Mコア資産設計フ ァンド (積極型)	—円	3, 942, 514円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	—円	10, 975, 697円
みずほエマージングボン ドオープン	10, 801, 911円	10, 801, 911円
D I A M高金利通貨ファ ンド	9, 608, 918円	9, 608, 918円
D I A Mエマージング債 券ファンド	9, 450, 010円	9, 450, 010円
D I A M国内債券パッシ ブファンド (適格機関投 資家向け)	12, 161, 340, 736円	31, 110, 776, 277円

D I AM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)	—円	925,357,458円
D I AMワールドバラン ス25VA (適格機関投 資家限定)	708,077,509円	598,181,155円
D I AMグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,083,456,644円	890,668,185円
D I AMグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	391,300,895円	295,141,650円
D I AM国際分散バラン スファンド30VA (適 格機関投資家限定)	252,489,640円	145,393,586円
D I AM国際分散バラン スファンド50VA (適 格機関投資家限定)	705,807,127円	396,454,681円
D I AM国内重視バラン スファンド30VA (適 格機関投資家限定)	248,091,708円	158,862,523円
D I AM国内重視バラン スファンド50VA (適 格機関投資家限定)	245,121,818円	122,661,862円
D I AM世界バランスマ ンダ40VA (適格機 関投資家限定)	24,499,571,391円	12,416,124,695円
D I AM世界バランスマ ンダ50VA (適格機 関投資家限定)	8,605,785,394円	4,716,711,039円
D I AMバランスファン ド25VA (適格機関投 資家限定)	12,537,944,510円	8,456,183,355円
D I AMバランスファン ド37.5VA (適格機 関投資家限定)	4,852,002,295円	3,795,959,754円
D I AMバランスファン ド50VA (適格機関投 資家限定)	8,171,451,026円	6,570,343,905円
D I AMグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	1,026,521,106円	787,739,006円
D I AMグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	4,606,495,216円	3,456,549,937円
D I AM アクサ グロ ーバル バランスファン ド30VA (適格機関投 資家限定)	6,060,818,780円	4,821,704,426円

D I AM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)	8,958,285,756円	6,663,294,119円
D I AMグローバルβ私 募ファンド(適格機関投 資家向け)	495,049,617円	839,267,900円
D I AM世界バランスフ ァンド5 5 V A (適格機 関投資家限定)	9,309,734,048円	6,555,700,476円
D I AM世界バランスフ ァンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	8,496,097,087円	6,940,477,535円
D I AMグローバル分散 ファンドV A (適格機関 投資家限定)	1,038,550,408円	—円
D I AM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)	104,406,638,366円	89,526,721,508円
D I AM世界アセットバ ランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1,620,368,453円	1,276,115,973円
D I AM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)	9,010,019,380円	7,766,460,038円
D I AM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)	32,807,793,993円	28,803,192,292円
D I AMバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	494,649円	58,681,744円
D I AMバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	43,932,447円	29,226,882円
D I AMバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	77,804,608円	9,770,347円
D I AM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)	36,564,549,550円	32,292,361,602円
D I AM世界バランス 2 5 V A (適格機関投資 家限定)	687,712,472円	593,551,673円
D I AM国内バランス 3 0 V A (適格機関投資 家限定)	171,833,083円	158,113,403円
D I AMバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	28,056,951円	641,936,416円

D I A Mバランス 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	595,035,375円	69,505,002円
D I A Mバランス 6 0 V A (適格機関投資家限 定)	326,057円	330,308円
計	345,746,995,990円	311,246,557,550円
2. 受益権の総数	345,746,995,990口	311,246,557,550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26年2月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	3,541,686,200	6,348,296,900
地方債証券	116,092,683	118,622,402
特殊債券	72,764,571	55,700,444
社債券	29,019,600	59,665,370
合計	3,759,563,054	6,582,285,116

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年2月17日から平成27年2月25日まで及び平成28年2月16日から平成28年2月25日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.2273円	1.2829円
(1万口当たり純資産額)	(12,273円)	(12,829円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 5 1 回 利付国庫債券 (2年)	1,500,000,000	1,505,160,000	
	3 5 3 回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	2,007,760,000	
	3 5 4 回 利付国庫債券 (2年)	1,500,000,000	1,506,195,000	
	3 5 5 回 利付国庫債券 (2年)	3,000,000,000	3,013,170,000	
	3 5 6 回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	2,009,280,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券 (5年)	3,000,000,000	3,015,990,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券 (5年)	4,500,000,000	4,523,580,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券 (5年)	4,500,000,000	4,528,125,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券 (5年)	3,300,000,000	3,325,146,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券 (5年)	2,000,000,000	2,013,620,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券 (5年)	2,000,000,000	2,021,880,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券 (5年)	1,500,000,000	1,521,915,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券 (5年)	2,000,000,000	2,024,580,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券 (5年)	3,500,000,000	3,547,740,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券 (5年)	4,200,000,000	4,251,030,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券 (5年)	4,500,000,000	4,559,490,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券 (5年)	3,500,000,000	3,549,525,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券 (5年)	1,500,000,000	1,522,590,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券 (5年)	1,500,000,000	1,517,205,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券 (5年)	4,500,000,000	4,554,405,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券 (5年)	4,500,000,000	4,557,960,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券 (5年)	5,000,000,000	5,067,350,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券 (5年)	4,000,000,000	4,056,120,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券 (5年)	1,000,000,000	1,014,560,000	
	2 回 利付国庫債券 (40年)	600,000,000	820,662,000	
	3 回 利付国庫債券 (40年)	700,000,000	960,995,000	
	4 回 利付国庫債券 (40年)	800,000,000	1,102,096,000	
	5 回 利付国庫債券 (40年)	800,000,000	1,055,344,000	
	6 回 利付国庫債券 (40年)	900,000,000	1,161,378,000	
	7 回 利付国庫債券 (40年)	800,000,000	982,808,000	
	8 回 利付国庫債券 (40年)	700,000,000	789,726,000	
	2 8 6 回 利付国庫債券 (10年)	2,600,000,000	2,668,120,000	
	2 8 8 回 利付国庫債券 (10年)	1,500,000,000	1,544,445,000	
	2 8 9 回 利付国庫債券 (10年)	3,200,000,000	3,299,616,000	
	2 9 0 回 利付国庫債券 (10年)	1,000,000,000	1,033,540,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券 (10年)	2,200,000,000	2,303,554,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券 (10年)	3,000,000,000	3,133,590,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券 (10年)	2,300,000,000	2,405,616,000	

299回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,675,040,000	
301回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,066,663,000	
303回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,433,193,000	
305回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,645,425,000	
306回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,664,600,000	
308回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,384,708,000	
309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,056,470,000	
310回 利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,954,588,000	
312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,348,940,000	
313回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,229,770,000	
315回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,365,198,000	
317回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,073,070,000	
318回 利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,814,665,000	
319回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,614,585,000	
320回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,070,510,000	
321回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,683,850,000	
324回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,127,740,000	
325回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,199,380,000	
326回 利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,805,587,000	
328回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,114,480,000	
329回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,073,350,000	
330回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,150,180,000	
332回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,121,860,000	
333回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,655,025,000	
334回 利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,976,624,000	
335回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,637,450,000	
336回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,583,490,000	
337回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,349,205,000	
338回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,663,240,000	
339回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,139,410,000	
340回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,661,805,000	
341回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,590,050,000	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	136,028,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	131,163,000	
3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,056,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	278,640,000	
5回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,896,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,868,000	
7回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	395,874,000	
8回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	372,285,000	
11回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	490,116,000	
12回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	387,807,000	
13回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	382,656,000	
14回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	672,345,000	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	272,572,000	
16回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	545,120,000	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,026,000	

18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,088,140,000
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,488,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	409,452,000
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	663,400,000
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	641,916,600
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	819,708,000
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	409,944,000
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	796,788,000
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	943,467,000
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,233,495,000
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,099,264,000
29回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,493,415,000
30回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,740,544,000
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,187,424,000
32回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,882,482,000
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,664,624,000
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,593,876,000
35回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,924,845,000
36回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,799,056,000
37回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	2,020,928,000
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,240,340,000
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,011,952,000
40回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,239,800,000
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	971,512,000
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,214,550,000
43回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,214,730,000
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	971,896,000
45回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,278,772,000
46回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,627,192,000
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,188,510,000
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,248,819,000
49回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	226,970,000
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	630,960,000
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	423,368,000
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	766,886,400
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	869,776,000
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	956,414,600
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	996,057,000
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	552,075,000
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,054,956,000
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	565,575,000
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	863,951,400
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	670,836,000
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	621,142,500
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	798,959,000
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	919,544,400
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,281,566,900

58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	683,736,000
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,099,325,700
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	868,688,000
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,394,835,000
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	695,364,000
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,280,180,000
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,218,459,000
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,516,837,500
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,490,612,500
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,414,576,800
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,682,198,000
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,720,816,500
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,680,490,000
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,697,514,000
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,704,178,000
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,490,604,000
90回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,730,694,000
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,597,648,000
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	855,239,000
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	986,264,000
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,510,356,000
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,751,960,000
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,739,962,000
100回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,887,555,000
102回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,187,305,000
105回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,879,080,000
107回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,757,420,000
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,971,120,000
111回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,293,380,000
113回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,150,517,000
114回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,154,274,000
116回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,311,092,000
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,258,230,000
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,106,442,000
121回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,366,982,000
123回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,426,167,000
125回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,329,524,000
128回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,125,558,000
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,112,211,000
130回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,102,492,000
132回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,955,776,000
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,115,316,000
135回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,222,860,000
137回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,081,327,000
140回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,326,949,000
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,325,619,000
143回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,536,758,000

	145回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,958,864,000	
	146回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,324,308,000	
	147回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,290,450,000	
	148回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,018,274,000	
	149回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,489,781,000	
	150回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,331,420,000	
	151回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,256,180,000	
	152回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,690,020,000	
	153回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,171,434,000	
	154回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,019,078,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,082,310,000	
国債証券 合計		287,820,000,000	323,036,447,800	
地方債証券	659回 東京都公募公債	203,500,000	211,188,230	
	664回 東京都公募公債	300,000,000	311,898,000	
	667回 東京都公募公債	300,000,000	314,598,000	
	680回 東京都公募公債	200,000,000	211,286,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	524,305,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	208,570,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	530,040,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	739,361,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	528,945,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	319,818,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	423,464,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	248,658,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	211,190,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	212,514,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,586,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	316,287,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	313,743,000	
	307回 大阪府公募公債	100,000,000	103,038,000	
	310回 大阪府公募公債	240,000,000	247,478,400	
	319回 大阪府公募公債	200,000,000	209,024,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	211,728,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	317,493,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	212,060,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	315,087,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	320,634,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	363,587,000	
	19年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,418,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	206,980,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	326,691,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	206,712,100	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	209,434,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	212,058,000	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	104,161,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	210,362,000		
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	533,405,000		

25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	318,753,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	211,636,000	
21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	462,101,200	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	212,532,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	420,420,000	
21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	210,898,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	210,926,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	210,130,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	315,159,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	212,568,000	
55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,096,000	
57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,016,000	
61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,101,000	
65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,069,000	
75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	527,550,000	
80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	740,628,000	
94回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	530,355,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	743,638,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	317,163,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	532,265,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	739,277,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	527,995,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	520,330,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	842,335,839	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	525,740,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,096,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,810,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	522,890,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,020,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	415,548,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	418,492,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,055,000	
19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	138,716,550	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	472,437,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	210,652,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	212,058,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	477,256,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	426,216,000	
19年度7回 札幌市公募公債	300,000,000	309,201,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	211,674,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,998,000	
21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	210,474,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	214,268,000	
地方債証券 合計	25,459,400,000	26,836,345,819	
特殊債券			
46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,914,000	
25回 高速道路機構債	300,000,000	308,511,000	
35回 高速道路機構債	400,000,000	413,516,000	

4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	736,400,000	
9 6 回 高速道路機構債	700,000,000	735,364,000	
1 1 6 回 高速道路機構債	100,000,000	105,423,000	
9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,700,000	
1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,432,000	
3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	352,575,920	
4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	340,483,150	
4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,528,000	
5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,590,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,056,000	
6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	737,026,290	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	168,355,260	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	418,359,290	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	624,072,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	731,486,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,063,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,160,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	423,160,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,052,150,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,490,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	533,550,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	353,103,300	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,455,000	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	514,375,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	682,983,630	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,304,520	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,245,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,375,000	

10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	526,530,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,952,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,757,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,624,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,184,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	423,884,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	534,830,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,133,000	
19回 都市再生機構債券	200,000,000	208,374,000	
11回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,952,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	314,841,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	65,301,000	70,621,725	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,616,000	49,254,332	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	67,536,000	72,987,505	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	72,747,000	79,121,092	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	32,318,000	34,038,287	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	165,655,000	173,175,737	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,161,000	44,672,929	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,364,000	30,939,167	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	105,136,000	114,554,082	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,692,000	89,949,876	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,100,000	151,847,587	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	241,265,000	262,271,943	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	473,224,000	509,411,439	
755号 利付商工債	260,000,000	261,575,600	
い第769号 利付商工債	200,000,000	201,498,000	
い第779号 利付商工債	200,000,000	201,454,000	
753号 利附農林債	300,000,000	301,293,000	
760号 利附農林債	300,000,000	302,829,000	
764号 利附農林債	500,000,000	504,590,000	
275回 利附信金中金債	400,000,000	401,680,000	
282回 利附信金中金債	300,000,000	301,884,000	
302回 利附信金中金債	300,000,000	301,818,000	
186号 利附商工債(3年)	200,000,000	200,676,000	
21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	311,475,000	
5回 中日本高速道路債券	200,000,000	209,444,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	529,735,000	
特殊債券 合計	21,651,115,000	22,621,064,661	
社債券			
1回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	98,765,000	
27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,838,000	
22回 中日本高速道路債券	300,000,000	314,301,000	
7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,463,000	

9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	201,032,000	
3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	104,395,000	
41回 住友化学社債	100,000,000	105,471,000	
37回 三菱化学社債	100,000,000	104,752,000	
8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,908,000	
64回 新日本製鐵社債	100,000,000	105,689,000	
1回 日本電産社債	100,000,000	100,395,000	
11回 パナソニック社債	100,000,000	101,937,000	
12回 パナソニック社債	200,000,000	201,408,000	
56回 日産自動車社債	100,000,000	101,745,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	212,192,000	
16回 トヨタ自動車社債	100,000,000	104,065,000	
49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	105,109,000	
66回 伊藤忠商事社債	200,000,000	200,798,000	
91回 丸紅社債	100,000,000	100,632,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	105,543,000	
45回 住友商事社債	100,000,000	105,017,000	
47回 住友商事社債	100,000,000	104,026,000	
69回 三菱商事社債	300,000,000	312,861,000	
48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,777,000	
7回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	308,367,000	
31回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,128,000	
32回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,690,000	
7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	107,465,000	
140回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,203,000	
7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	215,038,000	
12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,780,000	
25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,580,000	
28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,478,000	
32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	322,782,000	
4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,429,000	
6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,355,000	
7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,830,000	
9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,477,000	
7回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,115,000	
12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,264,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	206,880,000	
10回 セブン銀行社債	100,000,000	104,926,000	
57回 三井住友銀行社債	300,000,000	301,044,000	
11回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	207,324,000	
20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	214,034,000	
22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,164,000	
23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	426,912,000	
10回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,536,000	
14回 みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	213,768,000	
23回 ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,419,000	

15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	215,212,000
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	209,234,000
144回	オリックス社債	100,000,000	102,436,000
164回	オリックス社債	100,000,000	103,251,000
167回	オリックス社債	200,000,000	201,328,000
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,836,000
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,428,000
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,516,000
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,930,000
38回	三井不動産社債	200,000,000	210,686,000
72回	三菱地所社債	100,000,000	116,960,000
90回	三菱地所社債	100,000,000	103,362,000
96回	三菱地所社債	200,000,000	210,250,000
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,528,000
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,677,000
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	103,997,000
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,882,000
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	334,365,000
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,545,000
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	351,858,000
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	310,137,000
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,968,000
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,466,000
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	343,959,000
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,812,000
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,661,000
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	194,105,900
11回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,147,000
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	116,788,000
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	212,956,000
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,535,000
54回	日本電信電話社債	200,000,000	207,252,000
60回	日本電信電話社債	300,000,000	317,379,000
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	208,786,000
455回	東京電力社債	200,000,000	208,698,000
542回	東京電力社債	500,000,000	512,710,000
476回	中部電力社債	100,000,000	104,838,000
496回	中部電力社債	500,000,000	523,965,000
410回	関西電力社債	300,000,000	315,015,000
486回	関西電力社債	154,000,000	155,509,200
492回	関西電力社債	200,000,000	202,706,000
493回	関西電力社債	200,000,000	202,736,000
310回	中国電力社債	200,000,000	208,910,000
377回	中国電力社債	200,000,000	213,128,000
260回	北陸電力社債	100,000,000	109,331,000
281回	北陸電力社債	200,000,000	208,336,000
471回	東北電力社債	200,000,000	213,278,000

473回 東北電力社債	300,000,000	306,156,000	
237回 四国電力社債	100,000,000	105,429,000	
253回 四国電力社債	200,000,000	211,240,000	
423回 九州電力社債	200,000,000	205,540,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	213,718,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	422,044,000	
320回 北海道電力社債	200,000,000	204,140,000	
321回 北海道電力社債	161,000,000	168,116,200	
38回 電源開発社債	300,000,000	314,958,000	
17回 東京ガス社債	100,000,000	105,964,000	
9回 大阪ガス社債	100,000,000	105,544,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	109,314,000	
27回 NTTデータ社債	100,000,000	105,924,000	
社債券 合計	19,905,000,000	20,858,587,300	
合計	354,835,515,000	393,352,445,580	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		7,463,794,011	805,145,627
金銭信託		—	85,897,312
コール・ローン		317,762,461	—
株式		304,556,404,131	236,834,617,141
投資信託受益証券		931,236,031	789,271,471
投資証券		6,568,436,671	5,598,714,114
派生商品評価勘定		274,115,200	29,661,401
未収入金		18,440	159,029,454
未収配当金		540,263,891	490,890,995
差入委託証拠金		1,942,072,454	1,511,748,469
流動資産合計		322,594,103,290	246,304,975,984
資産合計		322,594,103,290	246,304,975,984
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,515,280	29,068,874
未払解約金		3,205,197,000	550,706,000
流動負債合計		3,206,712,280	579,774,874
負債合計		3,206,712,280	579,774,874
純資産の部			
元本等			
元本	※1	109,314,267,788	101,062,929,782
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		210,073,123,222	144,662,271,328
元本等合計		319,387,391,010	245,725,201,110
純資産合計		319,387,391,010	245,725,201,110
負債純資産合計		322,594,103,290	246,304,975,984

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
<p>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</p>	<p>137, 116, 704, 251円 10, 177, 480, 079円 37, 979, 916, 542円</p>	<p>109, 314, 267, 788円 20, 720, 942, 880円 28, 972, 280, 886円</p>

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	973, 546, 154円	1, 265, 346, 668円
M I T O ラップ型ファ ンド (安定型)	—円	5, 067, 406円
M I T O ラップ型ファ ンド (中立型)	—円	10, 330, 738円
M I T O ラップ型ファ ンド (積極型)	—円	24, 590, 871円
グローバル8資産ラップ ファンド (安定型)	—円	12, 074, 361円
グローバル8資産ラップ ファンド (中立型)	—円	8, 743, 829円
グローバル8資産ラップ ファンド (積極型)	—円	9, 184, 637円
たわらノーロード 先進 国株式	—円	826, 190, 880円
D I A M外国株式インデ ックスファンド<DC年 金>	34, 317, 265, 356円	34, 283, 257, 934円
D I A Mバランス・ファ ンド<DC年金> 1 安定 型	145, 630, 156円	169, 874, 284円
D I A Mバランス・ファ ンド<DC年金> 2 安 定・成長型	828, 101, 362円	905, 415, 134円
D I A Mバランス・ファ ンド<DC年金> 3 成長 型	1, 051, 813, 641円	1, 068, 407, 169円
D I A M DC バラン ス30インデックスファ ンド	140, 375, 493円	140, 986, 314円
D I A M DC バラン ス50インデックスファ ンド	403, 472, 656円	406, 671, 520円
D I A M DC バラン ス70インデックスファ ンド	323, 794, 483円	338, 651, 848円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	50, 098, 652円	43, 215, 717円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	795, 335, 714円	874, 460, 875円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	217, 561, 695円	242, 048, 956円
D I A M DC 8資産 バランスファンド (新興 国10)	11, 771, 139円	19, 784, 452円

D I A M D C 8資産 バランスファンド（新興 国20）	23,300,325円	39,211,766円
D I A M D C 8資産 バランスファンド（新興 国30）	58,619,745円	83,633,667円
投資のソムリエ クルーズコントロール	150,434,088円	477,923,774円
投資のソムリエ<DC年 金>	251,262,691円	116,268,511円
D I A M 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	2,221,645円	9,139,329円
D I A M D C バラン ス・F（成長型）	25,247,512円	60,602,702円
クルーズコントロール< DC年金>	2,351,445円	21,789,339円
D I A Mコア資産設計フ ァンド（堅実型）	75,719円	29,118円
D I A Mコア資産設計フ ァンド（積極型）	－円	1,060,414円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	－円	1,885,928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）	－円	389,909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）	347,241,830円	246,302,019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）	3,392,710,883円	3,399,312,717円
D I A Mワールドバラン ス25VA（適格機関投 資家限定）	－円	117,716,486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）	40,541,962円	38,663,574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）	1,438,591,599円	380,345,852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）	429,031,677円	374,359,591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）	47,163,743円	31,054,047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）	308,162,419円	198,593,205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）	20,801,176円	15,800,472円

D I AM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)	53, 437, 377円	30, 800, 758円
D I AM世界バ ランスフ ァンド4 0 V A (適格機 関投資家限定)	7, 090, 256, 484円	4, 146, 137, 174円
D I AM世界バ ランスフ ァンド5 0 V A (適格機 関投資家限定)	3, 741, 316, 822円	2, 361, 996, 766円
D I AMバ ランスフ ァンド2 5 V A (適格機 関投資家限定)	1, 369, 439, 114円	1, 057, 860, 672円
D I AMバ ランスフ ァンド3 7. 5 V A (適格機 関投資家限定)	1, 234, 248, 157円	1, 111, 132, 004円
D I AMバ ランスフ ァンド5 0 V A (適格機 関投資家限定)	3, 577, 642, 164円	3, 303, 720, 878円
D I AMグ ローバ ル・ア セット ・バ ラン スV A (適格機 関投資 家限 定)	1, 516, 695, 305円	1, 243, 117, 731円
D I AMグ ローバ ル・ア セット ・バ ラン スV A 2 (適格機 関投資 家限 定)	2, 435, 074, 033円	1, 975, 013, 508円
D I AM 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, 746, 188, 035円	1, 590, 347, 521円
D I AM世 界ア セ ット バ ラン スフ ァン ドV A (適 格機 関投 資家 向 け)	1, 321, 413, 471円	1, 062, 501, 229円
D I AMグ ロー バ ルβ 私 募 フ ァン ド(適 格機 関投 資家 向 け)	25, 693, 500円	12, 333, 699円
D I AM世 界バ ラン スフ ァン ド5 5 V A (適格機 関投資 家限 定)	6, 142, 740, 733円	4, 679, 814, 254円
D I AM世 界バ ラン スフ ァン ド3 5 V A (適格機 関投資 家限 定)	1, 850, 290, 073円	1, 794, 957, 557円
D I AMグ ロー バ ル分 散 フ ァン ドV A (適格機 関投資 家限 定)	43, 493, 404円	一円
D I AM世 界ア セ ット バ ラン スフ ァン ド2 V A (適格機 関投資 家限 定)	11, 518, 510, 481円	11, 097, 820, 859円
D I AM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)	708, 666, 227円	630, 608, 542円

D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,960,021,605円	1,901,357,227円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	7,251,366,521円	7,078,616,550円
D I A Mバランス30V A (適格機関投資家限 定)	138,291円	17,738,254円
D I A Mバランス50V A (適格機関投資家限 定)	31,289,480円	22,620,054円
D I A Mバランス70V A (適格機関投資家限 定)	127,053,691円	17,318,549円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	9,539,533,825円	9,537,135,837円
D I A Mバランス20V A (適格機関投資家限 定)	3,743,916円	92,569,470円
D I A Mバランス40V A (適格機関投資家限 定)	229,228,270円	28,741,863円
D I A Mバランス60V A (適格機関投資家限 定)	261,849円	282,813円
計	109,314,267,788円	101,062,929,782円
2. 受益権の総数	109,314,267,788口	101,062,929,782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26年2月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	3,978,069,952	7,430,439,349
投資信託受益証券	△10,111,126	22,625,311
投資証券	△106,355,730	230,562,250
合計	3,861,603,096	7,683,626,910

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年2月17日から平成27年2月25日まで及び平成28年2月16日から平成28年2月25日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成28年2月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	3,587,754,960	—	3,586,528,000	1,226,960	534,711,398	—	535,463,600	△752,202
アメリカ・ドル	2,282,482,980	—	2,280,192,000	2,290,980	362,801,552	—	363,395,200	△593,648
イギリス・ポンド	312,358,160	—	312,273,000	85,160	43,862,032	—	43,721,600	140,432
オーストラリア・ドル	157,903,700	—	158,607,000	△703,300	19,353,404	—	19,324,400	29,004
カナダ・ドル	160,999,840	—	161,806,000	△806,160	18,676,884	—	18,816,300	△139,416
ユーロ	674,010,280	—	673,650,000	360,280	90,017,526	—	90,206,100	△188,574
合計	3,587,754,960	—	3,586,528,000	1,226,960	534,711,398	—	535,463,600	△752,202

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

株式関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成28年2月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	6,286,651,477	—	6,558,024,437	271,372,960	2,204,383,417	—	2,205,728,146	1,344,729
合計	6,286,651,477	—	6,558,024,437	271,372,960	2,204,383,417	—	2,205,728,146	1,344,729

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	2,9217円	2,4314円
(1万口当たり純資産額)	(29,217円)	(24,314円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年2月25日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	31,822	554.040	17,630,660.880	
	ABBOTT LABORATORIES	118,858	39.200	4,659,233.600	
	AES CORP	47,729	10.030	478,721.870	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,956	132.800	9,954,156.800	
	ADOBE SYSTEMS INC	40,204	83.420	3,353,817.680	
	CHUBB LTD	36,008	116.180	4,183,409.440	
	AGCO CORP	6,536	47.100	307,845.600	
	AIRGAS INC	4,576	141.700	648,419.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,674	131.550	2,325,014.700	
	ENERGEN CORP	5,191	24.830	128,892.530	
	ALLEGHANY CORP	1,188	464.360	551,659.680	
	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	74,567	59.020	4,400,944.340	
	RALPH LAUREN CORP	4,294	89.960	386,288.240	
	ALLSTATE CORP	31,687	63.950	2,026,383.650	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,395	103.300	6,032,203.500	
	ALCOA INC	102,779	8.760	900,344.040	
	AMGEN INC	61,101	147.110	8,988,568.110	
	HESS CORP	20,456	41.700	853,015.200	
	AMERICAN EXPRESS CO	74,970	54.640	4,096,360.800	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	38,075	63.010	2,399,105.750	
	AFLAC INC	36,014	59.630	2,147,514.820	
	AMERICAN INTL GROUP	105,671	50.920	5,380,767.320	
	AMERCO	551	350.080	192,894.080	
	JARDEN CORP	13,598	52.430	712,943.140	
	ANALOG DEVICES	26,862	51.810	1,391,720.220	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	38,745	36.210	1,402,956.450	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,216	141.970	2,586,125.520	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	31,929	34.400	1,098,357.600	
	TIME WARNER	66,411	67.480	4,481,414.280	
	JONES LANG LASALLE INC	4,328	104.280	451,323.840	
	VALERO ENERGY CORP	41,738	60.610	2,529,740.180	
	APACHE CORP	29,768	38.600	1,149,044.800	
ANSYS INC	7,266	86.540	628,799.640		
APPLE INC	457,288	96.100	43,945,376.800		
APPLIED MATERIALS INC	92,368	18.690	1,726,357.920		
ALBEMARLE CORP	7,690	53.310	409,953.900		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,013	33.850	1,591,390.050	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	70.150	656,604.000	
AMEREN CORP	19,716	47.480	936,115.680	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	57.230	444,505.410	
ASHLAND INC	5,128	94.060	482,339.680	
AGL RESOURCES INC	8,945	64.870	580,262.150	
AUTOLIV INC	7,264	108.110	785,311.040	
AUTODESK INC	16,361	49.180	804,633.980	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,207	85.260	3,172,268.820	
AUTOZONE INC	2,371	777.830	1,844,234.930	
AVERY DENNISON CORP	9,595	64.780	621,564.100	
AVNET INC	10,288	41.220	424,071.360	
BAKER HUGHES INC	34,030	41.910	1,426,197.300	
BALL CORP	10,625	66.900	710,812.500	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	94,741	131.030	12,413,913.230	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,330	34.770	2,932,154.100	
CR BARD INC	5,892	193.910	1,142,517.720	
BAXTER INTERNATIONAL INC	41,887	38.970	1,632,336.390	
BED BATH & BEYOND INC	15,902	48.340	768,702.680	
BECTON DICKINSON & CO	15,840	147.470	2,335,924.800	
AMETEK INC	19,168	45.380	869,843.840	
BE AEROSPACE INC	7,540	42.100	317,434.000	
VERIZON COMM INC	324,572	50.820	16,494,749.040	
WR BERKLEY CORP	6,604	51.650	341,096.600	
BEST BUY CO INC	23,778	31.470	748,293.660	
YUM! BRANDS INC	35,750	71.480	2,555,410.000	
FIRSTENERGY CORP	33,061	32.700	1,081,094.700	
H&R BLOCK INC	20,906	33.490	700,141.940	
ENSCO PLC-CL A	16,993	8.280	140,702.040	
BOEING CO	52,515	115.590	6,070,208.850	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	39.280	426,030.880	
BORGWARNER INC	17,824	32.410	577,675.840	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,273	17.330	1,876,371.090	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	70.230	814,106.160	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	315.250	694,495.750	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,814	62.230	8,265,015.220	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	128.930	551,304.680	
ONEOK INC	16,401	21.520	352,949.520	
UNITED RENTALS INC	7,795	49.680	387,255.600	
SEMPRA ENERGY	18,407	98.900	1,820,452.300	

FEDEX CORP	22,217	133.490	2,965,747.330
VERISIGN INC	7,229	83.200	601,452.800
AMPHENOL CORP	27,155	52.430	1,423,736.650
BROWN-FORMAN CORP	9,485	102.360	970,884.600
QUANTA SERVICES INC	16,615	18.520	307,709.800
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	26,032	48.660	1,266,717.120
SIRIUS XM HOLDINGS INC	179,873	3.600	647,542.800
CSX CORP	85,294	24.490	2,088,850.060
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,517	32.370	502,285.290
CABOT OIL & GAS CORP	33,871	19.710	667,597.410
CAMPBELL SOUP CO	13,787	60.530	834,527.110
SEAGATE TECHNOLOGY	23,338	31.080	725,345.040
WHITING PETROLEUM CORP	15,410	3.720	57,325.200
CONSTELLATION BRANDS INC	13,276	139.080	1,846,426.080
CARDINAL HEALTH INC	26,820	82.140	2,202,994.800
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	48.030	1,559,630.160
CATERPILLAR INC	43,844	65.880	2,888,442.720
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,933	82.800	491,252.400
CELGENE CORP	63,929	102.080	6,525,872.320
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	102.630	324,208.170
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	69.580	869,054.200
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	2.690	119,990.140
CENTURYLINK INC	50,491	30.010	1,515,234.910
CERNER CORP	25,633	51.790	1,327,533.070
JPMORGAN CHASE & CO	297,973	56.140	16,728,204.220
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,603	91.620	971,446.860
CIGNA CORP	20,009	137.240	2,746,035.160
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	62.920	744,469.440
CINTAS CORP	7,454	84.210	627,701.340
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	79,229	5.300	419,913.700
CISCO SYSTEMS INC	408,218	26.320	10,744,297.760
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	7,706	34.490	265,779.940
CLOROX COMPANY	9,481	130.240	1,234,805.440
COCA-COLA CO/THE	326,767	43.910	14,348,338.970
COCA-COLA ENTERPRISES INC	16,090	49.470	795,972.300
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,256	66.320	4,526,737.920
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	16,077	67.030	1,077,641.310
COMERICA INC	13,912	33.890	471,477.680
NRG ENERGY, INC.	23,703	10.830	256,703.490

COMCAST CORP-CL A	199,126	58.400	11,628,958.400	
CA INC	26,267	29.510	775,139.170	
CONAGRA FOODS INC	34,323	41.980	1,440,879.540	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,012	71.570	1,575,398.840	
CMS ENERGY CORP	20,017	40.200	804,683.400	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,009	65.770	1,118,681.930	
COOPER COS INC	3,794	141.440	536,623.360	
MOLSON COORS BREWING CO	14,823	86.140	1,276,853.220	
CORNING INC	101,420	17.990	1,824,545.800	
SEALED AIR CORP	15,017	45.540	683,874.180	
CUMMINS INC	12,850	96.130	1,235,270.500	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	117.920	780,512.480	
DR HORTON INC	26,166	26.480	692,875.680	
DANAHER CORP	49,531	87.200	4,319,103.200	
MOODY' S CORP	16,620	86.650	1,440,123.000	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	46,508	56.190	2,613,284.520	
TARGET CORP	47,633	76.940	3,664,883.020	
DEERE & CO	27,579	79.000	2,178,741.000	
MORGAN STANLEY	110,016	23.710	2,608,479.360	
REPUBLIC SERVICES INC	18,651	46.000	857,946.000	
THE WALT DISNEY CO	128,615	95.430	12,273,729.450	
DOLLAR TREE INC	18,245	81.650	1,489,704.250	
DOVER CORP	11,617	59.780	694,464.260	
DOW CHEMICAL	86,405	47.190	4,077,451.950	
OMNICOM GROUP	20,681	76.900	1,590,368.900	
DTE ENERGY CO	14,055	86.060	1,209,573.300	
XL GROUP PLC	23,051	34.370	792,262.870	
DUKE ENERGY CORP	54,951	74.950	4,118,577.450	
FLOWSERVE CORP	9,241	41.910	387,290.310	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	63.320	597,487.520	
EBAY INC	89,434	23.960	2,142,838.640	
EMC CORP/MASS	146,656	25.430	3,729,462.080	
BANK OF AMERICA CORP	842,414	12.130	10,218,481.820	
CITIGROUP INC	244,760	38.090	9,322,908.400	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,592	63.860	740,265.120	
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,478	22.570	462,188.460	
EATON CORP PLC	38,338	56.800	2,177,598.400	
EATON VANCE CORP	9,128	27.920	254,853.760	
DISH NETWORK CORP	20,344	46.420	944,368.480	
ECOLAB INC	22,552	102.130	2,303,235.760	
ELECTRONIC ARTS INC	23,902	63.200	1,510,606.400	
SALESFORCE.COM INC	51,055	62.520	3,191,958.600	
EMERSON ELECTRIC CO	49,885	48.360	2,412,438.600	
WEATHERFORD INTL PLC	58,791	6.080	357,449.280	

ENERGY CORP	13,984	73.450	1,027,124.800
EOG RESOURCES INC	42,044	69.520	2,922,898.880
EQUIFAX INC	8,986	104.440	938,497.840
EQT CORP	12,314	57.160	703,868.240
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,769	92.020	1,727,123.380
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	45.470	649,266.130
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	52,940	69.200	3,663,448.000
EXXON MOBIL CORP	336,451	81.520	27,427,485.520
FMC CORP	9,724	36.990	359,690.760
NEXTERA ENERGY INC	34,147	116.000	3,961,052.000
ASSURANT INC	7,098	70.610	501,189.780
FASTENAL CO	25,574	44.500	1,138,043.000
FIFTH THIRD BANCORP	73,757	15.050	1,110,042.850
M&T BANK CORP	10,650	104.850	1,116,652.500
FISERV INC	20,271	98.290	1,992,436.590
FLIR SYSTEMS INC	8,840	31.240	276,161.600
MACY' S INC	29,828	42.850	1,278,129.800
FORD MOTOR CO	282,813	12.080	3,416,381.040
FRANKLIN RESOURCES INC	30,371	34.760	1,055,695.960
FREEMPORT-MCMORAN INC	85,535	7.200	615,852.000
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	10.690	474,240.470
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,532	39.650	496,893.800
TEGNA INC	14,989	24.150	361,984.350
GAP INC/THE	18,180	27.280	495,950.400
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,729	57.880	620,994.520
GENERAL DYNAMICS CORP	22,277	135.150	3,010,736.550
GENERAL MILLS INC	49,197	58.960	2,900,655.120
GENUINE PARTS CO	14,221	91.040	1,294,679.840
GILEAD SCIENCES INC	117,655	89.360	10,513,650.800
STARWOOD HOTELS&RESORTS	13,585	67.510	917,123.350
GARTNER INC	5,772	81.270	469,090.440
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	19,208	29.420	565,099.360
MCKESSON CORP	18,548	154.670	2,868,819.160
NVIDIA CORP	47,038	31.820	1,496,749.160
GENERAL ELECTRIC CO	759,442	28.960	21,993,440.320
WW GRAINGER INC	5,593	215.970	1,207,920.210
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,464	91.890	777,756.960
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	19.100	424,707.600
HALLIBURTON CO	64,473	32.460	2,092,793.580
MONSTER BEVERAGE CORP	11,657	132.400	1,543,386.800
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,674	145.560	4,756,027.440
HARLEY-DAVIDSON INC	15,057	42.140	634,501.980

HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,014	74.010	371,086.140	
HARRIS CORP	11,245	75.460	848,547.700	
HASBRO INC	8,909	75.750	674,856.750	
HENRY SCHEIN INC	6,256	167.700	1,049,131.200	
HELMERICH & PAYNE INC	7,163	51.320	367,605.160	
HERSHEY FOODS CORP	12,284	90.670	1,113,790.280	
HP INC	140,131	10.820	1,516,217.420	
F5 NETWORKS INC	5,809	94.300	547,788.700	
CROWN HOLDINGS INC NPR	9,809	45.890	450,135.010	
REYNOLDS AMERICAN INC	65,630	50.950	3,343,848.500	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	95.700	992,313.300	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	129.170	445,248.990	
JUNIPER NETWORKS INC	25,642	24.840	636,947.280	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	33.820	469,692.160	
HOLOGIC INC	18,649	34.610	645,441.890	
UNUM GROUP	23,743	27.770	659,343.110	
HOME DEPOT INC	101,869	125.610	12,795,765.090	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,610	76.340	962,647.400	
HORMEL FOODS CORP	23,322	43.710	1,019,404.620	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	18.860	602,614.720	
HUMANA INC	11,821	172.290	2,036,640.090	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	75.800	503,084.600	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	8.540	512,912.400	
RED HAT INC	14,283	65.360	933,536.880	
BIOGEN INC	18,893	257.220	4,859,657.460	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,965	94.210	2,634,582.650	
INTUIT INC	20,568	98.830	2,032,735.440	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	9,222	35.130	323,968.860	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	55.450	1,167,943.350	
INTEL CORP	383,404	29.190	11,191,562.760	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,217	106.210	766,517.570	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,541	34.710	1,094,788.110	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	37,561	21.370	802,678.570	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	38.510	358,027.470	
INCYTE CORP	12,683	74.320	942,600.560	
JOHNSON & JOHNSON	220,226	104.960	23,114,920.960	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,624	41.900	1,492,645.600	
JOHNSON CONTROLS INC	54,035	35.770	1,932,831.950	

KLA-TENCOR CORP	14,558	66.340	965,777.720
DEVON ENERGY CORP	28,689	19.410	556,853.490
KELLOGG CO	20,813	73.910	1,538,288.830
KEYCORP	66,833	10.540	704,419.820
KIMBERLY-CLARK CORP	27,934	132.350	3,697,064.900
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,284	307.980	2,859,286.320
KOHL'S CORP	15,787	45.460	717,677.020
KROGER CO	73,891	38.700	2,859,581.700
LAM RESEARCH CORP	12,091	70.480	852,173.680
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,466	47.290	400,357.140
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	54.780	787,024.260
LEGG MASON INC	6,295	27.910	175,693.450
LEGGETT & PLATT INC	12,274	44.750	549,261.500
LENNAR CORP	12,932	41.100	531,505.200
LEUCADIA NATIONAL CORP	23,605	14.620	345,105.100
ELI LILLY & CO	79,275	74.100	5,874,277.500
L BRANDS INC	19,395	83.190	1,613,470.050
LINCOLN NATIONAL CORP	18,267	35.500	648,478.500
LINEAR TECH CORP	18,324	43.340	794,162.160
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,910	96.870	5,416,001.700
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,128	37.480	1,091,717.440
LOCKHEED MARTIN CORP	22,285	216.630	4,827,599.550
LOEWS CORP	21,320	36.180	771,357.600
RANGE RESOURCES CORP	12,431	23.360	290,388.160
LOWE'S COS INC	72,969	68.620	5,007,132.780
DOMINION RESOURCES INC/VA	47,796	71.220	3,404,031.120
SCANA CORP	9,574	66.490	636,575.260
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	18.250	615,554.250
MCCORMICK & CO INC	9,163	92.900	851,242.700
MCDONALD'S CORPORATION	74,777	117.060	8,753,395.620
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	23,601	88.460	2,087,744.460
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	187.650	613,990.800
MANPOWERGROUP INC	5,703	77.490	441,925.470
MARKEL CORPORATION	1,049	866.630	909,094.870
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,526	87.790	1,450,817.540
MARSH & MCLENNAN COS	42,209	57.450	2,424,907.050
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,542	76.600	424,517.200
MASCO CORP	25,045	28.680	718,290.600
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,501	142.740	642,472.740
MATTEL INC	25,152	32.320	812,912.640

METLIFE INC	80,705	38.560	3,111,984.800
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,891	33.480	732,910.680
MEDTRONIC PLC	112,777	76.430	8,619,546.110
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,543	31.710	1,190,488.530
CVS HEALTH CORP	88,983	96.880	8,620,673.040
MERCK & CO. INC.	225,258	50.560	11,389,044.480
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,810	110.180	860,505.800
MICROSOFT CORP	608,817	51.360	31,268,841.120
MICRON TECH INC	83,952	10.640	893,249.280
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,953	43.680	653,147.040
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	9.490	293,127.120
3M CO	48,913	157.220	7,690,101.860
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,366	170.670	915,815.220
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,590	72.840	844,215.600
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	81.170	706,097.830
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	16.820	209,291.260
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,883	51.020	810,350.660
MYLAN NV	32,656	46.600	1,521,769.600
ILLUMINA INC	12,052	149.420	1,800,809.840
XCEL ENERGY INC	38,007	39.910	1,516,859.370
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,546	28.240	947,339.040
NETAPP INC	24,525	24.990	612,879.750
NEWELL RUBBERMAID INC	21,322	37.740	804,692.280
DUN & BRADSTREET CORP	4,306	93.700	403,472.200
NEWMONT MINING CORP	50,047	25.580	1,280,202.260
NIKE INC-CL B	108,387	60.400	6,546,574.800
NOBLE ENERGY INC	30,599	29.840	913,074.160
NORDSTROM INC	11,509	51.920	597,547.280
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,576	73.940	1,669,269.440
EVERSOURCE ENERGY	23,786	56.230	1,337,486.780
COACH INC	24,737	37.890	937,284.930
NORTHERN TRUST CORP	19,573	58.720	1,149,326.560
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,770	190.020	2,806,595.400
WELLS FARGO & CO	389,402	47.610	18,539,429.220
NUCOR CORP	24,612	39.020	960,360.240
MONSANTO CO	38,812	88.570	3,437,578.840
CHENIERE ENERGY INC	17,814	33.620	598,906.680
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,273	65.410	2,699,666.930
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	64,108	69.470	4,453,582.760
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	26.750	242,916.750

OGE ENERGY CORP	16,028	26.730	428,428.440
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,954	263.770	2,098,026.580
ORACLE CORP	270,567	36.630	9,910,869.210
PACCAR INC	27,939	51.170	1,429,638.630
EXELON CORP	67,643	31.750	2,147,665.250
PARKER HANNIFIN CORP	12,188	101.170	1,233,059.960
PARTNERRE LTD	3,890	140.110	545,027.900
PATTERSON COS INC	10,152	44.950	456,332.400
PAYCHEX INC	25,896	51.630	1,337,010.480
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	53.650	457,044.350
MEDNAX INC	7,106	66.510	472,620.060
PPL CORPORATION	52,418	35.930	1,883,378.740
PEPSICO INC	115,738	99.680	11,536,763.840
PENTAIR PLC	14,306	47.880	684,971.280
PFIZER INC	493,340	30.020	14,810,066.800
CONOCOPHILLIPS	97,893	32.960	3,226,553.280
PVH CORP	6,479	76.850	497,911.150
PG&E CORP	36,973	57.460	2,124,468.580
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,784	119.330	1,764,174.720
ALTRIA GROUP INC	155,451	61.360	9,538,473.360
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,993	82.300	3,456,023.900
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	87.670	436,596.600
GARMIN LTD	9,959	40.600	404,335.400
AETNA INC	28,172	106.650	3,004,543.800
FLUOR CORP (NEW)	11,793	46.140	544,129.020
PPG INDUSTRIES INC	22,588	95.680	2,161,219.840
PRAXAIR INC	24,966	101.890	2,543,785.740
COSTCO WHOLESALE CORP	34,453	153.870	5,301,283.110
T ROWE PRICE GROUP INC	23,740	68.960	1,637,110.400
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	66.070	730,469.920
PROCTER & GAMBLE CO	214,929	81.560	17,529,609.240
PROGRESSIVE CORP	45,883	31.850	1,461,373.550
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,399	43.400	1,709,916.600
PULTE GROUP INC	25,477	17.100	435,656.700
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	46,646	15.270	712,284.420
GLOBAL PAYMENTS INC	9,632	61.890	596,124.480
QUALCOMM INC	128,854	51.520	6,638,558.080
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	42.920	445,252.080
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	115.190	407,196.650
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,155	393.630	2,422,792.650

AUTONATION INC	7,394	51.340	379,607.960	
RESMED INC	11,376	57.790	657,419.040	
US BANCORP	141,917	38.440	5,455,289.480	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,021	68.790	620,554.590	
RITE AID CORP	73,930	7.950	587,743.500	
ROSS STORES INC	33,529	56.250	1,886,006.250	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,573	170.220	1,459,296.060	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,766	102.410	1,000,136.060	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,174	72.790	1,104,515.460	
RAYTHEON COMPANY	24,384	123.700	3,016,300.800	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,362	210.760	1,130,095.120	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	24.480	458,730.720	
ACCENTURE PLC-CL A	49,522	99.550	4,929,915.100	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	129,340	40.760	5,271,898.400	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,266	111.560	1,145,274.960	
SANDISK CORP	16,366	69.900	1,143,983.400	
ROCKWELL COLLINS INC	9,595	88.310	847,334.450	
ST JUDE MEDICAL INC	23,176	54.200	1,256,139.200	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,590	108.480	2,559,043.200	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	20,743	59.180	1,227,570.740	
PRICELINE GROUP INC	4,120	1,264.210	5,208,545.200	
SCHLUMBERGER LTD	104,583	72.210	7,551,938.430	
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,107	23.680	2,394,213.760	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,768	94.350	1,299,010.800	
BUNGE LTD	11,801	49.590	585,211.590	
SEI INVESTMENTS CO	13,638	38.180	520,698.840	
ANTHEM INC	20,646	130.750	2,699,464.500	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,201	87.080	1,497,863.080	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	37.130	867,022.630	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,687	259.710	1,736,680.770	
CENTENE CORP	10,224	57.270	585,528.480	
ACUITY BRANDS INC	3,145	196.750	618,778.750	
SNAP-ON INC	5,313	145.750	774,369.750	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,611	64.710	2,239,677.810	
ADVANCE AUTO PARTS	5,295	150.420	796,473.900	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	6.830	193,480.240	
EDISON INTERNATIONAL	23,842	67.830	1,617,202.860	
SOUTHERN CO	68,059	48.980	3,333,529.820	
BB&T CORP	60,610	32.000	1,939,520.000	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	41.360	568,534.560	

AT&T INC	487,453	37.100	18,084,506.300
CHEVRON CORP	153,214	85.270	13,064,557.780
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,613	93.720	1,275,810.360
STAPLES INC	58,400	9.190	536,696.000
STATE STREET CORP	31,417	54.180	1,702,173.060
STARBUCKS CORP	118,765	58.110	6,901,434.150
STRYKER CORP	27,397	99.570	2,727,919.290
NETFLIX INC	30,983	91.610	2,838,352.630
STERICYCLE INC	6,853	113.140	775,348.420
SUNTRUST BANKS INC	38,067	33.420	1,272,199.140
SYMANTEC CORP	60,158	19.290	1,160,447.820
SYNOPSIS INC	14,769	44.220	653,085.180
SYSCO CORP	43,896	43.100	1,891,917.600
INTUITIVE SURGICAL INC	2,954	553.650	1,635,482.100
TESORO CORP	9,395	78.950	741,735.250
TEXAS INSTRUMENTS INC	77,930	52.460	4,088,207.800
TEXTRON INC	21,846	34.000	742,764.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,898	129.770	4,139,403.460
TIFFANY & CO	10,305	64.940	669,206.700
TOLL BROTHERS INC	12,654	26.830	339,506.820
TORCHMARK CORP	10,414	50.640	527,364.960
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	43.700	595,936.900
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	64.140	894,496.440
TRACTOR SUPPLY CO	9,788	85.590	837,754.920
TRIMBLE NAVIGATION LTD	19,110	22.920	438,001.200
TYSON FOODS INC	24,887	65.380	1,627,112.060
MARATHON OIL CORP	52,743	7.220	380,804.460
UNION PACIFIC CORP	71,455	80.090	5,722,830.950
UNITED TECHNOLOGIES CORP	69,845	93.610	6,538,190.450
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,643	120.200	9,092,288.600
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	110.660	823,421.060
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	77.590	643,686.640
VF CORP	25,690	63.230	1,624,378.700
CBS CORP	33,562	47.480	1,593,523.760
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,746	86.770	1,626,590.420
VULCAN MATERIALS CO	11,687	97.350	1,137,729.450
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70,222	79.430	5,577,733.460
WAL-MART STORES INC	129,153	67.120	8,668,749.360
WASTE MANAGEMENT INC	34,984	56.090	1,962,252.560
WATERS CORP	6,779	120.760	818,632.040

ALLERGAN PLC	31,565	284.700	8,986,555.500
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,264	127.760	1,183,568.640
WESTERN DIGITAL CORP	18,200	43.920	799,344.000
WABTEC CORP	7,250	67.390	488,577.500
WHIRLPOOL CORP	6,288	151.280	951,248.640
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,061	63.710	959,536.310
WYNN RESORTS LTD	6,279	79.670	500,247.930
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	30.720	892,569.600
NASDAQ INC	9,132	63.660	581,343.120
CME GROUP INC	26,133	92.300	2,412,075.900
WILLIAMS COS INC	53,337	16.630	886,994.310
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,927	42.020	249,052.540
LKQ CORP	25,910	25.940	672,105.400
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	26.530	482,713.350
ALLIANT ENERGY CORP	11,212	69.170	775,534.040
WEC ENERGY GROUP INC	24,880	57.390	1,427,863.200
FOOT LOCKER INC	11,034	66.770	736,740.180
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,310	27.800	592,418.000
CARMAX INC	18,912	45.190	854,633.280
XEROX CORP	98,308	9.570	940,807.560
XILINX INC	20,017	47.580	952,408.860
YAHOO! INC	66,184	30.950	2,048,394.800
CIMAREX ENERGY CO	10,340	84.880	877,659.200
TJX COMPANIES INC	52,219	74.240	3,876,738.560
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,700	5.850	378,495.000
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,740	58.020	333,034.800
SIGNATURE BANK	3,706	128.310	475,516.860
CBRE GROUP INC	21,235	25.270	536,608.450
LIBERTY GLOBAL PLC	23,599	37.200	877,882.800
REGIONS FINANCIAL CORP	122,830	7.420	911,398.600
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,417	41.880	184,983.960
T-MOBILE US INC	23,522	36.780	865,139.160
LAS VEGAS SANDS CORP	35,011	46.920	1,642,716.120
MEDIVATION INC	12,474	32.040	399,666.960
MOSAIC CO/THE	25,355	24.970	633,114.350
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	27.330	985,984.410
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	90,569	27.320	2,474,345.080
CELANESE CORP	11,777	59.220	697,433.940
IHS INC-CLASS A	5,758	101.650	585,300.700
DISCOVERY COMMUNICATIONS- A	9,144	25.200	230,428.800

EXPEDIA INC	10,401	104.400	1,085,864.400	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,719	31.750	562,578.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,346	83.430	1,280,316.780	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	48,706	36.110	1,758,773.660	
GAMESTOP CORP. - CL. A	8,633	29.890	258,040.370	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,531	244.330	2,328,709.230	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,591	82.150	1,116,500.650	
VIACOM INC-CLASS B	27,414	37.220	1,020,349.080	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,433	514.860	1,252,654.380	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	56.260	391,625.860	
TRANSDIGM GROUP INC	4,845	214.260	1,038,089.700	
MASTERCARD INC	80,766	86.420	6,979,797.720	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	38,306	25.950	994,040.700	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	8,473	70.680	598,871.640	
HANESBRANDS INC	32,964	27.620	910,465.680	
WESTERN UNION CO	41,207	18.130	747,082.910	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	27,621	7.470	206,328.870	
AERCAP HOLDINGS NV	13,624	34.150	465,259.600	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	15,025	15.900	238,897.500	
SPECTRA ENERGY CORP	52,852	28.680	1,515,795.360	
TIME WARNER CABLE INC	22,777	189.860	4,324,441.220	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	40,198	14.560	585,282.880	
DELTA AIR LINES INC	17,228	48.940	843,138.320	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,680	17.920	155,545.600	
DISCOVER FINANCIAL	32,943	46.710	1,538,767.530	
TE CONNECTIVITY LTD	34,756	57.040	1,982,482.240	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	12,877	91.540	1,178,760.580	
WABCO HOLDING INC	4,395	95.000	417,525.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	60.810	467,020.800	
VMWARE INC	8,246	49.190	405,620.740	
TERADATA CORP	12,117	24.690	299,168.730	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	160.750	788,800.250	
INVESCO LTD	34,162	26.170	894,019.540	
NETSUITE INC	3,281	55.260	181,308.060	
CALPINE CORP NPR	26,738	12.560	335,829.280	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,555	91.460	11,300,340.300	
VISA INC	155,937	71.850	11,204,073.450	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,201	92.670	1,501,346.670	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,027	66.690	868,770.630	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,702	57.950	272,480.900	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	97.970	597,127.150	
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	21,028	24.820	521,914.960	
MARATHON PETROLEUM CORP	46,329	33.970	1,573,796.130	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	14,093	51.070	719,729.510	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	141,646	17.710	2,508,550.660	
XYLEM INC	17,859	37.470	669,176.730	
ALKERMES PLC	11,218	34.070	382,197.260	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	30,416	78.250	2,380,052.000	
LINKEDIN CORP	9,511	117.700	1,119,444.700	
SPLUNK INC	9,277	36.580	339,352.660	
HCA HOLDINGS INC	27,659	70.140	1,940,002.260	
VERISK ANALYTICS INC	13,563	71.650	971,788.950	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	121.830	593,799.420	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,223	128.120	797,290.760	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,369	72.680	1,262,378.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,944	59.770	654,122.880	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,182	175.790	1,086,733.780	
CIT GROUP INC	13,340	28.620	381,790.800	
NXP SEMICONDUCTOR NV	11,421	70.010	799,584.210	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	562,500	0.460	258,750.000	
LEAR CORP	6,259	98.440	616,135.960	
DOLLAR GENERAL CORP	23,585	75.080	1,770,761.800	
FORTINET INC	10,861	27.300	296,505.300	
AON PLC	21,841	94.660	2,067,469.060	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	30.100	345,066.400	
TESLA MOTORS INC	7,097	179.000	1,270,363.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,990	34.070	408,499.300	
GENERAL MOTORS CO	120,253	28.840	3,468,096.520	
VANTIV INC	12,141	51.450	624,654.450	

TRIPADVISOR INC	9,263	60.660	561,893.580
ALLY FINANCIAL INC	42,461	17.180	729,479.980
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,570	55.440	918,640.800
VOYA FINANCIAL INC	16,634	28.800	479,059.200
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	25,937	63.690	1,651,927.530
PHILLIPS 66	40,891	79.090	3,234,069.190
LIBERTY MEDIA CORP	5,006	34.430	172,356.580
FACEBOOK INC	171,240	106.880	18,302,131.200
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	7,204	62.100	447,368.400
ADT CORP	11,734	40.090	470,416.060
SERVICENOW INC	10,829	52.550	569,063.950
WHITEWAVE FOODS CO	12,239	38.180	467,285.020
PALO ALTO NETWORKS INC	5,614	127.940	718,255.160
TABLEAU SOFTWARE INC	5,133	42.070	215,945.310
WORKDAY INC	7,948	57.560	457,486.880
ABBVIE INC	133,635	54.890	7,335,225.150
ZOETIS INC	39,109	42.370	1,657,048.330
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,645	47.900	605,695.500
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	10.790	357,213.740
MALLINCKRODT PLC	9,419	66.260	624,102.940
CDW CORP	10,726	38.900	417,241.400
SPRINT CORP	57,295	3.050	174,749.750
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	19,598	21.990	430,960.020
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,283	40.660	580,746.780
FIREEYE INC	8,532	15.410	131,478.120
BROADCOM LTD	23,711	130.340	3,090,491.740
ANTERO RESOURCES CORP	8,460	24.040	203,378.400
TWITTER INC	43,632	18.000	785,376.000
PLAINS GP HOLDINGS LP	16,533	7.070	116,888.310
PERRIGO CO PLC	12,194	126.260	1,539,614.440
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	36,830	19.890	732,548.700
ARAMARK	20,586	30.780	633,637.080
IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,407	25.920	321,589.440
SABRE CORP	17,624	27.260	480,430.240
NAVIENT CORP	28,699	10.290	295,312.710
FNF GROUP	18,087	32.910	595,243.170
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	33.570	615,338.100
SYNCHRONY FINANCIAL	64,620	27.730	1,791,912.600
MOBILEYE NV	12,750	29.230	372,682.500
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	44,329	19.000	842,251.000

	CDK GLOBAL INC	9,646	43.390	418,539.940	
	QORVO INC	12,235	42.170	515,949.950	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,524	24.940	312,348.560	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	29,438	49.450	1,455,709.100	
	WESTROCK CO	19,981	32.310	645,586.110	
	KRAFT HEINZ CO	48,703	72.990	3,554,831.970	
	ALPHABET INC-CL A	22,941	720.900	16,538,166.900	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	140,131	13.530	1,895,972.430	
	PAYPAL HOLDINGS INC	89,501	36.470	3,264,101.470	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	20.200	164,306.800	
	ALPHABET INC-CL C	25,028	699.560	17,508,587.680	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	25,231	17.260	435,487.060	
	BAXALTA INC	48,546	38.980	1,892,323.080	
	アメリカ・ドル 小計	25,906,673		1,379,825,687.880 (154,775,047,410)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.270	161,944.070	
	AMEC FOSTER WHEELER PLC	28,599	3.276	93,690.320	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	4.765	123,437.320	
	ASHTED GROUP	38,160	8.650	330,084.000	
	SEVERN TRENT PLC	19,770	21.250	420,112.500	
	BHP BILLITON PLC	160,521	6.843	1,098,445.200	
	BARCLAYS PLC	1,270,807	1.567	1,991,354.560	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	95,491	5.715	545,731.060	
	BT GROUP PLC	681,176	4.584	3,122,510.780	
	SKY PLC	82,222	10.060	827,153.320	
	AGGREKO PLC	18,550	8.435	156,469.250	
	BUNZL PLC	26,929	19.120	514,882.480	
	EASYJET PLC	13,628	15.140	206,327.920	
	CAPITA PLC	50,523	10.720	541,606.560	
	AVIVA PLC	299,716	4.125	1,236,328.500	
	CRODA INTERNATIONAL	9,774	29.590	289,212.660	
	DIAGEO PLC	202,256	18.685	3,779,153.360	
	SCHRODERS PLC	10,331	24.730	255,485.630	
	NATIONAL GRID PLC	300,529	9.553	2,870,953.530	
	GKN PLC	134,097	2.624	351,870.520	
	KINGFISHER PLC	196,101	3.247	636,739.940	
	BAE SYSTEMS PLC	245,770	5.035	1,237,451.950	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,370	32.250	366,682.500	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	150,176	38.340	5,757,747.840	
	COBHAM PLC	88,449	2.493	220,503.350	
	NEXT PLC	10,966	67.000	734,722.000	
	REXAM PLC	54,770	6.070	332,453.900	
	IMPERIAL BRANDS PLC	77,589	37.180	2,884,759.020	

IMI PLC	22,272	8.490	189,089.280
JOHNSON MATTHEY PLC	13,463	24.260	326,612.380
SABMILLER PLC	77,950	41.665	3,247,786.750
ANGLO AMERICAN PLC	109,290	4.097	447,761.130
COMPASS GROUP PLC	125,596	12.240	1,537,295.040
HSBC HOLDINGS PLC	1,590,588	4.338	6,899,970.740
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.138	989,259.010
ARM HOLDINGS PLC	120,951	9.400	1,136,939.400
CENTRICA PLC	444,241	2.045	908,472.840
UNILEVER PLC	102,250	30.380	3,106,355.000
MEGGITT PLC	54,676	4.037	220,727.010
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	228,774	1.838	420,486.610
UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,266	9.170	488,449.220
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	3.945	288,722.710
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,749	33.210	921,544.290
PEARSON PLC	65,464	7.685	503,090.840
PERSIMMON PLC	23,150	20.750	480,362.500
PRUDENTIAL PLC	197,057	11.870	2,339,066.590
RIO TINTO PLC	110,210	18.740	2,065,335.400
VODAFONE GROUP PLC	2,081,451	2.108	4,387,698.700
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,222	65.200	3,274,474.400
RELX PLC	91,193	12.170	1,109,818.810
OLD MUTUAL PLC	389,986	1.656	645,816.810
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	145,152	6.535	948,568.320
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	259,456	2.321	602,197.370
ST JAMES' S PLACE PLC	41,514	8.565	355,567.410
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	17.150	341,199.250
SSE PLC	76,640	13.620	1,043,836.800
BP PLC	1,435,182	3.350	4,807,859.700
SHIRE PLC	48,495	37.890	1,837,475.550
SAGE GROUP PLC (THE)	85,271	5.680	484,339.280
SMITHS GROUP PLC	27,324	9.490	259,304.760
STANDARD CHARTERED PLC	245,759	3.891	956,248.260
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,735,568	0.622	2,945,523.290
TATE & LYLE PLC	39,915	5.670	226,318.050
TAYLOR WIMPLEY PLC	306,496	1.776	544,336.890
TESCO PLC	631,592	1.767	1,116,023.060
3I GROUP PLC	70,216	4.250	298,418.000
SMITH & NEPHEW PLC	74,628	11.460	855,236.880
GLAXOSMITHKLINE PLC	393,536	13.605	5,354,057.280

WEIR GROUP	18,336	9.020	165,390.720	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,036	25.320	633,911.520	
BABCOCK INT'L GROUP	15,650	8.980	140,537.000	
WPP PLC	108,159	14.630	1,582,366.170	
WOLSELEY PLC	23,413	35.640	834,439.320	
ASTRAZENECA PLC	101,390	40.865	4,143,302.350	
WHITBREAD PLC	13,806	37.500	517,725.000	
CARNIVAL PLC	14,275	34.250	488,918.750	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	147,471	4.120	607,580.520	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	28.810	387,379.260	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.969	238,517.050	
BURBERRY GROUP PLC	36,044	11.800	425,319.200	
INVESTEC PLC	50,655	4.532	229,568.460	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	24.860	444,546.520	
ICAP PLC	36,584	4.068	148,823.710	
ITV PLC	328,003	2.475	811,807.420	
SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.476	220,794.820	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	66.500	576,754.500	
G4S PLC	124,374	2.009	249,867.360	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	17.340	275,584.620	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	307,710	15.450	4,754,119.500	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	305,983	15.475	4,735,086.920	
INMARSAT PLC	34,127	9.670	330,008.090	
PETROFAC LTD	21,025	7.775	163,469.370	
TUI AG-DI	19,394	10.400	201,697.600	
STANDARD LIFE PLC	194,084	3.171	615,440.360	
EXPERIAN PLC	83,009	11.500	954,603.500	
MONDI PLC	25,855	12.660	327,324.300	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	21,006	3.821	80,263.920	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	12.240	260,589.600	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	9.925	155,217.070	
GLENCORE PLC	927,273	1.163	1,078,418.490	
DIXONS CARPHONE PLC	84,639	4.195	355,060.600	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	98,404	3.735	367,538.940	
COCA-COLA HBC AG	13,406	13.850	185,673.100	
ROYAL MAIL PLC	79,209	4.426	350,579.030	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	71,339	4.347	310,110.630	
AUTO TRADER GROUP PLC	58,105	3.590	208,596.950	
イギリス・ポンド 小計	23,157,700		118,556,391.890 (18,513,766,157)	

イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,152	18.700	1,910,242.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	13.230	1,644,092.100	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	8.650	1,628,189.500	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	38,983	15.050	586,694.150	
	NICE SYSTEMS LTD	3,882	233.800	907,611.600	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	72,855	221.800	16,159,239.000	
イスラエル・シュケル 小計		530,372		22,836,068.750 (654,025,009)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,312	62.300	891,637.600	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,911	22.320	4,886,093.520	
	AMCOR LTD	105,429	13.880	1,463,354.520	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	274,473	28.490	7,819,735.770	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	10.690	360,274.380	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	2.000	298,412.000	
	TELSTRA CORP LTD	328,099	5.160	1,692,990.840	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	8.450	269,335.300	
	AMP LTD	240,810	5.440	1,310,006.400	
	ASX LTD	23,079	41.230	951,547.170	
	BHP BILLITON LTD	246,516	16.180	3,988,628.880	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	27,545	35.670	982,530.150	
	COMPUTERSHARE LT	34,030	8.940	304,228.200	
	CSL LIMITED	37,056	100.950	3,740,803.200	
	REA GROUP LTD	4,119	49.910	205,579.290	
	TRANSURBAN GROUP	179,333	11.230	2,013,909.590	
	COCA-COLA AMATIL LTD	35,256	8.450	297,913.200	
	COCHLEAR LTD	5,226	103.910	543,033.660	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,102	4.070	537,655.140	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	138,660	71.260	9,880,911.600	
	BORAL LIMITED	43,430	5.800	251,894.000	
	RIO TINTO LIMITED	42,724	42.020	1,795,262.480	
	APA GROUP	87,434	8.850	773,790.900	
	ARISTOCRAT LEISU	40,226	9.880	397,432.880	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,933	5.420	1,213,716.860	
	TPG TELECOM LTD	12,142	10.120	122,877.040	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	17.390	622,388.100		
ORICA LTD	34,301	13.840	474,725.840		

	CIMIC GROUP LTD	7,290	30.670	223,584.300	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.410	545,683.300	
	MACQUARIE GROUP LTD	23,603	64.000	1,510,592.000	
	SUNCORP GROUP LTD	103,375	11.360	1,174,340.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	199,962	24.490	4,897,069.380	
	NEWCREST MINING LTD	57,418	16.560	950,842.080	
	OIL SEARCH LTD	103,413	6.660	688,730.580	
	INCITEC PIVOT LTD	112,083	2.900	325,040.700	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	11.020	1,169,629.740	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	44,294	7.540	333,976.760	
	SANTOS LTD	133,862	3.130	418,988.060	
	SONIC HEALTHCARE	33,734	17.870	602,826.580	
	TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.350	307,875.600	
	WESFARMERS LTD	87,657	41.500	3,637,765.500	
	ALUMINA LIMITED	184,613	1.255	231,689.310	
	ILUKA RESOURCES LIMI	45,912	6.510	298,887.120	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	26.970	1,562,183.310	
	WOOLWORTHS LTD	107,196	22.330	2,393,686.680	
	DUET GROUP	170,429	2.290	390,282.410	
	SEEK LTD	29,830	13.330	397,633.900	
	TATTS GROUP LTD	109,937	4.050	445,244.850	
	AUSNET SERVICES	122,966	1.445	177,685.870	
	AGL ENERGY LTD	48,662	18.200	885,648.400	
	BRAMBLES LTD	123,431	11.800	1,456,485.800	
	ASCIANO LTD	47,166	9.010	424,965.660	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.550	412,405.550	
	AURIZON HOLDINGS LTD	180,471	4.010	723,688.710	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	9.370	598,949.140	
	HEALTHSCOPE LTD	120,242	2.400	288,580.800	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.490	584,774.010	
	SOUTH32 LTD (AUD)	432,027	1.130	488,190.510	
	オーストラリア・ドル 小計	6,060,889		76,638,595.120 (6,171,706,066)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	13,502	48.210	650,931.420	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	34,037	60.130	2,046,644.810	
	BARRICK GOLD CORP	89,708	18.400	1,650,627.200	
	ATCO LTD	7,193	37.800	271,895.400	
	BANK OF MONTREAL	53,681	73.190	3,928,912.390	
	BANK OF NOVA SCOTIA	93,334	53.570	4,999,902.380	
	NATIONAL BANK OF CANADA	33,308	36.350	1,210,745.800	
	BCE INC	9,856	58.420	575,787.520	

BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	76,037	42.050	3,197,355.850	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,546	115.420	2,948,519.320	
SAPUTO INC	20,680	38.400	794,112.000	
BLACKBERRY LTD	38,780	10.060	390,126.800	
CGI GROUP INC	17,094	57.000	974,358.000	
CCL INDUSTRIES INC	2,207	196.740	434,205.180	
CAE INC	17,352	14.890	258,371.280	
CAMECO CORP	29,078	16.600	482,694.800	
ROGERS COMM-CL B	29,459	49.810	1,467,352.790	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,622	87.450	2,940,243.900	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	80,262	27.330	2,193,560.460	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,911	129.000	762,519.000	
CANADIAN UTILITIES LTD	15,398	34.260	527,535.480	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,409	78.870	4,764,457.830	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.720	225,143.240	
AGRIUM INC	9,963	112.680	1,122,630.840	
YAMANA GOLD INC	67,520	3.760	253,875.200	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	34.810	652,965.980	
OPEN TEXT CORP	8,895	66.890	594,986.550	
ELDORADO GOLD CORP	46,790	3.880	181,545.200	
EMPIRE CO LTD	15,093	25.660	387,286.380	
KINROSS GOLD CORP	125,461	4.340	544,500.740	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	17.990	308,708.400	
FORTIS INC	20,884	38.010	793,800.840	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	4.470	212,034.450	
TELUS CORP	18,945	40.040	758,557.800	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	34.530	857,621.610	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	42.930	982,367.190	
ENBRIDGE INC	65,595	43.160	2,831,080.200	
IGM FINANCIAL INC	8,010	34.990	280,269.900	
JEAN COUTU GROUP INC	3,791	20.860	79,080.260	
MANULIFE FINANCIAL CORP	165,426	17.180	2,842,018.680	
LINAMAR CORP	3,827	56.250	215,268.750	
LOBLAW CO LTD	17,936	67.540	1,211,397.440	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	35.920	345,909.600	
MAGNA INTERNATIONAL INC	38,264	47.620	1,822,131.680	
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,005	39.630	2,100,588.150	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,614	726.000	1,171,764.000	
METRO INC	16,790	42.480	713,239.200	

HUSKY ENERGY INC	27,568	13.560	373,822.080	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	16.310	602,165.200	
METHANEX CORP	7,381	40.690	300,332.890	
ONEX CORP	6,646	82.080	545,503.680	
GOLDCORP INC	67,652	21.610	1,461,959.720	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	65,526	22.660	1,484,819.160	
POWER CORP OF CANADA	38,592	28.400	1,096,012.800	
POWER FINANCIAL CORP	18,286	30.730	561,928.780	
ROYAL BANK OF CANADA	120,016	67.810	8,138,284.960	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,939	42.240	504,303.360	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,142	164.790	1,836,090.180	
SHAW COMM INC-B	29,011	23.530	682,628.830	
SUNCOR ENERGY INC	124,823	33.020	4,121,655.460	
ENCANA CORP	59,596	5.090	303,343.640	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	7.670	335,048.610	
THOMSON REUTERS CORP	26,087	50.070	1,306,176.090	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	150,826	51.230	7,726,815.980	
TRANSCANADA CORP	63,774	50.790	3,239,081.460	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,200	39.360	165,312.000	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	108.730	515,706.390	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	85.360	914,888.480	
SILVER WHEATON CORP	28,408	21.640	614,749.120	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	555.810	830,380.140	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	11,057	81.180	897,607.260	
CI FINANCIAL CORP	16,683	29.210	487,310.430	
VERESEN INC	17,460	7.420	129,553.200	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	25.570	403,469.030	
KEYERA CORP	13,728	37.120	509,583.360	
ALTAGAS LTD	12,358	33.220	410,532.760	
PEMBINA PIPELINE CORP	24,082	32.870	791,575.340	
DOLLARAMA INC	9,286	78.630	730,158.180	
CENOVUS ENERGY INC W/I	68,440	14.520	993,748.800	
VERMILION ENERGY INC	8,291	35.740	296,320.340	
ARC RESOURCES LTD	30,676	18.070	554,315.320	
CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	9.170	433,071.590	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	29.310	327,334.080	
ELEMENT FINANCIAL CORP	30,631	14.280	437,410.680	
INTER PIPELINE LTD	29,717	23.800	707,264.600	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,330	20.390	190,238.700	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	12,162	15.790	192,037.980	

	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	45.430	748,277.530	
カナダ・ドル 小計		2,969,960		105,860,450.080 (8,661,502,027)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	2.770	346,250.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	92,000	2.630	241,960.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.710	458,927.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.375	259,552.500	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	148,700	13.400	1,992,580.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	7.040	260,480.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	36.080	369,603.520	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	57,800	7.120	411,536.000	
	CAPITALAND LTD	184,415	2.860	527,426.900	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.735	429,534.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	5.050	537,825.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	135,400	2.890	391,306.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	239,253	8.020	1,918,809.060	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	626,022	3.640	2,278,720.080	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.420	542,450.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	17.010	1,607,445.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	220,600	3.090	681,654.000	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	389,100	0.940	365,754.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	1.730	493,050.000		
シンガポール・ドル 小計		4,199,274		14,114,863.060 (1,128,059,856)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	137,671	12.700	1,748,421.700	
	SYNGENTA AG	7,721	391.700	3,024,315.700	
	NESTLE SA-REGISTERED	254,437	69.400	17,657,927.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	44,767	61.500	2,753,170.500	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	56,244	252.100	14,179,112.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	163.400	579,743.200	
	SIKA INHABER	157	3,695.000	580,115.000	
	SGS SA-REG	533	1,966.000	1,047,878.000	
	SULZER AG-REG	683	91.700	62,631.100	
	NOVARTIS AG-REG SHS	182,822	72.250	13,208,889.500	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,687	121.400	447,601.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	232	1,062.000	246,384.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,105	471.500	992,507.500	

ABB LTD	168,155	17.210	2,893,947.550	
ADECCO SA-REG	11,997	56.950	683,229.150	
GEBERIT AG	3,062	350.700	1,073,843.400	
LONZA GROUP AG-REG	3,997	145.100	579,964.700	
LINDT & SPRUENGLI PART	65	5,620.000	365,300.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	67,485.000	607,365.000	
GIVAUDAN-REG	795	1,841.000	1,463,595.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,988	203.500	2,643,058.000	
LAFARGEHOLCIM LTD	18,410	35.810	659,262.100	
ACTELION	8,330	134.300	1,118,719.000	
SONOVA HOLDING AG	4,519	116.800	527,819.200	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	129.100	574,882.300	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,193	326.300	715,575.900	
THE SWATCH GROUP AG-REG	6,655	65.100	433,240.500	
SCHINDLER NAMEN	1,663	164.300	273,230.900	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,263	233.100	527,505.300	
GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,431.000	436,455.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	808	466.000	376,528.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	81.400	487,586.000	
DUFREY GROUP	3,162	101.100	319,678.200	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,056	353.750	373,560.000	
ARYZTA AG	5,959	45.090	268,691.310	
JULIUS BAER GROUP LTD	17,617	39.010	687,239.170	
SWISS RE LTD	28,457	88.000	2,504,216.000	
TRANSOCEAN LTD	26,823	7.690	206,268.870	
UBS GROUP AG	287,690	14.560	4,188,766.400	
スイス・フラン 小計	1,322,028		81,518,225.150 (9,240,906,003)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	47,392	188.600	8,938,131.200	
ATLAS COPCO AB-B SHS	33,729	176.400	5,949,795.600	
ERICSSON LM-B SHS	264,062	77.050	20,345,977.100	
GETINGE AB-B SHS	19,578	182.700	3,576,900.600	
SKF AB-B SHS	32,306	140.300	4,532,531.800	
SANDVIK AB	77,917	75.600	5,890,525.200	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	110,157	81.550	8,983,303.350	
SKANSKA AB-B SHS	26,640	169.700	4,520,808.000	
SWEDBANK AB	70,859	168.100	11,911,397.900	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	50,376	249.000	12,543,624.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	107.600	12,794,608.400	
VOLVO AB-B SHS	118,487	83.300	9,869,967.100	
SWEDISH MATCH AB	19,509	268.700	5,242,068.300	
TELE2 AB-B SHS	24,305	68.600	1,667,323.000	

	NORDEA AB	227,871	82.350	18,765,176.850	
	INDUSTRIVARDEN C	10,813	132.000	1,427,316.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	187.500	3,243,000.000	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	124.000	3,380,364.000	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	275.600	9,884,394.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	78,662	271.400	21,348,866.800	
	ASSA ABLOY AB-B	85,163	158.900	13,532,400.700	
	TELIASONERA AB	194,938	38.360	7,477,821.680	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	129.500	2,273,372.500	
	BOLIDEN AB	17,761	122.000	2,166,842.000	
	ALFA LAVAL AB	24,553	130.400	3,201,711.200	
	KINNEVIK INVESTMENT B	18,310	207.500	3,799,325.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	387.000	1,991,115.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	249.700	1,478,224.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	52.150	1,621,187.050	
	HEXAGON AB	18,226	284.600	5,187,119.600	
スウェーデン・クローナ 小計		1,830,652		217,545,197.930 (2,873,772,064)	
デンマーク・クロ ーネ	CARLSBERG AS-B	7,563	581.500	4,397,884.500	
	A P MOLLER A/S	550	8,125.000	4,468,750.000	
	AP MOLLER MAERSK A	291	7,910.000	2,301,810.000	
	DANSKE BANK A/S	60,349	181.000	10,923,169.000	
	NOVOZYMES-B SHS	16,988	291.800	4,957,098.400	
	NOVO NORDISK A/S-B	157,144	341.000	53,586,104.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,857	448.000	7,999,936.000	
	TDC A/S	70,447	28.890	2,035,213.830	
	COLOPLAST-B	8,513	514.500	4,379,938.500	
	DSV A/S	14,315	273.800	3,919,447.000	
	WILLIAM DEMANT	2,595	568.000	1,473,960.000	
	TRYG A/S	11,107	122.300	1,358,386.100	
	PANDORA A/S	8,054	828.000	6,668,712.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	411.800	3,174,154.400	
ISS A/S	14,618	237.200	3,467,389.600		
デンマーク・クローナ 小計		398,099		115,111,953.330 (1,906,253,948)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.245	611,960.040	
	CONTACT ENERGY L	64,605	4.530	292,660.650	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	6.900	510,544.800	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	149,990	3.460	518,965.400	
ニュージーランド・ドル 小計		386,579		1,934,130.890 (144,595,625)	
ノルウェー・クロ ーネ	DNB ASA	68,855	94.750	6,524,011.250	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	32.530	3,482,726.860	

	TELENOR ASA	60,554	125.700	7,611,637.800	
	SCHIBSTED ASA	5,731	231.300	1,325,580.300	
	ORKLA ASA	77,644	71.050	5,516,606.200	
	STATOIL ASA	88,513	116.100	10,276,359.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	17,756	325.600	5,781,353.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,642	133.500	1,821,207.000	
	SCHIBSTED ASA	6,671	222.000	1,480,962.000	
ノルウェー・クローネ 小計		446,428		43,820,444.310 (567,036,549)	
ユーロ	CRH PLC	74,912	22.420	1,679,527.040	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	129.650	809,793.900	
	KERRY GROUP PLC-A	11,920	76.420	910,926.400	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.239	525,474.240	
	UMICORE	6,363	40.005	254,551.810	
	AIR LIQUIDE	26,318	92.840	2,443,363.120	
	AIRBUS GROUP SE	44,733	54.950	2,458,078.350	
	AXA	150,698	19.500	2,938,611.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,227	21.180	767,287.860	
	ADIDAS AG	16,367	96.490	1,579,251.830	
	ASSICURAZIONI GENERALI	99,122	11.980	1,187,481.560	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	39,703	13.025	517,131.570	
	DANONE	47,942	62.640	3,003,086.880	
	SAFRAN SA	25,619	54.760	1,402,896.440	
	INTESA SANPAOLO	1,029,888	2.260	2,327,546.880	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	2.114	237,751.010	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,541	70.200	1,933,378.200	
	ACCOR SA	14,860	35.315	524,780.900	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	31.235	185,317.250	
	BOUYGUES	15,864	34.675	550,084.200	
	BNP PARIBAS	81,517	39.920	3,254,158.640	
	RELX NV	80,368	14.670	1,178,998.560	
	THALES SA	8,128	71.310	579,607.680	
	CAP GEMINI SA	15,271	73.770	1,126,541.670	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	40.225	165,284.520	
	CHRISTIAN DIOR SE	4,128	158.650	654,907.200	
	INGENICO GROUP	4,239	91.000	385,749.000	
	UNICREDIT SPA	354,830	3.274	1,161,713.420	
	NATIXIS	70,166	4.521	317,220.480	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,718	42.945	589,119.510	
	DELHAIZE GROUP	8,529	90.540	772,215.660	
	COMMERZBANK AG	80,064	7.054	564,771.450	
FRESENIUS SE & CO KGAA	29,762	59.710	1,777,089.020		
UNITED INTERNET	12,876	42.850	551,736.600		

FUCHS PETROLUB SE PREF	4,422	36.340	160,695.480
PUBLICIS GROUPE	14,367	55.600	798,805.200
MAN SE	3,396	93.850	318,714.600
IBERDROLA SA	440,361	5.869	2,584,478.700
ENI SPA	193,698	11.780	2,281,762.440
IMERYS SA	2,738	54.150	148,262.700
JERONIMO MARTINS	19,517	12.625	246,402.120
KBC GROUPE	17,923	46.000	824,458.000
HANNOVER RUECK SE	4,399	92.420	406,555.580
WARTSILA OYJ	11,298	37.110	419,268.780
L'OREAL	19,100	154.250	2,946,175.000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,488	148.500	3,190,968.000
LAGARDERE S. C. A.	14,725	26.435	389,255.370
GEA GROUP AG	18,086	39.390	712,407.540
BOLLORE	76,431	3.471	265,292.000
MEDIOBANCA SPA	42,404	5.995	254,211.980
MICHELIN(CGDE)-B	14,584	82.830	1,207,992.720
CONTINENTAL AG	8,194	178.500	1,462,629.000
DEUTSCHE POST AG-REG	75,581	20.915	1,580,776.610
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	32.030	301,049.970
AXEL SPRINGER SE	3,067	45.145	138,459.710
OMV AG	9,779	23.225	227,117.270
PERNOD-RICARD	18,470	97.070	1,792,882.900
PEUGEOT SA	33,969	13.865	470,980.180
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,007	38.790	465,751.530
RENAULT SA	14,323	77.940	1,116,334.620
REPSOL SA	78,034	8.581	669,609.750
REMY COINTREAU	905	62.400	56,472.000
MERCK KGAA	9,627	75.000	722,025.000
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	65,276	103.750	6,772,385.000
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,989	34.755	1,250,797.690
SAIPEM	12,974	0.350	4,540.900
RWE AG	41,149	10.165	418,279.580
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400
LUXOTTICA GROUP SPA	13,658	51.600	704,752.800
SOCIETE GENERALE-A	59,007	29.920	1,765,489.440
VINCI S. A.	36,668	62.370	2,286,983.160
SODEXO	7,368	89.200	657,225.600
SOLVAY SA	5,034	77.910	392,198.940
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,735	51.480	2,148,517.800
VIVENDI SA	90,768	18.025	1,636,093.200
SAP SE	80,396	68.000	5,466,928.000
TECHNIP-COFLEXIP S. A.	6,985	38.355	267,909.670

TELEFONICA S. A	380,757	8.967	3,414,248.010
TOTAL SA	170,265	39.135	6,663,320.770
VALEO	7,056	120.650	851,306.400
E. ON SE	182,365	8.241	1,502,869.960
VOEST-ALPINE AG	9,875	25.575	252,553.120
ZODIAC AEROSPACE	15,282	19.430	296,929.260
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	81.930	705,745.020
METRO AG	15,629	21.870	341,806.230
SIEMENS AG-REG	62,794	82.490	5,179,877.060
UPM-KYMMENE OYJ	38,638	15.090	583,047.420
ING GROEP NV-CVA	296,220	10.115	2,996,265.300
BAYER AG	64,911	94.790	6,152,913.690
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	7.370	328,783.070
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,837	95.310	1,414,114.470
DAIMLER AG	73,572	60.280	4,434,920.160
BASF SE	73,655	58.070	4,277,145.850
BEIERSDORF AG	9,149	78.920	722,039.080
HEIDELBERGCEMENT AG	10,251	64.380	659,959.380
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,988	73.730	1,326,255.240
ORANGE	148,319	15.555	2,307,102.040
SAMPO OYJ-A SHS	33,916	41.000	1,390,556.000
RANDSTAD HOLDINGS	8,654	45.615	394,752.210
ALLIANZ SE	37,602	132.850	4,995,425.700
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.802	535,445.380
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,600	19.630	1,385,878.000
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	16,917	45.065	762,364.600
HERMES INTL	2,185	313.000	683,905.000
ENDESA S. A.	27,930	16.375	457,353.750
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28,244	13.275	374,939.100
ERSTE GROUP BANK AG	21,896	24.180	529,445.280
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,853	175.400	2,429,816.200
ARCELOR MITTAL (NL)	76,767	3.144	241,355.440
SOCIETE BIC SA	2,165	125.800	272,357.000
DASSAULT SYSTEMES SA	9,429	67.640	637,777.560
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,099	21.550	303,833.450
HEINEKEN NV	19,424	73.370	1,425,138.880
AKZO NOBEL	18,274	52.560	960,481.440
ASML HOLDING NV	25,963	79.570	2,065,875.910
AEGON NV	144,321	4.401	635,156.720
BANKINTER S. A.	52,241	5.760	300,908.160
VOLKSWAGEN AG	2,794	117.000	326,898.000
VOLKSWAGEN AG PFD	14,091	98.500	1,387,963.500

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	482,863	5.342	2,579,454.140
KERING	6,033	155.100	935,718.300
FORTUM OYJ	46,085	11.670	537,811.950
AGEAS	14,964	33.570	502,341.480
UCB SA	10,367	71.210	738,234.070
THYSSENKRUPP AG	29,522	14.490	427,773.780
UNILEVER NV-CVA	132,890	38.345	5,095,667.050
CARREFOUR SA	51,966	23.050	1,197,816.300
GAS NATURAL SDG SA	38,086	15.620	594,903.320
ATOS SE	6,025	66.500	400,662.500
NOKIA OYJ	439,256	5.490	2,411,515.440
TUI AG	19,196	13.125	251,947.500
KONINKLIJKE PHILIPS NV	72,718	22.325	1,623,429.350
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	32.925	812,292.670
SANOFI	92,276	69.300	6,394,726.800
STMICROELECTRONICS NV	59,010	5.020	296,230.200
ELISA OYJ	13,644	32.300	440,701.200
BANCO SANTANDER SA	1,159,051	3.439	3,985,976.380
METSO OYJ	10,879	19.320	210,182.280
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	8,282	70.650	585,123.300
QIAGEN N. V.	19,737	19.200	378,950.400
LINDE AG	13,880	124.900	1,733,612.000
DEUTSCHE BANK AG-REG	103,124	14.645	1,510,250.980
BMW VORZUG	4,116	58.240	239,715.840
K & S	13,745	18.085	248,578.320
ZARDOYA OTIS	28,325	9.520	269,654.000
ENEL SPA	611,051	3.540	2,163,120.540
COLRUYT NV	4,673	48.775	227,925.570
VOPAK (KON.)	5,364	38.505	206,540.820
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.031	104,957.720
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	267,546	15.020	4,018,540.920
BANCO POPULAR ESPANOL	118,655	2.041	242,174.850
FINMECCANICA SPA	34,431	9.125	314,182.870
INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,012	10.905	894,340.860
KONINKLIJKE KPN NV	257,686	3.321	855,775.200
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.822	167,609.420
DEUTSCHE BOERSE AG	14,463	76.140	1,101,212.820
EURAZEO	3,870	51.540	199,459.800
BANCO SABADELL	410,991	1.392	572,099.470
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,276	67.630	559,705.880
FRAPORT AG	3,149	51.480	162,110.520
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	65.750	526,920.500
INDITEX	89,590	27.195	2,436,400.050

BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	195,575	0.515	100,721.120	
JC DECAUX SA	5,728	35.240	201,854.720	
ANDRITZ AG	4,704	41.965	197,403.360	
MAPFRE SA	80,219	1.729	138,698.650	
ESSILOR INTL	17,154	105.400	1,808,031.600	
SNAM SPA	158,640	4.886	775,115.040	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	8.922	763,589.370	
ENAGAS	16,043	24.860	398,828.980	
WENDEL	1,994	84.680	168,851.920	
TENARIS SA	33,458	8.975	300,285.550	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	3.394	254,393.870	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	0.867	757,503.960	
TELECOM ITALIA-RNC	615,947	0.689	424,387.480	
ATLANTIA SPA	33,870	22.500	762,075.000	
ILIAD SA	2,102	217.500	457,185.000	
PROXIMUS	13,498	30.060	405,749.880	
SES FDR	24,850	23.130	574,780.500	
TERNA SPA	110,846	4.682	518,980.970	
GRIFOLS SA	20,422	19.050	389,039.100	
FERROVIAL SA	43,345	18.020	781,076.900	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	35.630	244,279.280	
EXOR SPA	6,823	28.000	191,044.000	
NESTE OYJ	10,692	28.360	303,225.120	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	8,947	11.365	101,682.650	
KONE OYJ	25,273	39.780	1,005,359.940	
ENGIE	132,035	13.485	1,780,491.970	
ALSTOM	17,252	20.270	349,698.040	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	47.160	236,979.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	18,706	26.845	502,162.570	
ELECTRICITE DE FRANCE	38,234	9.190	351,370.460	
DEUTSCHE WOHNEN AG	23,808	23.770	565,916.160	
ARKEMA SA	5,658	52.440	296,705.520	
LEGRAND SA	20,657	44.130	911,593.410	
ADP	2,313	105.200	243,327.600	
ORION OYJ	8,051	30.150	242,737.650	
RTL GROUP SA	2,768	74.430	206,022.240	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	9.848	335,009.260	
SYMRISE AG	9,463	56.920	538,633.960	
SCOR SE	17,385	31.120	541,021.200	
REXEL SA	20,799	10.880	226,293.120	
PRYSMIAN SPA	14,445	17.710	255,820.950	
BANCO POPOLARE SC	29,282	7.335	214,783.470	

CAIXABANK	202,918	2.437	494,511.160	
BUREAU VERITAS SA	23,255	17.625	409,869.370	
GROUPE EUROTUNNEL SE	51,096	8.975	458,586.600	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	34,238	16.205	554,826.790	
ENGIE	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	33,641	36.000	1,211,076.000	
TNT EXPRESS NV W/I	44,157	7.869	347,471.430	
ENEL GREEN POWER SPA	188,905	1.713	323,594.260	
BRENTAG AG	11,108	43.400	482,087.200	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	67,082	6.676	447,839.430	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	38,477	4.733	182,111.640	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,928	27.290	270,935.120	
EDENRED	18,682	14.980	279,856.360	
BANKIA SA	330,088	0.734	242,284.590	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	39,139	4.355	170,450.340	
HUGO BOSS AG -ORD	5,197	51.290	266,554.130	
OSRAM LICHT AG	7,598	41.300	313,797.400	
GEMALTO	5,952	56.290	335,038.080	
VONOVIA SE	42,578	27.550	1,173,023.900	
FERRARI NV	12,402	34.410	426,752.820	
CNH INDUSTRIAL NV	67,754	5.570	377,389.780	
NUMERICABLE-SFR	9,058	32.505	294,430.290	
NN GROUP NV	20,757	27.885	578,808.940	
ZALANDO SE	6,674	28.355	189,241.270	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	5.520	387,007.200	
AENA SA	5,256	103.150	542,156.400	
ALTICE NV-A	41,585	12.420	516,485.700	
LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	32.915	464,266.070	
ユーロ 小計	21,539,413		236,875,712.070 (29,270,731,741)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	17,100	61.550	1,052,505.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	13.520	3,393,520.000	
BANK OF EAST ASIA	111,660	24.350	2,718,921.000	
CLP HOLDINGS LTD	155,000	68.250	10,578,750.000	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	12.400	1,066,400.000	
LI & FUNG LTD	532,400	4.400	2,342,560.000	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	78.150	3,829,350.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,640	172.300	16,306,472.000	
MTR CORP	103,000	37.000	3,811,000.000	
HANG SENG BANK LTD	57,100	131.100	7,485,810.000	

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	85,657	42.350	3,627,573.950	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	102,500	74.500	7,636,250.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	39.350	4,712,162.500	
HONG KONG & CHINA GAS	560,535	13.840	7,757,804.400	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	26.050	4,923,450.000	
KERRY PROPERTIES LTD	65,000	18.560	1,206,400.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	344,500	19.900	6,855,550.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	54,000	26.800	1,447,200.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	643,266	6.370	4,097,604.420	
SINO LAND CO	255,400	10.880	2,778,752.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	86.700	12,051,300.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	76.250	3,240,625.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	29.300	2,651,650.000	
WHEELLOCK & CO LTD	76,000	30.400	2,310,400.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	5.050	989,800.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	8.680	1,472,128.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	8.780	368,760.000	
AIA GROUP LTD	980,027	39.150	38,368,057.050	
HKT TRUST / HKT LTD	178,000	10.480	1,865,440.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	26.350	4,732,460.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	20.300	2,115,260.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	270,000	6.400	1,728,000.000	
WH GROUP LTD	530,500	4.530	2,403,165.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	221,332	95.550	21,148,272.600	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	236,332	40.800	9,642,345.600	
香港・ドル 小計	7,332,099		202,715,698.520 (2,927,214,686)	
合計	96,080,166		236,834,617,141 (236,834,617,141)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	653,312.470	
		GOODMAN GROUP	128,133.000	848,240.460	
		GPT GROUP	131,618.000	650,192.920	
		LENLEASE GROUP	46,860.000	602,151.000	
		MIRVAC GROUP	407,090.000	749,045.600	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,828,571.100	

		STOCKLAND	163,015.000	691,183.600	
		VICINITY CENTRES	252,110.000	768,935.500	
		WESTFIELD CORP	140,072.000	1,357,297.680	
	オーストラリア・ドル	小計	1,769,597.000	8,148,930.330	(656,233,359)
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	276,306.000	646,556.040	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	291,180.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	409,940.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	316,965.000	
	シンガポール・ドル	小計	878,406.000	1,664,641.040	(133,038,112)
投資信託受益証券	合計		2,648,003	789,271,471	(789,271,471)
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,741.000	466,684.330	
		AMERICAN TOWER CORP	33,923.000	3,020,164.690	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	775,280.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,455.000	1,774,527.150	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,437.000	1,300,615.640	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,569.000	319,549.950	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	464,021.550	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,026.000	2,246,043.800	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	873,747.000	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	583,418.660	
		EQUINIX INC	5,413.000	1,596,889.130	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,730.000	2,030,667.900	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	1,000,801.500	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,578.000	704,854.260	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	842,147.290	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	48,619.000	1,301,044.440	
		HCP INC	36,231.000	1,046,713.590	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	875,097.300	
		IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	405,081.780	
		KIMCO REALTY	32,980.000	875,948.800	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	295,272.330	
		PROLOGIS INC	40,935.000	1,562,488.950	
		PUBLIC STORAGE	11,398.000	2,848,588.160	
		REALTY INCOME CORP	16,761.000	997,782.330	

	REGENCY CENTERS CORP	9,409.000	662,111.330	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,449.000	4,625,017.330	
	SL GREEN	7,116.000	629,837.160	
	THE MACERICH COMPANY	10,631.000	832,513.610	
	UDR INC	21,797.000	734,340.930	
	VENTAS INC	24,973.000	1,344,796.050	
	VEREIT INC	65,404.000	515,383.520	
	VORNADO REALTY TRUST	13,114.000	1,125,836.900	
	WELLTOWER INC	26,264.000	1,616,286.560	
	WEYERHAEUSER CO	65,952.000	1,648,800.000	
アメリカ・ドル 小計		835,243.000	41,942,353.920 (4,704,673,839)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	90,641.000	584,181.240	
	HAMMERSON PLC	79,855.000	427,224.250	
	INTU PROPERTIES PLC	59,605.000	165,105.850	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	611,443.770	
	SEGRO PLC	82,229.000	343,470.530	
イギリス・ポンド 小計		375,561.000	2,131,425.640 (332,843,428)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	201,310.040	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	412,859.160	
カナダ・ドル 小計		26,512.000	614,169.200 (50,251,324)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	188,231.040	
	GECINA SA	2,710.000	297,829.000	
	ICADE	3,001.000	185,311.750	
	KLEPIERRE	15,834.000	594,566.700	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,861.000	2,002,142.950	
ユーロ 小計		32,998.000	3,268,081.440 (403,836,823)	
香港・ドル	LINK REIT	172,500.000	7,417,500.000	
香港・ドル 小計		172,500.000	7,417,500.000 (107,108,700)	
投資証券 合計		1,442,814	5,598,714,114 (5,598,714,114)	
合計			6,387,985,585 (6,387,985,585)	

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 601銘柄	62.99%	-%	-%	65.57%
	投資証券 34銘柄	-%	-%	1.91%	
イギリス・ポンド	株式 106銘柄	7.53%	-%	-%	7.75%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.27%	-%	-%	0.27%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.51%	-%	-%	2.81%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.27%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.52%	-%	-%	3.58%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 19銘柄	0.46%	-%	-%	0.52%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.76%	-%	-%	3.80%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.17%	-%	-%	1.18%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.78%	-%	-%	0.78%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.23%	-%	-%	0.23%
ユーロ	株式 232銘柄	11.91%	-%	-%	12.20%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.16%	
香港・ドル	株式 35銘柄	1.19%	-%	-%	1.25%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.04%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,369,690,970	3,674,514,331
金銭信託		—	273,381,282
コール・ローン		374,837,019	—
国債証券		337,543,101,755	258,776,560,149
派生商品評価勘定		1,800	325,815
未収利息		3,230,185,165	2,367,321,596
前払費用		95,848,149	46,246,607
流動資産合計		346,613,664,858	265,138,349,780
資産合計		346,613,664,858	265,138,349,780
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		60,400	1,539,709
未払解約金		53,890,000	936,520,000
流動負債合計		53,950,400	938,059,709
負債合計		53,950,400	938,059,709
純資産の部			
元本等			
元本	※1	183,852,928,058	149,167,353,470
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		162,706,786,400	115,032,936,601
元本等合計		346,559,714,458	264,200,290,071
純資産合計		346,559,714,458	264,200,290,071
負債純資産合計		346,613,664,858	265,138,349,780

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>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>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
<p>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</p>	<p>234,028,916,867円 13,814,661,751円 63,990,650,560円</p>	<p>183,852,928,058円 22,714,623,570円 57,400,198,158円</p>
<p>元本の内訳 ファンド名 D I A M外国債券パッシブ・ファンド 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） グローバル8資産ラップファンド（安定型） グローバル8資産ラップファンド（中立型） グローバル8資産ラップファンド（積極型） たわらノーロード 先進国債券</p>	<p>3,781,500,974円 —円 —円 —円 —円 —円 —円 —円 —円</p>	<p>4,608,868,777円 17,135,667円 49,601,868円 84,885,603円 40,812,730円 41,966,921円 31,685,325円 154,189,800円</p>

D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,544,032,431円	4,589,345,800円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	341,847,976円	381,621,256円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,214,750,317円	1,283,530,211円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,308,784,784円	1,366,997,870円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	313,217,589円	325,115,189円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	671,428,982円	702,091,373円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	481,588,849円	505,339,054円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,376,785円	27,849,563円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	501,462,033円	568,221,729円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	21,995,765円	18,844,770円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	5,344,612円	8,241,243円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	9,302,206円	14,982,115円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	22,535,569円	29,626,646円
クルーズコントロール	909,075,064円	416,028,978円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	11,234,137円	25,339,893円
D I AM DC バランス・F(成長型)	2,903,738円	25,127,893円
クルーズコントロール<DC年金>	274,315円	104,666円
D I AMコア資産設計ファンド(堅実型)	—円	3,004,878円
D I AMコア資産設計ファンド(積極型)	—円	5,367,737円
D I AMパッシブ資産分散ファンド	2,195,692,298円	1,803,256,689円

D I AM為替フルヘッジ 型外国債券パッシブ私募 ファンド（適格機関投資 家向け）	7,027,645,265円	6,936,738,041円
D I AM外国債券パッシ ブファンド（適格機関投 資家向け）	4,732,221,877円	4,671,354,435円
外国債券パッシブファン ド（適格機関投資家限 定）	1,250,447,896円	2,389,669,712円
D I AM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）	－円	195,054,050円
D I AMワールドバラン ス25VA（適格機関投 資家限定）	141,069,091円	125,179,732円
D I AMグローバル・バ ランスファンド25VA （適格機関投資家限定）	10,685,215,824円	2,536,469,224円
D I AMグローバル・バ ランスファンド50VA （適格機関投資家限定）	1,025,897,488円	833,903,203円
D I AM国際分散バラン スファンド30VA（適 格機関投資家限定）	165,286,091円	100,546,922円
D I AM国際分散バラン スファンド50VA（適 格機関投資家限定）	307,586,013円	183,536,447円
D I AM国内重視バラン スファンド30VA（適 格機関投資家限定）	64,479,077円	43,892,957円
D I AM国内重視バラン スファンド50VA（適 格機関投資家限定）	40,066,465円	21,332,413円
D I AM世界バランスフ ァンド40VA（適格機 関投資家限定）	16,046,248,001円	8,626,781,465円
D I AM世界バランスフ ァンド50VA（適格機 関投資家限定）	3,756,953,586円	2,181,728,841円
D I AMバランスファン ド25VA（適格機関投 資家限定）	7,184,715,005円	5,129,506,277円
D I AMバランスファン ド37.5VA（適格機 関投資家限定）	3,442,592,042円	2,858,417,978円
D I AMバランスファン ド50VA（適格機関投 資家限定）	5,346,965,944円	4,576,434,371円

D I AMグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	1,119,757,516円	881,138,244円
D I AMグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	4,223,200,090円	3,273,256,957円
D I AM アクサ グロ ーバル バランスファン ド30VA (適格機関投 資家限定)	5,299,806,889円	4,397,691,775円
D I AM世界アセットバ ランスファンドVA (適 格機関投資家向け)	21,653,398,611円	16,100,828,427円
D I AMグローバルβ私 募ファンド (適格機関投 資家向け)	100,927,303円	56,954,254円
D I AM世界バランスフ ァンド55VA (適格機 関投資家限定)	3,042,648,599円	2,193,691,472円
D I AM世界バランスフ ァンド35VA (適格機 関投資家限定)	12,468,255,935円	10,833,445,814円
D I AMグローバル分散 ファンドVA (適格機関 投資家限定)	134,886,348円	—円
D I AM世界アセットバ ランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	17,084,379,724円	15,360,947,657円
D I AM世界アセットバ ランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	21,483,751,875円	19,589,996,575円
D I AMバランス30V A (適格機関投資家限 定)	120,615円	14,748,909円
D I AMバランス50V A (適格機関投資家限 定)	28,789,731円	19,587,305円
D I AMバランス70V A (適格機関投資家限 定)	50,952,485円	6,546,806円
D I AM世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	19,153,914,577円	17,612,128,830円
D I AM世界バランス 25VA (適格機関投資 家限定)	137,085,607円	124,173,768円
D I AMバランス20V A (適格機関投資家限 定)	5,513,095円	129,091,817円

D I A Mバラン ス 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	279, 673, 418円	33, 261, 642円
D I A Mバラン ス 6 0 V A (適格機関投資家限 定)	127, 551円	132, 906円
計	183, 852, 928, 058円	149, 167, 353, 470円
2. 受益権の総数	183, 852, 928, 058口	149, 167, 353, 470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26年2月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	1,491,332,744	485,021,012
合計	1,491,332,744	485,021,012

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年2月24日から平成27年2月25日まで及び平成28年2月23日から平成28年2月25日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成28年2月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	165,322,800	—	165,321,000	1,800	973,770,226	—	974,984,120	△1,213,894
アメリカ・ドル	—	—	—	—	486,997,104	—	487,778,840	△781,736
イギリス・ポンド	165,322,800	—	165,321,000	1,800	86,047,075	—	85,726,350	320,725
ユーロ	—	—	—	—	400,726,047	—	401,478,930	△752,883
買 建	183,750,400	—	183,690,000	△60,400	—	—	—	—
イギリス・ポンド	183,750,400	—	183,690,000	△60,400	—	—	—	—
合計	349,073,200	—	349,011,000	△58,600	973,770,226	—	974,984,120	△1,213,894

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	1,8850円	1,7712円
(1万口当たり純資産額)	(18,850円)	(17,712円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.5 07/31/17	18,000,000.000	17,945,820.000	
		US T N/B 0.625 04/30/18	10,500,000.000	10,466,295.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	18,000,000.000	17,986,500.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	11,500,000.000	11,500,345.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	19,000,000.000	18,997,720.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	2,700,000.000	2,706,318.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	6,972,350.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	10,000,000.000	10,049,200.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	3,500,000.000	3,497,515.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	4,993,750.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	15,500,000.000	15,461,250.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	11,060,060.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,859,832.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	7,050,820.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,000,000.000	8,082,480.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	1,000,000.000	1,013,510.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,360,480.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	13,500,000.000	13,619,070.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	18,500,000.000	18,770,100.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	9,700,000.000	9,868,198.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,297,500.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	8,000,000.000	8,168,080.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,000,000.000	3,035,130.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,572,000.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	3,000,000.000	3,057,630.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	15,000,000.000	15,282,900.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	8,000,000.000	8,127,440.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	5,082,800.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,142,920.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,332,970.000	
		US T N/B 1.875 08/31/17	14,000,000.000	14,241,080.000	
		US T N/B 1.875 09/30/17	10,000,000.000	10,180,800.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	19,500,000.000	20,196,150.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,820,625.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	21,800,000.000	22,321,020.000			
US T N/B 2.0 02/28/21	3,000,000.000	3,108,030.000			
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,429,840.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,213,720.000			
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,765,560.000			

US T N/B 2.0 11/30/20	3,500,000.000	3,624,110.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	10,854,375.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,885,890.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,459,690.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,121,860.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	20,700,000.000	21,558,636.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	500,000.000	524,175.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,500,000.000	10,980,690.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	8,000,000.000	8,360,560.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	10,000,000.000	10,262,100.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	6,000,000.000	6,224,280.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,403,384.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,740,896.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,000,000.000	6,856,710.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	11,000,000.000	11,739,860.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	8,000,000.000	8,192,480.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,552,480.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,528,610.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,382,500.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	9,000,000.000	9,486,900.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	7,000,000.000	7,605,920.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,890,000.000	4,051,357.200	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,873,400.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,535,728.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,437,500.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,070,000.000	3,263,287.200	
US T N/B 2.875 08/15/45	8,000,000.000	8,461,840.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.000	20,478,800.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,488,828.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,500,000.000	7,049,900.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	8,800,000.000	9,556,184.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,000,000.000	3,257,100.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	3,000,000.000	3,369,840.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	7,600,000.000	8,488,212.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	18,000,000.000	18,516,060.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,897,780.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,736,800.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	7,100,000.000	7,910,394.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,000,000.000	3,371,700.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,800,000.000	8,021,754.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,090,000.000	7,119,088.200	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,338,400.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	14,748,580.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,000,000.000	2,402,500.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	15,343,020.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	19,745,100.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	6,126,230.000	

US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	6,121,050.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	9,000,000.000	9,802,260.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	6,374,420.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,480,000.000	4,332,843.600	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	7,146,375.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,550,000.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,570,000.000	3,253,054.600	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	12,959,040.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,177,435.500	
US T N/B 4.25 11/15/17	9,000,000.000	9,536,760.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,673,120.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,450,000.000	1,976,524.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,791,107.800	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,450,000.000	1,976,915.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,860,000.000	3,885,109.800	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,800,000.000	3,874,500.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,981,765.500	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,200,000.000	3,040,884.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	14,000,000.000	14,542,500.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	5,202,385.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	4,304,040.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.000	15,886,500.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	2,109,907.800	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	2,058,795.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,741,407.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,511,972.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,444,864.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	2,027,144.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	2,140,572.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,333,120.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	8,200,980.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,973,720.000	
US T N/B 8.75 05/15/17	12,000,000.000	13,185,000.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,942,960.000	
アメリカ・ドル 小計	944,410,000.000 (105,934,469,700)	1,004,632,328.700 (112,689,608,310)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.0 09/07/17	2,400,000.000	2,425,200.000
	UK TREASURY 1.25 07/22/18	5,500,000.000	5,614,400.000
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	700,000.000	724,388.000
	UK TREASURY 1.75 07/22/19	5,000,000.000	5,205,500.000
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,462,690.000

UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,800,000.000	2,964,612.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,200,000.000	3,461,696.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	400,000.000	443,436.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	3,700,000.000	4,152,399.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,800,000.000	4,554,300.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	3,500,000.000	4,398,450.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,650,000.000	3,785,525.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,600,000.000	3,614,000.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,453,880.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	4,400,000.000	5,019,520.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,200,000.000	3,711,808.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,000,000.000	3,062,000.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,800,000.000	3,323,880.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,350,000.000	4,519,820.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,950,000.000	3,909,635.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,050,000.000	2,810,755.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,160,000.000	2,794,392.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,500,000.000	3,461,000.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,700,000.000	3,904,470.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,074,778.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,490,000.000	3,896,103.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,400,000.000	2,700,240.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,500,000.000	4,828,250.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,750,000.000	3,994,375.000	

	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.000	7,593,950.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,900,000.000	4,014,180.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,500,000.000	3,649,500.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	1,800,000.000	1,974,780.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,880,000.000	3,808,512.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,750,000.000	2,655,625.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	2,000,000.000	2,752,800.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	800,000.000	903,040.000	
	イギリス・ポンド 小計	104,200,000.000 (16,271,872,000)	129,623,889.000 (20,242,066,506)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,866,752.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,500,000.000	4,964,445.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,388,052.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	1,000,000.000	991,450.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	4,032,444.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	871,245.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,000,000.000	1,033,780.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,000,000.000	4,281,600.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	2,029,428.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	200,000.000	206,356.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	1,841,499.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,100,000.000	3,614,290.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,800,000.000	1,859,454.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,208,150.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,400,000.000	4,152,012.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	5,200,000.000	5,556,356.000	

	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,652,380.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.000	3,647,490.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	3,100,000.000	3,221,365.000	
オーストラリア・ドル 小計		51,550,000.000 (4,151,321,500)	57,418,548.000 (4,623,915,670)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	600,000.000	1,015,620.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	1,400,000.000	1,412,096.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,600,000.000	1,624,720.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	3,250,000.000	3,312,985.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	3,100,000.000	3,131,589.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,870,902.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,000,000.000	1,023,210.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	4,900,000.000	4,974,872.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,974,690.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,500,000.000	2,787,025.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,400,000.000	2,682,720.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	595,985.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	500,000.000	633,985.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,200,000.000	2,493,458.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,300,000.000	4,833,888.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,050,000.000	4,134,275.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	5,700,000.000	6,297,075.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	5,200,000.000	5,429,996.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,500,000.000	3,527,725.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,500,000.000	1,627,065.000	
CANADA 5.0 06/01/37	1,860,000.000	2,866,204.200		
CANADA 5.75 06/01/29	1,800,000.000	2,706,552.000		
CANADA 5.75 06/01/33	2,000,000.000	3,189,240.000		
カナダ・ドル 小計		55,460,000.000 (4,537,737,200)	64,145,877.200 (5,248,415,673)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	1,430,000.000	1,413,555.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	610,000.000	618,082.500	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	417,600.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	477,825.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	710,000.000	756,860.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,715,200.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,436,480.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	531,244.800	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,111,000.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,150,000.000	2,305,875.000	
シンガポール・ドル 小計		10,180,000.000 (813,585,600)	10,783,722.300 (861,835,086)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,597,056.000	

	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,800,000.000	13,968,722.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,900,000.000	9,490,329.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	15,370,000.000	18,616,912.500	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	8,980,000.000	9,558,581.400	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	13,300,000.000	15,197,777.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	9,410,000.000	11,725,518.700	
スウェーデン・クローナ	小計	75,460,000.000 (996,826,600)	89,154,896.600 (1,177,736,184)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	8,500,000.000	9,350,000.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	8,970,000.000	10,051,602.600	
	DENMARK 3.0 11/15/21	12,000,000.000	14,043,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	7,780,000.000	8,375,170.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	13,900,000.000	16,096,200.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	18,000,000.000	31,653,000.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	3,700,000.000	5,853,400.000	
デンマーク・クローネ	小計	72,850,000.000 (1,206,396,000)	95,422,372.600 (1,580,194,490)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.75 03/13/25	800,000.000	832,096.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	8,095,824.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	10,400,000.000	11,836,240.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	9,100,000.000	10,462,270.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	7,000,000.000	7,315,910.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	9,560,000.000	10,763,604.000	
ノルウェー・クローネ	小計	44,460,000.000 (575,312,400)	49,305,944.000 (638,018,915)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,948,790.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,226,846.300	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,529,967.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	7,000,000.000	7,348,600.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,395,895.000	
	POLAND 4.75 04/25/17	2,280,000.000	2,373,480.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	4,000,000.000	4,253,640.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	3,890,000.000	4,436,545.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	3,041,583.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,360,720.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,814,440.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,365,584.000	
ポーランド・ズロチ	小計	43,850,000.000 (1,238,762,500)	48,096,090.300 (1,358,714,551)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,188,219.000	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,193,070.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	3,270,000.000	3,047,672.700	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	4,700,000.000	4,730,268.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	5,520,000.000	5,568,576.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,122,335.500	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	2,450,000.000	2,387,451.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,620,450.000	

	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,448,961.800	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	4,300,000.000	4,381,700.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,790,694.400	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,131,400.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	800,000.000	826,344.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,741,232.000	
マレーシア・リンギット	小計	40,950,000.000 (1,090,908,000)	41,178,374.900 (1,096,991,907)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	17,000,000.000	23,186,640.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	41,000,000.000	52,407,840.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	41,500,000.000	41,549,800.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	10,000,000.000	10,369,900.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	22,000,000.000	22,887,920.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,133,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	22,334,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	3,000,000.000	3,336,960.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	60,000,000.000	63,639,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	32,978,100.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,813,560.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	39,000,000.000	46,494,630.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	19,000,000.000	22,787,460.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	10,000,000.000	10,936,800.000	
メキシコ・ペソ	小計	336,500,000.000 (2,076,205,000)	379,856,210.000 (2,343,712,816)	
ユーロ	AUSTRIA 1.2 10/20/25	700,000.000	751,114.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,397,025.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,573,600.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,507,996.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	800,000.000	981,984.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	970,000.000	1,417,131.200	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,150,000.000	1,190,940.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,844,100.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,600,000.000	3,130,400.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,600,000.000	1,968,000.000	

AUSTRIA 3.8 01/26/62	570,000.000	1,044,371.100	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,500,000.000	2,959,500.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,800,000.000	2,821,500.000	
AUSTRIA 4.3 09/15/17	1,200,000.000	1,288,560.000	
AUSTRIA 4.35 03/15/19	2,300,000.000	2,633,385.000	
AUSTRIA 4.65 01/15/18	2,200,000.000	2,411,860.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,500,000.000	2,143,125.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	950,000.000	1,540,567.500	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,400,000.000	2,466,648.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	600,000.000	594,468.000	
BELGIUM 1.25 06/22/18	2,000,000.000	2,078,760.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	500,000.000	550,070.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,600,000.000	1,850,368.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,085,238.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,106,623.500	
BELGIUM 3.0 09/28/19	2,100,000.000	2,352,798.000	
BELGIUM 3.5 06/28/17	2,000,000.000	2,105,420.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,150,000.000	1,778,912.000	
BELGIUM 3.75 09/28/20	3,000,000.000	3,556,590.000	
BELGIUM 4.0 03/28/17	600,000.000	628,830.000	
BELGIUM 4.0 03/28/18	1,500,000.000	1,639,470.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	2,350,000.000	2,670,469.500	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,300,000.000	2,874,632.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,400,000.000	2,010,134.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,600,000.000	4,206,540.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,682,641.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,600,000.000	3,329,924.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,225,472.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,000,000.000	4,966,800.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,050,000.000	4,725,365.000	
BELGIUM 5.5 09/28/17	1,500,000.000	1,641,360.000	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,030,420.000	
BUNDESABL 0.5 02/23/18	2,600,000.000	2,653,170.000	
BUNDESABL 0.5 04/07/17	4,600,000.000	4,651,014.000	
BUNDESABL 0.5 04/12/19	4,300,000.000	4,433,945.000	
BUNDESABL 0.5 10/13/17	4,100,000.000	4,167,527.000	
BUNDESABL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,871,712.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,900,000.000	4,063,215.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,376,861.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,474,560.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,000,000.000	1,121,010.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,269,072.000	

DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	3,800,000.000	4,299,206.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,793,040.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,724,490.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,500,000.000	3,955,770.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.000	2,840,000.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,700,000.000	4,307,318.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	2,700,000.000	3,029,670.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,500,000.000	2,860,875.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,700,000.000	3,083,805.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,600,000.000	3,730,090.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,880,000.000	2,732,768.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	4,500,000.000	5,177,250.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	8,700,000.000	9,955,410.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,800,000.000	4,538,910.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,150,000.000	3,423,122.500	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	5,900,000.000	6,691,780.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	4,900,000.000	5,498,535.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,100,000.000	3,361,671.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,500,000.000	5,753,125.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	4,800,000.000	5,109,984.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	6,000,000.000	6,675,900.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,050,000.000	3,597,955.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,600,000.000	2,468,560.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,100,000.000	5,343,749.000	

DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/40	2, 600, 000. 000	4, 925, 700. 000	
DEUTSCHLAND 5. 5 01/04/31	2, 700, 000. 000	4, 654, 395. 000	
DEUTSCHLAND 5. 625 01/04/28	2, 360, 000. 000	3, 845, 030. 000	
DEUTSCHLAND 6. 25 01/04/24	1, 400, 000. 000	2, 107, 420. 000	
DEUTSCHLAND 6. 25 01/04/30	1, 300, 000. 000	2, 337, 140. 000	
DEUTSCHLAND 6. 5 07/04/27	1, 550, 000. 000	2, 645, 075. 000	
FINLAND 0. 75 04/15/31	200, 000. 000	195, 568. 000	
FINLAND 0. 875 09/15/25	300, 000. 000	312, 183. 000	
FINLAND 1. 125 09/15/18	900, 000. 000	935, 802. 000	
FINLAND 1. 5 04/15/23	770, 000. 000	846, 692. 000	
FINLAND 1. 625 09/15/22	900, 000. 000	996, 345. 000	
FINLAND 1. 875 04/15/17	470, 000. 000	482, 596. 000	
FINLAND 2. 0 04/15/24	800, 000. 000	914, 016. 000	
FINLAND 2. 625 07/04/42	610, 000. 000	824, 171. 000	
FINLAND 2. 75 07/04/28	1, 080, 000. 000	1, 340, 550. 000	
FINLAND 3. 375 04/15/20	1, 130, 000. 000	1, 301, 251. 500	
FINLAND 3. 5 04/15/21	1, 000, 000. 000	1, 189, 450. 000	
FINLAND 3. 875 09/15/17	700, 000. 000	746, 900. 000	
FINLAND 4. 0 07/04/25	1, 010, 000. 000	1, 345, 421. 000	
FINLAND 4. 375 07/04/19	810, 000. 000	939, 316. 500	
FR TREASURY 1. 0 07/25/17	3, 000, 000. 000	3, 060, 840. 000	
FRANCE BTAN 8. 5 04/25/23	2, 200, 000. 000	3, 533, 222. 000	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/25	1, 800, 000. 000	1, 812, 330. 000	
FRANCE OAT 1. 0 05/25/18	4, 300, 000. 000	4, 435, 321. 000	
FRANCE OAT 1. 0 05/25/19	1, 700, 000. 000	1, 773, 185. 000	
FRANCE OAT 1. 0 11/25/18	500, 000. 000	518, 645. 000	
FRANCE OAT 1. 0 11/25/25	1, 800, 000. 000	1, 884, 492. 000	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/31	1, 200, 000. 000	1, 280, 916. 000	
FRANCE OAT 1. 75 05/25/23	4, 400, 000. 000	4, 923, 336. 000	
FRANCE OAT 1. 75 11/25/24	6, 460, 000. 000	7, 250, 962. 400	
FRANCE OAT 2. 25 05/25/24	3, 100, 000. 000	3, 606, 912. 000	
FRANCE OAT 2. 25 10/25/22	4, 700, 000. 000	5, 395, 882. 000	
FRANCE OAT 2. 5 05/25/30	4, 800, 000. 000	5, 789, 040. 000	
FRANCE OAT 2. 5 10/25/20	9, 200, 000. 000	10, 363, 340. 000	
FRANCE OAT 2. 75 10/25/27	5, 440, 000. 000	6, 672, 432. 000	

FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,295,605.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,250,000.000	3,200,872.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,300,000.000	7,499,331.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	7,500,000.000	8,681,775.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,940,000.000	8,965,092.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	5,800,000.000	6,083,330.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	6,400,000.000	7,701,824.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,586,304.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	6,200,000.000	6,794,022.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,600,000.000	4,398,680.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	3,178,508.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,710,000.000	5,658,751.700	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	7,600,000.000	8,707,320.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	6,800,000.000	7,331,420.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,754,220.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,600,000.000	8,673,456.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,300,000.000	7,156,705.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,600,000.000	5,804,820.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,800,000.000	7,603,776.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,600,000.000	7,917,520.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,498,156.800	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.000	3,975,150.000	
IRISH 0.8 03/15/22	800,000.000	824,808.000	
IRISH 2.0 02/18/45	790,000.000	815,548.600	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,252,658.000	
IRISH 3.4 03/18/24	1,230,000.000	1,491,018.300	
IRISH 3.9 03/20/23	800,000.000	990,616.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,430,000.000	1,637,421.500	
IRISH 4.5 04/18/20	1,750,000.000	2,072,630.000	
IRISH 4.5 10/18/18	1,540,000.000	1,727,110.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,400,000.000	1,714,580.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,800,000.000	2,509,290.000	
IRISH 5.5 10/18/17	300,000.000	328,347.000	
IRISH 5.9 10/18/19	750,000.000	909,712.500	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,515,625.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,800,000.000	1,721,592.000	

ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,500,000.000	1,563,795.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,000,000.000	1,078,800.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,357,040.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,100,000.000	2,374,995.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,700,000.000	3,222,045.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,100,000.000	2,295,804.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,800,000.000	4,394,320.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,666,160.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	4,500,000.000	5,235,300.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,262,064.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	3,200,000.000	3,319,232.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,350,000.000	5,510,145.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	5,096,960.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,368,390.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,200,000.000	6,006,520.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	7,287,680.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	11,700,000.000	12,702,339.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,233,950.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,930,950.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,608,239.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,587,120.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,100,000.000	3,832,096.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	6,200,000.000	6,863,400.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	3,000,000.000	3,776,700.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,752,540.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,230,000.000	4,277,747.400	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,437,016.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	7,200,000.000	8,958,960.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,430,000.000	5,759,708.800	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,300,000.000	4,678,080.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,700,000.000	3,926,880.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	4,999,050.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,800,000.000	9,459,384.000	

ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,700,000.000	6,573,890.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	5,000,000.000	6,434,450.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,225,600.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,470,000.000	3,726,489.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,400,000.000	6,656,320.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	4,200,000.000	6,278,580.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,700,000.000	2,630,070.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	2,400,000.000	3,771,120.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	850,000.000	870,170.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,692,588.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	3,500,000.000	3,614,030.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	2,460,000.000	2,578,695.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,400,000.000	2,707,920.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,500,000.000	2,887,000.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,783,988.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,222,589.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,450,000.000	2,142,186.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,880,000.000	3,424,320.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	3,270,000.000	3,825,736.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,500,000.000	3,161,000.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,470,000.000	4,115,563.400	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,950,000.000	3,136,185.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	2,943,556.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,527,890.500	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	3,090,000.000	3,304,446.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,300,000.000	3,637,910.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	1,200,000.000	1,230,816.000	

	SPAIN 1.6 04/30/25	1,800,000.000	1,809,252.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,000,000.000	982,430.000	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,723,110.000	
	SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,156,300.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,900,000.000	4,286,685.000	
	SPAIN 3.75 10/31/18	2,400,000.000	2,630,256.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	4,500,000.000	4,659,750.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	3,400,000.000	4,014,482.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	5,000,000.000	5,715,500.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,711,080.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,296,150.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,600,000.000	6,396,600.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,551,340.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	5,700,000.000	6,184,500.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	4,700,000.000	5,381,970.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,600,000.000	4,553,820.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,300,000.000	3,133,750.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,200,000.000	4,019,840.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,464,195.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,200,000.000	3,066,800.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	2,971,980.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,800,000.000	2,640,708.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,200,000.000	4,107,840.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	4,200,000.000	5,217,660.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	4,800,000.000	5,176,368.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,000,000.000	4,460,130.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,762,344.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,486,375.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,100,515.000	
	ユーロ 小計	699,400,000.000 (86,424,858,000)	857,549,904.200 (105,967,441,662)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	26,992,000.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,089,345.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,006,913.600	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	19,660,000.000	17,911,439.600	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	8,969,120.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	10,110,000.000	8,814,100.200	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	14,000,000.000	13,797,700.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	8,000,000.000	6,972,800.000	

		SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	3,270,000.000	3,272,452.500	
		SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,496,827.700	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	5,000,000.000	4,395,950.000	
		SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	15,000,000.000	13,118,400.000	
	南アフリカ・ランド	小計	149,010,000.000 (1,071,381,900)	131,837,048.600 (947,908,379)	
国債証券	合計		226,389,636,400 (226,389,636,400)	258,776,560,149 (258,776,560,149)	
合計			226,389,636,400 (226,389,636,400)	258,776,560,149 (258,776,560,149)	

- (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	42.65%	43.55%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.66%	7.82%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	1.75%	1.79%
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	1.99%	2.03%
シンガポール・ドル	国債証券 10銘柄	0.33%	0.33%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.45%	0.46%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.60%	0.61%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.24%	0.25%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.51%	0.53%
マレーシア・リンギット	国債証券 14銘柄	0.42%	0.42%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.89%	0.91%
ユーロ	国債証券 236銘柄	40.11%	40.95%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.36%	0.37%

(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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月26日から平成28年8月25日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

石本 貴三 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光夫 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成28年2月26日から平成28年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成28年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年2月26日から平成28年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

【中間財務諸表】

【D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	281,775,214	—
コール・ローン	—	290,118,135
親投資信託受益証券	8,351,998,256	8,859,703,115
未収入金	11,082,000	—
流動資産合計	8,644,855,470	9,149,821,250
資産合計	8,644,855,470	9,149,821,250
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,791,516	3,962,669
未払受託者報酬	1,418,199	1,437,042
未払委託者報酬	10,873,110	11,017,607
その他未払費用	224,467	217,739
流動負債合計	36,307,292	16,635,057
負債合計	36,307,292	16,635,057
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,756,501,296	※1 6,049,225,721
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,852,046,882	3,083,960,472
(分配準備積立金)	1,137,498,160	1,080,746,974
元本等合計	8,608,548,178	9,133,186,193
純資産合計	8,608,548,178	9,133,186,193
負債純資産合計	8,644,855,470	9,149,821,250

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第14期中間計算期間 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日
営業収益		
受取利息	74,388	221
有価証券売買等損益	△76,446,368	91,575,859
営業収益合計	△76,371,980	91,576,080
営業費用		
支払利息	—	78,334
受託者報酬	1,362,276	1,437,042
委託者報酬	10,444,338	11,017,607
その他費用	215,599	218,025
営業費用合計	12,022,213	12,751,008
営業利益又は営業損失(△)	△88,394,193	78,825,072
経常利益又は経常損失(△)	△88,394,193	78,825,072
中間純利益又は中間純損失(△)	△88,394,193	78,825,072
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	12,477,400	6,435,399
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,748,864,299	2,852,046,882
剰余金増加額又は欠損金減少額	457,213,544	308,762,234
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	457,213,544	308,762,234
剰余金減少額又は欠損金増加額	307,944,943	149,238,317
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	307,944,943	149,238,317
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,797,261,307	3,083,960,472

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. ※1 期首元本額	5,436,916,498円	5,756,501,296円
期中追加設定元本額	1,428,568,208円	593,292,118円
期中一部解約元本額	1,108,983,410円	300,567,693円
2. 受益権の総数	5,756,501,296口	6,049,225,721口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,4954円 (14,954円)	1,5098円 (15,098円)

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年2月26日から平成28年8月25日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月12日

アセットマネジメント One 株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴司 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光夫 

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DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成28年2月26日から平成28年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成28年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年2月26日から平成28年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	607,708,568	—
コール・ローン	—	625,647,244
親投資信託受益証券	18,367,994,608	19,104,248,101
未収入金	1,757,000	—
流動資産合計	18,977,460,176	19,729,895,345
資産合計	18,977,460,176	19,729,895,345
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,962,513	5,231,292
未払受託者報酬	3,206,512	3,145,251
未払委託者報酬	27,790,146	27,259,200
その他未払費用	507,606	476,713
流動負債合計	44,466,777	36,112,456
負債合計	44,466,777	36,112,456
純資産の部		
元本等		
元本	※1 11,311,377,052	※1 11,703,703,886
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	7,621,616,347	7,990,079,003
(分配準備積立金)	4,205,323,682	4,070,447,767
元本等合計	18,932,993,399	19,693,782,889
純資産合計	18,932,993,399	19,693,782,889
負債純資産合計	18,977,460,176	19,729,895,345

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第14期中間計算期間 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日
営業収益		
受取利息	173,467	486
有価証券売買等損益	△384,549,047	123,631,493
営業収益合計	△384,375,580	123,631,979
営業費用		
支払利息	—	168,322
受託者報酬	3,244,746	3,145,251
委託者報酬	28,121,487	27,259,200
その他費用	513,670	477,333
営業費用合計	31,879,903	31,050,106
営業利益又は営業損失(△)	△416,255,483	92,581,873
経常利益又は経常損失(△)	△416,255,483	92,581,873
中間純利益又は中間純損失(△)	△416,255,483	92,581,873
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	38,078,952	8,087,611
期首剰余金又は期首欠損金(△)	8,378,221,947	7,621,616,347
剰余金増加額又は欠損金減少額	785,575,035	536,475,032
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	785,575,035	536,475,032
剰余金減少額又は欠損金増加額	642,587,040	252,506,638
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	642,587,040	252,506,638
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	8,066,875,507	7,990,079,003

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. ※1 期首元本額	11,167,153,451円	11,311,377,052円
期中追加設定元本額	1,697,863,637円	766,569,826円
期中一部解約元本額	1,553,640,036円	374,242,992円
2. 受益権の総数	11,311,377,052口	11,703,703,886口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,6738円	1,6827円
(1万口当たり純資産額)	(16,738円)	(16,827円)

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年2月26日から平成28年8月25日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月12日

アセットマネジメント One 株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鷗田 光夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成28年2月26日から平成28年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成28年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年2月26日から平成28年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	469,831,116	—
コール・ローン	—	476,356,241
親投資信託受益証券	14,090,232,030	14,531,697,654
流動資産合計	14,560,063,146	15,008,053,895
資産合計	14,560,063,146	15,008,053,895
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,908,084	1,671,870
未払受託者報酬	2,529,402	2,413,858
未払委託者報酬	24,451,297	23,334,373
その他未払費用	400,401	365,866
流動負債合計	35,289,184	27,785,967
負債合計	35,289,184	27,785,967
純資産の部		
元本等		
元本	※1 7,866,965,749	※1 8,110,010,669
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	6,657,808,213	6,870,257,259
(分配準備積立金)	3,708,200,293	3,569,194,509
元本等合計	14,524,773,962	14,980,267,928
純資産合計	14,524,773,962	14,980,267,928
負債純資産合計	14,560,063,146	15,008,053,895

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第14期中間計算期間 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日
営業収益		
受取利息	144,180	375
有価証券売買等損益	△475,538,698	20,432,624
営業収益合計	△475,394,518	20,432,999
営業費用		
支払利息	—	130,875
受託者報酬	2,639,864	2,413,858
委託者報酬	25,519,104	23,334,373
その他費用	417,892	366,351
営業費用合計	28,576,860	26,245,457
営業利益又は営業損失(△)	△503,971,378	△5,812,458
経常利益又は経常損失(△)	△503,971,378	△5,812,458
中間純利益又は中間純損失(△)	△503,971,378	△5,812,458
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	64,349,765	5,057,217
期首剰余金又は期首欠損金(△)	7,956,536,137	6,657,808,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	874,170,692	482,395,660
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	874,170,692	482,395,660
剰余金減少額又は欠損金増加額	919,273,316	259,076,939
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	919,273,316	259,076,939
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	7,343,112,370	6,870,257,259

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. ※1 期首元本額	7,932,612,026円	7,866,965,749円
期中追加設定元本額	1,425,335,822円	548,616,446円
期中一部解約元本額	1,490,982,099円	305,571,526円
2. 受益権の総数	7,866,965,749口	8,110,010,669口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,8463円	1,8471円
(1万口当たり純資産額)	(18,463円)	(18,471円)

(参考)

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		3,319,697,186	—
コール・ローン		—	2,285,763,314
株式	※2	266,950,636,500	273,315,370,850
派生商品評価勘定		16,762,460	298,380
未収配当金		477,553,356	350,878,962
前払金		256,490,000	10,273,600
流動資産合計		271,021,139,502	275,962,585,106
資産合計		271,021,139,502	275,962,585,106
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		199,635,772	12,533,540
未払解約金		131,488,000	146,669,000
流動負債合計		331,123,772	159,202,540
負債合計		331,123,772	159,202,540
純資産の部			
元本等			
元本	※1	142,969,149,329	144,400,734,532
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		127,720,866,401	131,402,648,034
元本等合計		270,690,015,730	275,803,382,566
純資産合計		270,690,015,730	275,803,382,566
負債純資産合計		271,021,139,502	275,962,585,106

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>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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
<p>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</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p>	<p>155,777,350,252円</p> <p>39,180,158,135円</p> <p>51,988,359,058円</p>	<p>142,969,149,329円</p> <p>22,502,376,020円</p> <p>21,070,790,817円</p>
<p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p> <p>D I A M D C 国内株式インデックスファンド</p> <p>D I A M国内株式パッシブ・ファンド</p> <p>M I T O ラップ型ファンド (安定型)</p> <p>M I T O ラップ型ファンド (中立型)</p> <p>M I T O ラップ型ファンド (積極型)</p> <p>グローバル8資産ラップファンド (安定型)</p> <p>グローバル8資産ラップファンド (中立型)</p> <p>グローバル8資産ラップファンド (積極型)</p> <p>D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金></p> <p>D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型</p>	<p>5,696,126,195円</p> <p>1,699,376,937円</p> <p>6,524,503円</p> <p>13,299,631円</p> <p>31,387,977円</p> <p>15,547,145円</p> <p>11,269,512円</p> <p>11,755,011円</p> <p>38,084,258,210円</p> <p>856,679,246円</p>	<p>6,423,707,483円</p> <p>1,536,876,971円</p> <p>9,265,861円</p> <p>17,855,870円</p> <p>37,506,678円</p> <p>19,473,677円</p> <p>15,821,313円</p> <p>16,384,830円</p> <p>38,931,214,865円</p> <p>909,614,339円</p>

D I A M バランス・ファンド< DC 年金> 2 安定・成長型	2,984,860,292円	3,115,930,744円
D I A M バランス・ファンド< DC 年金> 3 成長型	3,003,978,386円	3,160,745,088円
D I A M DC バランス 3 0 インデックスファンド	368,862,991円	408,716,759円
D I A M DC バランス 5 0 インデックスファンド	1,225,176,057円	1,312,232,391円
D I A M DC バランス 7 0 インデックスファンド	1,095,709,664円	1,142,165,568円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	60,788,627円	64,124,991円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,229,112,654円	1,355,771,901円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	27,113,958円	31,261,205円
D I A M DC 8 資産バラン スファンド (新興国 1 0)	25,953,986円	34,679,539円
D I A M DC 8 資産バラン スファンド (新興国 2 0)	51,128,058円	69,618,343円
D I A M DC 8 資産バラン スファンド (新興国 3 0)	108,496,820円	134,257,227円
投資のソムリエ	1,057,072,049円	1,108,515,481円
クルーズコントロール	292,854,639円	979,491,190円
投資のソムリエ< DC 年金>	20,915,913円	28,922,895円
D I A M 8 資産バラン スファ ンド N < DC 年金>	76,867,727円	107,114,949円
D I A M DC バランス・F (成長型)	60,755,446円	81,334,337円
クルーズコントロール< DC 年 金>	73,605円	380,482円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	3,971,426円	16,719,561円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	7,035,679円	46,793,768円
投資のソムリエ< DC 年金> リ スク抑制型	762,065円	3,885,943円
ダイナミック・ナビゲーション	－円	497,322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)	199,876,126円	174,944,494円
D I A M ワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	113,636,589円	117,339,447円
D I A M グローバル・バラン ス ファンド 2 5 V A (適格機関投 資家限定)	492,301,556円	273,900,140円
D I A M グローバル・バラン ス ファンド 5 0 V A (適格機関投 資家限定)	474,003,080円	457,247,022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)	39,526,570円	35,558,614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)	166,681,120円	141,842,511円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA (適格機関投資家 限定)	39,752,947円	37,322,761円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA (適格機関投資家 限定)	58,181,496円	48,997,248円
D I A M世界バランスファンド 40VA (適格機関投資家限 定)	5,219,612,585円	3,354,560,573円
D I A M世界バランスファンド 50VA (適格機関投資家限 定)	1,982,163,464円	1,132,981,860円
D I A Mバランスファンド25 VA (適格機関投資家限定)	1,997,353,962円	1,866,566,486円
D I A Mバランスファンド 37.5VA (適格機関投資家 限定)	1,598,529,122円	1,547,973,027円
D I A Mバランスファンド50 VA (適格機関投資家限定)	4,159,227,906円	4,094,747,610円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA (適格機関投 資家限定)	319,046,954円	342,933,197円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2 (適格機関 投資家限定)	847,270,983円	843,348,091円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適 格機関投資家限定)	999,463,797円	978,554,556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)	4,058,272,373円	3,995,531,779円
D I A Mグローバルβ私募ファン ド (適格機関投資家向け)	46,003,219円	51,147,517円
D I A M世界バランスファンド 55VA (適格機関投資家限 定)	1,326,335,640円	1,407,500,666円
D I A M世界バランスファンド 35VA (適格機関投資家限 定)	5,832,541,011円	5,531,171,471円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA (適格機関投資 家限定)	20,951,975,557円	21,791,461,352円

	D I A M世界アセットバランス ファンド40VA (適格機関投 資家限定)	793,931,787円	798,051,519円
	D I A M世界アセットバランス ファンド25VA (適格機関投 資家限定)	2,393,749,966円	2,492,557,857円
	D I A M世界アセットバランス ファンド3VA (適格機関投資 家限定)	13,362,055,990円	13,755,337,783円
	D I A Mバランス30VA (適 格機関投資家限定)	4,455,809円	7,974,250円
	D I A Mバランス50VA (適 格機関投資家限定)	7,115,578円	761,002円
	D I A Mバランス70VA (適 格機関投資家限定)	5,949,384円	5,724,599円
	D I A M世界アセットバランス ファンド4VA (適格機関投資 家限定)	12,007,265,860円	12,368,104,415円
	D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	112,585,022円	111,779,801円
	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	42,353,931円	43,892,220円
	D I A Mバランス20VA (適 格機関投資家限定)	39,006,138円	26,228,863円
	D I A Mバランス40VA (適 格機関投資家限定)	12,076,611円	40,046,439円
	D I A Mバランス60VA (適 格機関投資家限定)	120,493円	131,089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)	670,998,289円	729,123,003円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA (1303) (適格機関投資家限定)	1,887,540,594円	1,971,158,603円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA (1306) (適格機関投資家限定)	2,485,634,300円	2,597,804,800円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA (1309) (適格機関投資家限定)	94,839,111円	105,546,296円
	計	142,969,149,329円	144,400,734,532円
2.	受益権の総数	142,969,149,329口	144,400,734,532口
3.	※2 差入代用有価証券	株式 2,965,500,000円	株式 3,058,000,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,945,500,000	—	3,762,720,000	△182,780,000	2,486,923,600	—	2,474,750,000	△12,173,600
合計	3,945,500,000	—	3,762,720,000	△182,780,000	2,486,923,600	—	2,474,750,000	△12,173,600

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1.8933円	1.9100円
(1万口当たり純資産額)	(18,933円)	(19,100円)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		5,472,962,846	—
コール・ローン		—	2,145,350,595
国債証券		323,036,447,800	320,717,185,000
地方債証券		26,836,345,819	23,811,045,755
特殊債券		22,621,064,661	20,211,226,128
社債券		20,858,587,300	18,361,049,020
未収入金		5,561,648,080	1,490,683,400
未収利息		1,289,905,463	1,183,662,464
前払費用		21,283,042	10,304,086
流動資産合計		405,698,245,011	387,930,506,448
資産合計		405,698,245,011	387,930,506,448
負債の部			
流動負債			
未払金		—	4,090,310,000
未払解約金		6,394,594,000	552,031,000
流動負債合計		6,394,594,000	4,642,341,000
負債合計		6,394,594,000	4,642,341,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	311,246,557,550	293,322,586,786
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		88,057,093,461	89,965,578,662
元本等合計		399,303,651,011	383,288,165,448
純資産合計		399,303,651,011	383,288,165,448
負債純資産合計		405,698,245,011	387,930,506,448

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
<p>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</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p>	<p>345,746,995,990円</p> <p>87,184,744,613円</p> <p>121,685,183,053円</p>	<p>311,246,557,550円</p> <p>31,467,790,280円</p> <p>49,391,761,044円</p>
<p>元本の内訳 ファンド名</p>		
<p>D I A M国内債券パッシブ・ファンド</p>	<p>9,175,982,314円</p>	<p>10,103,767,469円</p>
<p>M I T O ラップ型ファンド (安定型)</p>	<p>184,519,752円</p>	<p>174,842,311円</p>
<p>M I T O ラップ型ファンド (中立型)</p>	<p>135,188,893円</p>	<p>121,867,322円</p>
<p>M I T O ラップ型ファンド (積極型)</p>	<p>55,433,709円</p>	<p>35,866,940円</p>
<p>グローバル8資産ラップファンド (安定型)</p>	<p>439,534,915円</p>	<p>367,269,645円</p>
<p>グローバル8資産ラップファンド (中立型)</p>	<p>113,983,594円</p>	<p>107,651,144円</p>
<p>グローバル8資産ラップファンド (積極型)</p>	<p>20,718,437円</p>	<p>15,647,878円</p>
<p>たわらノーロード 国内債券</p>	<p>352,758,070円</p>	<p>890,980,674円</p>
<p>たわらノーロード 国内債券< ラップ向け></p>	<p>—円</p>	<p>755,274円</p>
<p>D I A M国内債券インデックス ファンド<DC年金></p>	<p>11,609,907,063円</p>	<p>12,261,382,870円</p>
<p>D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 1 安定型</p>	<p>4,397,137,375円</p>	<p>4,552,232,888円</p>
<p>D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 2 安定・成長型</p>	<p>6,424,462,977円</p>	<p>6,491,172,492円</p>
<p>D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 3 成長型</p>	<p>2,637,655,262円</p>	<p>2,554,420,292円</p>
<p>D I A M DC バランス30 インデックスファンド</p>	<p>1,668,885,289円</p>	<p>1,616,740,563円</p>
<p>D I A M DC バランス50 インデックスファンド</p>	<p>1,829,884,341円</p>	<p>1,716,557,175円</p>

D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	275,586,880円	239,516,995円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	118,176,862円	106,519,798円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,437,259,337円	2,248,236,465円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	7,449,695円	5,859,192円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	223,190,480円	288,234,534円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	166,232,315円	211,832,153円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	41,960,388円	49,295,583円
投資のソムリエ	5,533,410,782円	4,989,277,922円
クルーズコントロール	604,204,415円	1,685,775,728円
投資のソムリエ<DC年金>	99,483,266円	130,158,493円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	706,595,262円	889,101,210円
D I A M D C バランス・F (成長型)	50,283,533円	65,750,112円
クルーズコントロール<DC年 金>	151,948円	659,560円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	2,220,634円	7,729,708円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	3,942,514円	21,556,556円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	10,975,697円	37,868,678円
ダイナミック・ナビゲーシ ョン	—円	1,445,892円
みずほエマージングボンドオー プン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	31,110,776,277円	31,064,453,322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)	925,357,458円	1,302,703,663円
D I A Mワールドバランス 2 5 VA(適格機関投資家限定)	598,181,155円	568,274,260円
D I A Mグローバル・バラン スファンド 2 5 VA(適格機関投 資家限定)	890,668,185円	484,269,033円
D I A Mグローバル・バラン スファンド 5 0 VA(適格機関投 資家限定)	295,141,650円	269,285,475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)	145,393,586円	122,287,293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)	396,454,681円	313,566,755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)	158,862,523円	137,516,139円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA (適格機関投資家 限定)	122,661,862円	96,262,182円
D I A M世界バランスファンド 40VA (適格機関投資家限 定)	12,416,124,695円	7,332,535,891円
D I A M世界バランスファンド 50VA (適格機関投資家限 定)	4,716,711,039円	2,476,500,279円
D I A Mバランスファンド25 VA (適格機関投資家限定)	8,456,183,355円	7,335,136,097円
D I A Mバランスファンド 37.5VA (適格機関投資家 限定)	3,795,959,754円	3,421,753,737円
D I A Mバランスファンド50 VA (適格機関投資家限定)	6,570,343,905円	6,029,577,784円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA (適格機関投 資家限定)	787,739,006円	757,730,885円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2 (適格機関 投資家限定)	3,456,549,937円	3,103,032,469円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適 格機関投資家限定)	4,821,704,426円	4,331,363,618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)	6,663,294,119円	5,843,289,923円
D I A Mグローバルβ私募ファン ド (適格機関投資家向け)	839,267,900円	812,385,968円
D I A M世界バランスファンド 55VA (適格機関投資家限 定)	6,555,700,476円	6,252,621,067円
D I A M世界バランスファンド 35VA (適格機関投資家限 定)	6,940,477,535円	6,389,387,464円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA (適格機関投資 家限定)	89,526,721,508円	85,545,143,036円

D I A M世界アセットバランス ファンド40VA (適格機関投 資家限定)	1,276,115,973円	1,175,876,654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)	7,766,460,038円	7,347,795,635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)	28,803,192,292円	27,024,083,226円
D I A Mバランス30VA (適 格機関投資家限定)	58,681,744円	94,176,422円
D I A Mバランス50VA (適 格機関投資家限定)	29,226,882円	2,802,834円
D I A Mバランス70VA (適 格機関投資家限定)	9,770,347円	8,430,190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)	32,292,361,602円	30,379,068,748円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	593,551,673円	539,740,633円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	158,113,403円	151,004,336円
D I A Mバランス20VA (適 格機関投資家限定)	641,936,416円	383,593,137円
D I A Mバランス40VA (適 格機関投資家限定)	69,505,002円	206,783,882円
D I A Mバランス60VA (適 格機関投資家限定)	330,308円	320,394円
計	311,246,557,550円	293,322,586,786円
2. 受益権の総数	311,246,557,550口	293,322,586,786口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1 口当たり純資産額	1,282,900円	1,306,700円
(1万口当たり純資産額)	(12,829円)	(13,067円)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		805,145,627	2,596,581,721
金銭信託		85,897,312	—
コール・ローン		—	86,902,389
株式		236,834,617,141	239,112,128,356
投資信託受益証券		789,271,471	872,514,559
投資証券		5,598,714,114	6,007,560,268
派生商品評価勘定		29,661,401	40,443,198
未収入金		159,029,454	1,117,292
未収配当金		490,890,995	516,333,299
差入委託証拠金		1,511,748,469	1,155,724,413
流動資産合計		246,304,975,984	250,389,305,495
資産合計		246,304,975,984	250,389,305,495
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		29,068,874	1,034,102
未払解約金		550,706,000	116,596,000
流動負債合計		579,774,874	117,630,102
負債合計		579,774,874	117,630,102
純資産の部			
元本等			
元本	※1	101,062,929,782	100,289,360,294
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		144,662,271,328	149,982,315,099
元本等合計		245,725,201,110	250,271,675,393
純資産合計		245,725,201,110	250,271,675,393
負債純資産合計		246,304,975,984	250,389,305,495

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25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	109,314,267,788円	101,062,929,782円
同期中追加設定元本額	20,720,942,880円	10,777,449,334円
同期中一部解約元本額	28,972,280,886円	11,551,018,822円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,265,346,668円	1,885,865,866円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	5,067,406円	7,181,511円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	10,330,738円	16,077,859円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	24,590,871円	36,837,702円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	12,074,361円	15,083,867円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	8,743,829円	14,242,184円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	9,184,637円	16,098,392円
たわらノーロード 先進国株式	826,190,880円	1,780,579,780円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	－円	426,031円
DIAM外国株式インデックス ファンド<DC年金>	34,283,257,934円	35,388,002,795円
DIAMバランス・ファンド< DC年金>1安定型	169,874,284円	180,412,814円
DIAMバランス・ファンド< DC年金>2安定・成長型	905,415,134円	935,896,872円
DIAMバランス・ファンド< DC年金>3成長型	1,068,407,169円	1,121,704,085円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	140,986,314円	146,392,355円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	406,671,520円	410,806,415円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	338,651,848円	344,162,987円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	43,215,717円	45,391,084円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	874,460,875円	958,076,304円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	242,048,956円	236,734,710円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	19,784,452円	26,518,123円

D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	39,211,766円	53,198,477円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	83,633,667円	102,429,349円
投資のソムリエ	477,923,774円	381,820,394円
クルーズコントロール	116,268,511円	373,432,127円
投資のソムリエ<DC年金>	9,139,329円	10,195,908円
D I A M 8資産バラン スファンドN<DC年金>	60,602,702円	83,194,086円
D I A M D C バランス・F (成長型)	21,789,339円	29,515,916円
クルーズコントロール<DC年 金>	29,118円	144,987円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,060,414円	4,264,805円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	1,885,928円	11,938,064円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	389,909円	1,980,539円
ダイナミック・ナビゲーション	－円	879,618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)	246,302,019円	204,554,102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)	3,399,312,717円	3,239,660,527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)	117,716,486円	109,792,772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)	－円	392,381円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	38,663,574円	38,055,376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)	380,345,852円	207,425,551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)	374,359,591円	346,296,546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)	31,054,047円	26,932,972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)	198,593,205円	161,322,522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)	15,800,472円	14,126,448円

D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	30,800,758円	24,735,172円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,146,137,174円	2,564,941,915円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,361,996,766円	1,299,656,432円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,057,860,672円	942,160,195円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,111,132,004円	1,025,727,779円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,303,720,878円	3,101,085,306円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	1,243,117,731円	1,314,101,642円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	1,975,013,508円	1,939,460,157円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,590,347,521円	1,483,700,093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)	1,062,501,229円	999,974,970円
D I A Mグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け)	12,333,699円	13,494,600円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	4,679,814,254円	4,881,115,646円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	1,794,957,557円	1,727,954,755円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	11,097,820,859円	11,000,313,965円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	630,608,542円	604,405,763円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,901,357,227円	1,887,705,576円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	7,078,616,550円	6,943,701,949円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	17,738,254円	30,217,326円

	D I A M バランス 5 0 V A (適格機関投資家限定)	22,620,054円	2,304,631円
	D I A M バランス 7 0 V A (適格機関投資家限定)	17,318,549円	15,885,893円
	D I A M 世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	9,537,135,837円	9,366,800,018円
	D I A M バランス 2 0 V A (適格機関投資家限定)	92,569,470円	60,124,924円
	D I A M バランス 4 0 V A (適格機関投資家限定)	28,741,863円	91,450,334円
	D I A M バランス 6 0 V A (適格機関投資家限定)	282,813円	296,050円
	計	101,062,929,782円	100,289,360,294円
2.	受益権の総数	101,062,929,782口	100,289,360,294口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	534,711,398	—	535,463,600	△752,202	152,157,444	—	152,223,500	△66,056
アメリカ・ドル	362,801,552	—	363,395,200	△593,648	91,418,750	—	91,449,000	△30,250
イギリス・ポンド	43,862,032	—	43,721,600	140,432	13,272,064	—	13,326,000	△53,936
オーストラリア・ドル	19,353,404	—	19,324,400	29,004	7,654,600	—	7,662,400	△7,800
カナダ・ドル	18,676,884	—	18,816,300	△139,416	4,664,070	—	4,666,200	△2,130
ユーロ	90,017,526	—	90,206,100	△188,574	35,147,960	—	35,119,900	28,060
合計	534,711,398	—	535,463,600	△752,202	152,157,444	—	152,223,500	△66,056

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

株式関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	2,204,383,417	—	2,205,728,146	1,344,729	4,061,720,771	—	4,101,195,923	39,475,152
合計	2,204,383,417	—	2,205,728,146	1,344,729	4,061,720,771	—	4,101,195,923	39,475,152

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	2.4314円	2.4955円
(1万口当たり純資産額)	(24,314円)	(24,955円)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,674,514,331	3,917,423,603
金銭信託		273,381,282	—
コール・ローン		—	250,702,544
国債証券		258,776,560,149	249,457,211,643
派生商品評価勘定		325,815	45,478
未収利息		2,367,321,596	1,993,798,760
前払費用		46,246,607	90,518,939
流動資産合計		265,138,349,780	255,709,700,967
資産合計		265,138,349,780	255,709,700,967
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,539,709	—
未払解約金		936,520,000	67,543,000
流動負債合計		938,059,709	67,543,000
負債合計		938,059,709	67,543,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	149,167,353,470	153,987,236,214
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		115,032,936,601	101,654,921,753
元本等合計		264,200,290,071	255,642,157,967
純資産合計		264,200,290,071	255,642,157,967
負債純資産合計		265,138,349,780	255,709,700,967

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>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>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
<p>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</p>	<p>183,852,928,058円 22,714,623,570円 57,400,198,158円</p>	<p>149,167,353,470円 19,990,216,220円 15,170,333,476円</p>
<p>元本の内訳 ファンド名 D I A M外国債券パッシブ・ファンド 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） グローバル8資産ラップファンド（安定型） グローバル8資産ラップファンド（中立型） グローバル8資産ラップファンド（積極型） たわらノーロード 先進国債券 たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け></p>	<p>4,608,868,777円 17,135,667円 49,601,868円 84,885,603円 40,812,730円 41,966,921円 31,685,325円 154,189,800円 －円</p>	<p>4,734,991,628円 18,742,650円 49,229,931円 74,374,850円 39,368,616円 43,608,079円 32,497,829円 390,642,897円 606,412円</p>

D I A M 外国債券インデックス ファンド<DC年金>	4,589,345,800円	4,704,426,879円
D I A M バランス・ファンド< DC年金> 1 安定型	381,621,256円	435,921,478円
D I A M バランス・ファンド< DC年金> 2 安定・成長型	1,283,530,211円	1,406,622,480円
D I A M バランス・ファンド< DC年金> 3 成長型	1,366,997,870円	1,420,070,472円
D I A M DC バランス 3 0 インデックスファンド	325,115,189円	338,907,679円
D I A M DC バランス 5 0 インデックスファンド	702,091,373円	706,238,360円
D I A M DC バランス 7 0 インデックスファンド	505,339,054円	515,422,473円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	27,849,563円	27,624,031円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	568,221,729円	579,380,141円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,844,770円	15,280,613円
D I A M DC 8 資産バラン スファンド (新興国 1 0)	8,241,243円	11,934,817円
D I A M DC 8 資産バラン スファンド (新興国 2 0)	14,982,115円	21,120,737円
D I A M DC 8 資産バラン スファンド (新興国 3 0)	29,626,646円	38,281,227円
クルーズコントロール	416,028,978円	1,361,582,815円
D I A M 8 資産 バランスファ ンドN<DC年金>	25,339,893円	34,924,753円
D I A M DC バランス・F (成長型)	25,127,893円	37,284,488円
クルーズコントロール<DC年 金>	104,666円	530,346円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	3,004,878円	12,415,786円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	5,367,737円	34,857,452円
ダイナミック・ナビゲーション	－円	495,798円
D I A M パッシブ資産分散ファ ンド	1,803,256,689円	1,681,199,585円
D I A M 為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド (適 格機関投資家向け)	6,936,738,041円	7,840,256,212円
D I A M 外国債券パッシブファ ンド (適格機関投資家向け)	4,671,354,435円	4,290,559,339円
外国債券パッシブファンド (適 格機関投資家限定)	2,389,669,712円	4,758,540,866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)	195,054,050円	182,836,916円

D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	125, 179, 732円	133, 408, 183円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	2, 536, 469, 224円	1, 495, 700, 651円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	833, 903, 203円	832, 079, 876円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	100, 546, 922円	94, 577, 123円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	183, 536, 447円	161, 289, 570円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	43, 892, 957円	42, 434, 281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)	21, 332, 413円	18, 556, 524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)	8, 626, 781, 465円	5, 776, 686, 399円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	2, 181, 728, 841円	1, 300, 468, 992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)	5, 129, 506, 277円	4, 953, 852, 079円
D I A Mバランスファンド 3 7. 5 V A (適格機関投資家 限定)	2, 858, 417, 978円	2, 860, 534, 037円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	4, 576, 434, 371円	4, 655, 595, 218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)	881, 138, 244円	974, 202, 071円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	3, 273, 256, 957円	3, 354, 342, 863円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	4, 397, 691, 775円	4, 483, 555, 025円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	16, 100, 828, 427円	16, 880, 654, 371円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	56, 954, 254円	64, 131, 288円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	2, 193, 691, 472円	2, 406, 308, 062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)	10,833,445,814円	11,168,532,699円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	15,360,947,657円	16,514,948,859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)	19,589,996,575円	20,855,041,860円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	14,748,909円	27,238,496円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	19,587,305円	2,162,904円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	6,546,806円	6,506,045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)	17,612,128,830円	18,752,930,259円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	124,173,768円	127,071,862円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	129,091,817円	89,579,154円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	33,261,642円	113,920,521円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	132,906円	148,307円
計	149,167,353,470円	153,987,236,214円
2. 受益権の総数	149,167,353,470口	153,987,236,214口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	973,770,226	—	974,984,120	△1,213,894	246,163,188	—	246,117,710	45,478
アメリカ・ドル	486,997,104	—	487,778,840	△781,736	112,558,880	—	112,548,800	10,080
イギリス・ポンド	86,047,075	—	85,726,350	320,725	—	—	—	—
ユーロ	400,726,047	—	401,478,930	△752,883	133,604,308	—	133,568,910	35,398
合計	973,770,226	—	974,984,120	△1,213,894	246,163,188	—	246,117,710	45,478

(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。
 - ①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。
 - ②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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1.7712円	1.6602円
(1万口当たり純資産額)	(17,712円)	(16,602円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

平成28年8月31日現在

I 資産総額	9,219,072,128円
II 負債総額	1,042,747円
III 純資産総額 (I - II)	9,218,029,381円
IV 発行済数量	6,082,864,267口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.5154円

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

平成28年8月31日現在

I 資産総額	19,965,638,016円
II 負債総額	8,027,800円
III 純資産総額 (I - II)	19,957,610,216円
IV 発行済数量	11,753,685,826口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.6980円

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

平成28年8月31日現在

I 資産総額	15,266,902,967円
II 負債総額	4,107,792円
III 純資産総額 (I - II)	15,262,795,175円
IV 発行済数量	8,147,481,441口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.8733円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

平成28年8月31日現在

I 資産総額	282,706,870,254円
II 負債総額	280,516,800円
III 純資産総額 (I - II)	282,426,353,454円
IV 発行済数量	145,011,552,087口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.9476円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

I 資産総額	394,493,662,031円
II 負債総額	9,772,769,000円
III 純資産総額 (I - II)	384,720,893,031円
IV 発行済数量	295,615,138,455口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3014円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

I 資産総額	256,591,738,240円
II 負債総額	308,260,118円
III 純資産総額 (I - II)	256,283,478,122円
IV 発行済数量	100,436,350,060口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.5517円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

I 資産総額	261,290,759,093円
II 負債総額	296,343,041円
III 純資産総額 (I - II)	260,994,416,052円
IV 発行済数量	154,288,070,704口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.6916円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①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。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成28年10月1日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成28年10月1日現在）

① 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。

② 投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

平成28年8月31日現在、D I A Mアセットマネジメント株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	392	5,889,391,856,643
単位型公社債投資信託	49	344,511,981,244
単位型株式投資信託	7	79,197,511,703
合計	448	6,313,101,349,590

（ご参考）

平成28年8月31日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額（円）
追加型公社債投資信託	13	263,953,485,574
追加型株式投資信託	232	2,245,140,638,646
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,483,762,979
合計	248	2,510,577,887,199

・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	25	645,515,628,611
追加型株式投資信託	243	3,151,408,584,879
単位型公社債投資信託	6	40,509,834,945
単位型株式投資信託	78	282,536,779,714
合計	352	4,119,970,828,149

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I AMアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
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31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

※D I AM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、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新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表を参考として添付しております。

独立監査人の監査報告書


平成28年5月31日

D I A Mアセットマネジメント株式会社


取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

山内 功彦 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

山野 浩 

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

(単位：千円)

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

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

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

会計上の見積りの変更

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

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

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

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

※1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

※2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

※1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

※2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
①非上場株式	80,246	77,696
②関係会社株式	2,316,596	3,229,196
③差入保証金	733,907	2,040,945

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

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

③差入保証金は、本社オフィス等の不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期 (平成27年3月31日現在)

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

第31期 (平成28年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
①株式	516,710	146,101	370,608
②債券	—	—	—
③その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
①株式	—	—	—
②債券	—	—	—
③その他（投資信託）	—	—	—
小計	—	—	—
合計	532,891	159,101	373,789

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
①株式	365,683	146,101	219,581
②債券	—	—	—
③その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
①株式	—	—	—
②債券	—	—	—
③その他（投資信託）	—	—	—
小計	—	—	—
合計	381,005	159,101	221,903

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

(金銭の信託関係)

1. 運用目的の金銭の信託

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。
- (注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3) 兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払 手数料	372,837
								預金の預入 (純額)	879,733	現金・ 預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収 収益	123
	みずほ第 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	—	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	557,013	未払 費用	292,861
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	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)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の 支払	8,336		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

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

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

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(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。
- 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、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。

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



指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井 純子



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

(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	4,716,474	4,716,474
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	17,872,927	19,042,177
自己株式	-	△377,863
株主資本合計	24,635,002	25,426,389
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	726,935	137,791
純資産合計	25,361,937	25,564,180
負債純資産合計	29,973,099	29,654,112

(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	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						
	利益剰余金						株主資本 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		
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							
	利益準備金	利益剰余金					自己株式	株主資本合計
		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

① 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。

② 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

①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います。

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。

②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、定期的到时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います。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）			
① ヘッジ会計が適用されていないもの	(3,601)	(3,601)	-
② 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）			
① ヘッジ会計が適用されていないもの	(220)	(220)	-
② 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 其他有価証券」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 其他有価証券のうち 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 其他有価証券のうち 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 其他有価証券

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 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			
① 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			
① 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			
① 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)
① 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)
① 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）

該当するものではありません。

(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、記載していません。

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。

(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。

なお、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、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。


独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日


新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

伊藤 忠信 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

福村 寛 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

(1) 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	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。

①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。

②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

① 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。

② 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。

③ 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			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③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			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③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			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③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			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③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			
①国債・地方債等	-	-	-
②社債	-	-	-
③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			
① 国債・地方債等	-	-	-
② 社債	-	-	-
③ 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)
①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%

②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の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。

	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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

追加型証券投資信託

DIAM バランス・ファンド<DC 年金> 1 安定型

約 款

アセットマネジメント One 株式会社

運用の基本方針

約款第 17 条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。

2) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が 40%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が 30%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、当社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果を目指して運用します。

(注) 当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については TOPIX（東証株価指数、配当込み）、国内債券については NOMURA - BPI 総合、外国株式については MSCI コクサイインデックス（円換算ベース、配当込み）、外国債券についてはシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行い

ません。

- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 40%以下とします。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 15%以下とします。
- 3) 各マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 4) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 5) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 6) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第 22 条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第 23 条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第 24 条の範囲で行います。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
DIAM バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメント One 株式会社を委託者としみずは信託銀行株式会社を受託者とします。

- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けません。

<信託事務の委託>

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

<信託の目的、金額および限度額>

第 3 条 委託者は、金 100 万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金 1 兆円を限度として信託金を追加することができるものとします。
- 3) 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 4) 委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 49 条第 7 項、第 51 条第 1 項、第 52 条第 1 項、第 53 条第 1 項および第 55 条第 2 項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

<受益権の分割および再分割>

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権について 100 万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- 2) 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する

る法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

第 6 条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第 7 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 5 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- 2) この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 27 条に規定する借入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従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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- 3) 第 30 条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第 10 条 この信託の受益権は、平成 19 年 1 月 4 日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権

の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- 2) 委託者は、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つて、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、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、委託者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なわないものとします。

- 3) 委託者は、第5条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。
- 4) 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第 11 条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<受益権の申込み単位、価額および手数料>

第 12 条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1 口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- 2) 第 1 項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第 3 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- 3) 第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- 4) 前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については 1 口につき 1 円とします。）に乗じて得た額とします。
- 5) 前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第 46 条第 2 項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第 40 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 6) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所(金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。)における

取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

第 13 条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

2) 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項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なわれるよう通知するものとします。

3) 委託者は、第 1 項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

<受益権の譲渡の対抗要件>

第 14 条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

第 15 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第16条 委託者は、信託金を主として第1号から第4号までのアセットマネジメント One 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第5号以降の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
2. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. 株券または新株引受権証券
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）

18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- 2) 委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 3) 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- 4) 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の40を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、

有価証券の値上がり等により 100 分の 40 を超えることとなった場合には、これを調整します。

- 5) 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。
- 6) 委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 15 を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 前 3 項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<運用の基本方針>

第 17 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第 18 条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- 2) 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第 19 条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

- 2) 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める

当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<同一銘柄の転換社債等への投資制限>

第 20 条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

- 2) 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<信用取引の指図範囲>

第 21 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

<先物取引等の運用指図・目的・範囲>

第 22 条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマ

ザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプ

レミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が

当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 6) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

- 8) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第 24 条の 2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

第 25 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

<公社債の空売りの指図範囲>

第 26 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

<公社債の借入れ>

第 27 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と

認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2) 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の30を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

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

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第29条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約の指図>

第30条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、

マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 4) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- 2) 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- 3) 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- 4) 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法による

ほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第 35 条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第 36 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第 37 条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の 10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第 38 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第 39 条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当が

ある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- 2) 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- 3) 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、毎年2月26日から翌年2月25日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成14年12月13日から平成16年2月25日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

- 2) 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<信託財産に関する報告>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 2) 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

<信託事務の諸費用>

第42条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき当該消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで …年10,000分の31

2. 平成 17 年 10 月 1 日から信託終了の日まで …年 10,000 分の 26
- 2) 前項の信託報酬は、毎年 8 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとし、
- 3) 第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第 44 条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

<収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第 45 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 47 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 47 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- 2) 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

第 46 条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- 2) 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末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者の指定する証券会社または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- 3) 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- 4) 前項および第 47 条第 4 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第 47 条 償還金は、信託終了後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- 2) 一部解約金は、第 49 条第 1 項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 6 営業日目から当該受益者に支払います。
- 3) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。
- 4) 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第 48 条 受益者が、信託終了による償還金について第 47 条第 1 項に規定する支払い開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

第 49 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- 2) 平成 19 年 1 月 4 日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- 3) 委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- 4) 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- 5) 委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- 6) 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受

益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。

- 7) 委託者は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第51条の規定を準用するものとします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

第51条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 6) 第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第 52 条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- 2) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第 56 条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第 53 条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- 2) 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 56 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第 54 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- 2) 委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第 55 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第 56 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- 2) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更>

第 56 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書

面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとしします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- 5) 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公 告>

第58条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am-one.co.jp/>

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

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第59条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- 2) 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第60条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

＜附 則＞

- 第 1 条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。
- 第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。
- 第 3 条 第 24 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- 第 4 条 第 24 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日

(信託契約締結日)

委託者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

追加型証券投資信託

DIAM バランス・ファンド<DC 年金> 2 安定・成長型

約 款

アセットマネジメント One 株式会社

運用の基本方針

約款第 17 条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。
- 2) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が 60%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が 50%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、当社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果を目指して運用します。

(注) 当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については TOPIX（東証株価指数、配当込み）、国内債券については NOMURA - BPI 総合、外国株式については MSCI コクサイインデックス（円換算ベース、配当込み）、外国債券についてはシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

- 3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 60%以下とします。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 15%以下とします。
- 3) 各マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 4) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 5) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 6) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 50%以下とします。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第 22 条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第 23 条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第 24 条の範囲で行います。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
DIAM バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメント One 株式会社を委託者としみずは信託銀行株式会社を受託者とします。

- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けません。

<信託事務の委託>

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

<信託の目的、金額および限度額>

第 3 条 委託者は、金 100 万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金 1 兆円を限度として信託金を追加することができますものとしします。
- 3) 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 4) 委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 49 条第 7 項、第 51 条第 1 項、第 52 条第 1 項、第 53 条第 1 項および第 55 条第 2 項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

<受益権の分割および再分割>

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権について 100 万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- 2) 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する

る法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- 2) この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入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従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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- 3) 第30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権

の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- 2) 委託者は、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つて、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、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、委託者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なわないものとします。

- 3) 委託者は、第5条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

- 4) 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第 11 条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<受益権の申込み単位、価額および手数料>

第 12 条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1 口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- 2) 第 1 項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第 3 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- 3) 第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- 4) 前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については 1 口につき 1 円とします。）に乗じて得た額とします。
- 5) 前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第 46 条第 2 項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第 40 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 6) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）における

取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

第 13 条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

2) 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項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なわれるよう通知するものとします。

3) 委託者は、第 1 項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

<受益権の譲渡の対抗要件>

第 14 条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

第 15 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第 16 条 委託者は、信託金を主として第 1 号から第 4 号までのアセットマネジメント One 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第 5 号以降の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
2. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. 株券または新株引受権証券
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
13. 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 5 号から第 15 号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）

19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- 2) 委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 3) 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- 4) 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の60を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の60を超えることとなった場合には、これを調整します。

- 5) 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- 6) 委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の15を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 前3項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<運用の基本方針>

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第18条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- 2) 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第19条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- 2) 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<同一銘柄の転換社債等への投資制限>

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- 2) 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<信用取引の指図範囲>

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

<先物取引等の運用指図・目的・範囲>

第 22 条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに

第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。) の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引に係る支

払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 6) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

- 8) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第 24 条の 2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

第 25 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

<公社債の空売りの指図範囲>

第 26 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

<公社債の借入れ>

第 27 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2) 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 第 1 項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第 28 条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 50 を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により 100 分の 50 を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

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

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第 29 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約の指図>

第 30 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファン

ドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 4) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- 2) 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- 3) 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、そ

の計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

- 4) 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第 35 条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第 36 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第 37 条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の 10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第 38 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第 39 条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- 2) 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- 3) 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第 40 条 この信託の計算期間は、毎年 2 月 26 日から翌年 2 月 25 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は平成 14 年 12 月 13 日から平成 16 年 2 月 25 日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

- 2) 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<信託財産に関する報告>

第 41 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 2) 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

<信託事務の諸費用>

第 42 条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第 40 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年 8 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき当該消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第 43 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 40 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成 17 年 9 月 30 日まで …年 10,000 分の 34
 2. 平成 17 年 10 月 1 日から信託終了の日まで …年 10,000 分の 29
- 2) 前項の信託報酬は、毎年 8 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
- 3) 第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第 44 条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

<収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第 45 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 47 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 47 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- 2) 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

第 46 条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- 2) 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- 3) 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- 4) 前項および第 47 条第 4 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第 47 条 償還金は、信託終了後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- 2) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 6 営業日目から当該受益者に支払います。
- 3) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。

- 4) 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第 48 条 受益者が、信託終了による償還金について第 47 条第 1 項に規定する支払い開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託者が受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

第 49 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

ただし、一部解約の実行の請求日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- 2) 平成 19 年 1 月 4 日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするとき、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- 3) 委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- 4) 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- 5) 委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- 6) 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。

- 7) 委託者は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回る事となった場合には、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第51条の規定を準用するものとします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

第51条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 6) 第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第 52 条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- 2) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第 56 条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第 53 条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- 2) 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 56 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第 54 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- 2) 委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する営業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第 55 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第 56 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- 2) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更>

第 56 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとしします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- 5) 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公 告>

第58条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am-one.co.jp/>

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

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第59条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- 2) 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第60条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

<附 則>

第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別

の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

第 3 条 第 24 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 4 条 第 24 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日 (信託契約締結日)

委託者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

追加型証券投資信託

DIAM バランス・ファンド<DC 年金> 3 成長型

約 款

アセットマネジメント One 株式会社

運用の基本方針

約款第 17 条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。
- 2) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が 80%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が 55%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、当社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果を目指して運用します。

(注) 当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については TOPIX（東証株価指数、配当込み）、国内債券については NOMURA - BPI 総合、外国株式については MSCI コクサイインデックス（円換算ベース、配当込み）、外国債券についてはシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

- 3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 80%未満とします。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 15%以下とします。
- 3) 各マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 4) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 5) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 6) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 55%以下とします。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第 22 条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第 23 条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第 24 条の範囲で行います。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
DIAM バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメント One 株式会社を委託者としみずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けません。

<信託事務の委託>

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

<信託の目的、金額および限度額>

第 3 条 委託者は、金 100 万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金 1 兆円を限度として信託金を追加することができるものとします。
- 3) 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 4) 委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 49 条第 7 項、第 51 条第 1 項、第 52 条第 1 項、第 53 条第 1 項および第 55 条第 2 項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

<受益権の分割および再分割>

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権について 100 万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- 2) 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第 6 条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第 7 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 5 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- 2) この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 28 条に規定する借入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従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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- 3) 第 30 条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第 10 条 この信託の受益権は、平成 19 年 1 月 4 日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。

以下同じ。)の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)及び当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)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(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)

- 2) 委託者は、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、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、委託者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なわないものとし、
- 3) 委託者は、第5条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとし、振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。
- 4) 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権(受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。)を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとし、振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券(当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。)は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。)および登録金融機関(委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に

規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)に当該申請の手続きを委任することができます。

<受益権の設定に係る受託者の通知>

第 11 条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<受益権の申込み単位、価額および手数料>

第 12 条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1 口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- 2) 第 1 項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第 3 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- 3) 第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- 4) 前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については 1 口につき 1 円とします。）に乗じて得た額とします。
- 5) 前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第 46 条第 2 項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第 40 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 6) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買また

は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。)における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

2) 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項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なわれるよう通知するものとします。

3) 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

<受益権の譲渡の対抗要件>

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

- ニ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第16条 委託者は、信託金を主として第1号から第4号までのアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第5号以降の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
2. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. 株券または新株引受権証券
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第

1 項第 10 号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)

18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。)
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。)
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
21. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。)
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
24. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。)
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第 5 号の証券または証書、第 16 号ならびに第 21 号の証券または証書のうち第 5 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 6 号から第 10 号までの証券および第 16 号ならびに第 21 号の証券または証書のうち第 6 号から第 10 号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第 17 号の証券および第 18 号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- 2) 委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 3) 第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第 1 号から第 4 号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- 4) 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産

の純資産総額の100分の80以上となる投資の指図しません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の80以上となった場合には、これを調整します。

- 5) 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- 6) 委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の15を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 前3項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<運用の基本方針>

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第18条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- 2) 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第19条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- 2) 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める

当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<同一銘柄の転換社債等への投資制限>

第 20 条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であつて当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

- 2) 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<信用取引の指図範囲>

第 21 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

<先物取引等の運用指図・目的・範囲>

第 22 条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ)。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファ

ンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引に係る支

払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第 24 条の 2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

第 25 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

<公社債の空売りの指図範囲>

第 26 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

<公社債の借入れ>

第 27 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2) 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の55を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の55を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

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

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第29条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約の指図>

第30条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産

の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 4) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- 2) 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- 3) 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- 4) 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第 35 条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第 36 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第 37 条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の 10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第 38 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第 39 条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

きます。

- 2) 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- 3) 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、毎年2月26日から翌年2月25日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成14年12月13日から平成16年2月25日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

- 2) 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<信託財産に関する報告>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 2) 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

<信託事務の諸費用>

第42条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき当該消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで …年10,000分の37
2. 平成17年10月1日から信託終了の日まで …年10,000分の32

- 2) 前項の信託報酬は、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
- 3) 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第44条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

<収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

- 第45条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第47条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第47条第2項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。
- 2) 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

- 第46条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- 2) 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、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けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- 3) 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- 4) 前項および第47条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第47条 償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- 2) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。
- 3) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。
- 4) 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第 48 条 受益者が、信託終了による償還金について第 47 条第 1 項に規定する支払い開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託者が受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

第 49 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

ただし、一部解約の実行の請求日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- 2) 平成 19 年 1 月 4 日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- 3) 委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- 4) 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- 5) 委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- 6) 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。
- 7) 委託者は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 10 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第 51 条の規定を準用するものとします。

<質権口記載又は記録の受益権の取り扱い>

第 50 条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

第 51 条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 6) 第 3 項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第 3 項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第 52 条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- 2) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第 56 条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取り扱い>

第 53 条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- 2) 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 56 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第 54 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- 2) 委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する営業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第 55 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第 56 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- 2) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更>

第 56 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとし、
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託約款の変更をしません。

- 5) 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第 57 条 第 51 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第 51 条第 3 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 30 条の 2 の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公 告>

第 58 条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am-one.co.jp/>

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

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第 59 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- 2) 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第 60 条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

<附 則>

第 1 条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得な

い事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとし
ます。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日 (信託契約締結日)

委 託 者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受 託 者 み ず ほ 信 託 銀 行 株 式 会 社

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
- 6) 有価証券等の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に海外の株式に投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- 5) 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
- 4) 有価証券等の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
- 2) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 5) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 6) 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
- 7) スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
- 8) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
- 9) 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。

運用の基本方針

約款第 15 条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 4) 有価証券等の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り
ます。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約
権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあら
かじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある
新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信
託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- 5) 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。
- 8) 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行いません。

