

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年5月13日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金 >  
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）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】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 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1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

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.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（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】

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行う場合は、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14日から平成29年5月12日まで

ただし、お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。

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、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：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

( 9 ) 【払込期日】

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、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：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

お申込みの方法

お申込みの際は、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受益権を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」にしたが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、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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し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かかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、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かか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】

当ファンドは、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

当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>

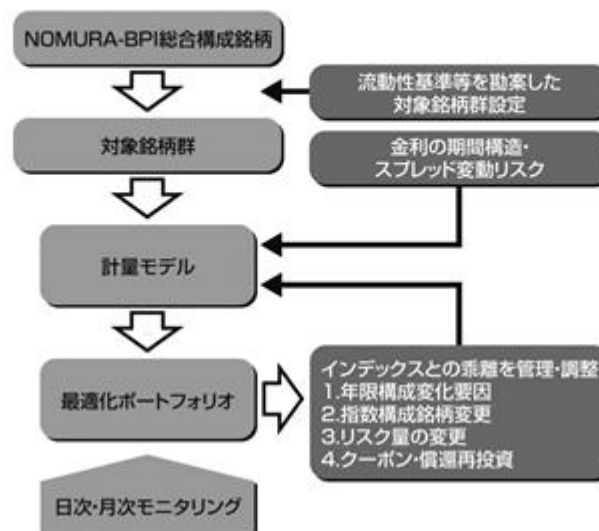
**1** 主に国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドに投資を行い、「NOMURA-BPI総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。

※NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）は、野村證券株式会社金融経済研究所が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に算出されます。

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

**2** 流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、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。



#### 分配方針

年1回の決算時(毎年2月14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

金支払われない場合もあります。

## 商品分類表

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	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ( )	特殊型
		資産複合	

(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

「国内」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 投資対象資産

「債券」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を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

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル ( )  日本		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (債券))	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ	その他 (NOMURA - BPI総合)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(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（債券））」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、主として債券へ実質的に投資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債券に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（債券））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

「日本」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。

対象インデックス

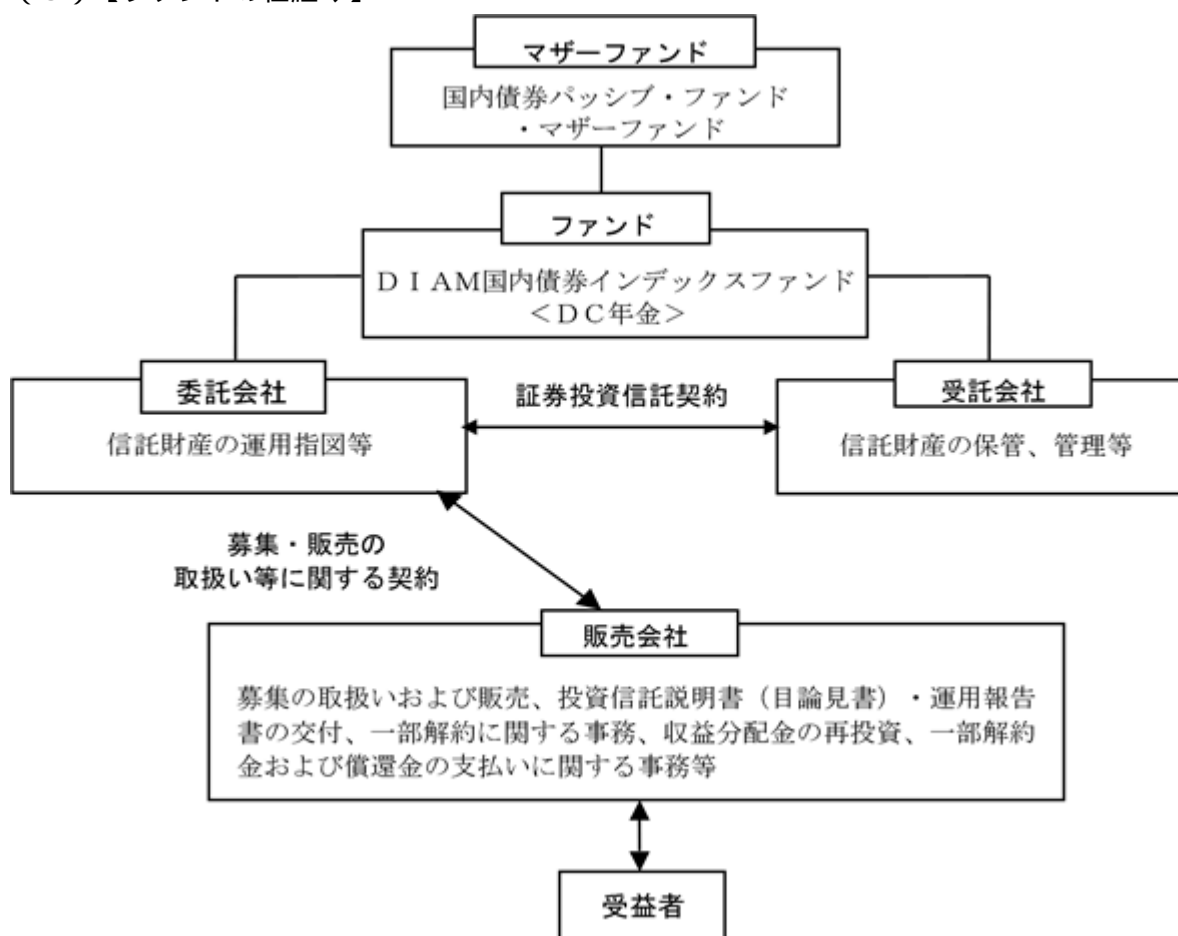
「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

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/>）をご覧ください。

## （２）【ファンドの沿革】

平成14年12月3日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## （３）【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

・「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あります。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

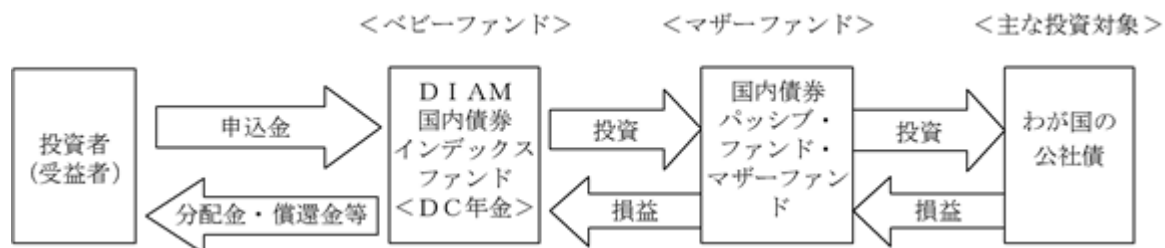
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、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受益証券に投資して、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：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成28年2月29日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社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「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

## 大株主の状況

（平成28年2月29日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
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	12,000株	50.0%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## &lt;基本方針&gt;

当ファンドは、NOMURA - B P I総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## &lt;投資対象&gt;

国内債券パッシブ・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。

## &lt;投資態度&gt;

- 1) 主として国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資し、NOMURA - B P I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。）の実質組入比率は、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) 公社債の実質組入比率の調整には、債券先物取引等を活用します。

当ファンドが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、上記 1)ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

## (2)【投資対象】

## 1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

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D I A Mアセットマネジメント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国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 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の新株引受権証券を除きます。)
- 5) 特定目的会社にかかる特定社債券(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。)
- 6) 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。)
- 7) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(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。)
- 8) 特定目的会社にかかる優先出資証券(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。)
- 9) 転換社債の転換、新株予約権(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。以下同じ。)の新株予約権に限ります。)の行使、株主割当または社債権者割当により取得した株券
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)~10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 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。)
- 13) 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。)
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。)
- 16) 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
- 17) 外国の者に対する権利で16)の有価証券の性質を有するもの

なお、上記9)の証券または証書および11)の証券または証書のうち9)の性質を有するものを以下「株式」といい、1)から5)までの証券および11)ならびに13)の証券または証書のうち1)から5)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」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5)の権利の性質を有するもの
4. 金融商品の指図範囲（約款第16条第3項）

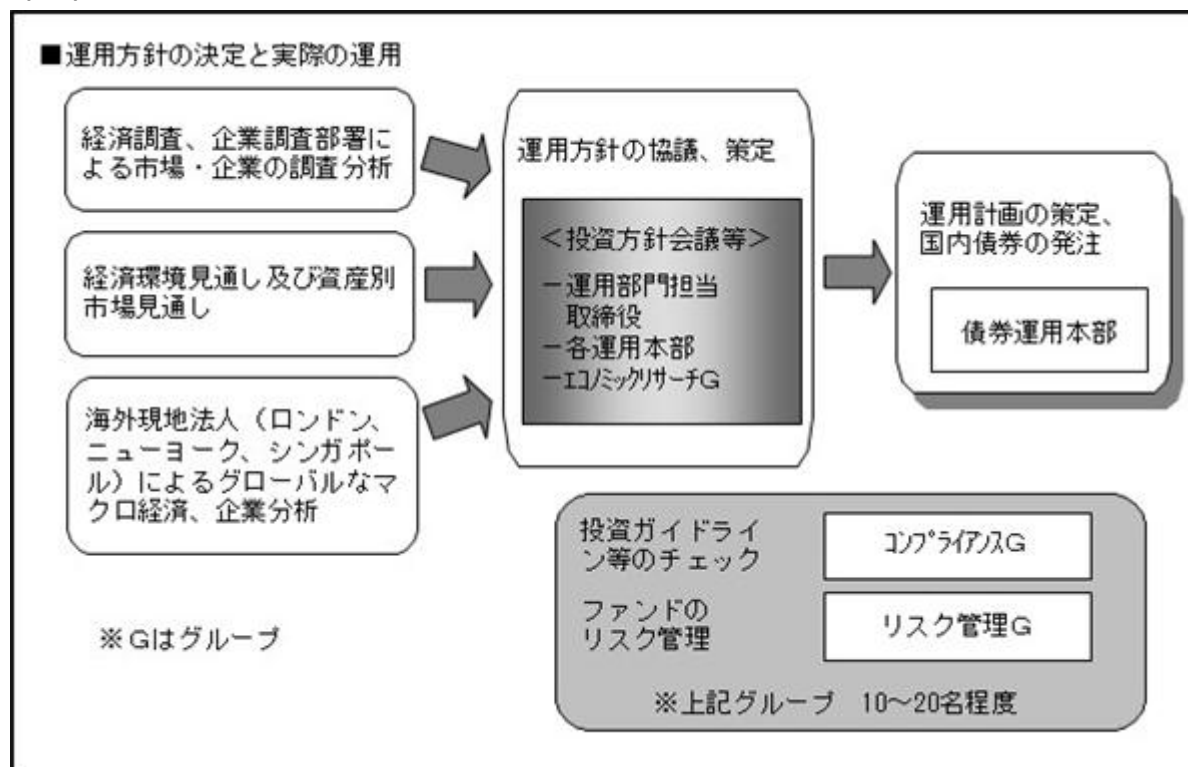
上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>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。</li> </ol>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## ( 3 ) 【運用体制】



経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部の運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等から得られた情報も参考にされます。

国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。それ以外の個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## ( 4 ) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時（原則として毎年2月14日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

## 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ないます。

#### 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、貸付有価証券にかかる品賃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かかる消費税および地方消費税(以下、「消費税等」といいます。)に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかか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かかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかか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。

#### 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代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)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) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)  
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せん。  
株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%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」(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10%以下とします。
- 3) 投資する株式等の範囲(約款第18条)  
委託会社が投資することを指図する株式は、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については、この限りではありません。
- 4) 同一銘柄の株式、転換社債等への投資制限(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

- (a) 同一銘柄の株式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10%以下とします。
- (b) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債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10%以下とします。

#### 5) 信用取引の指図範囲（約款第20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るものとします。
- (b) 上記(a)の信用取引の指図は、次の1.～5.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.～5.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
  - 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. 売り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、）の行使により取得可能な株券

#### 6) 先物取引等の運用指図・目的（約款第21条）

- (a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券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、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。)
- (b) 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為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかか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効率的な運用ならびに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かか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行うことの指図をすることができます。

#### 7) スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第22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、当該信託財産にかか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かか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かか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かか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。

#### 8) 金利先渡し取引および為替先渡し取引の運用指図・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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡し取引および為替先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの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) 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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。
- (d) 委託会社は、金利先渡し取引および為替先渡し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。

#### 9) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23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。

#### 10) 有価証券の貸付けの指図および範囲(約款第24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。
- (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るときは、担保の受入の指図を行うものとします。

#### 11) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第26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。

#### 12) 外貨為替予約の指図(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、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（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。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 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。

### 13) 資金の借入れ（約款第34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。

### 14) 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】

### (1) 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。

#### 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。当ファンドの実質的な主要投資対象である公社債は、一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、金利が下落した場合には価格は上昇します。したがって、金利が上昇した場合、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

#### 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。

### (2)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。

### (3)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。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてNOMURA - B P I 総合に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス構成全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入公社債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、基準価額と当該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、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及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、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

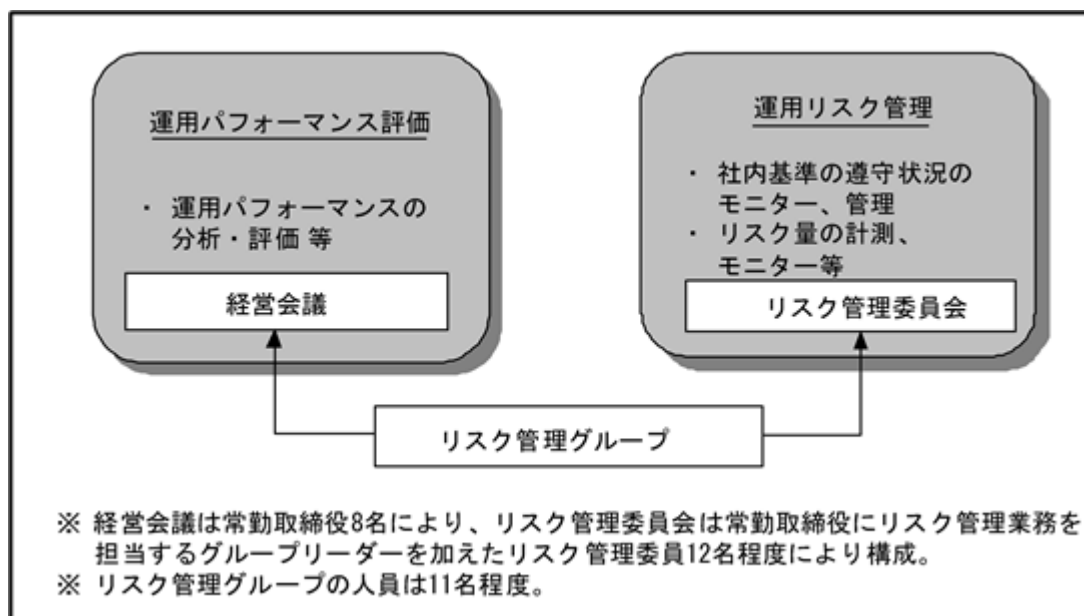
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、受益者のために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、実質的に公社債など値動きのある有価証券に投資しますので、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。

#### < 運用評価・運用リスク管理体制 >



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理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、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

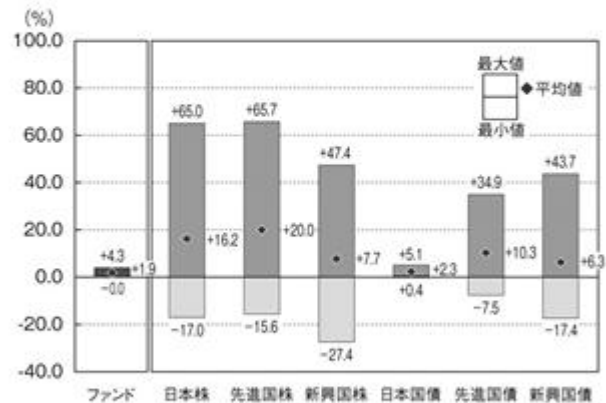
## （参考情報）

### 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。

### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



2011年3月～2016年2月

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

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.27%（税抜0.25%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.11%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.11%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎年8月14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】

## イ. 信託財産留保額

ありません。

## ロ. その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎年8月14日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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かかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、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

#### 収益分配時

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

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

#### 換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 損益通算について

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

### 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4月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

### 個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

#### <収益分配金の課税について>

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

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

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

税法が改正された場合等には、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】

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	14,985,204,593	100.01
内 日本	14,985,204,593	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	903,754	0.01
純資産総額	14,984,300,839	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）

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	325,573,515,000	81.60
内 日本	325,573,515,000	81.60
地方債証券	26,848,715,182	6.73
内 日本	26,848,715,182	6.73
特殊債券	22,629,557,051	5.67
内 日本	22,629,557,051	5.67
社債券	20,876,779,580	5.23
内 日本	20,576,804,580	5.16
内 オランダ	201,112,000	0.05
内 イギリス	98,863,000	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,068,808,147	0.77
純資産総額	398,997,374,960	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	11,678,906,238	1.2615 14,733,890,786	1.2831 14,985,204,593	- -	100.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.01%
合計	100.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	341回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	5,000,000,000	102.84 5,142,175,000	103.60 5,180,000,000	0.300000 2025/12/20	1.30%
2	124回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	5,000,000,000	101.02 5,051,250,000	101.47 5,073,850,000	0.100000 2020/6/20	1.27%
3	117回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	101.10 4,549,500,000	101.41 4,563,585,000	0.200000 2019/3/20	1.14%
4	123回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	101.00 4,545,270,000	101.41 4,563,495,000	0.100000 2020/3/20	1.14%
5	122回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	101.32 4,559,580,000	0.100000 2019/12/20	1.14%
6	106回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.54 4,524,705,000	100.65 4,529,430,000	0.200000 2017/9/20	1.14%
7	105回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.46 4,520,790,000	100.54 4,524,345,000	0.200000 2017/6/20	1.13%

8	116回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	101.29 4,254,516,000	0.200000 2018/12/20	1.07%
9	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	101.54 4,061,640,000	0.100000 2020/9/20	1.02%
10	338回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,500,000,000	103.35 3,617,320,000	104.66 3,663,135,000	0.400000 2025/3/20	0.92%
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	104.62 3,661,700,000	0.400000 2025/9/20	0.92%
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	101.51 3,552,990,000	0.200000 2019/6/20	0.89%
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	101.43 3,550,365,000	0.300000 2018/9/20	0.89%
14	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	100.80 3,326,565,000	0.200000 2017/12/20	0.83%
15	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	103.15 3,300,800,000	1.500000 2017/12/20	0.83%
16	313回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	107.78 3,233,640,000	1.300000 2021/3/20	0.81%
17	325回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	106.07 3,182,250,000	106.74 3,202,380,000	0.800000 2022/9/20	0.80%
18	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	104.64 3,139,350,000	0.400000 2025/6/20	0.79%
19	296回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	104.30 3,129,060,000	104.51 3,135,300,000	1.500000 2018/9/20	0.79%
20	301回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	105.84 3,069,447,000	1.500000 2019/6/20	0.77%
21	355回 利付国庫債券（2年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.36 3,010,950,000	100.46 3,014,010,000	0.100000 2017/8/15	0.76%
22	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	105.26 2,947,420,000	106.34 2,977,772,000	0.600000 2024/6/20	0.75%
23	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	105.65 2,958,452,000	1.000000 2020/9/20	0.74%
24	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.86 2,671,625,000	107.44 2,686,150,000	1.000000 2022/3/20	0.67%

25	286回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,600,000,000	102.59 2,667,548,000	102.62 2,668,172,000	1.800000 2017/6/20	0.67%
26	306回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.34 2,658,700,000	106.70 2,667,650,000	1.400000 2020/3/20	0.67%
27	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.23 2,630,825,000	106.28 2,657,075,000	0.600000 2024/3/20	0.67%
28	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	105.91 2,647,750,000	1.300000 2019/12/20	0.66%
29	335回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	104.38 2,609,600,000	105.54 2,638,500,000	0.500000 2024/9/20	0.66%
30	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	120.79 2,536,611,000	1.600000 2033/3/20	0.64%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
国債証券	81.60%
地方債証券	6.73%
特殊債券	5.67%
社債券	5.23%
合計	99.23%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（平成28年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (平成19年2月14日)	3,173	3,173	1.0060	1.0060
第5計算期間末 (平成20年2月14日)	4,343	4,343	1.0330	1.0330
第6計算期間末 (平成21年2月16日)	5,647	5,647	1.0575	1.0575
第7計算期間末 (平成22年2月15日)	6,943	6,943	1.0725	1.0725
第8計算期間末 (平成23年2月14日)	8,293	8,293	1.0844	1.0844
第9計算期間末 (平成24年2月14日)	10,287	10,287	1.1142	1.1142
第10計算期間末 (平成25年2月14日)	11,244	11,244	1.1331	1.1331
第11計算期間末 (平成26年2月14日)	11,897	11,897	1.1597	1.1597
第12計算期間末 (平成27年2月16日)	13,189	13,189	1.1775	1.1775
第13計算期間末 (平成28年2月15日)	14,544	14,544	1.2180	1.2180
平成27年2月末日	13,356	-	1.1875	-
3月末日	13,334	-	1.1878	-
4月末日	13,453	-	1.1914	-
5月末日	13,416	-	1.1856	-
6月末日	13,388	-	1.1847	-
7月末日	13,680	-	1.1878	-
8月末日	13,658	-	1.1896	-
9月末日	13,798	-	1.1928	-
10月末日	13,959	-	1.1970	-
11月末日	14,018	-	1.1967	-
12月末日	14,205	-	1.2037	-
平成28年1月末日	14,645	-	1.2183	-
2月末日	14,984	-	1.2388	-

## 【分配の推移】

	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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	0.5
第5計算期間	2.7
第6計算期間	2.4
第7計算期間	1.4
第8計算期間	1.1
第9計算期間	2.7
第10計算期間	1.7
第11計算期間	2.3
第12計算期間	1.5
第13計算期間	3.4

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第4計算期間	1,071,932,121	4,001,852,186
第5計算期間	1,811,098,542	761,370,221
第6計算期間	2,309,502,415	1,174,301,229
第7計算期間	2,070,084,195	935,666,283
第8計算期間	2,234,996,477	1,061,084,008
第9計算期間	2,735,732,180	1,150,521,086
第10計算期間	2,369,625,571	1,679,076,450
第11計算期間	2,906,649,158	2,571,041,551
第12計算期間	2,929,676,639	1,987,482,863
第13計算期間	3,275,952,445	2,536,711,742

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2016年2月29日

## 基準価額・純資産の推移

〈2006年2月28日～2016年2月29日〉



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2002年12月3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	(2012.02.14)	0円
第10期	(2013.02.14)	0円
第11期	(2014.02.14)	0円
第12期	(2015.02.16)	0円
第13期	(2016.02.15)	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

■組入銘柄一覧 (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。

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	100.01%

## ■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。

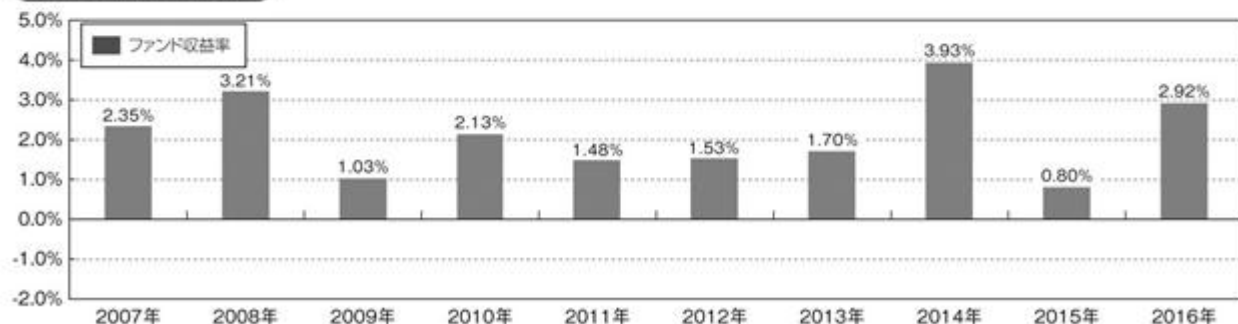
## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	81.60
内 日本	81.60
地方債証券	6.73
内 日本	6.73
特殊債券	5.67
内 日本	5.67
社債券	5.23
内 日本	5.16
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.77
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	1.30%
2	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.27%
3	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.14%
4	123回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/3/20	1.14%
5	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.14%
6	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.14%
7	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.13%
8	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.07%
9	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.02%
10	338回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/3/20	0.92%

## 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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。  
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受益権を取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配がなされた場合、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）」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」にしたが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時までにお申込が行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
- ・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かかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、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かかる信託を設定した旨の通知を行います。
- ・お申込価額はお申込日の基準価額 とします。  
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、公表されません。  
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.diam.co.jp/>  
コールセンター：0120-506-860（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）  
収益分配金の再投資を行う場合は、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、委託会社に1口単位をもって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。解約の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

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

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、解約の請求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。解約の請求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実行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、解約請求受付日の基準価額とします。
- ・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5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。

### ・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.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

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

主な投資対象の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。
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.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（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3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15日から翌年2月14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、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。
- b. 委託会社は、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、対象インデックスが改廃の場合、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。
- c. 委託会社は上記a.およびb.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かかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかか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。
- d. 委託会社は上記c.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。
- e. 上記d.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を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e.の規定により、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。
- g. 上記d.からf.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、上記d.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。
- h. 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。
- i. 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き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、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 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。
- k. 上記d.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かかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかか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. からe. の規定にしたがいます。
- 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、当ファンドの決算時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。

## 八．関係法人との契約の更改

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

## 二．公告

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

(URL <http://www.diam.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14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.diam.co.jp/>)

#### 4【受益者の権利等】

##### 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代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）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。

##### 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てします。）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。

##### 一部解約請求権

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

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる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、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとしてします。

##### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

(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17日から平成28年2月15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。

## 1【財務諸表】

## D I A M国内債券インデックスファンド&lt;DC年金&gt;

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成27年2月16日現在	第13期 平成28年2月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,687,089	55,360,732
親投資信託受益証券	13,189,310,087	14,543,878,176
未収入金	17,750,000	-
流動資産合計	13,241,747,176	14,599,238,908
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	34,253,151	35,692,647
未払受託者報酬	2,137,023	2,299,448
未払委託者報酬	15,671,791	16,862,917
その他未払費用	169,091	181,948
流動負債合計	52,231,056	55,036,960
負債合計	52,231,056	55,036,960
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,201,734,486	11,940,975,189
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,987,781,634	2,603,226,759
（分配準備積立金）	714,981,005	1,009,911,250
元本等合計	13,189,516,120	14,544,201,948
純資産合計	13,189,516,120	14,544,201,948
負債純資産合計	13,241,747,176	14,599,238,908

## （ 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15日 至 平成27年2月16日	自	平成27年2月17日 至 平成28年2月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		14,614		18,102
有価証券売買等損益		222,101,579		508,818,089
営業収益合計		222,116,193		508,836,191
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		4,074,491		4,425,389
委託者報酬		29,880,120		32,453,320
その他費用		322,385		350,162
営業費用合計		34,276,996		37,228,871
営業利益又は営業損失（ ）		187,839,197		471,607,320
経常利益又は経常損失（ ）		187,839,197		471,607,320
当期純利益又は当期純損失（ ）		187,839,197		471,607,320
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（ ）		25,553,989		34,613,777
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,638,370,311		1,987,781,634
剰余金増加額又は欠損金減少額		506,298,887		632,038,576
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		506,298,887		632,038,576
剰余金減少額又は欠損金増加額		319,172,772		453,586,994
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		319,172,772		453,586,994
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,987,781,634		2,603,226,759

## ( 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。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年2月14日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成27年2月16日、当計算期間末日を平成28年2月15日としております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第12期 平成27年2月16日現在	第13期 平成28年2月15日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	10,259,540,710円 2,929,676,639円 1,987,482,863円	11,201,734,486円 3,275,952,445円 2,536,711,742円
2 . 受益権の総数	11,201,734,486口	11,940,975,189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15日 至 平成27年2月16日	第13期 自 平成27年2月17日 至 平成28年2月15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（11,186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（162,274,022円）、信託約款に規定される収益調整金（1,272,800,629円）及び分配準備積立金（552,695,797円）より分配対象収益は1,987,781,634円（1万口当たり1,774.53円）であります。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（18,102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（436,975,441円）、信託約款に規定される収益調整金（1,593,315,509円）及び分配準備積立金（572,917,707円）より分配対象収益は2,603,226,759円（1万口当たり2,180.08円）であります。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 自 平成26年2月15日 至 平成27年2月16日	第13期 自 平成27年2月17日 至 平成28年2月15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、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16日現在	第13期 平成28年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 平成27年2月16日現在	第13期 平成28年2月15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	211,188,592	493,516,913
合計	211,188,592	493,516,913

(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16日現在	第13期 平成28年2月15日現在
1口当たり純資産額	1,177.5円	1,218.0円
(1万口当たり純資産額)	(11,775円)	(12,180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15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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,529,949,403	14,543,878,176	
親投資信託受益証券	合計	11,529,949,403	14,543,878,176	
合計		11,529,949,403	14,543,878,176	

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）

当ファンドは、「国内債券パッシブ・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16日現在	平成28年2月15日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,337,055,354	6,297,011,172
国債証券		338,928,930,200	322,707,941,900
地方債証券		27,187,009,552	27,744,814,417
特殊債券		27,474,070,177	23,861,727,397
社債券		22,398,714,500	20,798,921,930
未収入金		3,040,150,000	-
未収利息		1,470,302,071	1,271,123,310
前払費用		29,412,790	25,804,237
流動資産合計		423,865,644,644	402,707,344,363
資産合計		423,865,644,644	402,707,344,363
負債の部			
流動負債			
未払解約金		1,369,156,000	2,113,655,000
流動負債合計		1,369,156,000	2,113,655,000
負債合計		1,369,156,000	2,113,655,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	347,423,592,460	317,585,333,198
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		75,072,896,184	83,008,356,165
元本等合計		422,496,488,644	400,593,689,363
純資産合計		422,496,488,644	400,593,689,363
負債純資産合計		423,865,644,644	402,707,344,363

## 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16日現在	平成28年2月15日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	370,588,010,034円 44,950,935,215円 68,115,352,789円	347,423,592,460円 87,481,386,346円 117,319,645,608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	8,473,659,637円	9,180,793,194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	328,317,407円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	10,845,580,205円	11,529,949,403円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	4,262,167,150円	4,533,439,273円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	6,629,015,049円	6,720,747,339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	2,638,545,253円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,645,584,410円	1,674,955,687円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,795,769,252円	1,838,846,755円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	254,649,242円	277,399,912円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	122,058,057円	118,030,773円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,939,654,102円	2,433,369,924円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	10,884,247円	7,449,695円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	156,161,361円	228,850,737円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	110,907,227円	167,009,796円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	33,583,715円	43,656,123円
投資のソムリエ	2,143,157,299円	5,533,410,782円
クルーズコントロール	1,015,318,040円	604,204,415円
投資のソムリエ<DC年金>	30,483,530円	99,954,372円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	324,888,979円	707,058,309円
D I A M D C バランス・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>	295,827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	10,473,184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 A Mアクティブアローケー 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 A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	708,077,509円	613,664,421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)	4,180,908,337円	1,012,198,618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)	399,001,865円	313,645,050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)	261,050,248円	154,353,367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)	709,197,151円	410,660,969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)	248,392,313円	164,767,245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)	246,197,601円	127,441,343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)	24,730,660,493円	13,028,814,650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)	8,680,094,977円	4,958,449,523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)	12,637,931,749円	8,793,123,299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)	4,874,174,640円	3,957,801,644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)	8,212,747,799円	6,837,982,277円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	1,037,419,637円	793,288,879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)	4,656,402,804円	3,506,317,917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)	6,092,820,089円	4,949,886,866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)	9,025,779,093円	6,714,994,436円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	495,049,617円	839,267,900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)	9,453,002,824円	6,562,723,625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)	8,496,097,087円	7,095,353,821円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	1,114,850,888円	- 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)	104,678,670,105円	91,998,687,705円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	1,632,824,839円	1,310,783,827円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	9,010,948,928円	7,893,491,422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)	32,857,355,513円	29,291,592,534円
D I A M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 A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	43,932,447円	29,226,882円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	77,804,608円	9,770,347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)	36,651,254,854円	32,925,355,214円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	688,966,263円	610,386,800円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	171,833,083円	162,414,311円
	D I A Mバランス20VA(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40VA(適格機関投資家限定)	597,937,201円	69,505,002円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	326,057円	330,308円
	計	347,423,592,460円	317,585,333,198円
2.	受益権の総数	347,423,592,460口	317,585,333,198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15日 至 平成27年2月16日	自 平成27年2月17日 至 平成28年2月15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16日現在	平成28年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成27年2月16日現在	平成28年2月15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	2,501,994,900	9,587,999,700
地方債証券	3,594,367	167,008,374
特殊債券	121,753,603	1,892,678
社債券	127,686,500	44,503,050
合計	2,256,149,164	9,708,612,346

## (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16日現在	平成28年2月15日現在
1口当たり純資産額	1.2161円	1.2614円
(1万口当たり純資産額)	(12,161円)	(12,614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15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	1,504,245,000	
	3 5 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,006,480,000	
	3 5 4 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,505,175,000	
	3 5 5 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,010,950,000	
	3 5 6 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,007,720,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,014,490,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,520,790,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,524,705,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,321,285,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,010,860,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,019,240,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,519,695,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,021,580,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,541,825,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,243,092,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,549,500,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,541,650,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,025,240,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,513,530,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,542,525,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,050,300,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,051,250,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,042,440,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,010,950,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	756,426,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,263,290,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,012,512,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	968,472,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,063,044,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	896,352,000	
	8 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	719,068,000	
	2 8 6 回 利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,667,548,000	
	2 8 8 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,543,830,000	
	2 8 9 回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,297,024,000	
	2 9 0 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,032,520,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,301,134,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,129,060,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,401,614,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,672,160,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,060,979,000	

303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,428,639,000	
305回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,639,425,000	
306回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,658,700,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,381,081,000	
309回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,053,640,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,944,704,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,341,306,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,217,920,000	
315回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,355,980,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,068,640,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,807,117,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,607,595,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,811,945,000	
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,671,625,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,646,850,000	
325回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,182,250,000	
326回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,794,877,000	
328回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,100,640,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,385,449,000	
330回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,133,560,000	
332回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,103,940,000	
333回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,630,825,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,947,420,000	
335回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,609,600,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,564,890,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,333,280,000	
338回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,617,320,000	
339回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,130,080,000	
340回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,611,720,000	
341回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,552,425,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	132,641,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,715,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,112,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	270,800,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,208,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,570,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	382,314,000	
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	358,374,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	470,572,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	372,483,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	367,086,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	644,725,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,262,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	522,728,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,660,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,041,760,800	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	254,068,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	391,674,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	633,830,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	611,968,200	

23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	781,140,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	390,498,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	758,712,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	898,016,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,171,953,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,043,504,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,413,720,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,646,294,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,122,192,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,777,412,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,568,944,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,876,020,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,811,160,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,689,632,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,892,512,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,159,380,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	945,432,000	
40回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,157,960,000	
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	907,128,000	
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,132,380,000	
43回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,130,840,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	904,392,000	
45回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,189,815,000	
46回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,513,386,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,104,770,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,159,422,000	
49回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	210,638,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	631,008,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	423,048,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	766,044,000	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	868,448,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	954,471,000	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	993,915,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	550,755,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,052,248,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	563,925,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	861,135,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	668,538,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	618,557,500	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	795,480,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	915,300,000	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,275,340,600	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	680,040,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,092,623,400	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	863,096,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,385,449,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	690,180,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,269,290,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,198,965,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,503,237,500	

7 2 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,476,087,500
7 3 回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,399,106,800
7 5 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,662,556,000
7 8 回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,700,081,500
8 1 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,658,944,000
8 3 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,675,226,000
8 5 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,039,456,000
8 8 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,467,840,000
9 0 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,702,694,000
9 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,571,193,000
9 3 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	840,280,000
9 4 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	969,040,000
9 5 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,483,464,000
9 7 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,719,088,000
9 9 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,706,628,000
1 0 0 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,849,620,000
1 0 2 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,142,544,000
1 0 5 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,838,685,000
1 0 7 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,718,962,000
1 0 9 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,925,952,000
1 1 1 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,241,450,000
1 1 3 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,098,157,000
1 1 4 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,100,979,000
1 1 6 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,251,512,000
1 1 8 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,224,420,000
1 1 9 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,435,572,000
1 2 1 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,300,786,000
1 2 3 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,355,715,000
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,259,324,000
1 2 8 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,090,350,000
1 2 9 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,077,399,000
1 3 0 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,034,305,000
1 3 2 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,890,096,000
1 3 4 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,076,589,000
1 3 5 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,181,280,000
1 3 7 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,006,578,000
1 4 0 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,238,960,000
1 4 1 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,591,886,000
1 4 3 回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,436,735,000
1 4 5 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,880,800,000
1 4 6 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,230,733,000
1 4 7 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,195,545,000
1 4 8 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,932,271,000
1 4 9 回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,609,603,000
1 5 0 回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,230,280,000
1 5 1 回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,157,440,000
1 5 2 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,614,030,000
1 5 3 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,400,288,000
1 5 4 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,926,810,000
1 5 5 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,030,710,000

国債証券 合計		293,320,000,000	322,707,941,900	
地方債証券	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	210,921,645	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	311,388,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	314,037,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	210,824,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	523,095,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	207,928,000	
	6 9 7 回 東京都公募公債	500,000,000	527,640,000	
	7 0 1 回 東京都公募公債	700,000,000	735,763,000	
	7 0 8 回 東京都公募公債	500,000,000	526,120,000	
	7 2 0 回 東京都公募公債	300,000,000	318,819,000	
	7 2 6 回 東京都公募公債	400,000,000	421,420,000	
	9 回 東京都公募公債 20年	200,000,000	244,770,000	
	1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	307,761,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	210,746,000	
	2 2 年度 1 2 回 北海道公募公債	200,000,000	211,534,000	
	1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	313,977,000	
	1 9 4 回 神奈川県公募公債	300,000,000	315,585,000	
	2 0 8 回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,554,000	
	3 0 7 回 大阪府公募公債	100,000,000	102,978,000	
	3 1 0 回 大阪府公募公債	240,000,000	247,219,200	
	3 1 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	208,744,000	
	3 3 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	211,194,000	
	3 4 5 回 大阪府公募公債	300,000,000	316,437,000	
	3 5 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	211,062,000	
	3 6 4 回 大阪府公募公債	300,000,000	313,404,000	
	3 7 4 回 大阪府公募公債	300,000,000	318,465,000	
	2 6 年度 1 1 回 京都府公募公債	350,000,000	359,327,500	
	1 9 年度 2 回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,384,000	
	2 6 年度 1 7 回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,430,000	
	1 回 兵庫県公募公債（12年）	300,000,000	323,400,000	
	2 1 年度 5 回 静岡県公募公債	197,000,000	206,294,460	
	2 2 年度 8 回 静岡県公募公債	200,000,000	209,294,000	
	2 3 年度 9 回 静岡県公募公債	200,000,000	211,744,000	
	2 0 年度 4 回 愛知県公募公債	100,000,000	103,980,000	
	2 2 年度 6 回 愛知県公募公債	200,000,000	209,786,000	
	2 3 年度 2 0 回 愛知県公募公債	500,000,000	532,270,000	
	2 5 年度 4 回 愛知県公募公債	300,000,000	318,018,000	
	2 2 年度 1 回 広島県公募公債	200,000,000	211,056,000	
	2 1 年度 4 回 埼玉県公募公債	440,000,000	461,252,000	
	2 3 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	211,676,000	
	2 6 年度 5 回 埼玉県公募公債	400,000,000	415,908,000	
	2 1 年度 3 回 福岡県公募公債	200,000,000	210,474,000	
	2 5 年度 1 1 回 福岡県公募公債	200,000,000	209,370,000	
	1 9 年度 5 回 千葉県公募公債	300,000,000	308,946,000	
	2 1 年度 6 回 千葉県公募公債	200,000,000	209,692,000	
	2 4 年度 7 回 千葉県公募公債	300,000,000	314,553,000	
	2 5 年度 5 回 千葉県公募公債	200,000,000	211,920,000	
5 4 回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,384,000		
5 5 回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,964,000		

57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,800,000		
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,726,000		
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,912,000		
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	526,465,000		
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	738,871,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	529,120,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	742,644,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,626,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	531,340,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	737,947,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	527,545,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,560,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	839,612,762		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,925,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,926,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,930,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,680,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,480,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,208,000		
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,844,000		
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,855,000		
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	138,740,850		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	467,307,000		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	210,430,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	211,678,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	476,244,000		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	425,844,000		
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	308,838,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	211,130,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,771,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	209,984,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	213,322,000		
地方債証券 合計		26,459,400,000	27,744,814,417		
特殊債券	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,872,000	
	25回	高速道路機構債	300,000,000	308,412,000	
	35回	高速道路機構債	400,000,000	413,408,000	
	48回	高速道路機構債	700,000,000	735,966,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	732,886,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	104,567,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,249,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	335,049,000	
	33回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	302,779,620	
	36回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	352,500,240	
	40回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	340,526,180	

4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,474,000	
5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,025,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,828,000	
6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	736,234,450	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	168,062,040	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	417,717,690	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	622,956,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	730,163,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,863,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,500,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	422,508,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,048,570,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,725,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	531,335,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	351,496,200	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,190,000	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	492,160,560	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	513,895,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	681,753,240	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,089,390	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,740,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,952,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,810,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,562,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,061,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,868,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,416,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	421,136,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	532,370,000	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,592,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	208,334,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,912,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	314,478,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	65,301,000	70,558,383	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	45,616,000	49,206,891	

9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	67,536,000	72,916,593	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	72,747,000	79,047,617	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	32,318,000	34,026,006	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	165,655,000	173,101,192	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,161,000	44,657,391	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,364,000	30,921,298	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	105,136,000	114,488,898	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,692,000	89,890,338	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,100,000	151,737,529	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	241,265,000	260,870,193	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	473,224,000	507,021,658	
7 5 5 号 利付商工債	260,000,000	261,164,800	
い第 7 6 9 号 利付商工債	200,000,000	201,038,000	
い第 7 7 9 号 利付商工債	200,000,000	200,868,000	
7 4 3 号 利附農林債	300,000,000	301,197,000	
7 5 3 号 利附農林債	300,000,000	300,882,000	
7 6 0 号 利附農林債	300,000,000	302,346,000	
7 6 4 号 利附農林債	500,000,000	503,660,000	
2 7 5 回 利附信金中金債	400,000,000	401,284,000	
2 8 2 回 利附信金中金債	300,000,000	301,422,000	
3 0 2 回 利附信金中金債	300,000,000	301,056,000	
1 7 1 号 利附商工債（3 年）	200,000,000	200,226,000	
1 8 6 号 利附商工債（3 年）	200,000,000	200,338,000	
2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	311,064,000	
5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	209,436,000	
5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	526,310,000	
特殊債券 合計	22,930,115,000	23,861,727,397	
社債券			
1 回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	98,831,000	
2 7 回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,266,000	
2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	313,110,000	
7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,295,000	
9 回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,358,000	
3 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	104,334,000	
4 1 回 住友化学社債	100,000,000	105,307,000	
3 7 回 三菱化学社債	100,000,000	104,695,000	
8 回 プリヂストン社債	200,000,000	200,494,000	
6 4 回 新日本製鐵社債	100,000,000	105,452,000	
1 回 日本電産社債	100,000,000	100,379,000	
1 1 回 パナソニック社債	100,000,000	101,900,000	
1 2 回 パナソニック社債	200,000,000	201,134,000	
5 6 回 日産自動車社債	100,000,000	101,490,000	
1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	210,818,000	
1 6 回 トヨタ自動車社債	100,000,000	103,123,000	
4 9 回 伊藤忠商事社債	100,000,000	105,055,000	

66回	伊藤忠商事社債	200,000,000	200,734,000	
91回	丸紅社債	100,000,000	100,590,000	
94回	丸紅社債	100,000,000	105,577,000	
45回	住友商事社債	100,000,000	105,081,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	103,771,000	
69回	三菱商事社債	300,000,000	312,693,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,144,000	
7回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	308,427,000	
31回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	300,966,000	
32回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,530,000	
7回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	107,363,000	
140回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,810,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	214,616,000	
12回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,742,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,876,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,770,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	321,540,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,312,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,128,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,326,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,141,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,138,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,956,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,598,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	104,222,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,882,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	207,252,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,764,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,566,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	425,664,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,498,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	213,428,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,321,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	214,598,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	207,836,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	102,383,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,089,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,142,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,770,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,401,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,070,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,971,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	210,208,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	115,745,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	103,303,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	209,954,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,445,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,427,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	103,942,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,883,000	

15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	333,702,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,170,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	347,727,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,930,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,698,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,706,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	341,679,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,689,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,288,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	194,024,200	
11回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,700,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	115,776,000	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	212,746,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,479,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	207,112,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	316,785,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	208,664,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	208,456,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	512,040,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	104,723,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	522,335,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	314,601,000	
486回	関西電力社債	154,000,000	155,426,040	
492回	関西電力社債	200,000,000	202,292,000	
493回	関西電力社債	200,000,000	202,296,000	
310回	中国電力社債	200,000,000	208,932,000	
377回	中国電力社債	200,000,000	211,532,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	109,043,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	208,124,000	
471回	東北電力社債	200,000,000	211,540,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	304,926,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	105,294,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	209,692,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	205,072,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	211,998,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	418,180,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	203,150,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	166,198,690	
38回	電源開発社債	300,000,000	312,144,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	105,863,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	105,508,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	108,867,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	105,180,000	
社債券 合計		19,905,000,000	20,798,921,930	
合計		362,614,515,000	395,113,405,644	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成28年2月29日現在

資産総額	15,013,761,382円
負債総額	29,460,543円
純資産総額（ - ）	14,984,300,839円
発行済数量	12,095,497,866口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2388円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産総額	405,463,318,960円
負債総額	6,465,944,000円
純資産総額（ - ）	398,997,374,960円
発行済数量	310,971,245,010口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2831円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

##### 直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### 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、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

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これにあたります。

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

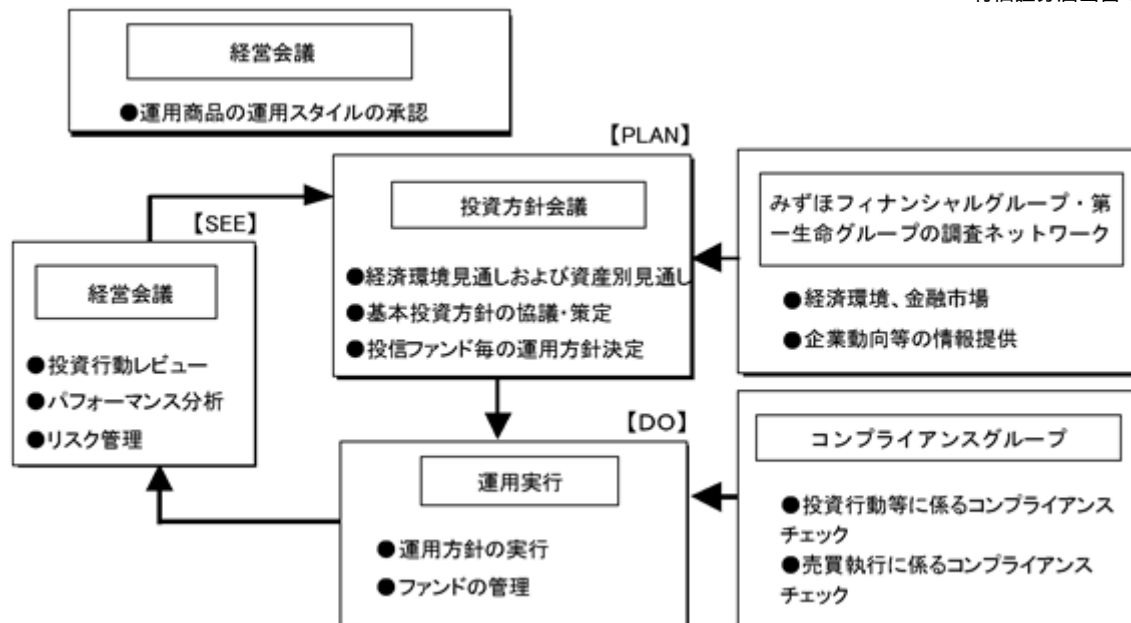
###### 投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「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り、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）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成28年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は415本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	5	23,629,020,732
追加型株式投資信託	370	5,576,357,548,539
単位型公社債投資信託	40	294,039,557,704
追加型公社債投資信託	0	0
合計	415	5,894,026,126,975

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

3．委託会社は、第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	4,178,284	4,343,365
関係会社株式	617,159	613,137
繰延税金資産	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（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	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
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	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

	第29期 ( 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 )		第30期 ( 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日 )	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		15,024		17,346
受取利息		2,318		2,404
時効成立分配金・償還金		33,872		974
為替差益		-		652
雑収入		4,746		1,822
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損		7,364		-
金銭の信託運用損		213,744		163,033
時効成立後支払分配金・償還金		-		65
外国税支払損失		-		47,515
雑損失		10,952		-
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26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	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
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	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金の 積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	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	103,768	25,430,943
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	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		3,096,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

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

## 重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、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9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

## 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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

### 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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035

## （損益計算書関係）

## 1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

## 2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26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25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

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

平成27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

## (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

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

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

#### 第29期（平成26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	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

#### 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	-

## (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29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

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。

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。

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第29期（平成26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	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

## 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	-	-	-

（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29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）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29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	522,887	146,101	376,785
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	9,474	10,000	526
小計	9,474	10,000	526
合計	536,913	159,101	377,811

（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30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

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  
該当事項はありません。

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29期（平成26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	10,952,459	1,628,835

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

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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
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	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

## (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29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
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	179,840	174,402

## (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29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	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29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり  
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29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

## 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27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27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35.64%から、平成27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33.10%に、平成28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32.34%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89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

## (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29期（自平成25年4月1日 至平成26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	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## (1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26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	2,102 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

## 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

## 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29期（自平成25年4月1日 至平成26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	627,855	未払費用	224,758
	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	251,110	未払費用	97,587

## 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	-	-

## 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29期（自平成25年4月1日 至平成26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 (旧株式 会社みず ほコーポ レート銀 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	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 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	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	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	287,136	未払 費用	155,413
							業務委託料 の支払	11,810	未払金	2,646	
	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)	1,000,000	金銭の 信託	10,952,459
							信託報酬の 支払	7,933			

## 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  預金の預入 (純額)  受取利息	2,217,439  551,351  2,139	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	306,365  11,276,198  71
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払  業務委託料 の支払	407,531  8,540	未払 費用  未払金	240,725  6,501
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)  信託報酬の 支払	3,500,000  8,254	金銭の 信託	14,169,657

## 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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
資産合計		38,994,807

（単位：千円）

	第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	956,031
未払金	2,105,195
未払収益分配金	44
未払償還金	49,873
未払手数料	1,770,062
その他未払金	285,213
未払費用	1,927,420
未払法人税等	1,486,583
未払消費税等	289,515
賞与引当金	724,368
その他	20,000
流動負債計	7,509,114
固定負債	
退職給付引当金	920,913
役員退職慰労引当金	137,750
固定負債計	1,058,663
負債合計	8,567,778
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	25,771,823
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	22,030,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	3,118,530
株主資本計	30,200,301
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	226,727
評価・換算差額等計	226,727
純資産合計	30,427,029
負債・純資産合計	38,994,807

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	15,465,477	
運用受託報酬	3,695,539	
投資助言報酬	510,549	
その他営業収益	383,893	
	営業収益計	20,055,459
営業費用		
支払手数料	6,672,717	
広告宣伝費	217,738	
公告費	129	
調査費	3,678,769	
調査費	2,272,268	
委託調査費	1,406,500	
委託計算費	207,057	
営業雑経費	280,193	
通信費	17,208	
印刷費	226,482	
協会費	11,849	
諸会費	17	
支払販売手数料	24,635	
	営業費用計	11,056,605
一般管理費		
給料	2,351,238	
役員報酬	121,094	
給料・手当	2,230,144	
交際費	19,774	
寄付金	2,156	
旅費交通費	119,653	
租税公課	94,838	
不動産賃借料	363,395	
退職給付費用	114,178	
固定資産減価償却費	1 362,235	
福利厚生費	10,385	
修繕費	30,844	
賞与引当金繰入額	724,368	
役員退職慰労引当金繰入額	27,285	
機器リース料	76	
事務委託費	137,814	
事務用消耗品費	33,473	
器具備品費	14,115	
諸経費	84,703	
	一般管理費計	4,490,538
営業利益		4,508,315

(単位:千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	8,323	
受取利息	1,015	
雑収入	5,491	
		営業外収益計 14,830
営業外費用		
為替差損	3,664	
金銭の信託運用損	166,406	
		営業外費用計 170,070
経常利益		4,353,076
特別損失		
固定資産除却損	182	
固定資産売却損	2,654	
ゴルフ会員権評価損	3,806	
		特別損失計 6,642
税引前中間純利益		4,346,433
法人税、住民税及び事業税		1,434,006
法人税等調整額		14,388
法人税等合計		1,448,394
中間純利益		2,898,038

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

	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
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	26,178	26,178
当中間期変動額 合計	26,178	327,860
当中間期末残高	226,727	30,427,029

## 重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 追加情報

第31期中間会計期間  
(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

当社は、平成27年9月30日開催の取締役会の決議に基づき、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」)の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」)、及び新光投信株式会社(以下「新光投信」)の機能統合に向けた具体的な準備を開始すべく、同日付で当社、TB、MHAM及び新光投信の間で「統合基本合意書」を締結いたしました。今後、統合に必要な各社の取締役会決議及び株主総会決議、国内外の関係当局への届出、許認可の取得等を前提として、平成28年度上期中の統合を予定しております。

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)	
1. 固定資産の減価償却累計額	建物	596,463千円
	車両運搬具	4,178千円
	器具備品	499,246千円
	商標権	883千円
	ソフトウェア	2,309,177千円
	電信電話専用施設利用権	1,429千円

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	68,441千円
	無形固定資産	293,794千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成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

## (金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,613,571	10,613,571	-
(2) 金銭の信託	14,000,363	14,000,363	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	493,805	493,805	-
資産計	25,107,739	25,107,739	-
(1) 未払法人税等	1,486,583	1,486,583	-
負債計	1,486,583	1,486,583	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## 負債

### (1) 未払法人税等

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

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,316,596
差入保証金	771,427

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

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

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃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、時価開示の対象としておりません。

## （有価証券関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,316,596千円）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。			
3. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	493,805	159,101	334,703
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額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。			

## （金銭の信託関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
1. 満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外） 該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

## 1. セグメント情報

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

## 2. 関連情報

## (1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	15,465,477	4,206,088	383,893	20,055,459

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で中間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。

## (1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,267,792円	89銭
1株当たり中間純利益金額	120,751円	62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
中間純利益	2,898,038千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,898,038千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第31期中間会計期間  
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、平成27年9月25日開催の取締役会において、子会社であるDIAM International Ltdの増資引受を決議いたしました。

## 1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

## 2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

## 3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

#### 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25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）に変更）

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

##### a.名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b.資本金の額

平成27年3月末日現在 247,369百万円

##### c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	343,104	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注)資本金の額は平成27年3月末日現在

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2)信託財産の計算
- (3)信託財産に関する報告書の作成
- (4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）、運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

第一生命保険株式会社は、委託会社の株式を12,000株（持株比率 50.00%）所有しています。この他に、委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

### 第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況 には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。  
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。  
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。  
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。  
(当ファンドの略称：DC内債イ)

# 独立監査人の監査報告書

平成27年6月5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 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30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27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年3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

## P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴田 光夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 > の平成27年2月17日から平成28年2月15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、D I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 > の平成28年2月15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

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

以 上

---

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25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 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている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期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。