

【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23年5月25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 中島 敬雄

【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】 大楽 信雄

【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バランス・ファンド< D C年金> 1 安定型
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

【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バランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

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

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.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】

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）
収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

(7)【申込期間】

継続申込期間：平成23年5月26日から平成24年5月25日まで

お申込みの取扱いは、販売会社の毎営業日に行われます。

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

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

(8)【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、下記の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

コールセンター：0120-506-860（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。

(10)【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または

販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

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

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。

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

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

なお、海外休業日には、お申込みの受付を行いません。

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

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

振替受益権について

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、3本のファンドから構成され、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

当ファンドは、追加型株式投資信託に属します。

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。

各ファンドの信託金の限度額は1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 ●ライフサイクルにあわせた分散投資

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

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

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

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

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

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

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

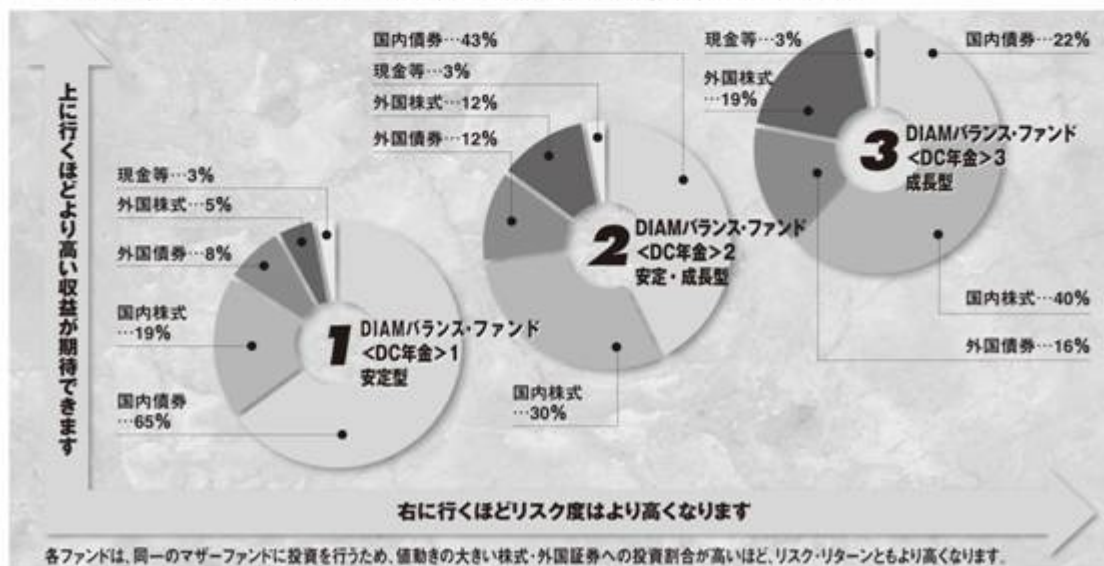
(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMU RA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

2 ●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

3ファンドの基本アロケーション

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



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

商品分類表

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型」

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ()	
		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

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

投資対象資産

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

補足分類

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

属性区分表

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型」

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
--------	------	--------	------	-------	----------

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券)資産配分 固定型)) 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回	グローバル (日本を含む)			
	年2回				
	年4回	日本			日経225
	年6回 (隔月)	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
	年12回 (毎月)	欧州			TOPIX
	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCIコク サイ・インデッ クス、NOMU RA-BPII総 合、シティグル ープ世界国債 インデックス)
		アフリカ			
		中近東 (中東)			
	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（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

対象インデックス

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

上記の分類は、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、以下の方法でご確認ください。

・投資信託協会への照会

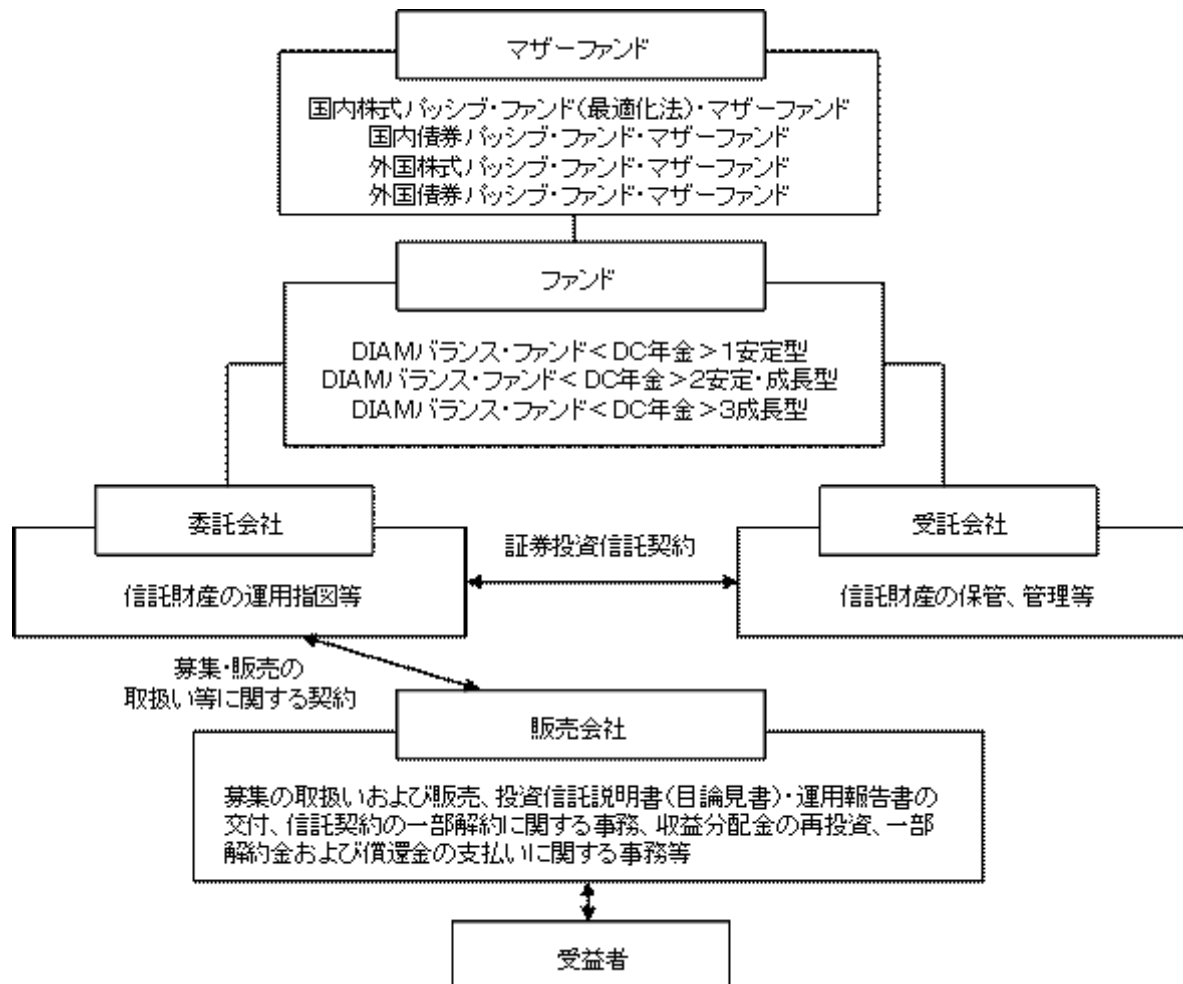
ホームページ URL <http://www.toushin.or.jp/>

(2)【ファンドの沿革】

平成14年12月13日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

平成17年10月1日 信託報酬率の変更

(3)【ファンドの仕組み】



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、信託契約の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

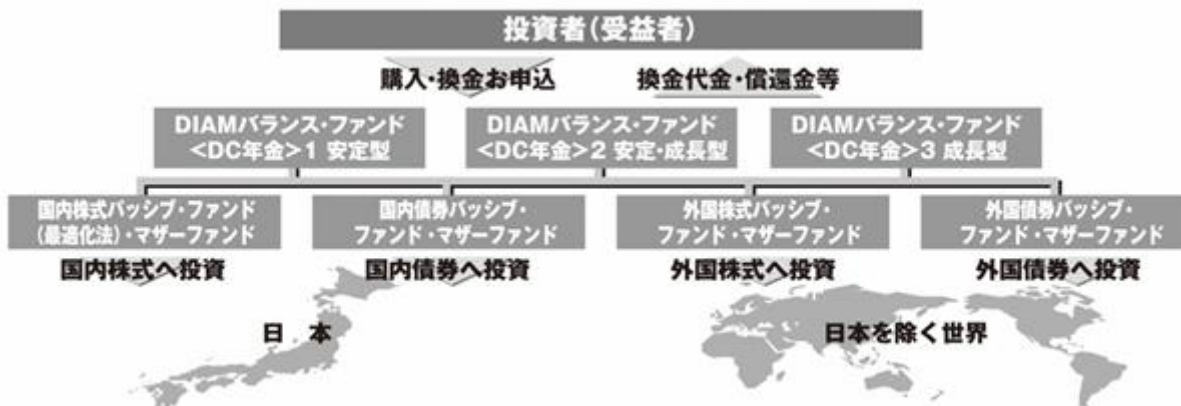
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



ベビーファンドはマザーファンドのほか、株式・公社債等に直接投資を行うこともあります。

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23年2月28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23年2月28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	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資態度>

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

2) 「D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型」

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

「D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型」

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

「D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型」

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

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

- (注1) T O P I Xの指数値及びT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利及びT O P I Xの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。
- 株東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の停止又はT O P I Xの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- 株東京証券取引所は、T O P I Xの商標の使用もしくはT O P I Xの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- 株東京証券取引所は、T O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドはT O P I Xの指数値に連動した投資成果を目標として運用いたしますが、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの基準価額とT O P I Xの指数値の動向が乖離することがあります。
- 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- 株東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- 株東京証券取引所は、当社又は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、株東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- (注2) N O M U R A - B P I 総合は、野村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。
- (注3) M S C I コクサイ・インデックスは、M S C I Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I Inc.に属しており、また、M S C I Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注4) シティグループ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・グローバル・マーケット・インクに帰属します。

- 3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができま

す。

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(4)までの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親投資信託の受益証券ならびに(5)以降の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

(1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(5) 株券または新株引受権証券

(6) 国債証券

(7) 地方債証券

(8) 特別の法律により法人の発行する債券

(9) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

(10) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

(11) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

(12) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

(13) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

(14) コマーシャル・ペーパー

(15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

(16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの

(17) 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをい

い、振替投資信託受益権を含みます。）

(18)投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

(19)外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

(20)オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、）

(21)預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

(22)外国法人が発行する譲渡性預金証書

(23)指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

(24)抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

(25)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

(26)外国の者に対する権利で上記(25)の有価証券の性質を有するもの

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

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

(1) 預金

(2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

(3) コール・ローン

(4) 手形割引市場において売買される手形

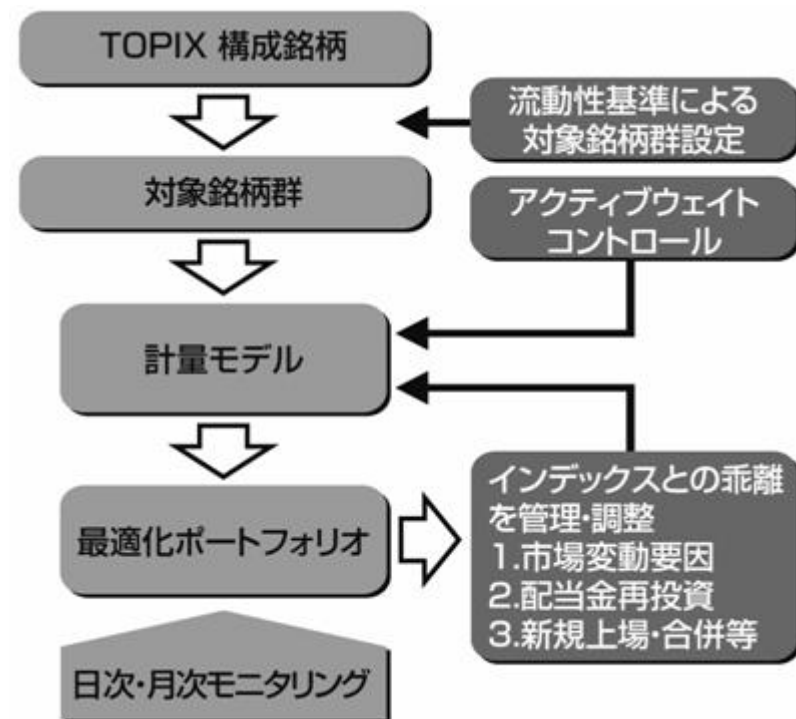
(5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

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

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

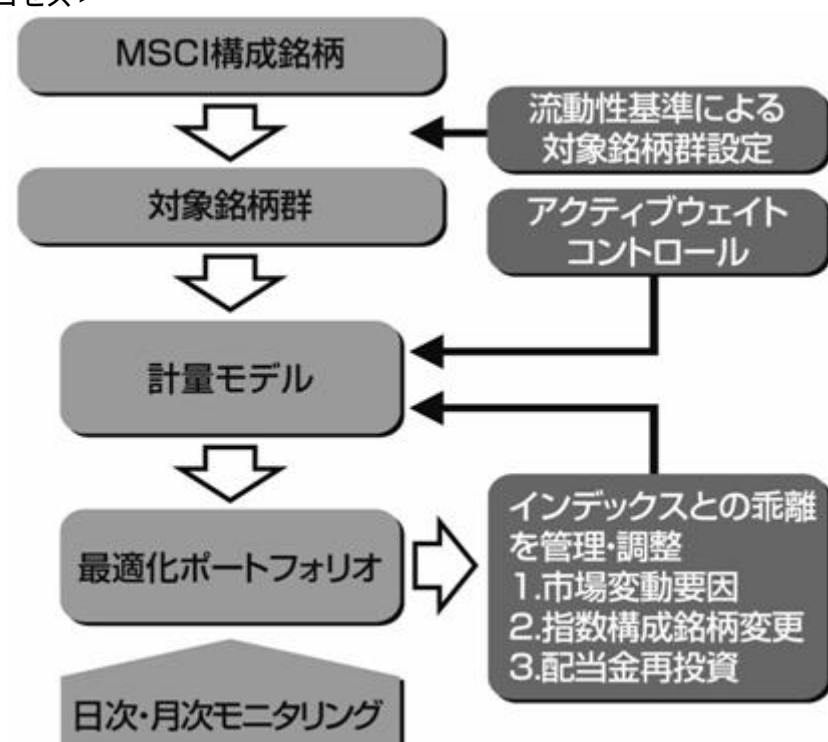
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 運用プロセス</p> <p>1)流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施  <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <p>6. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。</p>
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

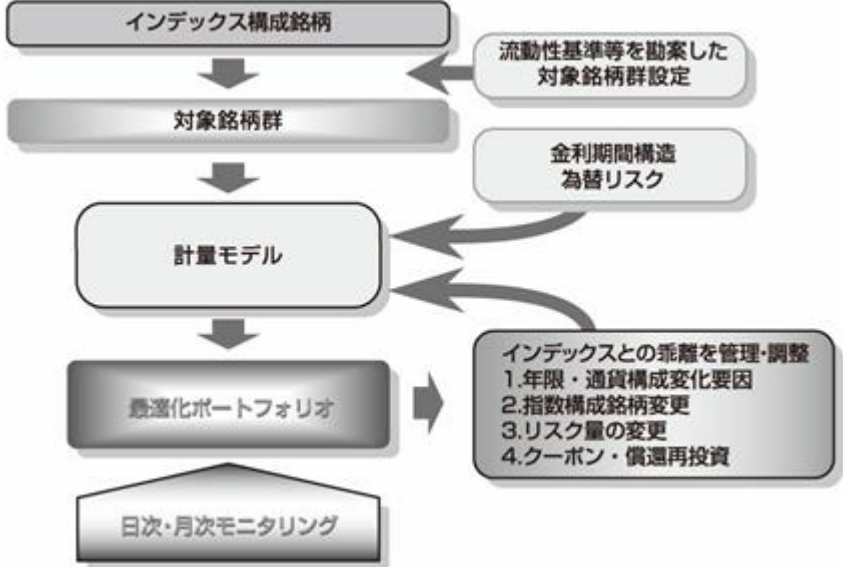
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 運用プロセス</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 流動性基準による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2) 最適化法によるポートフォリオの構築 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資 <p>3. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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。 2) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

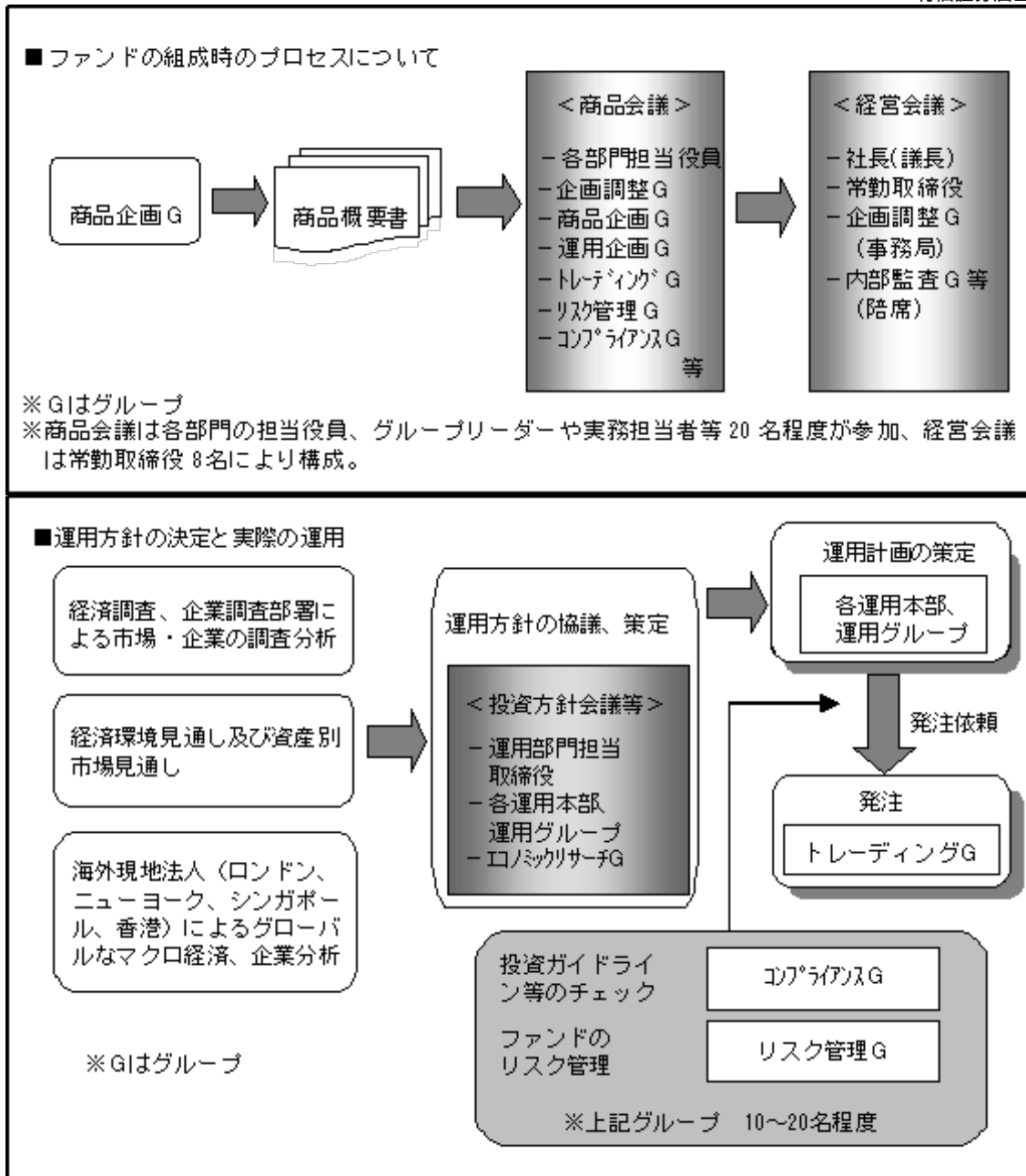
投資態度	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <p><運用プロセス></p>  <p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <p><運用プロセス></p>  <p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーボン・償還再投資
主な投資制限	<p>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、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

資金動向、市況動向によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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、運用グループの運用担当者、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。

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。

上記体制は平成23年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

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

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、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全額再投資される性格を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる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）に対し支払われます。販売会社は、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】

「D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞1 安定型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

「D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

「D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。

共通

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

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

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

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

(5) 投資する株式等の範囲（約款第18条）

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

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

(6) 同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資制限（約款第19条）

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

(7) 同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第20条）

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

ち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(8)信用取引の指図範囲（約款第21条）

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (b)上記(a)の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 1)信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2)株式分割により取得する株券
 - 3)有償増資により取得する株券
 - 4)売出しにより取得する株券
 - 5)信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 - 6)信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(9)先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第22条）

- (a)委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- 1)先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 - 2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならび

に上記(2)投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

3)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(b)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。

(c)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。

1)先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額、以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3)コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(10)スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

(a)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

(b)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(c)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少し

て、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

を乗じて得た額をいいます。

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

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

(12)有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

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

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

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

(b)上記(a)各号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。

(13)公社債の空売りの指図範囲（約款第26条）

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

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

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

(14)公社債の借入れ（約款第27条）

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

(b)上記(a)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

(d)上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(15)特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第29条）

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

(16)外国為替予約の指図（約款第30条）

(a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(b)上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファ

ンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- (c)上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (d)上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(17)資金の借入れ（約款第37条）

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (b)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (c)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (d)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(18)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委託会社に指図してはなりません。

(19)デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(1) 株式投資リスク

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

1) 価格変動リスク

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

2) 信用リスク

株式の発行者が経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想される場合、当該株式の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

(2) 債券投資リスク

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

1) 金利リスク

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

2) 信用リスク

信用リスクとは、公社債、コマーシャルペーパーおよび短期金融商品の発行者が、経営不振、その他の理由により利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。一般に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、当該公社債等の価格は下落（価格がゼロになることもあります。）し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

(3) 為替リスク

当ファンドは実質的に外国証券を保有します。外国証券に投資する場合には、一般的に為替リスクがあります。

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

(4) 資産配分リスク

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

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

(5) カントリーリスク

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

< 分配金に関する留意点 >

収益分配は、計算期間中に発生した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、収益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。

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

<その他の留意点>

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

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

当ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成インデックスが乖離する場合があります。

当ファンドの収益分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。

資金動向、市場動向等によっては、上記の投資態度に従った運用ができない場合があります。

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

各ファンドにつき、受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合等、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（線上償還）させる場合があります。

注意事項

イ. 当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって元本が保証されているものではありません。

ロ. 証券投資信託は、預金・金融債・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

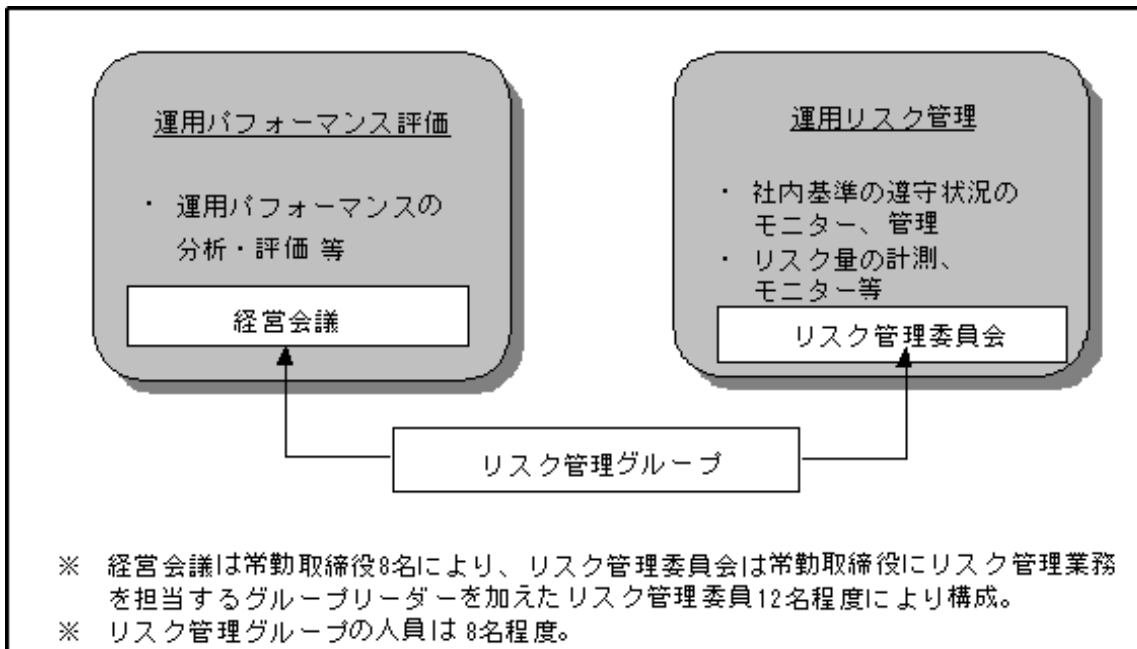
の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

八. 証券投資信託は金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、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。

二. 証券投資信託は、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、これによる損失は購入者が負担することとなります。

リスク管理体制

<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23年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。

D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 1 安定型	純資産総額に対して年率0.273%（税抜0.26%） （内訳：委託会社0.105%（税抜0.10%）、販売会社0.1365% （税抜0.13%）、受託会社0.0315%（税抜0.03%））
--------------------------------------	--

D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 2 安定・成長型	純資産総額に対して年率0.3045%（税抜0.29%） （内訳：委託会社0.12075%（税抜0.115%）、販売会社0.15225% （税抜0.145%）、受託会社0.0315%（税抜0.03%））
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 3 成長型	純資産総額に対して年率0.336%（税抜0.32%） （内訳：委託会社0.1365%（税抜0.13%）、販売会社0.168% （税抜0.16%）、受託会社0.0315%（税抜0.03%））

信託報酬の総額は、日々の基準価額に反映され、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のとき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。

(4) 【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用に係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係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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。

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。

(5) 【課税上の取扱い】

確定拠出年金の加入者におかれましては、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。

なお、上記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

法人の受益者に対する課税

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成24年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

益金不算入制度、配当控除の適用

益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

税法もしくは確定拠出年金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。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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 >

追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（お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を取得する場合は当該支店毎に、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。（「特別分配金」については、次の< 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 >

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「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特別分配金となり、当該収益分配金から当該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特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	4,292,488,733	97.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		132,397,528	2.99
合 計（純資産総額）		4,424,886,261	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	10,534,769,038	97.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		324,436,199	2.99
合 計（純資産総額）		10,859,205,237	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	8,444,188,765	97.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		259,465,547	2.98
合 計（純資産総額）		8,703,654,312	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考) マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	266,954,973,308	96.64
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,281,457,862	3.36
合 計（純資産総額）		276,236,431,170	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
-------	----	---------	---------

株式	米国	144,895,253,903	50.23
	英国	28,476,094,129	9.87
	カナダ	17,149,246,039	5.94
	スイス	12,716,906,463	4.41
	スウェーデン	4,321,955,663	1.50
	デンマーク	1,424,459,020	0.49
	ノルウェー	1,038,720,344	0.36
	アイルランド	1,661,468,617	0.58
	オランダ	3,657,822,253	1.27
	ベルギー	1,248,235,142	0.43
	ルクセンブルク	776,429,695	0.27
	フランス	13,105,157,864	4.54
	ドイツ	11,709,981,861	4.06
	ポルトガル	360,178,749	0.12
	スペイン	5,051,832,062	1.75
	イタリア	3,877,315,183	1.34
	フィンランド	1,429,313,552	0.50
	オーストリア	453,186,363	0.16
	キプロス	47,409,383	0.02
	ギリシャ	330,734,531	0.11
	香港	3,484,412,095	1.21
	中国	24,719,700	0.01
	シンガポール	2,114,540,570	0.73
	イスラエル	1,014,240,431	0.35
	オーストラリア	11,141,768,270	3.86
	ニュージーランド	115,616,678	0.04
	パナマ	220,534,489	0.08
	バミューダ諸島	763,497,871	0.26
	オランダ領アンティル	1,514,137,908	0.52
	ケイマン諸島	171,506,122	0.06
	ガーンジー・チャンネル諸島	78,217,315	0.03
	ジャージー・チャンネル諸島	683,335,238	0.24
	マン島	118,041,226	0.04
リベリア	80,724,949	0.03	
モーリシャス	51,568,020	0.02	
小計	275,308,561,699	95.44	
投資信託受益証券	シンガポール	56,723,740	0.02
	オーストラリア	848,912,647	0.29
	小計	905,636,387	0.31
投資証券	米国	2,651,240,392	0.92
	英国	370,727,620	0.13
	カナダ	59,029,771	0.02
	オランダ	50,099,267	0.02
	フランス	385,772,516	0.13
	香港	94,218,344	0.03
	小計	3,611,087,910	1.25
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	8,646,610,450	3.00	
合計（純資産総額）	288,471,896,446	100.00	

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	326,796,429,300	75.60
地方債証券	日本	29,074,148,806	6.73
特殊債券	日本	40,020,951,094	9.26
社債券	日本	33,884,017,630	7.84

現金・預金・その他の資産（負債控除後）	2,479,337,523	0.57
合 計（純資産総額）	432,254,884,353	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	米国	153,225,968,257	38.92
	英国	30,944,192,337	7.86
	カナダ	11,360,511,671	2.89
	スウェーデン	2,638,191,357	0.67
	デンマーク	3,288,672,118	0.84
	ノルウェー	1,017,592,576	0.26
	アイルランド	2,543,549,387	0.65
	オランダ	9,406,438,889	2.39
	ベルギー	10,488,553,892	2.66
	フランス	37,110,981,373	9.43
	ドイツ	37,183,910,501	9.44
	ポルトガル	3,189,686,611	0.81
	スペイン	16,463,901,945	4.18
	イタリア	40,080,966,660	10.18
	フィンランド	2,371,676,895	0.60
	ポーランド	3,435,276,242	0.87
	オーストリア	7,016,031,250	1.78
	シンガポール	1,530,810,031	0.39
	マレーシア	1,902,532,015	0.48
	オーストラリア	4,360,421,819	1.11
メキシコ	3,313,515,465	0.84	
小計	382,873,381,292	97.24	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		10,871,720,588	2.76
合 計（純資産総額）		393,745,101,880	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 【投資資産】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

【投資有価証券の主要銘柄】

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率（%）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2,562,878,656	11,125.00	2,851,202,504	11,125.00	2,851,202,504	64.44
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	699,880,376	12,280.00	859,453,101	12,401.00	867,921,654	19.61
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	297,561,636	11,449.00	340,678,317	11,381.00	338,654,897	7.65
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	174,116,972	13,384.00	233,038,155	13,480.00	234,709,678	5.30

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.01
合計	97.01

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	4,104,287,669	11,125.00	4,566,020,031	11,125.00	4,566,020,031	42.05
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2,742,299,301	12,280.00	3,367,543,541	12,401.00	3,400,725,363	31.32
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	990,180,130	13,384.00	1,325,257,085	13,480.00	1,334,762,815	12.29
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,083,613,768	11,449.00	1,240,629,402	11,381.00	1,233,260,829	11.36

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.01
合計	97.01

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2,869,308,935	12,280.00	3,523,511,372	12,401.00	3,558,230,010	40.88
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,686,301,944	11,125.00	1,876,010,912	11,125.00	1,876,010,912	21.55
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,235,372,366	13,384.00	1,653,422,374	13,480.00	1,665,281,949	19.13
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,181,500,654	11,449.00	1,352,700,098	11,381.00	1,344,665,894	15.45

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.02
合計	97.02

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は券面総額	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	2,686,700	3,490.00	9,376,583,000	3,820.00	10,263,194,000	3.72
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	15,620,500	447.00	6,982,363,500	453.00	7,076,086,500	2.56

3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,764,300	3,510.00	6,192,693,000	3,545.00	6,254,443,500	2.26
4	キャノン	株式	日本	電気機 器	1,299,100	3,940.00	5,118,454,000	3,940.00	5,118,454,000	1.85
5	三井住友フィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,560,900	2,909.00	4,540,658,100	3,085.00	4,815,376,500	1.74
6	みずほフィナン シャルG	株式	日本	銀行業	25,228,400	164.00	4,137,457,600	168.00	4,238,371,200	1.53
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,652,800	2,362.00	3,903,913,600	2,261.00	3,736,980,800	1.35
8	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,174,200	2,872.00	3,372,302,400	2,993.00	3,514,380,600	1.27
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	820,500	4,010.00	3,290,205,000	4,065.00	3,335,332,500	1.21
10	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	1,539,200	2,064.00	3,176,908,800	2,114.00	3,253,868,800	1.18
11	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	775,000	3,870.00	2,999,250,000	3,990.00	3,092,250,000	1.12
12	ソフトバンク	株式	日本	情報・ 通信業	913,900	2,961.00	2,706,057,900	3,355.00	3,066,134,500	1.11
13	任天堂	株式	日本	その他 製品	119,600	22,890.00	2,737,644,000	23,970.00	2,866,812,000	1.04
14	ファナック	株式	日本	電気機 器	217,700	12,380.00	2,695,126,000	12,680.00	2,760,436,000	1.00
15	三井物産	株式	日本	卸売業	1,781,600	1,486.00	2,647,457,600	1,486.00	2,647,457,600	0.96
16	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	17,060	149,300.00	2,547,058,000	153,500.00	2,618,710,000	0.95
17	小松製作所	株式	日本	機械	1,037,600	2,552.00	2,647,955,200	2,495.00	2,588,812,000	0.94
18	三菱地所	株式	日本	不動産 業	1,445,000	1,605.00	2,319,225,000	1,668.00	2,410,260,000	0.87
19	日立	株式	日本	電気機 器	4,694,000	498.00	2,337,612,000	495.00	2,323,530,000	0.84
20	パナソニック	株式	日本	電気機 器	2,070,800	1,082.00	2,240,605,600	1,101.00	2,279,950,800	0.83
21	野村ホールディ ングス	株式	日本	証券、 商品先 物取引 業	4,346,400	522.00	2,268,820,800	518.00	2,251,435,200	0.82
22	東芝	株式	日本	電気機 器	4,127,000	523.00	2,158,421,000	535.00	2,207,945,000	0.80
23	日産自動車	株式	日本	輸送用 機器	2,641,700	867.00	2,290,353,900	835.00	2,205,819,500	0.80
24	東京海上HD	株式	日本	保険業	783,500	2,508.00	1,965,018,000	2,679.00	2,098,996,500	0.76
25	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	363,600	5,330.00	1,937,988,000	5,690.00	2,068,884,000	0.75
26	三菱電機	株式	日本	電気機 器	2,091,000	1,008.00	2,107,728,000	967.00	2,021,997,000	0.73
27	セブン&アイ・ HL D G S	株式	日本	小売業	863,300	2,167.00	1,870,771,100	2,277.00	1,965,734,100	0.71
28	関西電力	株式	日本	電気・ ガス業	853,300	2,088.00	1,781,690,400	2,146.00	1,831,181,800	0.66
29	信越化学	株式	日本	化学	364,700	4,835.00	1,763,324,500	4,695.00	1,712,266,500	0.62
30	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	5,745,000	309.00	1,775,205,000	296.00	1,700,520,000	0.62

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	電気機器	14.10
	輸送用機器	10.01
	銀行業	9.34
	化学	5.67
	情報・通信業	5.42
	卸売業	5.07
	機械	4.82
	電気・ガス業	4.52
	医薬品	4.15
	小売業	3.38
	陸運業	3.35
	食料品	2.79
	保険業	2.52
	不動産業	2.45
	鉄鋼	2.21
	その他製品	2.00
	建設業	1.91
	サービス業	1.63
	証券、商品先物取引業	1.49
	非鉄金属	1.34
	精密機器	1.32
	ガラス・土石製品	1.30
	繊維製品	0.89
	石油・石炭製品	0.85
	その他金融業	0.78
	金属製品	0.65
	ゴム製品	0.58
	鉱業	0.58
海運業	0.55	
パルプ・紙	0.35	
空運業	0.30	
倉庫・運輸関連業	0.22	
水産・農林業	0.09	
合計		96.64

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	754,565	6,938.00	5,235,169,027	6,973.13	5,261,680,895	1.82

2	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	136,163	29,348.60	3,996,193,122	28,448.15	3,873,585,939	1.34
3	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロメリット	1,575,000	1,756.77	2,766,904,875	1,701.20	2,679,393,465	0.93
4	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	298,768	7,921.78	2,366,775,711	8,342.59	2,492,499,228	0.86
5	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	1,144,943	2,224.96	2,547,456,156	2,169.40	2,483,839,917	0.86
6	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術サービス	185,555	13,336.71	2,474,692,519	13,259.90	2,460,440,522	0.85
7	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	2,606,233	930.46	2,425,005,357	934.67	2,435,967,381	0.84
8	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	521,814	4,550.12	2,374,314,752	4,598.52	2,399,573,420	0.83
9	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	581,000	3,802.78	2,209,417,155	3,814.22	2,216,063,447	0.77
10	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	422,849	5,273.56	2,229,921,010	5,134.66	2,171,184,324	0.75
11	AT&T INC	株式	米国	各種電気通信サービス	889,526	2,325.47	2,068,563,003	2,298.50	2,044,577,557	0.71
12	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	415,020	4,959.80	2,058,414,951	4,873.18	2,022,468,990	0.70
13	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	754,934	2,767.52	2,089,293,207	2,647.40	1,998,615,291	0.69
14	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	497,776	3,919.04	1,950,803,657	3,808.80	1,895,926,989	0.66
15	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	37,362	51,326.14	1,917,647,112	49,846.37	1,862,360,016	0.65
16	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,202,153	1,556.58	1,871,241,907	1,541.05	1,852,578,602	0.64
17	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	2,778,630	630.91	1,753,071,011	650.23	1,806,758,810	0.63
18	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	7,811,349	236.46	1,847,075,959	229.63	1,793,686,325	0.62
19	BANK OF AMERICA CORP	株式	米国	各種金融サービス	1,522,007	1,216.66	1,851,767,928	1,160.28	1,765,957,326	0.61
20	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	315,312	5,159.17	1,626,748,022	5,254.77	1,656,892,070	0.57
21	CITIGROUP INC	株式	米国	各種金融サービス	4,281,831	401.20	1,717,853,898	384.04	1,644,381,532	0.57

22	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	609,018	2,720.13	1,656,605,635	2,692.34	1,639,686,263	0.57
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	536,015	2,773.38	1,486,575,425	2,908.77	1,559,142,851	0.54
24	SCHLUMBERGER LTD	株式	オランダ	エネルギー設備・サービス	199,576	7,536.93	1,504,190,422	7,586.77	1,514,137,908	0.52
25	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	308,253	4,856.22	1,496,945,217	4,909.49	1,513,364,774	0.52
26	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	816,484	1,762.48	1,439,040,558	1,786.18	1,458,387,881	0.51
27	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	319,033	4,752.54	1,516,217,094	4,510.51	1,439,002,334	0.50
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	272,431	4,881.36	1,329,832,533	5,086.45	1,385,705,979	0.48
29	CONOCOPHILLIPS	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	204,596	6,027.75	1,233,252,864	6,314.55	1,291,931,426	0.45
30	SIEMENS AG-REG	株式	ドイツ	コングロマリット	120,159	10,654.42	1,280,224,621	10,559.10	1,268,771,185	0.44

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.65
	商業銀行	8.20
	医薬品	5.50
	金属・鉱業	4.38
	保険	4.21
	各種電気通信サービス	2.98
	各種金融サービス	2.79
	化学	2.69
	メディア	2.57
	食品	2.48
	資本市場	2.39
	ソフトウェア	2.35
	コンピュータ・周辺機器	2.31
	食品・生活必需品小売り	2.19
	コングロマリット	2.16
	機械	2.01
	飲料	1.97
	情報技術サービス	1.87
	エネルギー設備・サービス	1.85
	電力	1.84
	半導体・半導体製造装置	1.70
	航空宇宙・防衛	1.69
	通信機器	1.56

総合公益事業	1.41
ホテル・レストラン・レジャー	1.40
家庭用品	1.32
タバコ	1.31
専門小売り	1.29
ヘルスケア機器・用品	1.25
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.19
インターネットソフトウェア・サービス	0.98
無線通信サービス	0.98
自動車	0.98
電気設備	0.87
バイオテクノロジー	0.83
繊維・アパレル・贅沢品	0.82
陸運・鉄道	0.72
不動産管理・開発	0.65
航空貨物・物流サービス	0.57
複合小売り	0.54
建設・土木	0.52
インターネット販売・カタログ販売	0.47
商業サービス・用品	0.41
消費者金融	0.39
電子装置・機器・部品	0.38
自動車部品	0.36
建設資材	0.34
専門サービス	0.33
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.32
家庭用耐久財	0.27
パーソナル用品	0.23
紙製品・林産品	0.21
建設関連製品	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.18
商社・流通業	0.18
運送インフラ	0.16
ガス	0.16
容器・包装	0.15
旅客航空輸送業	0.12
海運業	0.12
販売	0.11
事務用電子機器	0.08
貯蓄・抵当・不動産金融	0.07
レジャー用品	0.06
各種消費者サービス	0.06
不動産投資信託	0.06
水道	0.04
ヘルスケア・テクノロジー	0.03
株式計	95.44
投資信託受益証券	0.31
投資証券	1.25
合計	97.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	64回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	7,200,000,000	101.74	7,325,280,000	101.70	7,322,184,000	1.50	2012/ 6/20	1.69
2	310回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	6,500,000,000	97.57	6,341,790,000	97.99	6,369,480,000	1.00	2020/ 9/20	1.47
3	306回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	6,200,000,000	101.56	6,296,410,000	102.05	6,326,976,000	1.40	2020/ 3/20	1.46
4	81回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	6,200,000,000	101.28	6,279,360,000	101.37	6,285,002,000	0.80	2014/ 3/20	1.45
5	285回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	5,600,000,000	105.65	5,916,456,000	105.89	5,930,008,000	1.70	2017/ 3/20	1.37
6	66回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,700,000,000	101.41	5,780,313,000	101.38	5,778,831,000	1.10	2012/ 9/20	1.34
7	305回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	100.96	5,552,800,000	101.44	5,579,255,000	1.30	2019/ 12/20	1.29
8	88回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	99.96	5,497,745,000	100.10	5,505,445,000	0.50	2015/ 3/20	1.27
9	89回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	99.41	5,467,330,000	99.56	5,475,690,000	0.40	2015/ 6/20	1.27
10	312回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	99.35	5,463,990,000	99.52	5,473,600,000	1.20	2020/ 12/20	1.27
11	75回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,300,000,000	102.03	5,407,537,000	102.04	5,407,961,000	1.10	2013/ 9/20	1.25
12	293回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	105.90	5,295,100,000	106.35	5,317,250,000	1.80	2018/ 6/20	1.23
13	85回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,200,000,000	100.88	5,245,864,000	101.00	5,251,844,000	0.70	2014/ 9/20	1.21
14	72回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,900,000,000	102.82	5,038,180,000	102.81	5,037,641,000	1.50	2013/ 6/20	1.17
15	87回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.06	5,002,800,000	100.21	5,010,250,000	0.50	2014/ 12/20	1.16
16	93回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	99.75	4,987,420,000	99.79	4,989,450,000	0.50	2015/ 12/20	1.15
17	70回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,900,000,000	101.14	4,955,860,000	101.14	4,955,860,000	0.80	2013/ 3/20	1.15
18	92回 利付国 庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	98.81	4,940,700,000	98.98	4,948,850,000	0.30	2015/ 9/20	1.14
19	299回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	4,800,000,000	101.67	4,880,304,000	102.16	4,903,584,000	1.30	2019/ 3/20	1.13
20	286回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	106.26	4,781,475,000	106.54	4,794,255,000	1.80	2017/ 6/20	1.11
21	289回 利付 国庫債券（10 年）	国債 証券	日本	4,400,000,000	104.13	4,581,852,000	104.48	4,597,120,000	1.50	2017/ 12/20	1.06

22	288回利付 国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,300,000,000	105.57	4,539,381,000	105.87	4,552,195,000	1.70	2017/9/20	1.05
23	83回利付国 庫債券（5年）	国債証券	日本	4,400,000,000	101.60	4,470,224,000	101.68	4,473,788,000	0.90	2014/6/20	1.03
24	290回利付 国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,200,000,000	103.26	4,336,962,000	103.73	4,356,450,000	1.40	2018/3/20	1.01
25	297回利付 国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,200,000,000	102.65	4,311,132,000	103.08	4,329,360,000	1.40	2018/12/20	1.00
26	301回利付 国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,100,000,000	103.02	4,223,615,000	103.51	4,244,074,000	1.50	2019/6/20	0.98
27	296回利付 国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,000,000,000	103.56	4,142,520,000	104.02	4,160,840,000	1.50	2018/9/20	0.96
28	78回利付国 庫債券（5年）	国債証券	日本	4,000,000,000	101.57	4,062,960,000	101.62	4,064,920,000	0.90	2013/12/20	0.94
29	69回利付国 庫債券（5年）	国債証券	日本	3,800,000,000	101.24	3,846,930,000	101.23	3,846,664,000	0.90	2012/12/20	0.89
30	266回利付 国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,700,000,000	103.47	3,828,279,000	103.59	3,832,756,000	1.40	2014/12/20	0.89

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	75.60
地方債証券	6.73
特殊債券	9.26
社債券	7.84
合計	99.43

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 （%）	償還 期限	投資 比率 （%）
					単価 （円）	金額 （円）	単価 （円）	金額 （円）			
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債証券	米国	3,595,240,000	105.79	3,803,368,444	105.88	3,806,460,350	4.00	2012/ 11/15	0.97
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	米国	3,268,400,000	108.55	3,547,717,464	108.70	3,552,587,380	4.25	2013/ 11/15	0.90
3	US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	米国	3,268,400,000	108.13	3,533,957,500	108.41	3,543,141,704	4.00	2014/ 2/15	0.90

4	US T N/B 4.5 04/30/12	国債 証券	米国	3,268,400,000	104.94	3,429,891,644	104.86	3,427,080,820	4.50	2012/ 4/30	0.87
5	US T N/B 0.875 02/29/12	国債 証券	米国	3,268,400,000	100.55	3,286,506,936	100.57	3,287,160,616	0.88	2012/ 2/29	0.83
6	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,859,850,000	110.70	3,165,710,958	111.05	3,175,977,819	4.75	2014/ 5/15	0.81
7	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,859,850,000	107.98	3,088,180,424	108.20	3,094,214,708	4.25	2013/ 8/15	0.79
8	US T N/B 4.375 08/15/12	国債 証券	米国	2,859,850,000	105.69	3,022,489,670	105.80	3,025,606,906	4.38	2012/ 8/15	0.77
9	US T N/B 1.5 07/15/12	国債 証券	米国	2,941,560,000	101.49	2,985,448,075	101.52	2,986,359,959	1.50	2012/ 7/15	0.76
10	US T N/B 1.875 06/15/12	国債 証券	米国	2,859,850,000	101.94	2,915,359,689	101.93	2,915,130,901	1.88	2012/ 6/15	0.74
11	US T N/B 1.125 12/15/12	国債 証券	米国	2,859,850,000	100.75	2,881,298,875	100.87	2,884,644,900	1.13	2012/ 12/15	0.73
12	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,614,720,000	106.23	2,777,721,645	106.33	2,780,179,482	3.88	2013/ 2/15	0.71
13	US T N/B 1.375 09/15/12	国債 証券	米国	2,696,430,000	101.27	2,730,539,840	101.34	2,732,643,055	1.38	2012/ 9/15	0.69
14	US T N/B 4.5 03/31/12	国債 証券	米国	2,614,720,000	104.55	2,733,689,760	104.50	2,732,460,842	4.50	2012/ 3/31	0.69
15	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,451,300,000	109.63	2,687,409,216	110.04	2,697,386,007	4.25	2014/ 11/15	0.69
16	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,451,300,000	103.81	2,544,743,556	104.13	2,552,587,716	2.63	2014/ 6/30	0.65
17	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,369,590,000	106.11	2,514,348,253	106.34	2,519,703,527	3.63	2013/ 5/15	0.64
18	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,287,880,000	109.34	2,501,453,598	109.77	2,511,291,482	4.25	2014/ 8/15	0.64
19	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,451,300,000	98.41	2,412,422,382	98.65	2,418,158,424	0.50	2013/ 10/15	0.61
20	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,287,880,000	102.64	2,348,371,547	103.09	2,358,461,098	2.38	2014/ 9/30	0.60
21	US T N/B 1.375 03/15/13	国債 証券	米国	2,287,880,000	101.14	2,313,870,317	101.29	2,317,279,258	1.38	2013/ 3/15	0.59
22	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	2,130,660,000	107.72	2,295,146,952	107.43	2,288,968,038	4.25	2014/ 7/4	0.58
23	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債 証券	ドイツ	2,130,660,000	106.35	2,265,956,910	106.16	2,261,802,123	3.75	2015/ 1/4	0.57
24	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	国債 証券	ドイツ	2,130,660,000	105.67	2,251,468,422	105.57	2,249,295,149	4.50	2013/ 1/4	0.57
25	US T N/B 3.625 02/15/20	国債 証券	米国	2,124,460,000	101.66	2,159,641,058	102.89	2,185,856,894	3.63	2020/ 2/15	0.56

26	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債 証券	イタ リア	2,130,660,000	102.91	2,192,662,206	102.53	2,184,565,698	4.25	2014/ 8/1	0.55
27	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債 証券	ドイ ツ	2,018,520,000	106.94	2,158,605,288	106.83	2,156,384,916	4.25	2014/ 1/4	0.55
28	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	国債 証券	フラ ンス	2,018,520,000	105.35	2,126,510,820	105.18	2,123,079,336	4.75	2012/ 10/25	0.54
29	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債 証券	ドイ ツ	2,018,520,000	105.18	2,123,079,336	104.89	2,117,225,628	3.75	2013/ 7/4	0.54
30	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債 証券	フラ ンス	2,018,520,000	104.90	2,117,427,480	104.78	2,115,005,256	4.00	2013/ 4/25	0.54

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.24
合計	97.24

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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23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。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成16年2月25日現在）	150	150	1.0666	1.0666
第2期末（平成17年2月25日現在）	969	969	1.1019	1.1019
第3期末（平成18年2月27日現在）	2,058	2,058	1.1990	1.1990
第4期末（平成19年2月26日現在）	2,669	2,669	1.2585	1.2585
第5期末（平成20年2月25日現在）	3,305	3,305	1.2076	1.2076
第6期末（平成21年2月25日現在）	3,259	3,259	1.0599	1.0599
第7期末（平成22年2月25日現在）	3,884	3,884	1.1365	1.1365
第8期末（平成23年2月25日現在）	4,419	4,419	1.1651	1.1651
平成22年2月末	3,880		1.1356	
3月末	4,078		1.1658	
4月末	4,134		1.1759	
5月末	4,049		1.1403	
6月末	4,086		1.1329	
7月末	4,152		1.1421	
8月末	4,136		1.1303	
9月末	4,221		1.1464	
10月末	4,225		1.1360	
11月末	4,266		1.1419	

12月末	4,335		1.1547	
平成23年1月末	4,388		1.1565	
2月末	4,424		1.1672	

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成16年2月25日現在）	184	184	1.1111	1.1111
第2期末（平成17年2月25日現在）	1,668	1,668	1.1715	1.1715
第3期末（平成18年2月27日現在）	5,022	5,022	1.3523	1.3523
第4期末（平成19年2月26日現在）	6,979	6,979	1.4627	1.4627
第5期末（平成20年2月25日現在）	8,199	8,199	1.3419	1.3419
第6期末（平成21年2月25日現在）	7,395	7,395	1.0433	1.0433
第7期末（平成22年2月25日現在）	9,529	9,529	1.1659	1.1659
第8期末（平成23年2月25日現在）	10,826	10,826	1.2065	1.2065
平成22年2月末	9,512		1.1638	
3月末	10,189		1.2195	
4月末	10,350		1.2312	
5月末	9,711		1.1642	
6月末	9,697		1.1425	
7月末	9,901		1.1577	
8月末	9,717		1.1316	
9月末	10,060		1.1604	
10月末	9,992		1.1465	
11月末	10,165		1.1646	
12月末	10,447		1.1827	
平成23年1月末	10,674		1.1906	
2月末	10,859		1.2104	

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成16年2月25日現在）	130	130	1.1555	1.1555
第2期末（平成17年2月25日現在）	1,197	1,197	1.2420	1.2420
第3期末（平成18年2月27日現在）	4,156	4,156	1.5136	1.5136
第4期末（平成19年2月26日現在）	6,033	6,033	1.6848	1.6848
第5期末（平成20年2月25日現在）	7,103	7,103	1.4810	1.4810
第6期末（平成21年2月25日現在）	5,656	5,656	1.0219	1.0219
第7期末（平成22年2月25日現在）	7,667	7,667	1.1890	1.1890
第8期末（平成23年2月25日現在）	8,673	8,673	1.2395	1.2395
平成22年2月末	7,644		1.1855	
3月末	8,371		1.2663	
4月末	8,498		1.2798	
5月末	7,758		1.1812	
6月末	7,613		1.1449	
7月末	7,829		1.1662	
8月末	7,596		1.1262	
9月末	7,929		1.1677	
10月末	7,853		1.1503	
11月末	8,086		1.1799	
12月末	8,316		1.2027	
平成23年1月末	8,522		1.2166	
2月末	8,703		1.2450	

【分配の推移】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-
第5期	-
第6期	-
第7期	-
第8期	-

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-
第5期	-
第6期	-
第7期	-
第8期	-

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-
第5期	-
第6期	-
第7期	-
第8期	-

【収益率の推移】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

	収益率（％）
第1期	6.66
第2期	3.31
第3期	8.81
第4期	4.96
第5期	4.04
第6期	12.23
第7期	7.23
第8期	2.52

(注) 収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

	収益率（％）
--	--------

第1期	11.11
第2期	5.44
第3期	15.43
第4期	8.16
第5期	8.26
第6期	22.25
第7期	11.75
第8期	3.48

(注) 収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型

	収益率 (%)
第1期	15.55
第2期	7.49
第3期	21.87
第4期	11.31
第5期	12.10
第6期	31.00
第7期	16.35
第8期	4.25

(注) 収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

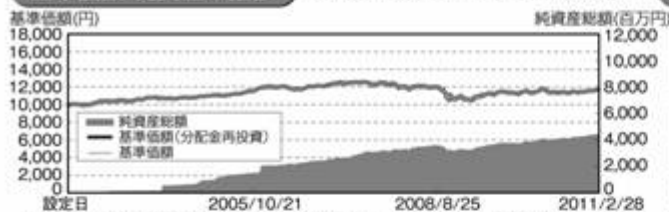
<< 参考情報 >>

データの基準日:2011年2月28日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

基準価額・純資産の推移

《設定日(2002年12月13日)～2011年2月28日》



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

分配の推移(税引前)

期	分配日	分配金(円)
第4期	(2007.02.26)	0円
第5期	(2008.02.25)	0円
第6期	(2009.02.25)	0円
第7期	(2010.02.25)	0円
第8期	(2011.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

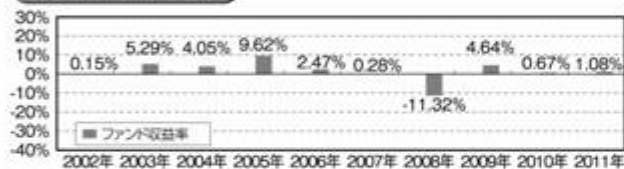
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内債券バツシブ・ファンドマザーファンド	64.44
2	国内株式バツシブ・ファンド(最適化法)マザーファンド	19.61
3	外国債券バツシブ・ファンドマザーファンド	7.65
4	外国株式バツシブ・ファンドマザーファンド	5.30

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

年間収益率の推移

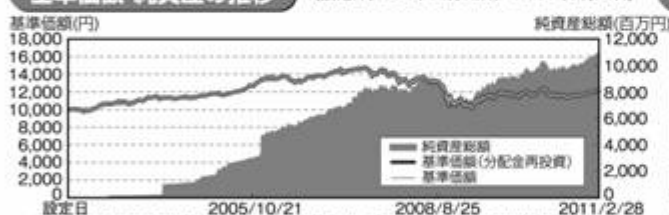


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2002年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

基準価額・純資産の推移

《設定日(2002年12月13日)～2011年2月28日》



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

分配の推移(税引前)

期	分配日	分配金(円)
第4期	(2007.02.26)	0円
第5期	(2008.02.25)	0円
第6期	(2009.02.25)	0円
第7期	(2010.02.25)	0円
第8期	(2011.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

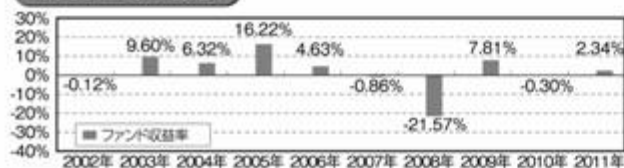
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内債券バツシブ・ファンドマザーファンド	42.05
2	国内株式バツシブ・ファンド(最適化法)マザーファンド	31.32
3	外国株式バツシブ・ファンドマザーファンド	12.29
4	外国債券バツシブ・ファンドマザーファンド	11.36

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。
 ※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、2002年は設定日から年末までの収益率、および2011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。

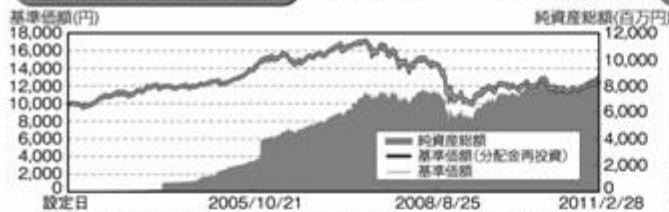
データの基準日:2011年2月28日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

基準価額・純資産の推移

(設定日(2002年12月13日)~2011年2月28日)

分配の推移(税引前)



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

期	日	金額
第4期	(2007.02.26)	0円
第5期	(2008.02.25)	0円
第6期	(2009.02.25)	0円
第7期	(2010.02.25)	0円
第8期	(2011.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

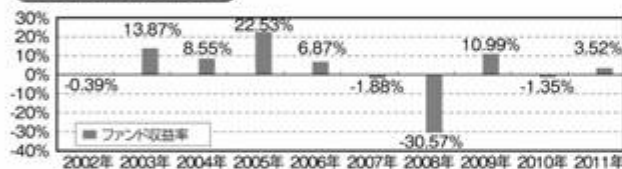
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)-マザーファンド	40.88
2	国内債券パッシブ・ファンドマザーファンド	21.55
3	外国株式パッシブ・ファンドマザーファンド	19.13
4	外国債券パッシブ・ファンドマザーファンド	15.45

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。
 ※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、2002年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年当初から基準日までの収益率を表示しています。

各マザーファンドの主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)-マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	日本	96.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.36
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.72
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.56
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.26
4	キヤノン	株式	日本	電気機器	1.85
5	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.74
6	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.53
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.35
8	ソニー	株式	日本	電気機器	1.27
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	1.21
10	東京電力	株式	日本	電気・ガス業	1.18

組入上位5業種

業種	投資比率(%)
電気機器	14.10
輸送用機器	10.01
銀行業	9.34
化学	5.67
情報・通信業	5.42

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2011年2月28日

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	米国	50.23
	英国	9.87
	カナダ	5.94
	フランス	4.54
	スイス	4.41
	その他	20.44
	小計	95.44
投資信託受益証券	オーストラリア	0.29
	シンガポール	0.02
	小計	0.31
投資証券	米国	0.92
	フランス	0.13
	英国	0.13
	香港	0.03
	カナダ	0.02
	その他	0.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.25
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	1.82
2	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ周辺機器	1.34
3	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コンプロマシナ	0.93
4	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	0.86
5	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	0.66
6	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術サービス	0.65
7	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	0.64
8	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.63
9	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	0.77
10	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	0.75

組入上位5業種

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.65
	商業銀行	8.20
	医薬品	5.50
	金属・鉱業	4.38
	保険	4.21

■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。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	日本	75.60
地方債証券	日本	6.73
特殊債券	日本	9.26
社債券	日本	7.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.57
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	64回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	1.50	2012/6/20	1.69
2	310回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.00	2020/9/20	1.47
3	306回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.40	2020/3/20	1.46
4	81回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.80	2014/3/20	1.45
5	285回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.70	2017/3/20	1.37
6	66回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	1.10	2012/9/20	1.34
7	305回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2019/12/20	1.29
8	88回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.50	2015/3/20	1.27
9	89回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.40	2015/6/20	1.27
10	312回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2020/12/20	1.27

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	米国	38.92
	イタリア	10.18
	ドイツ	9.44
	フランス	9.43
	英国	7.86
	その他	21.42
	小計	97.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.76
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債証券	米国	4.00	2012/11/15	0.97
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/11/15	0.90
3	US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	米国	4.00	2014/2/15	0.90
4	US T N/B 4.5 04/30/12	国債証券	米国	4.50	2012/4/30	0.87
5	US T N/B 0.875 02/29/12	国債証券	米国	0.88	2012/2/29	0.83
6	US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	米国	4.75	2014/5/15	0.81
7	US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/8/15	0.79
8	US T N/B 4.375 08/15/12	国債証券	米国	4.38	2012/8/15	0.77
9	US T N/B 1.5 07/15/12	国債証券	米国	1.50	2012/7/15	0.76
10	US T N/B 1.875 06/15/12	国債証券	米国	1.88	2012/6/15	0.74

○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。

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

	設定口数	解約口数
第1期	144,709,992	3,455,800
第2期	783,296,638	44,899,767
第3期	1,071,241,518	234,014,125
第4期	746,595,858	341,955,723
第5期	1,023,536,793	407,728,822
第6期	808,835,748	470,954,147
第7期	717,089,255	374,538,190
第8期	717,088,658	341,609,549

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

	設定口数	解約口数
第1期	171,631,847	5,928,590
第2期	1,332,596,333	74,131,606
第3期	2,610,265,343	320,692,996
第4期	1,520,234,750	462,264,605
第5期	1,986,010,161	647,207,655
第6期	1,694,085,942	716,280,777
第7期	1,585,255,449	499,713,782
第8期	1,458,689,281	659,115,611

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

	設定口数	解約口数
第1期	115,302,114	2,576,841
第2期	914,161,482	62,918,227
第3期	2,153,330,055	371,349,072
第4期	1,327,156,219	491,810,911
第5期	1,854,832,281	639,682,536
第6期	1,377,219,073	638,023,646
第7期	1,360,590,692	447,612,668
第8期	1,167,657,064	618,314,729

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

- ・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。

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

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

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

- ・お申込価額（発行価格）はお申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

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

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.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）とします。

収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

- ・お申込手数料はありません。

- ・取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を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。

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、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。原則として販売会社の毎営業日の午後3時までには解約の請求が行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

- ・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

・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）

- ・換金（解約）単位は1口単位とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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、毎営業日、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】

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。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成14年12月13日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には、信託を終了する場合があります。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は各ファンドについて受益権の口数が10億口を下回る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。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 委託会社は上記a. b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

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

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。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しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a. ~ e. の規定に従います。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面に付記します。

h.上記b.に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

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、日本経済新聞に掲載します。

ホ．運用報告書

委託会社は、各計算期間末日（原則として2月25日。休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資される性質を有します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる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）に対し支払われます。販売会社は、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、委託会社に帰属するものとします。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として償還日（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係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、解約の請求を受益者がするとき、振替受益権をもって行うものとします。受益証券をお手許で保有されている方は、解約のお申込みの際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

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）ならびに同規則第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7期計算期間（平成21年2月26日から平成22年2月25日まで）及び第8期計算期間（平成22年2月26日から平成23年2月25日まで）の財務諸表について、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バランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第 7 期 平成22年 2 月25日現在	第 8 期 平成23年 2 月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	123,012,919	141,192,132
親投資信託受益証券	3,767,135,371	4,286,622,077
未収入金	-	7,400,000
流動資産合計	3,890,148,290	4,435,214,209
資産合計	3,890,148,290	4,435,214,209
負債の部		
流動負債		
未払解約金	618,931	9,633,882
未払受託者報酬	605,688	680,786
未払委託者報酬	4,643,952	5,219,631
その他未払費用	100,870	113,377
流動負債合計	5,969,441	15,647,676
負債合計	5,969,441	15,647,676
純資産の部		
元本等		
元本	3,417,759,228	3,793,238,337
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	466,419,621	626,328,196
(分配準備積立金)	149,436,534	136,036,044
元本等合計	3,884,178,849	4,419,566,533
純資産合計	3,884,178,849	4,419,566,533
負債純資産合計	3,890,148,290	4,435,214,209

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 7 期	第 8 期
	自 平成21年 2月26日 至 平成22年 2月25日	自 平成22年 2月26日 至 平成23年 2月25日
営業収益		
受取利息	96,176	99,431
有価証券売買等損益	252,304,208	116,411,706
営業収益合計	252,400,384	116,511,137
営業費用		
受託者報酬	1,160,865	1,316,001
委託者報酬	8,900,577	10,089,872
その他費用	193,323	219,163
営業費用合計	10,254,765	11,625,036
営業利益	242,145,619	104,886,101
経常利益	242,145,619	104,886,101
当期純利益	242,145,619	104,886,101
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	22,567,843	3,701,841
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	184,209,884	466,419,621
剰余金増加額又は欠損金減少額	87,236,337	105,725,335
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	87,236,337	105,725,335
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,604,376	47,001,020
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,604,376	47,001,020
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	466,419,621	626,328,196

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
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。	親投資信託受益証券 同左

(追加情報)

第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
*1 期首元本額	3,075,208,163円	3,417,759,228円
期中追加設定元本額	717,089,255円	717,088,658円
期中解約元本額	374,538,190円	341,609,549円
*2 計算期間末日における受益権の総数	3,417,759,228口	3,793,238,337口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
*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（88,374円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（432,122,396円）及び分配準備積立金（149,348,160円）より分配対象収益は581,558,930円（1万口当たり1,701.58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（88,916円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（509,502,554円）及び分配準備積立金（135,947,128円）より分配対象収益は645,538,598円（1万口当たり1,701.81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)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)親投資信託受益証券 「注記表（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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
種 類	貸借対照表 計上額(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	3,767,135,371	215,735,764
合計	3,767,135,371	215,735,764

	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券	110,990,784	
合計	110,990,784	

（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 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1365円 (11,365円)	1.1651円 (11,651円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式
該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法) ・マザーファンド	700,002,526	859,603,101	
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	2,562,878,656	2,851,202,504	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファン ド	175,686,010	235,138,155	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファン ド	297,561,636	340,678,317	
合計		3,736,128,828	4,286,622,077	

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。

【D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成22年2月25日現在	第8期 平成23年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	308,137,749	358,823,732
親投資信託受益証券	9,241,957,792	10,499,450,059
未収入金	-	6,000,000
流動資産合計	9,550,095,541	10,864,273,791
資産合計	9,550,095,541	10,864,273,791
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,609,945	21,502,634
未払受託者報酬	1,477,285	1,635,146
未払委託者報酬	12,803,524	14,171,512
その他未払費用	246,130	272,435
流動負債合計	20,136,884	37,581,727
負債合計	20,136,884	37,581,727
純資産の部		
元本等		
元本	8,173,859,814	8,973,433,484
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,356,098,843	1,853,258,580
（分配準備積立金）	689,885,732	638,650,522
元本等合計	9,529,958,657	10,826,692,064
純資産合計	9,529,958,657	10,826,692,064
負債純資産合計	9,550,095,541	10,864,273,791

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期	第8期
	自 平成21年 2月26日 至 平成22年 2月25日	自 平成22年 2月26日 至 平成23年 2月25日
営業収益		
受取利息	228,491	239,998
有価証券売買等損益	916,010,788	386,770,267
営業収益合計	916,239,279	387,010,265
営業費用		
受託者報酬	2,777,555	3,180,586
委託者報酬	24,072,809	27,565,768
その他費用	462,767	529,921
営業費用合計	27,313,131	31,276,275
営業利益	888,926,148	355,733,990
経常利益	888,926,148	355,733,990
当期純利益	888,926,148	355,733,990
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	47,208,527	5,876,680
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	306,797,317	1,356,098,843
剰余金増加額又は欠損金減少額	233,446,845	257,514,251
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	233,446,845	257,514,251
剰余金減少額又は欠損金増加額	25,862,940	110,211,824
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	25,862,940	110,211,824
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,356,098,843	1,853,258,580

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
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。	親投資信託受益証券 同左

(追加情報)

第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
*1 期首元本額	7,088,318,147円	8,173,859,814円
期中追加設定元本額	1,585,255,449円	1,458,689,281円
期中解約元本額	499,713,782円	659,115,611円
*2 計算期間末日における受益権の総数	8,173,859,814口	8,973,433,484口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
*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（216,978円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,767,528,310円）及び分配準備積立金（689,668,754円）より分配対象収益は2,457,414,042円（1万口当たり3,006.43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（221,140円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,059,371,906円）及び分配準備積立金（638,429,382円）より分配対象収益は2,698,022,428円（1万口当たり3,006.68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)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)親投資信託受益証券 「注記表（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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
種 類	貸借対照表 計上額(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	9,241,957,792	863,712,172
合計	9,241,957,792	863,712,172

	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券	373,695,820	
合計	373,695,820	

（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 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1659円 (11,659円)	1.2065円 (12,065円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式
該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法) ・マザーファンド	2,742,299,301	3,367,543,541	
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	4,104,287,669	4,566,020,031	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファン ド	990,180,130	1,325,257,085	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファン ド	1,083,613,768	1,240,629,402	
合計		8,920,380,868	10,499,450,059	

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。

【D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成22年2月25日現在	第8期 平成23年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	246,631,536	286,700,540
親投資信託受益証券	7,433,841,033	8,411,644,756
未収入金	-	3,000,000
流動資産合計	7,680,472,569	8,701,345,296
資産合計	7,680,472,569	8,701,345,296
負債の部		
流動負債		
未払解約金	316,076	13,402,245
未払受託者報酬	1,194,238	1,298,850
未払委託者報酬	11,544,728	12,556,060
その他未払費用	198,957	216,388
流動負債合計	13,253,999	27,473,543
負債合計	13,253,999	27,473,543
純資産の部		
元本等		
元本	6,448,618,015	6,997,960,350
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,218,600,555	1,675,911,403
（分配準備積立金）	691,348,532	630,649,498
元本等合計	7,667,218,570	8,673,871,753
純資産合計	7,667,218,570	8,673,871,753
負債純資産合計	7,680,472,569	8,701,345,296

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 7 期	第 8 期
	自 平成21年 2月26日 至 平成22年 2月25日	自 平成22年 2月26日 至 平成23年 2月25日
営業収益		
受取利息	184,076	192,320
有価証券売買等損益	973,610,515	376,884,723
営業収益合計	973,794,591	377,077,043
営業費用		
受託者報酬	2,228,470	2,541,156
委託者報酬	21,542,809	24,565,516
その他費用	371,253	423,362
営業費用合計	24,142,532	27,530,034
営業利益	949,652,059	349,547,009
経常利益	949,652,059	349,547,009
当期純利益	949,652,059	349,547,009
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	59,780,017	2,723,977
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	121,354,340	1,218,600,555
剰余金増加額又は欠損金減少額	223,100,849	228,141,563
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	223,100,849	228,141,563
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,726,676	117,653,747
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,726,676	117,653,747
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,218,600,555	1,675,911,403

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
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。	親投資信託受益証券 同左

(追加情報)

第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
*1 期首元本額	5,535,639,991円	6,448,618,015円
期中追加設定元本額	1,360,590,692円	1,167,657,064円
期中解約元本額	447,612,668円	618,314,729円
*2 計算期間末日における受益権の総数	6,448,618,015口	6,997,960,350口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
*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（176,019円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,117,138,010円）及び分配準備積立金（691,172,513円）より分配対象収益は2,808,486,542円（1万口当たり4,355.18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（178,555円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,417,261,829円）及び分配準備積立金（630,470,943円）より分配対象収益は3,047,911,327円（1万口当たり4,355.43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)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)親投資信託受益証券 「注記表（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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 7 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
種 類	貸借対照表 計上額(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	7,433,841,033	917,995,223
合計	7,433,841,033	917,995,223

	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券	366,734,582	
合計	366,734,582	

（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 7 期 平成22年2月25日現在	第 8 期 平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1890円 (11,890円)	1.2395円 (12,395円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式
該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法) ・マザーファンド	2,874,194,929	3,529,511,372	
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	1,686,301,944	1,876,010,912	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファン ド	1,235,372,366	1,653,422,374	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファン ド	1,181,500,654	1,352,700,098	
合計		6,977,369,893	8,411,644,756	

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。

[次へ](#)

（参考）

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」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す。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況
貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,876,621,924	3,133,270,232
株式	*2	264,115,174,600	264,381,727,116
派生商品評価勘定		6,940,865	47,203,959
未収入金		-	9,716,660,290
未収配当金		307,816,364	338,180,312
前払金		19,227,814	-
差入委託証拠金		69,605,186	-
流動資産合計		266,395,386,753	277,617,041,909
資産合計		266,395,386,753	277,617,041,909
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		31,096,326	30,823,445
前受金		-	11,090,000
未払解約金		162,725,000	7,164,018,000
流動負債合計		193,821,326	7,205,931,445
負債合計		193,821,326	7,205,931,445
純資産の部			
元本等			
元本		233,574,423,007	220,196,722,346
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		32,627,142,420	50,214,388,118
元本等合計		266,201,565,427	270,411,110,464
純資産合計		266,201,565,427	270,411,110,464
負債純資産合計		266,395,386,753	277,617,041,909

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 等における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準 ずる価額）、又は金融商品取引業 者等から提示される気配相場に 基づいて評価しております。	株式及び新株予約権証券 同左

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月9日から平成23年2月7日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月8日から平成24年2月7日までとなっております。

(追加情報)

自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券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	159,884,634,622円	233,574,423,007円
同期中追加設定元本額	121,665,042,924円	39,969,597,768円
同期中解約元本額	47,975,254,539円	53,347,298,429円
同期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,267,533,687円	1,590,840,264円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	749,811,436円	1,047,651,439円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	27,785,350,686円	30,830,403,842円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	642,998,905円	700,002,526円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,476,148,985円	2,742,299,301円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	2,661,398,182円	2,874,194,929円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	418,128,815円	435,640,513円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,260,397,262円	1,341,511,810円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	976,532,444円	1,024,991,073円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	163,416,214円	145,238,096円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,278,998,146円	1,335,828,864円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	12,643,790円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	273,845,181円	244,604,947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）	11,610,765,719円	9,867,955,132円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA（適格機関投資 家限定）	1,869,361,848円	1,702,994,850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）	219,843,217円	194,710,307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）	807,812,105円	749,714,375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）	227,441,435円	204,600,270円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA（適格機関投資家 限定）	303,242,611円	280,211,174円
D I A M世界バランスファンド 40VA（適格機関投資家限 定）	20,794,111,285円	18,635,488,207円
D I A M世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限 定）	6,791,172,198円	6,231,615,021円
D I A Mバランスファンド25 VA（適格機関投資家限定）	5,498,244,510円	4,790,801,907円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA（適格機関投資家限 定）	3,755,150,130円	3,252,926,220円
D I A Mバランスファンド50 VA（適格機関投資家限定）	8,733,276,034円	7,709,381,095円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA（適格機関投資 家限定）	1,253,721,860円	1,160,684,000円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA2（適格機関投 資家限定）	2,681,101,035円	2,429,481,845円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30VA（適格 機関投資家限定）	2,790,469,753円	2,471,661,142円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA（適格機関投資家 向け）	14,545,694,295円	13,265,254,995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）	243,609,429円	204,230,422円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	541,675,984円	291,738,856円
D I A M世界バランスファンド 55VA（適格機関投資家限 定）	4,808,055,363円	4,563,474,472円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35VA（適格機 関投資家限定）	9,344,521,039円	8,532,106,085円
D I A Mグローバル分散ファン ドVA（適格機関投資家限定）	452,944,061円	425,829,736円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA（適格機関投資 家限定）	41,335,843,161円	37,946,928,846円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA（適格機関投 資家限定）	2,903,591,558円	2,579,508,320円

D I A M世界アセットバランス ファンド25VA（適格機関投 資家限定）	5,078,768,426円	4,614,978,702円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA（適格機関投 資家限定）	25,288,084,193円	22,954,362,059円
D I A Mバランス30VA（適 格機関投資家限定）	282,165,442円	261,737,293円
D I A Mバランス50VA（適 格機関投資家限定）	91,029円	91,930円
D I A Mバランス70VA（適 格機関投資家限定）	140,254円	144,867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）	21,303,265,635円	20,067,408,457円
D I A M世界バランス25VA （適格機関投資家限定）	42,891,050円	209,319,294円
D I A M国内バランス30VA （適格機関投資家限定）	37,771,600円	73,184,000円
D I A Mバランス20VA（適 格機関投資家限定）	74,822,249円	198,128,463円
D I A Mバランス40VA（適 格機関投資家限定）	86,022円	86,168円
D I A Mバランス60VA（適 格機関投資家限定）	128,534円	132,442円
（合 計）	233,574,423,007円	220,196,722,346円
*2 差入代用有価証券		株式 1,877,500,000円
*3 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	233,574,423,007口	220,196,722,346口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制		<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		<p>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。</p>
2. 時価の算定方法		<p>(1)株式 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	--	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

自平成21年2月26日 至平成22年2月25日		
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	264,115,174,600	2,474,642,237
合計	264,115,174,600	2,474,642,237

自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	470,551,754
合計	470,551,754

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	
3. 取引に係るリスクの内容	株価の変動によるリスクを有しております。	

4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成22年2月25日現在					
区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	3,101,161,000	-	3,077,400,000	24,155,461
合計		3,101,161,000	-	3,077,400,000	24,155,461

平成23年2月25日現在					
区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	9,138,356,000	-	9,155,250,000	16,380,514
合計		9,138,356,000	-	9,155,250,000	16,380,514

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.1397円	1.2280円

(1万口当たり純資産額)	(11,397円)	(12,280円)
--------------	-----------	-----------

[次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

平成23年2月25日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	96,000	190	18,240,000	
日本水産	271,200	279	75,664,800	
マルハニチロホールディングス	465,000	152	70,680,000	
ハウスイ	20,000	109	2,180,000	
サカタのタネ	33,000	1,226	40,458,000	
ホクト	24,100	1,887	45,476,700	
ショーボンドHD	21,000	1,720	36,120,000	
ミライト・ホールディングス	61,600	615	37,884,000	
住石ホールディングス	66,400	90	5,976,000	
日鉄鉱業	60,000	423	25,380,000	
三井松島	136,000	167	22,712,000	
国際石油開発帝石	2,374	578,000	1,372,172,000	
日本海洋掘削	5,900	3,660	21,594,000	
関東天然瓦斯	24,000	472	11,328,000	
石油資源開発	37,100	4,005	148,585,500	
ダイセキ環境ソリューション	21	83,200	1,747,200	
間組	94,000	73	6,862,000	
東急建設	83,800	243	20,363,400	
コムシスホールディングス	114,500	833	95,378,500	
ミサワホーム	28,000	409	11,452,000	
高松コンストラクションGP	18,000	1,161	20,898,000	
東建コーポレーション	8,190	3,205	26,248,950	
ヤマウラ	8,500	212	1,802,000	
大成建設	1,112,000	189	210,168,000	
大林組	704,000	362	254,848,000	
清水建設	666,000	346	230,436,000	
飛鳥建設	683,500	23	15,720,500	
長谷工コーポレーション	1,465,000	75	109,875,000	
松井建設	2,000	317	634,000	
鹿島建設	1,031,000	214	220,634,000	
不動テトラ	173,800	52	9,037,600	
大末建設	88,000	42	3,696,000	
鉄建建設	145,000	89	12,905,000	
安藤建設	80,000	113	9,040,000	
太平工業	47,000	372	17,484,000	
西松建設	309,000	111	34,299,000	
三井住友建設	129,700	65	8,430,500	
大豊建設	73,000	85	6,205,000	
前田建設	145,000	258	37,410,000	
佐田建設	86,000	36	3,096,000	
ナカノフドー建設	19,000	205	3,895,000	
奥村組	224,000	320	71,680,000	
大和小田急建設	12,000	226	2,712,000	
東鉄工業	31,000	683	21,173,000	
イチケン	29,000	116	3,364,000	
浅沼組	80,000	75	6,000,000	
戸田建設	252,000	307	77,364,000	
熊谷組	179,000	61	10,919,000	
青木あすなる建設	16,500	402	6,633,000	
北野建設	53,000	207	10,971,000	

植木組	32,000	138	4,416,000
三井ホーム	27,000	466	12,582,000
矢作建設	29,300	496	14,532,800
ピーエス三菱	16,000	255	4,080,000
大東建託	91,600	6,630	607,308,000
新日本建設	28,600	253	7,235,800
N I P P O	55,000	568	31,240,000
東亜道路	47,000	125	5,875,000
前田道路	68,000	690	46,920,000
日本道路	71,000	202	14,342,000
東亜建設	193,000	103	19,879,000
若築建設	133,000	47	6,251,000
東洋建設	322,000	46	14,812,000
五洋建設	271,500	134	36,381,000
大林道路	31,000	158	4,898,000
世紀東急	63,000	49	3,087,000
福田組	33,000	172	5,676,000
住友林業	161,700	724	117,070,800
日本基礎技術	31,400	244	7,661,600
日成ビルド工業	73,000	57	4,161,000
エス・パイ・エル	113,000	53	5,989,000
巴コーポレーション	33,300	254	8,458,200
パナホーム	77,000	549	42,273,000
大和ハウス	585,000	1,037	606,645,000
ライト工業	51,700	224	11,580,800
積水ハウス	703,000	842	591,926,000
日特建設	69,000	69	4,761,000
北陸電気工事	2,000	230	460,000
ユアテック	38,000	350	13,300,000
西部電気工業	1,000	371	371,000
四電工	6,000	357	2,142,000
中電工	34,500	1,008	34,776,000
関電工	108,000	515	55,620,000
きんでん	157,000	733	115,081,000
東京エネシス	27,000	549	14,823,000
トーエネック	35,000	466	16,310,000
住友電設	17,500	334	5,845,000
日本電設工業	44,000	779	34,276,000
協和エクシオ	85,000	770	65,450,000
新日本空調	17,800	458	8,152,400
日本工営	74,000	275	20,350,000
日本電話施設	38,000	264	10,032,000
九電工	44,000	519	22,836,000
三機工業	54,000	517	27,918,000
日揮	235,000	1,801	423,235,000
中外炉工業	76,000	376	28,576,000
ヤマト	16,000	299	4,784,000
太平電業	31,000	634	19,654,000
高砂熱学	67,700	724	49,014,800
三晃金属	27,000	167	4,509,000
N E C ネットズエスアイ	20,100	1,090	21,909,000
朝日工業社	8,000	376	3,008,000
アタカ大機	17,000	285	4,845,000
大気社	36,100	1,471	53,103,100
ダイダン	25,000	466	11,650,000
日比谷総合設	31,600	766	24,205,600
東芝プラントシステム	38,000	1,079	41,002,000
日本製粉	137,000	408	55,896,000
日清製粉G本社	213,000	1,072	228,336,000

日東富士製粉	8,000	330	2,640,000
昭和産業	98,000	253	24,794,000
鳥越製粉	21,200	726	15,391,200
協同飼料	85,000	104	8,840,000
中部飼料	21,100	606	12,786,600
日本配合飼料	75,000	108	8,100,000
東洋精糖	38,000	116	4,408,000
日本甜菜糖	131,000	209	27,379,000
三井製糖	93,000	345	32,085,000
ネクスト	57	70,900	4,041,300
日本M&Aセンター	48	486,000	23,328,000
アコーディア・ゴルフ	617	66,500	41,030,500
パソナグループ	196	70,100	13,739,600
リンクアンドモチベーション	51	49,100	2,504,100
テンプホールディングス	30,200	763	23,042,600
森永製菓	231,000	200	46,200,000
中村屋	55,000	404	22,220,000
江崎グリコ	85,000	951	80,835,000
名糖産業	10,800	1,113	12,020,400
不二家	135,000	155	20,925,000
山崎製パン	172,000	1,004	172,688,000
第一屋製パン	35,000	96	3,360,000
モロゾフ	39,000	272	10,608,000
森永乳業	199,000	345	68,655,000
ヤクルト	125,700	2,304	289,612,800
明治ホールディングス	69,600	3,865	269,004,000
雪印メグミルク	46,200	1,450	66,990,000
プリマハム	133,000	108	14,364,000
日本ハム	163,000	1,148	187,124,000
伊藤ハム	130,000	309	40,170,000
林兼産業	78,000	86	6,708,000
丸大食品	105,000	268	28,140,000
米久	21,000	716	15,036,000
S Foods	15,500	737	11,423,500
学情	8,200	304	2,492,800
スタジオアリス	9,300	842	7,830,600
シミック	430	27,480	11,816,400
システナ	207	102,900	21,300,300
NECフィールドینگ	17,600	1,012	17,811,200
新日鉄ソリューションズ	17,200	1,817	31,252,400
総合警備保障	79,700	979	78,026,300
日本駐車場開発	2,279	4,085	9,309,715
コア	7,900	729	5,759,100
カカクコム	151	463,500	69,988,500
アイロムホールディングス	503	2,398	1,206,194
ルネサンス	11,400	302	3,442,800
新日本科学	13,800	373	5,147,400
エムスリー	86	424,500	36,507,000
ディー・エヌ・エー	85,300	3,020	257,606,000
博報堂DYHLDGS	30,310	5,090	154,277,900
ぐるなび	116	113,300	13,142,800
一休	160	40,600	6,496,000
ジャパンベストレスキューS	35	71,200	2,492,000
ジェイコムホールディングス	20	153,800	3,076,000
PGMホールディングス	464	53,200	24,684,800
サッポロホールディングス	333,000	371	123,543,000
アサヒビール	439,700	1,589	698,683,300
麒麟HD	941,000	1,150	1,082,150,000
宝ホールディングス	199,000	486	96,714,000

オエノンホールディングス	67,000	202	13,534,000
養命酒	3,000	800	2,400,000
三国コカ・コ・ラ	28,900	725	20,952,500
コカ・コーラウエスト	72,400	1,510	109,324,000
コカコーラセントラルジャパン	26,900	1,097	29,509,300
ダイドードリンコ	9,800	3,460	33,908,000
伊藤園	71,400	1,455	103,887,000
キーコーヒー	21,000	1,507	31,647,000
ユニカフェ	6,100	412	2,513,200
ジャパンフーズ	3,700	839	3,104,300
日清オイリオグループ	102,000	430	43,860,000
不二製油	57,200	1,203	68,811,600
J-オイルミルズ	88,000	255	22,440,000
ローソン	71,700	4,045	290,026,500
インターニックス	8,700	401	3,488,700
サンエー	7,100	3,225	22,897,500
キリン堂	9,500	412	3,914,000
ダイユーエイト	1,900	514	976,600
カワチ薬品	14,400	1,723	24,811,200
エーピーシー・マート	24,400	3,220	78,568,000
ハードオフコーポレーション	10,400	456	4,742,400
高千穂交易	8,800	975	8,580,000
アスクル	15,400	1,636	25,194,400
ゲオ	342	105,400	36,046,800
ポイント	17,440	3,930	68,539,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	116	580,000
伊藤忠食品	5,300	2,855	15,131,500
くらコーポレーション	10,800	1,310	14,148,000
キャンドゥ	89	73,100	6,505,900
エレマテック	16,600	1,183	19,637,800
バル	6,050	2,996	18,125,800
JALUX	6,300	840	5,292,000
エディオン	75,300	841	63,327,300
サーラコーポレーション	20,500	468	9,594,000
トーマンデバイス	2,700	2,406	6,496,200
バルス	97	87,000	8,439,000
あみやき亭	36	274,200	9,871,200
東京エレクトロンデバイス	42	185,100	7,774,200
ひらまつ	42	105,000	4,410,000
双日	1,382,800	183	253,052,400
アルフレッサホールディングス	54,100	3,210	173,661,000
ハニーズ	18,200	1,073	19,528,600
キッコーマン	192,000	895	171,840,000
味の素	637,000	937	596,869,000
キューピー	121,400	1,038	126,013,200
ハウス食品	83,500	1,382	115,397,000
カゴメ	84,400	1,526	128,794,400
焼津水産化工	11,600	882	10,231,200
アリアケジャパン	19,600	1,425	27,930,000
ニチレイ	264,000	387	102,168,000
横浜冷凍	45,400	585	26,559,000
東洋水産	101,000	1,855	187,355,000
日清食品HD	84,000	2,939	246,876,000
永谷園	2,000	873	1,746,000
フジッコ	26,000	1,031	26,806,000
ロックフィールド	11,800	1,340	15,812,000
日本たばこ産業	4,870	337,500	1,643,625,000
わらべや日洋	13,200	1,051	13,873,200
なとり	12,200	857	10,455,400

片倉工業	25,300	843	21,327,900
ゲンゼ	150,000	341	51,150,000
昭栄	37,700	724	27,294,800
神栄	27,000	159	4,293,000
川島織物セルコン	81,000	76	6,156,000
山下医科器械	1,900	1,150	2,185,000
ラサ商事	9,700	392	3,802,400
アルペン	13,100	1,580	20,698,000
アルコニックス	3,400	2,350	7,990,000
ビックカメラ	502	33,900	17,017,800
D C Mホールディングス	98,500	493	48,560,500
MonotaRO	4,100	970	3,977,000
あいホールディングス	37,200	349	12,982,800
ユニバース	3,300	1,258	4,151,400
J. フロントリテイリング	488,000	423	206,424,000
ドトール・日レスHD	36,400	1,091	39,712,400
マツモトキヨシHLDGS	38,300	1,836	70,318,800
ココカラファイン	20,000	1,848	36,960,000
三越伊勢丹HD	410,200	979	401,585,800
東洋紡績	779,000	134	104,386,000
ユニチカ	493,000	78	38,454,000
富士紡ホールディングス	98,000	163	15,974,000
日清紡ホールディングス	139,000	890	123,710,000
倉敷紡績	209,000	159	33,231,000
ダイワボウHD	191,000	195	37,245,000
シキボウ	134,000	109	14,606,000
日東紡績	178,000	241	42,898,000
トヨタ紡織	73,100	1,348	98,538,800
クリエイトSDH	7,500	1,904	14,280,000
バイタルKSKHD	39,100	691	27,018,100
UKCホールディングス	12,300	1,185	14,575,500
CHIグループ	12,100	296	3,581,600
日本毛織	75,000	726	54,450,000
大東紡織	35,000	79	2,765,000
トーア紡コーポレーション	77,000	73	5,621,000
ダイドーリミテッド	27,200	788	21,433,600
東京建物不動産販	6,000	321	1,926,000
野村不動産HLDGS	86,500	1,630	140,995,000
ヒューリック	58,500	747	43,699,500
帝国繊維	23,000	508	11,684,000
ブックオフコーポレーション	12,700	713	9,055,100
日本コークス工業	177,000	157	27,789,000
ミタチ産業	3,800	440	1,672,000
JFE商事HLDGS	139,000	395	54,905,000
あさひ	8,600	1,298	11,162,800
サークルKサンクス	44,900	1,383	62,096,700
日本調剤	2,660	3,265	8,684,900
コスモス薬品	9,400	3,415	32,101,000
シップヘルスケアHD	27,000	1,037	27,999,000
セブン&アイ・HLDGS	863,300	2,278	1,966,597,400
ツルハホールディングス	18,500	4,060	75,110,000
サンマルクホールディングス	6,700	3,680	24,656,000
フェリシモ	5,900	1,036	6,112,400
トリドール	77	112,500	8,662,500
帝人	831,000	387	321,597,000
東レ	1,695,000	600	1,017,000,000
クラレ	323,300	1,144	369,855,200
旭化成	1,275,000	556	708,900,000
サカイオーベックス	63,000	131	8,253,000

稲葉製作所	10,600	845	8,957,000
宮地エンジニアリングG	71,000	91	6,461,000
三協・立山HLDGS	263,000	111	29,193,000
トーカロ	11,300	1,473	16,644,900
アルファCO	6,800	1,016	6,908,800
SUMCO	134,000	1,514	202,876,000
川田テクノロジーズ	5,100	1,501	7,655,100
住江織物	57,000	216	12,312,000
日本フェルト	13,000	431	5,603,000
イチカワ	14,000	174	2,436,000
日本バイリン	24,000	433	10,392,000
エコナックホールディングス	70,000	36	2,520,000
日東製網	27,000	95	2,565,000
芦森工業	53,000	135	7,155,000
アツギ	189,000	110	20,790,000
ダイニック	42,000	184	7,728,000
共和レザー	13,400	324	4,341,600
セーレン	54,600	608	33,196,800
東海染工	31,000	87	2,697,000
小松精練	37,000	370	13,690,000
ワコールホールディングス	130,000	1,112	144,560,000
ホギメディカル	11,700	3,865	45,220,500
サンエー・インターナショナル	9,300	1,015	9,439,500
レナウン	42,400	210	8,904,000
クラウディア	2,400	1,250	3,000,000
ITホールディングス	68,400	909	62,175,600
グリー	66,600	1,312	87,379,200
コーエーテクモHD	41,000	674	27,634,000
三菱総合研究所	8,000	1,801	14,408,000
特種東海製紙	139,000	191	26,549,000
ダウンゴ	104	223,200	23,212,800
ベリサーブ	13	122,100	1,587,300
マクロミル	20,800	1,158	24,086,400
ティーガイア	167	159,600	26,653,200
GMOペイメントゲートウェイ	45	251,200	11,304,000
ザッパラス	115	128,700	14,800,500
インターネットイニシアティブ	121	261,500	31,641,500
ソネットエンタテインメント	117	289,900	33,918,300
SRAホールディングス	11,000	905	9,955,000
JBISホールディングス	22,200	324	7,192,800
朝日ネット	18,000	359	6,462,000
王子製紙	967,000	408	394,536,000
三菱製紙	313,000	101	31,613,000
北越紀州製紙	136,500	471	64,291,500
中越パルプ	85,000	154	13,090,000
巴川製紙	37,000	274	10,138,000
大王製紙	92,000	599	55,108,000
日本製紙G本社	105,600	2,261	238,761,600
レンゴー	176,000	534	93,984,000
トーモク	70,000	255	17,850,000
ザ・パック	15,600	1,391	21,699,600
コ-プケミカル	34,000	119	4,046,000
昭和電工	1,458,000	176	256,608,000
住友化学	1,505,000	435	654,675,000
日本化成	42,000	205	8,610,000
住友精化	46,000	400	18,400,000
日産化学	158,400	951	150,638,400
ラサ工業	83,000	155	12,865,000
クレハ	142,000	442	62,764,000

テイカ	37,000	329	12,173,000
石原産業	368,000	106	39,008,000
片倉チツカリン	13,000	262	3,406,000
日本曹達	131,000	419	54,889,000
東ソー	547,000	286	156,442,000
トクヤマ	341,000	426	145,266,000
セントラル硝子	210,000	362	76,020,000
東亜合成	223,000	404	90,092,000
ダイソー	88,000	280	24,640,000
関東電化	49,000	683	33,467,000
電気化学	460,000	424	195,040,000
イビデン	127,300	2,725	346,892,500
信越化学	364,700	4,640	1,692,208,000
日本カ - バイド	53,000	243	12,879,000
堺化学	69,000	458	31,602,000
エア・ウォーター	177,000	1,070	189,390,000
大陽日酸	288,000	720	207,360,000
日本化学工業	82,000	215	17,630,000
日本パ - カライジング	52,000	1,264	65,728,000
高压ガス	33,000	516	17,028,000
チタン工業	26,000	495	12,870,000
四国化成	32,000	509	16,288,000
戸田工業	32,000	807	25,824,000
ステラ ケミファ	9,600	3,580	34,368,000
保土谷化学	50,000	349	17,450,000
日本触媒	179,000	945	169,155,000
大日精化	79,000	464	36,656,000
カネカ	273,000	592	161,616,000
協和発酵キリン	263,000	828	217,764,000
三菱瓦斯化学	345,000	625	215,625,000
三井化学	996,000	298	296,808,000
J S R	182,800	1,717	313,867,600
東京応化工業	39,300	1,770	69,561,000
三菱ケミカルH L D G S	1,271,500	591	751,456,500
日本合成化学	51,000	560	28,560,000
ダイセル化学	284,000	553	157,052,000
住友ベ - クライト	205,000	535	109,675,000
積水化学	456,000	640	291,840,000
日本ゼオン	204,000	828	168,912,000
アイカ工業	63,900	1,093	69,842,700
宇部興産	918,000	260	238,680,000
積水樹脂	32,000	801	25,632,000
タキロン	52,000	329	17,108,000
旭有機材	78,000	231	18,018,000
日立化成	94,700	1,849	175,100,300
ニチバン	22,000	301	6,622,000
リケンテクノス	39,000	294	11,466,000
大倉工業	53,000	266	14,098,000
積水化成品	50,000	355	17,750,000
群栄化学	60,000	245	14,700,000
タイガース ポリマー	11,100	381	4,229,100
日本カ - リット	18,000	492	8,856,000
日本化薬	154,000	846	130,284,000
イーピーエス	119	190,200	22,633,800
パナソニック電工 I S	4,200	2,130	8,946,000
フェイス	713	11,440	8,156,720
アミューズ	6,700	983	6,586,100
野村総合研究所	116,800	1,904	222,387,200
ドリームインキュベータ	64	71,800	4,595,200

サイバネットシステム	173	23,460	4,058,580
T A C	13,600	342	4,651,200
ケネディクス	2,466	21,660	53,413,560
電通	198,800	2,558	508,530,400
インテージ	6,300	1,835	11,560,500
テイクアンドグヴィニーズ	1,106	8,180	9,047,080
びあ	6,700	896	6,003,200
シンプレクスホールディング	347	37,850	13,133,950
イオンファンタジー	7,300	1,065	7,774,500
ソースネクスト	43	21,620	929,660
ネクシィーズ	952	2,931	2,790,312
メディカルシステムネットワーク	3,100	691	2,142,100
日本精化	18,600	540	10,044,000
A D E K A	87,800	897	78,756,600
日油	192,000	409	78,528,000
ミヨシ油脂	77,000	133	10,241,000
ハリマ化成	9,000	612	5,508,000
花 王	596,200	2,196	1,309,255,200
第一工業製薬	37,000	306	11,322,000
三洋化成	62,000	670	41,540,000
武田薬品	820,500	4,015	3,294,307,500
アステラス製薬	486,300	3,210	1,561,023,000
大日本住友製薬	155,500	793	123,311,500
塩野義製薬	319,400	1,537	490,917,800
田辺三菱製薬	182,600	1,388	253,448,800
わかもと製薬	4,000	253	1,012,000
あすか製薬	27,000	687	18,549,000
日本新薬	51,000	1,073	54,723,000
中外製薬	218,200	1,582	345,192,400
科研製薬	93,000	1,039	96,627,000
エーザイ	269,700	3,020	814,494,000
ロート製薬	100,000	972	97,200,000
小野薬品	109,900	4,210	462,679,000
久光製薬	61,900	3,270	202,413,000
有機合成薬品	17,000	238	4,046,000
持田製薬	88,000	960	84,480,000
大正製薬	176,000	1,776	312,576,000
参天製薬	67,900	3,080	209,132,000
扶桑薬品	75,000	242	18,150,000
日本ケミファ	34,000	274	9,316,000
ツムラ	59,900	2,639	158,076,100
日医工	21,500	2,289	49,213,500
テルモ	164,400	4,405	724,182,000
みらかホールディングス	53,200	3,155	167,846,000
キッセイ薬品工業	44,600	1,621	72,296,600
生化学工業	42,500	930	39,525,000
栄研化学	17,200	1,036	17,819,200
日水製薬	9,900	721	7,137,900
鳥居薬品	15,200	1,752	26,630,400
東和薬品	11,200	4,460	49,952,000
沢井製薬	14,400	7,460	107,424,000
ゼリア新薬工業	32,000	1,000	32,000,000
第一三共	736,700	1,762	1,298,065,400
キョーリン製薬H D	59,000	1,480	87,320,000
大幸薬品	7,700	1,003	7,723,100
大塚ホールディングス	380,300	2,025	770,107,500
大日本塗料	127,000	117	14,859,000
日本ペイント	190,000	597	113,430,000
関西ペイント	248,000	782	193,936,000

トウベ	21,000	85	1,785,000
中国塗料	59,000	707	41,713,000
日本特殊塗料	17,300	403	6,971,900
藤倉化成	28,000	615	17,220,000
太陽ホールディングス	16,200	2,706	43,837,200
D I C	836,000	215	179,740,000
サカタインクス	45,000	414	18,630,000
東洋インキ	197,000	414	81,558,000
アルプス技研	10,100	690	6,969,000
サニックス	32,600	187	6,096,200
ダイオーズ	1,400	495	693,000
日本空調サービス	6,300	756	4,762,800
オリエンタルランド	59,100	8,100	478,710,000
ダスキン	61,400	1,631	100,143,400
パーク24	97,200	900	87,480,000
明光ネットワークジャパン	17,000	720	12,240,000
ファルコSDホールディングス	11,300	768	8,678,400
クレスコ	5,400	628	3,391,200
フジ・メディア・HD	2,151	136,800	294,256,800
秀英予備校	4,100	368	1,508,800
田谷	900	686	617,400
ラウンドワン	56,000	520	29,120,000
リゾートトラスト	33,600	1,325	44,520,000
オービック	7,110	16,370	116,390,700
ティーディーシーソフトウェア	4,800	750	3,600,000
ヤフー	15,112	30,700	463,938,400
ビー・エム・エル	13,000	2,327	30,251,000
ワタベウェディング	6,800	891	6,058,800
トレンドマイクロ	91,100	2,577	234,764,700
もしもしホットライン	13,750	1,800	24,750,000
東急コミュニティー	5,800	2,528	14,662,400
リソー教育	2,264	4,980	11,274,720
日本オラクル	32,900	3,830	126,007,000
アルファシステムズ	5,700	1,422	8,105,400
フューチャーアーキテクト	250	39,350	9,837,500
ウェアハウス	5,500	291	1,600,500
シーエーシー	12,700	683	8,674,100
ソフトバンク・テクノ	5,200	726	3,775,200
トーセ	4,100	561	2,300,100
ユー・エス・エス	28,500	6,610	188,385,000
オービックビジネスC	5,250	5,260	27,615,000
日立ビジネスソリューション	6,900	771	5,319,900
伊藤忠テクノソリューション	29,300	2,860	83,798,000
アイティフォー	23,300	288	6,710,400
東京個別指導学院	16,700	231	3,857,700
東計電算	3,900	1,130	4,407,000
カルチュア・コンビニエンス	113,700	596	67,765,200
エクスネット	18	136,000	2,448,000
テー・オー・ダブリュー	6,500	503	3,269,500
大塚商会	16,400	5,720	93,808,000
総合メディカル	4,500	2,398	10,791,000
サイボウズ	276	23,150	6,389,400
ソフトブレーン	307	14,500	4,451,500
アグレックス	5,200	831	4,321,200
セントラルスポーツ	7,300	997	7,278,100
電通国際情報S	12,900	631	8,139,900
ウェザーニューズ	4,800	1,760	8,448,000
C I J	20,700	278	5,754,600
フルキャストホールディングス	209	34,100	7,126,900

富士フィルムHLDGS	467,800	2,856	1,336,036,800	
-------------	---------	-------	---------------	--

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年2月25日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
コニカミノルタHLDGS	552,500	757	418,242,500	
資生堂	363,500	1,666	605,591,000	
ライオン	253,000	435	110,055,000	
高砂香料	72,000	480	34,560,000	
マンダム	22,000	2,190	48,180,000	
ミルボン	11,800	2,231	26,325,800	
ファンケル	42,400	1,194	50,625,600	
コーセー	39,300	2,206	86,695,800	
ドクターシーラボ	147	309,000	45,423,000	
ポーラ・オルビスHD	19,600	1,836	35,985,600	
エステー	10,600	959	10,165,400	
コニシ	17,300	1,127	19,497,100	
長谷川香料	27,900	1,328	37,051,200	
小林製薬	30,300	3,955	119,836,500	
荒川化学工業	17,200	847	14,568,400	
メック	14,600	439	6,409,400	
日本高純度化学	63	256,800	16,178,400	
荏原ユーザライト	3,100	2,513	7,790,300	
アース製薬	15,800	2,738	43,260,400	
イハラケミカル	41,000	298	12,218,000	
北興化学	11,000	295	3,245,000	
大成ラミック	6,300	2,416	15,220,800	
クミアイ化学	46,000	293	13,478,000	
日本農薬	46,000	445	20,470,000	
昭和シェル石油	195,700	733	143,448,100	
コスモ石油	605,000	295	178,475,000	
富士興産	81,000	95	7,695,000	
ニチレキ	28,000	334	9,352,000	
東燃ゼネラル石油	330,000	962	317,460,000	
ユシロ化学	11,000	1,260	13,860,000	
ビーピー・カストロール	9,800	354	3,469,200	
AOCホールディングス	55,900	548	30,633,200	
出光興産	26,000	9,630	250,380,000	
JXホールディングス	2,430,200	572	1,390,074,400	
横浜ゴム	245,000	422	103,390,000	
東洋ゴム	182,000	219	39,858,000	
ブリヂストン	686,200	1,646	1,129,485,200	
住友ゴム	153,600	875	134,400,000	
藤倉ゴム	14,100	399	5,625,900	
オカモト	84,000	323	27,132,000	
アキレス	178,000	122	21,716,000	
フコク	9,300	899	8,360,700	
ニッタ	19,700	1,534	30,219,800	
クリエートメディック	7,000	841	5,887,000	
東海ゴム工業	33,700	1,105	37,238,500	
三ツ星ベルト	57,000	477	27,189,000	
バンドー化学	79,000	381	30,099,000	
鬼怒川ゴム	53,000	493	26,129,000	
旭硝子	1,079,000	1,112	1,199,848,000	
日本板硝子	940,000	227	213,380,000	
石塚硝子	29,000	164	4,756,000	
有沢製作所	34,200	474	16,210,800	
日本山村硝子	95,000	237	22,515,000	
日本電気硝子	452,000	1,353	611,556,000	
オハラ	8,400	1,056	8,870,400	

住友大阪セメント	417,000	213	88,821,000
太平洋セメント	927,000	123	114,021,000
デイ・シイ	23,700	160	3,792,000
リゾートソリューション	21,000	163	3,423,000
日本ヒュ-ム	19,000	297	5,643,000
日本コンクリ-ト	37,000	177	6,549,000
東海カーボン	205,000	475	97,375,000
日本カーボン	108,000	251	27,108,000
東洋炭素	12,100	4,520	54,692,000
ノリタケ	114,000	351	40,014,000
TOTO	314,000	670	210,380,000
日本碍子	263,000	1,481	389,503,000
日本特殊陶業	194,000	1,207	234,158,000
ダントーホールディングス	35,000	109	3,815,000
MARUWA	5,100	2,761	14,081,100
品川リフラクトリーズ	56,000	303	16,968,000
黒崎播磨	48,000	359	17,232,000
東京窯業	13,000	209	2,717,000
ニッカトー	8,400	440	3,696,000
フジミインコーポレーテッド	20,100	1,245	25,024,500
エーアンドエ-マテリアル	48,000	55	2,640,000
ニチアス	106,000	498	52,788,000
新日本製鐵	5,745,000	292	1,677,540,000
住友金属工業	4,056,000	207	839,592,000
神戸製鋼所	3,033,000	220	667,260,000
日新製鋼	839,000	180	151,020,000
中山製鋼所	112,000	110	12,320,000
合同製鐵	123,000	168	20,664,000
JFEホールディングス	518,500	2,571	1,333,063,500
東京製鐵	120,800	890	107,512,000
共英製鋼	23,400	1,325	31,005,000
大和工業	50,000	2,613	130,650,000
東京鐵鋼	46,000	258	11,868,000
大阪製鐵	13,700	1,412	19,344,400
淀川製鋼所	168,000	359	60,312,000
東洋鋼鋳	52,000	485	25,220,000
住友鋼管	15,000	697	10,455,000
丸一鋼管	73,200	1,880	137,616,000
モリ工業	36,000	423	15,228,000
大同特殊鋼	367,000	540	198,180,000
日本高周波	87,000	110	9,570,000
日本金属工業	161,000	104	16,744,000
日本冶金工	113,000	229	25,877,000
山陽特殊鋼	109,000	530	57,770,000
愛知製鋼	116,000	580	67,280,000
日立金属	143,000	1,102	157,586,000
日本金属	57,000	167	9,519,000
大平洋金属	153,000	756	115,668,000
日本電工	86,000	586	50,396,000
栗本鉄工所	114,000	138	15,732,000
旭テック	160,000	33	5,280,000
日本鑄鉄管	25,000	128	3,200,000
日本製鋼所	338,000	842	284,596,000
三菱製鋼	132,000	302	39,864,000
日亜鋼業	31,000	226	7,006,000
日本精線	17,000	500	8,500,000
日本軽金属	496,000	167	82,832,000
大紀アルミニウム	34,000	273	9,282,000
三井金属	632,000	314	198,448,000

東邦亜鉛	124,000	441	54,684,000
三菱マテリアル	1,366,000	306	417,996,000
住友鉱山	604,000	1,500	906,000,000
DOWAホールディングス	262,000	567	148,554,000
古河機金	369,000	95	35,055,000
大阪チタニウム	23,900	6,000	143,400,000
東邦チタニウム	35,600	2,530	90,068,000
住友軽金属	364,000	105	38,220,000
古河スカイ	89,000	256	22,784,000
古河電工	688,000	347	238,736,000
住友電工	773,200	1,200	927,840,000
フジクラ	328,000	400	131,200,000
昭和電線HLDGS	265,000	92	24,380,000
東京特殊電線	33,000	82	2,706,000
タツタ電線	42,000	357	14,994,000
日立電線	171,000	232	39,672,000
沖電線	25,000	158	3,950,000
カナレ電気	2,600	1,227	3,190,200
平河ビューテック	4,400	732	3,220,800
リョービ	122,000	350	42,700,000
アサヒHD	30,700	1,797	55,167,900
東洋製罐	154,700	1,495	231,276,500
ホッカンホールディングス	53,000	289	15,317,000
コロナ	10,100	871	8,797,100
横河ブリッジHLDGS	39,000	524	20,436,000
日本橋梁	9,150	180	1,647,000
駒井ハルテック	44,000	216	9,504,000
サクラダ	205,000	16	3,280,000
高田機工	20,000	203	4,060,000
三和ホールディングス	219,000	285	62,415,000
文化シャツタ-	57,000	231	13,167,000
東洋シャツタ-	4,800	350	1,680,000
住生活グループ	264,300	1,925	508,777,500
日本フィルコン	16,100	419	6,745,900
ノーリツ	39,800	1,372	54,605,600
長府製作所	21,200	1,865	39,538,000
リンナイ	35,300	4,930	174,029,000
ユニプレス	26,800	1,970	52,796,000
ダイニチ工業	11,400	588	6,703,200
日東精工	32,000	259	8,288,000
三洋工業	30,000	106	3,180,000
岡部	47,300	437	20,670,100
日立ツール	12,600	935	11,781,000
中国工業	36,000	92	3,312,000
東プレ	42,200	699	29,497,800
高周波熱錬	29,400	785	23,079,000
東京製綱	150,000	273	40,950,000
パイオラックス	9,400	2,160	20,304,000
日本発条	158,000	941	148,678,000
中央発條	28,000	344	9,632,000
アドバネクス	43,000	94	4,042,000
三浦工業	35,200	2,251	79,235,200
タクマ	80,000	256	20,480,000
ツガミ	62,000	595	36,890,000
オークマ	143,000	733	104,819,000
東芝機械	130,000	478	62,140,000
アマダ	309,000	708	218,772,000
アイダエンジニア	56,800	420	23,856,000
牧野フライス	101,000	731	73,831,000

オーエスジー	96,400	1,151	110,956,400
ダイジェット	22,000	127	2,794,000
旭ダイヤモンド	46,000	1,519	69,874,000
森精機製作所	115,400	1,019	117,592,600
ディスコ	22,100	5,650	124,865,000
日東工器	12,800	2,076	26,572,800
豊田自動織機	190,300	2,792	531,317,600
豊和工業	115,000	106	12,190,000
大阪機工	75,000	124	9,300,000
石川製作所	48,000	83	3,984,000
東洋機械金属	17,900	286	5,119,400
オ・エム製作所	20,000	537	10,740,000
津田駒工業	53,000	236	12,508,000
エンシュウ	50,000	116	5,800,000
島精機製作所	28,500	1,945	55,432,500
日阪製作所	28,000	1,115	31,220,000
やまびこ	8,700	1,052	9,152,400
ペガサスミシン製造	21,900	265	5,803,500
ナプテスコ	82,600	1,884	155,618,400
三井海洋開発	18,100	1,481	26,806,100
レオン自動機	21,000	209	4,389,000
S M C	65,300	13,700	894,610,000
新川	15,700	890	13,973,000
ホソカワミクロン	37,000	385	14,245,000
ユニオンツール	13,500	1,996	26,946,000
オイレス工業	22,100	1,646	36,376,600
サトー	21,200	1,091	23,129,200
日本エアーテック	6,800	416	2,828,800
日精樹脂工業	17,700	295	5,221,500
ワイエイシイ	9,500	690	6,555,000
小松製作所	1,037,600	2,422	2,513,067,200
住友重機械	559,000	558	311,922,000
日立建機	97,800	2,019	197,458,200
日工	18,000	291	5,238,000
巴工業	8,300	1,408	11,686,400
井関農機	224,000	214	47,936,000
T O W A	21,200	700	14,840,000
丸山製作所	50,000	183	9,150,000
北川鉄工所	101,000	158	15,958,000
シンニッタン	21,000	439	9,219,000
クボタ	918,000	827	759,186,000
荏原実業	5,400	1,196	6,458,400
東洋エンジニア	138,000	310	42,780,000
三菱化工機	67,000	188	12,596,000
月島機械	36,000	767	27,612,000
帝国電機製作所	7,400	1,799	13,312,600
東京機械	66,000	76	5,016,000
新東工業	44,100	882	38,896,200
渋谷工業	12,500	830	10,375,000
アイチ コーポレーション	36,600	343	12,553,800
小森コーポレーション	57,700	859	49,564,300
鶴見製作所	14,000	600	8,400,000
住友精密	38,000	599	22,762,000
酒井重工業	43,000	162	6,966,000
荏原製作所	384,000	468	179,712,000
石井鉄工所	33,000	166	5,478,000
西島製作所	25,300	1,498	37,899,400
千代田化工建	152,000	721	109,592,000
ダイキン工業	228,400	2,758	629,927,200

オルガノ	38,000	604	22,952,000
ト - ヨ - カネツ	118,000	145	17,110,000
栗田工業	120,700	2,317	279,661,900
椿本チエイン	112,000	489	54,768,000
大同工業	43,000	195	8,385,000
日本コンベヤ	70,000	82	5,740,000
日 機 装	73,000	689	50,297,000
木村化工機	20,200	603	12,180,600
新興プランテック	45,100	851	38,380,100
アネスト岩田	39,000	386	15,054,000
ダイフク	88,500	641	56,728,500
加藤製作所	51,000	213	10,863,000
油研工業	39,000	169	6,591,000
タダノ	93,000	442	41,106,000
フジテック	61,000	422	25,742,000
シーケーディ	58,600	870	50,982,000
キトー	62	89,400	5,542,800
平和	45,400	1,440	65,376,000
理想科学工業	16,500	1,430	23,595,000
SANKYO	63,300	4,640	293,712,000
日本金銭機械	19,500	730	14,235,000
マースエンジニアリング	10,400	1,532	15,932,800
福島工業	6,700	997	6,679,900
オーイズミ	7,800	355	2,769,000
ダイコク電機	8,800	1,022	8,993,600
ア マ ノ	58,500	773	45,220,500
JUKI	126,000	180	22,680,000
サンデン	119,000	371	44,149,000
蛇の目ミシン	204,000	82	16,728,000
ブラザー工業	270,500	1,267	342,723,500
マックス	36,000	1,070	38,520,000
モリタホールディングス	37,000	497	18,389,000
グローリー	58,100	1,975	114,747,500
大和冷機工業	30,000	403	12,090,000
セガサミーホールディングス	207,400	1,825	378,505,000
日本ピストンリング	82,000	225	18,450,000
リ ケ ン	83,000	399	33,117,000
帝国ピストン	25,500	873	22,261,500
ホシザキ電機	42,200	1,461	61,654,200
大豊工業	14,800	843	12,476,400
日本精工	465,000	769	357,585,000
N T N	484,000	429	207,636,000
ジェイテクト	222,200	1,165	258,863,000
不 二 越	210,000	433	90,930,000
ミネベア	311,000	486	151,146,000
日本トムソン	72,000	665	47,880,000
T H K	139,100	2,086	290,162,600
ユーシン精機	10,500	1,680	17,640,000
前澤給装工業	8,300	1,070	8,881,000
イーグル工業	26,000	987	25,662,000
前澤工業	14,700	226	3,322,200
日本ピラ - 工業	23,000	783	18,009,000
キッツ	86,000	371	31,906,000
日 立	4,694,000	482	2,262,508,000
東 芝	4,127,000	529	2,183,183,000
三菱電機	2,091,000	939	1,963,449,000
富士電機HLDGS	630,000	271	170,730,000
東洋電機製造	35,000	467	16,345,000
安川電機	229,000	922	211,138,000

シンフォニア テクノロジー	126,000	261	32,886,000
明電舎	207,000	366	75,762,000
オリジン電気	28,000	540	15,120,000
デンヨー	19,900	718	14,288,200
日立工機	55,900	836	46,732,400
三桜工業	24,300	807	19,610,100
マキタ	136,300	3,350	456,605,000
東芝テック	132,000	381	50,292,000
芝浦メカトロニクス	37,000	310	11,470,000
マブチモーター	29,900	4,080	121,992,000
日本電産	103,600	7,580	785,288,000
高岳製作所	83,000	449	37,267,000
ダイヘン	115,000	359	41,285,000
JVCケンウッドHD	80,600	442	35,625,200
日新電機	35,000	567	19,845,000
大崎電気	30,000	758	22,740,000
オムロン	232,800	2,238	521,006,400
日東工業	31,600	957	30,241,200
I D E C	25,000	791	19,775,000
エルピーダメモリ	184,600	1,216	224,473,600
ジーエス・ユアサ コーポ	403,000	581	234,143,000
サクサホールディングス	53,000	156	8,268,000
メルコホールディングス	11,600	3,110	36,076,000
テクノメディカ	13	295,300	3,838,900
日本電気	2,705,000	233	630,265,000
富士通	2,016,000	554	1,116,864,000
沖電気	760,000	70	53,200,000
岩崎通信機	95,000	68	6,460,000
電気興業	64,000	381	24,384,000
サンケン電気	122,000	523	63,806,000
ナカヨ通信機	18,000	208	3,744,000
アイホン	13,700	1,330	18,221,000
ルネサスエレクトロニクス	54,300	915	49,684,500
セイコーエプソン	142,800	1,354	193,351,200
ワコム	411	121,100	49,772,100
アルバック	38,500	1,912	73,612,000
アクセル	7,300	2,270	16,571,000
ピクセラ	8,900	277	2,465,300
ナナオ	17,700	1,979	35,028,300
日本信号	48,800	634	30,939,200
京三製作所	45,000	445	20,025,000
能美防災	28,000	539	15,092,000
ホーチキ	19,000	433	8,227,000
マスプロ電工	14,800	810	11,988,000
日本無線	63,000	234	14,742,000
パナソニック	2,070,800	1,096	2,269,596,800
シャープ	938,000	885	830,130,000
アンリツ	92,000	744	68,448,000
富士通ゼネラル	50,000	460	23,000,000
日立国際電気	48,000	779	37,392,000
ソニー	1,174,200	2,967	3,483,851,400
T D K	117,800	5,460	643,188,000
帝国通信工業	51,000	198	10,098,000
三洋電機	1,599,000	124	198,276,000
宮越商事	6,400	317	2,028,800
ミツミ電機	74,000	1,362	100,788,000
タムラ製作所	64,000	251	16,064,000
アルプス電気	165,200	1,071	176,929,200
池上通信機	68,000	61	4,148,000

バイオニア	296,900	420	124,698,000
日本電波工業	16,200	1,510	24,462,000
日本トリム	2,450	1,796	4,400,200
ローランド ディー . ジー .	9,300	1,240	11,532,000
日本コロムビア	172,000	43	7,396,000
山水電気	1,355,000	3	4,065,000
フオスタ - 電機	19,900	2,217	44,118,300
クラリオン	111,000	174	19,314,000
S M K	62,000	447	27,714,000
ヨコオ	17,800	656	11,676,800
東 光	89,000	193	17,177,000
ティアック	120,000	45	5,400,000
ホシデン	52,000	945	49,140,000
ヒロセ電機	33,800	9,140	308,932,000
日本航空電子	48,000	669	32,112,000
T O A	26,000	490	12,740,000
ユニデン	62,000	286	17,732,000
アルパイン	41,000	1,171	48,011,000
スミダコーポレーション	13,000	905	11,765,000
アイコム	11,600	2,213	25,670,800
船井電機	18,800	2,650	49,820,000
横河電機	209,600	627	131,419,200
新電元工業	74,000	429	31,746,000
山武	58,500	2,079	121,621,500
日本光電工業	38,800	1,763	68,404,400
チ ノ ー	42,000	214	8,988,000
共和電業	3,000	256	768,000
日本電子材料	9,100	578	5,259,800
堀場製作所	36,000	2,520	90,720,000
アドバンテスト	142,500	1,695	241,537,500
小野測器	23,000	272	6,256,000
エスベック	21,900	691	15,132,900
パナソニック電工 S U N X	18,800	467	8,779,600
キーエンス	46,700	21,850	1,020,395,000
日置電機	10,200	1,670	17,034,000
シスメックス	36,800	5,290	194,672,000
メガチップス	18,800	1,768	33,238,400
O B A R A	14,900	1,041	15,510,900
日本電産コパル電子	21,800	651	14,191,800
ミヤチテクノス	10,300	749	7,714,700
東京電波	6,300	643	4,050,900
澤藤電機	13,000	277	3,601,000
デンソー	459,200	3,015	1,384,488,000
コーセル	28,900	1,293	37,367,700
日立メディコ	16,000	887	14,192,000
新日本無線	16,000	296	4,736,000
オプテックス	14,500	1,170	16,965,000
千代田インテグレ	8,300	1,248	10,358,400
東光電気	13,000	529	6,877,000
スタンレー電気	141,200	1,505	212,506,000
岩崎電気	77,000	162	12,474,000
ウシオ電機	126,900	1,653	209,765,700
岡谷電機	11,700	509	5,955,300
ヘリオステクノH	19,500	242	4,719,000
日本セラミック	13,700	1,651	22,618,700
新神戸電機	17,000	987	16,779,000
日本デジタル研究所	17,700	959	16,974,300
古河電池	15,000	556	8,340,000
双信電機	10,300	530	5,459,000

山一電機	21,400	309	6,612,600	
函 研	14,700	650	9,555,000	
日本電子	78,000	262	20,436,000	
カ シ オ	199,700	694	138,591,800	
ファナック	217,700	12,220	2,660,294,000	
日本シイエムケイ	41,000	410	16,810,000	
エンプラス	10,500	1,210	12,705,000	
ロ ー ム	104,800	5,630	590,024,000	
浜松ホトニクス	81,600	3,070	250,512,000	
三井ハイテック	25,000	475	11,875,000	
新光電気工業	52,700	957	50,433,900	
京 セ ラ	173,900	8,420	1,464,238,000	
協栄産業	23,000	176	4,048,000	
太陽誘電	94,000	1,301	122,294,000	
村田製作所	219,400	5,920	1,298,848,000	
ユーシン	25,000	716	17,900,000	
双葉電子工業	35,800	1,616	57,852,800	
日東電工	180,500	4,785	863,692,500	
北陸電気工業	85,000	189	16,065,000	
パナソニック電工	195,000	1,003	195,585,000	
東海理化電機	48,900	1,577	77,115,300	
ニチコン	65,900	1,142	75,257,800	
日本ケミコン	130,000	542	70,460,000	
K O A	26,300	988	25,984,400	
三井造船	810,000	220	178,200,000	
日立造船	879,000	124	108,996,000	
佐世保重工業	137,000	189	25,893,000	
三菱重工業	3,505,000	342	1,198,710,000	
川崎重工業	1,627,000	319	519,013,000	
I H I	1,429,000	211	301,519,000	
日本車輜	76,000	418	31,768,000	
日本輸送機	25,000	220	5,500,000	
近畿車輜	32,000	417	13,344,000	
日産自動車	2,641,700	838	2,213,744,600	
いすゞ自動車	1,212,000	358	433,896,000	
トヨタ自動車	2,686,700	3,755	10,088,558,500	*
日野自動車	261,000	453	118,233,000	
三菱自動車工業	4,315,000	115	496,225,000	
エフテック	7,300	1,686	12,307,800	
武蔵精密工業	20,300	2,143	43,502,900	
トヨタ車体	38,000	1,498	56,924,000	
日産車体	82,000	679	55,678,000	
関東自動車	31,800	676	21,496,800	
新明和工業	94,000	356	33,464,000	
極東開発工業	39,300	382	15,012,600	
日信工業	42,500	1,498	63,665,000	
トピー工業	172,000	228	39,216,000	
ティラド	68,000	391	26,588,000	
曙ブレーキ	97,100	490	47,579,000	
タチエス	27,300	1,602	43,734,600	
N O K	101,100	1,609	162,669,900	
フタバ産業	59,200	583	34,513,600	
カヤバ工業	130,000	677	88,010,000	
シロキ工業	46,000	329	15,134,000	
市光工業	50,000	242	12,100,000	
大同メタル工業	32,000	823	26,336,000	
プレス工業	97,000	385	37,345,000	
カルソニックカンセイ	107,000	392	41,944,000	
太平洋工業	43,000	486	20,898,000	

ケーヒン	43,200	1,790	77,328,000
河西工業	26,000	557	14,482,000
アイシン精機	172,200	3,100	533,820,000
富士機工	24,000	403	9,672,000
マツダ	1,618,000	206	333,308,000
ダイハツ	222,000	1,296	287,712,000
愛知機械	47,000	353	16,591,000
今仙電機製作所	14,200	1,323	18,786,600
本田技研	1,764,300	3,540	6,245,622,000
スズキ	437,100	1,893	827,430,300
富士重工業	661,000	696	460,056,000
ヤマハ発動機	317,900	1,404	446,331,600
ショーワ	44,500	677	30,126,500
小糸製作所	104,000	1,454	151,216,000
T B K	21,000	552	11,592,000
エクセディ	25,300	2,644	66,893,200
ミツバ	39,000	723	28,197,000
豊田合成	59,100	1,903	112,467,300
愛三工業	25,300	961	24,313,300
ヨロズ	12,600	1,774	22,352,400
エフ・シー・シー	30,800	1,999	61,569,200
新家工業	50,000	132	6,600,000
シマノ	85,200	4,045	344,634,000
タカタ	32,400	2,483	80,449,200
テイ・エス テック	39,800	1,710	68,058,000
小野建	18,100	736	13,321,600
はるやま商事	9,900	491	4,860,900
佐鳥電機	14,500	601	8,714,500
カップクリエイト	15,200	1,830	27,816,000
エコートレーディング	5,400	816	4,406,400
伯東	12,700	897	11,391,900
中山福	12,400	618	7,663,200
ライトオン	15,600	482	7,519,200
ナガイレーベン	11,200	2,045	22,904,000
ジーンズメイト	6,700	318	2,130,600
菱食	20,100	1,867	37,526,700
良品計画	23,700	3,920	92,904,000
三城ホールディングス	25,600	805	20,608,000
松田産業	15,200	1,427	21,690,400
メディパルHD	190,600	788	150,192,800
アドヴァン	12,600	717	9,034,200
S P K	4,600	1,280	5,888,000
アズワン	13,600	1,860	25,296,000
スズデン	7,000	547	3,829,000
尾家産業	6,800	813	5,528,400
シモジマ	14,400	1,026	14,774,400
ドウシシャ	9,900	1,879	18,602,100
コナカ	24,400	478	11,663,200
高速	12,700	742	9,423,400
ハウス ローゼ	2,000	1,305	2,610,000
G - 7ホールディングス	5,500	496	2,728,000
イオン北海道	16,100	330	5,313,000
コジマ	25,200	569	14,338,800
コーナン商事	20,100	1,116	22,431,600
黒田電気	27,600	1,105	30,498,000
ネットワンシステムズ	502	129,900	65,209,800
エコス	7,400	436	3,226,400
ワタミ	24,400	1,712	41,772,800
マルシェ	5,900	721	4,253,900

ドン・キホーテ	39,900	2,885	115,111,500	
丸文	16,600	489	8,117,400	

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年2月25日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
メガネトップ	21,700	808	17,533,600	
西松屋チェーン	45,200	734	33,176,800	
ゼンショー	78,600	879	69,089,400	
ハピネット	5,600	1,123	6,288,800	
幸楽苑	12,900	1,248	16,099,200	
トーメンエレクトロニクス	8,500	1,306	11,101,000	
ハークスレイ	5,900	529	3,121,100	
サイゼリヤ	27,100	1,548	41,950,800	
エクセル	10,100	1,046	10,564,600	
マルカキカイ	6,800	644	4,379,200	
アルゴグラフィックス	7,700	1,150	8,855,000	
ガリバーインターナショナル	5,560	3,555	19,765,800	
日本エム・ディ・エム	18,000	241	4,338,000	
ポプラ	6,400	472	3,020,800	
ユナイテッドアローズ	19,500	1,386	27,027,000	
進和	11,300	981	11,085,300	
エスケイジャパン	5,500	283	1,556,500	
ダイトエレクトロン	8,900	602	5,357,800	
ハイデイ日高	9,200	1,327	12,208,400	
シークス	13,100	1,130	14,803,000	
京都きもの友禅	13,400	934	12,515,600	
コロワイド	68,500	504	34,524,000	
田中商事	7,400	328	2,427,200	
オーハシテクニカ	11,800	629	7,422,200	
壱番屋	7,700	2,392	18,418,400	
マクニカ	9,500	2,028	19,266,000	
白銅	6,900	962	6,637,800	
トップカルチャー	7,900	369	2,915,100	
スギホールディングス	33,000	1,971	65,043,000	
島津製作所	250,000	709	177,250,000	
J M S	32,000	299	9,568,000	
クボテック	47	49,500	2,326,500	
モリテックス	4,800	428	2,054,400	
長野計器	14,000	746	10,444,000	
スター精密	39,900	921	36,747,900	
東京計器	74,000	126	9,324,000	
愛知時計	7,000	242	1,694,000	
日本電産トーソク	12,700	825	10,477,500	
東京精密	40,200	1,588	63,837,600	
ニコン	364,400	1,890	688,716,000	
トプコン	48,400	438	21,199,200	
オリンパス	246,600	2,365	583,209,000	
理研計器	17,200	757	13,020,400	
大日本スクリーン	231,000	757	174,867,000	
キヤノン電子	19,300	2,411	46,532,300	
タムロン	20,300	1,725	35,017,500	
HOYA	480,200	1,936	929,667,200	
ノーリツ鋼機	19,300	535	10,325,500	
エー・アンド・デイ	20,700	332	6,872,400	
キヤノン	1,299,100	3,915	5,085,976,500	
リコー	629,000	1,087	683,723,000	
日本電産コパル	16,500	1,212	19,998,000	
日本電産サンキョー	50,000	662	33,100,000	
シチズンホールディングス	227,400	525	119,385,000	
リズム時計	104,000	143	14,872,000	

S R Iスポーツ	134	90,500	12,127,000
バンダイナムコH L D G S	243,500	929	226,211,500
共立印刷	20,600	135	2,781,000
フランスベッドH L D G S	141,000	113	15,933,000
パイロットコーポレーション	198	147,400	29,185,200
エイベックス・グループHD	39,300	1,190	46,767,000
トッパン・フォームズ	45,200	792	35,798,400
フジシールインターナショナル	21,500	1,759	37,818,500
タカラトミー	62,400	709	44,241,600
廣済堂	17,700	123	2,177,100
アーク	71,300	132	9,411,600
レック	5,900	1,475	8,702,500
アロン化成	16,000	494	7,904,000
タカノ	8,400	555	4,662,000
プロネクサス	23,700	436	10,333,200
ホクシン	17,300	105	1,816,500
ウッドワン	36,000	288	10,368,000
大建工業	86,000	249	21,414,000
きもと	19,800	757	14,988,600
凸版印刷	590,000	753	444,270,000
大日本印刷	637,000	1,098	699,426,000
図書印刷	35,000	146	5,110,000
共同印刷	66,000	191	12,606,000
日本写真印刷	38,100	2,078	79,171,800
光村印刷	3,000	288	864,000
藤森工業	15,800	1,315	20,777,000
宝印刷	9,200	676	6,219,200
前澤化成工業	15,900	786	12,497,400
アシックス	195,000	1,072	209,040,000
ツツミ	9,200	2,163	19,899,600
ジェイ エス ピー	14,300	1,486	21,249,800
ニチハ	22,000	793	17,446,000
ローランド	20,100	945	18,994,500
エフピコ	10,800	4,590	49,572,000
小松ウオール工業	8,000	802	6,416,000
ヤマハ	166,500	1,053	175,324,500
河合楽器	78,000	200	15,600,000
クリナップ	21,700	631	13,692,700
ビジョン	14,500	2,435	35,307,500
天馬	19,500	862	16,809,000
パラマウントベッド	16,500	2,203	36,349,500
兼松日産農林	34,000	132	4,488,000
キングジム	16,700	623	10,404,100
リンテック	44,700	2,232	99,770,400
田崎真珠	40,000	76	3,040,000
信越ポリマー	43,100	513	22,110,300
東リ	59,000	162	9,558,000
イトーキ	44,700	212	9,476,400
任天堂	119,600	25,000	2,990,000,000
三菱鉛筆	17,800	1,360	24,208,000
タカラスタンダード	97,000	560	54,320,000
コクヨ	108,600	669	72,653,400
ナカバヤシ	45,000	181	8,145,000
ニフコ	41,900	2,166	90,755,400
グローブライド	95,000	102	9,690,000
岡村製作所	80,000	503	40,240,000
日本バルカー	92,000	262	24,104,000
M U T O Hホールディングス	26,000	243	6,318,000
伊藤忠	1,440,800	837	1,205,949,600

丸 紅	1,806,000	618	1,116,108,000
スクロール	29,400	358	10,525,200
高 島	37,000	136	5,032,000
F & A アクアホールディングス	16,300	754	12,290,200
三陽商会	107,000	303	32,421,000
長瀬産業	117,000	1,038	121,446,000
ナイガイ	63,000	47	2,961,000
蝶 理	140,000	110	15,400,000
豊田通商	230,100	1,543	355,044,300
オンワ - ドホールディングス	146,000	720	105,120,000
三共生興	35,300	328	11,578,400
兼 松	469,000	96	45,024,000
美 津 濃	103,000	389	40,067,000
ツカモトコーポレーション	38,000	102	3,876,000
ファミリーマート	69,800	3,120	217,776,000
ルック	37,000	144	5,328,000
三井物産	1,781,600	1,463	2,606,480,800
日本紙バルブ	117,000	320	37,440,000
東京エレクトロン	164,200	5,270	865,334,000
日立ハイテクノロジーズ	62,600	1,861	116,498,600
カメイ	25,000	420	10,500,000
東都水産	35,000	169	5,915,000
スターゼン	71,000	264	18,744,000
セイコーHD	109,000	309	33,681,000
山 善	79,900	469	37,473,100
椿本興業	22,000	233	5,126,000
住友商事	1,136,900	1,207	1,372,238,300
日本ユニシス	56,800	633	35,954,400
内田洋行	44,000	287	12,628,000
三菱商事	1,652,800	2,256	3,728,716,800
第一実業	46,000	367	16,882,000
キヤノンマーケティングJPN	68,800	1,133	77,950,400
西華産業	81,000	226	18,306,000
佐藤商事	18,700	531	9,929,700
菱洋エレクトロ	27,200	925	25,160,000
東京産業	21,500	264	5,676,000
ユアサ商事	213,000	93	19,809,000
神鋼商事	54,000	219	11,826,000
阪和興業	193,000	378	72,954,000
カナデン	2,000	520	1,040,000
菱電商事	34,000	567	19,278,000
ニプロ	41,600	1,722	71,635,200
フルサト工業	12,400	558	6,919,200
岩谷産業	230,000	261	60,030,000
すてきナイスグループ	91,000	181	16,471,000
昭光通商	78,000	126	9,828,000
ニチモウ	32,000	204	6,528,000
極東貿易	28,000	167	4,676,000
イワキ	23,000	209	4,807,000
兼松エレクトロニクス	13,200	861	11,365,200
三愛石油	50,000	427	21,350,000
稲畑産業	55,600	559	31,080,400
G S Iクレオス	55,000	126	6,930,000
明和産業	17,100	301	5,147,100
ゴ - ルドウイン	50,000	295	14,750,000
東京スタイル	80,000	615	49,200,000
ユニ・チャ - ム	120,900	3,135	379,021,500
デサント	55,000	415	22,825,000
ヤマトインタ - ナショナル	13,400	390	5,226,000

東邦ホールディングス	63,200	1,016	64,211,200
サンゲツ	36,600	1,991	72,870,600
ミツウロコ	33,500	527	17,654,500
シナネン	45,000	389	17,505,000
伊藤忠エネクス	46,000	482	22,172,000
ザ・トーカイ	50,000	338	16,900,000
サンリオ	57,900	2,584	149,613,600
サンワ テクノス	10,300	724	7,457,200
リョーサン	33,600	2,137	71,803,200
新光商事	19,500	732	14,274,000
トーホー	44,000	305	13,420,000
三信電気	25,600	717	18,355,200
東陽テクニカ	28,300	824	23,319,200
モスフード サービス	27,100	1,556	42,167,600
加賀電子	20,600	1,040	21,424,000
三益半導体	16,700	982	16,399,400
ソーダニツカ	2,000	374	748,000
立花エレテック	12,600	766	9,651,600
木曽路	23,600	1,805	42,598,000
千趣会	37,300	522	19,470,600
タカキュー	16,500	163	2,689,500
ケーヨー	38,700	426	16,486,200
ユニハアー	23,800	859	20,444,200
上新電機	45,000	844	37,980,000
日本瓦斯	19,900	1,122	22,327,800
ベスト電器	64,500	241	15,544,500
マルエツ	42,000	327	13,734,000
ロイヤルホールディングス	31,900	878	28,008,200
東天紅	14,000	142	1,988,000
いなげや	23,000	890	20,470,000
島忠	40,000	1,876	75,040,000
チヨダ	27,100	1,134	30,731,400
鈴丹	5,500	166	913,000
ライフコーポレーション	13,100	1,312	17,187,200
カスミ	42,900	461	19,776,900
リンガーハット	15,800	1,029	16,258,200
さが美	17,000	116	1,972,000
MR MAX	20,800	294	6,115,200
テンアライド	13,800	296	4,084,800
AOKIホールディングス	19,200	1,442	27,686,400
オークワ	30,000	879	26,370,000
コメリ	28,200	2,025	57,105,000
青山商事	52,500	1,421	74,602,500
しまむら	21,500	7,830	168,345,000
CFSコーポレーション	21,000	422	8,862,000
高島屋	279,000	668	186,372,000
松屋	38,200	624	23,836,800
エイチ・ツー・オーリテイリング	121,000	616	74,536,000
丸栄	35,000	106	3,710,000
ニッセンHD	41,200	543	22,371,600
パルコ	53,700	807	43,335,900
丸井グループ	269,200	725	195,170,000
クレディセゾン	156,600	1,554	243,356,400
原信ナルスHLDGS	12,500	1,295	16,187,500
セディナ	211,000	180	37,980,000
井筒屋	114,000	64	7,296,000
ダイエー	95,650	333	31,851,450
イズミヤ	72,000	380	27,360,000
イオン	727,500	1,028	747,870,000

ユニー	167,800	803	134,743,400
イズミ	56,700	1,193	67,643,100
東武ストア	29,000	258	7,482,000
平和堂	41,800	1,043	43,597,400
フジ	23,000	1,697	39,031,000
ヤオコー	9,200	2,501	23,009,200
ゼビオ	24,900	1,859	46,289,100
ケーズホールディングス	47,500	2,744	130,340,000
Pal t a c	12,800	1,508	19,302,400
OL Y M P I C	14,200	645	9,159,000
東日カーライフグループ	31,000	123	3,813,000
新生銀行	1,072,000	105	112,560,000
あおぞら銀行	751,000	183	137,433,000
三菱UFJフィナンシャルG	15,620,500	450	7,029,225,000
りそなホールディングス	1,273,700	444	565,522,800
中央三井トラストHD	1,185,000	339	401,715,000
三井住友フィナンシャルG	1,560,900	3,060	4,776,354,000
第四銀行	270,000	296	79,920,000
北越銀行	232,000	195	45,240,000
西日本シティ銀行	723,000	267	193,041,000
札幌北洋ホール	310,900	419	130,267,100
千葉銀行	814,000	544	442,816,000
横浜銀行	1,414,000	432	610,848,000
常陽銀行	795,000	377	299,715,000
群馬銀行	482,000	498	240,036,000
武蔵野銀行	33,600	2,735	91,896,000
千葉興業銀行	39,500	589	23,265,500
筑波銀行	91,600	302	27,663,200
東京都民銀行	39,100	1,140	44,574,000
七十七銀行	348,000	506	176,088,000
青森銀行	165,000	259	42,735,000
秋田銀行	142,000	272	38,624,000
山形銀行	126,000	411	51,786,000
岩手銀行	14,000	3,890	54,460,000
東邦銀行	174,000	275	47,850,000
東北銀行	115,000	141	16,215,000
みちのく銀行	104,000	177	18,408,000
ふくおかフィナンシャルG	838,000	363	304,194,000
静岡銀行	641,000	757	485,237,000
十六銀行	259,000	275	71,225,000
スルガ銀行	218,000	797	173,746,000
八十二銀行	388,000	509	197,492,000
山梨中央銀行	126,000	444	55,944,000
大垣共立銀行	275,000	286	78,650,000
福井銀行	178,000	264	46,992,000
北國銀行	236,000	313	73,868,000
清水銀行	7,100	3,935	27,938,500
滋賀銀行	194,000	451	87,494,000
南都銀行	192,000	421	80,832,000
百五銀行	186,000	383	71,238,000
京都銀行	369,000	769	283,761,000
三重銀行	93,000	235	21,855,000
ほくほくフィナンシャルG	1,445,000	182	262,990,000
広島銀行	609,000	367	223,503,000
山陰合同銀行	124,000	622	77,128,000
中国銀行	169,000	966	163,254,000
鳥取銀行	66,000	183	12,078,000
伊予銀行	221,000	752	166,192,000
百十四銀行	242,000	332	80,344,000

四国銀行	149,000	267	39,783,000
阿波銀行	172,000	500	86,000,000
鹿児島銀行	133,000	564	75,012,000
大分銀行	134,000	309	41,406,000
宮崎銀行	137,000	219	30,003,000
肥後銀行	162,000	483	78,246,000
佐賀銀行	126,000	231	29,106,000
十八銀行	132,000	257	33,924,000
沖縄銀行	15,700	3,485	54,714,500
琉球銀行	43,500	975	42,412,500
住友信託	1,849,000	506	935,594,000
みずほ信託銀行	1,961,000	84	164,724,000
八千代銀行	10,800	2,879	31,093,200
みずほフィナンシャルG	25,228,400	165	4,162,686,000
紀陽ホールディングス	819,000	118	96,642,000
山口フィナンシャルG	206,000	836	172,216,000
フィデック	130	13,430	1,745,900
芙蓉総合リース	19,700	2,949	58,095,300
興銀リース	28,700	2,086	59,868,200
東京センチュリーリース	48,500	1,520	73,720,000
S B Iホールディングス	24,606	12,660	311,511,960
日本証券金融	85,200	611	52,057,200
大阪証券金融	24,200	173	4,186,600
アイフル	170,650	170	29,010,500
日本アジア投資	142,000	92	13,064,000
ポケットカード	19,900	374	7,442,600
長野銀行	73,000	194	14,162,000
名古屋銀行	187,000	284	53,108,000
愛知銀行	6,900	5,480	37,812,000
第三銀行	126,000	236	29,736,000
中京銀行	85,000	213	18,105,000
東日本銀行	109,000	207	22,563,000
愛媛銀行	130,000	249	32,370,000
トマト銀行	82,000	155	12,710,000
みなと銀行	214,000	160	34,240,000
京葉銀行	170,000	465	79,050,000
関西アーバン銀行	289,000	146	42,194,000
栃木銀行	104,000	406	42,224,000
北日本銀行	6,500	2,100	13,650,000
東和銀行	222,000	117	25,974,000
福島銀行	256,000	63	16,128,000
大東銀行	133,000	74	9,842,000
リコーリース	14,200	2,161	30,686,200
イオン クレジットサービス	91,800	1,229	112,822,200
N I Sグループ	160,500	9	1,444,500
アコム	41,490	1,421	58,957,290
プロミス	105,150	783	82,332,450
ジャックス	137,000	294	40,278,000
日立キャピタル	48,600	1,282	62,305,200
オリックス	107,350	8,790	943,606,500
三菱UFJリース	52,340	3,610	188,947,400
ジャフコ	28,200	2,587	72,953,400
トモニホールディングス	158,800	332	52,721,600
大和証券G本社	2,044,000	428	874,832,000
野村ホールディングス	4,346,400	508	2,207,971,200
みずほ証券	528,000	224	118,272,000
みずほインベスタズ証	479,000	86	41,194,000
岡三証券グループ	176,000	351	61,776,000
丸三証券	66,000	463	30,558,000

東洋証券	78,000	142	11,076,000
東海東京HD	237,000	298	70,626,000
光世証券	52,000	87	4,524,000
水戸証券	56,000	137	7,672,000
いちよし証券	46,500	618	28,737,000
松井証券	122,400	568	69,523,200
NK S Jホールディングス	1,726,000	623	1,075,298,000
だいこう証券ビジ	12,500	322	4,025,000
マネックスG	1,220	22,360	27,279,200
カブドットコム証券	88,800	349	30,991,200
極東証券	28,000	669	18,732,000
岩井コスモホールディング	19,500	567	11,056,500
フィデアホール	119,500	266	31,787,000
池田泉州HD	579,800	128	74,214,400
MS & A D	616,800	2,133	1,315,634,400
SONY F H	989	334,000	330,326,000
小林洋行	5,200	236	1,227,200
第一生命	8,278	143,500	1,187,893,000
富士火災	182,000	146	26,572,000
東京海上HD	783,500	2,658	2,082,543,000
アサックス	30	117,800	3,534,000
NECキャピタルソリューション	5,600	1,339	7,498,400
T & Dホールディングス	376,150	2,340	880,191,000
三井不動産	973,000	1,715	1,668,695,000
三菱地所	1,445,000	1,652	2,387,140,000
平和不動産	156,000	243	37,908,000
東京建物	422,000	379	159,938,000
ダイビル	60,900	689	41,960,100
サンケイビル	40,200	526	21,145,200
東急不動産	416,000	461	191,776,000
京阪神不動産	24,900	404	10,059,600
住友不動産	495,000	2,147	1,062,765,000
東宝不動産	22,200	556	12,343,200
太平洋興発	72,000	73	5,256,000
大京	347,000	157	54,479,000
テーオーシー	80,400	355	28,542,000
東京楽天地	27,000	293	7,911,000
レオパレス21	124,700	136	16,959,200
フジ住宅	21,900	413	9,044,700
空港施設	21,800	373	8,131,400
明和地所	12,100	602	7,284,200
住友不動産販売	7,460	4,245	31,667,700
ゴールドクレスト	18,610	2,201	40,960,610
東栄住宅	15,800	1,196	18,896,800
日本エスリード	9,100	910	8,281,000
東急リパブル	22,000	980	21,560,000
飯田産業	23,500	957	22,489,500
日神不動産	12,300	636	7,822,800
アーネストワン	38,500	1,010	38,885,000
タカラレーベン	19,600	639	12,524,400
サンヨーハウジ 名古屋	90	80,600	7,254,000
イオンモール	94,200	2,125	200,175,000
フージャースコーポレーション	321	40,950	13,144,950
サンシティ	511	2,465	1,259,615
タクトホーム	97	93,000	9,021,000
ランド	22,600	21	474,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,497	85,400	127,843,800
サンフロンティア不動産	199	12,200	2,427,800
ランドビジネス	143	19,100	2,731,300

東武鉄道	892,000	402	358,584,000
相鉄ホールディングス	329,000	268	88,172,000
東京急行	1,148,000	377	432,796,000
京浜急行	537,000	671	360,327,000
小田急電鉄	670,000	764	511,880,000
京王電鉄	543,000	548	297,564,000
京成電鉄	337,000	570	192,090,000
富士急行	58,000	431	24,998,000
新京成電鉄	23,000	349	8,027,000
東日本旅客鉄道	363,600	5,700	2,072,520,000
西日本旅客鉄道	1,948	336,500	655,502,000
東海旅客鉄道	1,815	730,000	1,324,950,000
アートコーポレーション	4,400	1,791	7,880,400
西日本鉄道	271,000	352	95,392,000
ハマキョウレックス	6,000	2,538	15,228,000
サカイ引越センター	3,900	1,784	6,957,600
近畿鉄道	1,888,000	257	485,216,000
阪急阪神HLDGS	1,403,000	390	547,170,000
南海電鉄	436,000	337	146,932,000
京阪電鉄	469,000	346	162,274,000
名糖運輸	8,400	689	5,787,600
名古屋鉄道	729,000	224	163,296,000
日本通運	828,000	346	286,488,000
ヤマトホールディングス	425,500	1,318	560,809,000
山九	254,000	379	96,266,000
日新	80,000	230	18,400,000
丸運	12,500	222	2,775,000
丸全昭和運輸	71,000	279	19,809,000
センコー	84,000	273	22,932,000
トナミホールディングス	44,000	161	7,084,000
日本梱包運輸	63,000	927	58,401,000
日石輸送	12,000	210	2,520,000
福山通運	145,000	421	61,045,000
セイノーホールディングス	162,000	620	100,440,000
神奈川中央交通	25,000	427	10,675,000
日立物流	36,400	1,306	47,538,400
日本郵船	1,766,000	362	639,292,000
商船三井	1,018,000	540	549,720,000
川崎汽船	646,000	353	228,038,000
NSユニテッド海運	75,000	199	14,925,000
乾汽船	25,000	570	14,250,000
明治海運	19,100	328	6,264,800
飯野海運	101,200	430	43,516,000
共栄タンカー	18,000	187	3,366,000
第一中央汽船	137,000	197	26,989,000
全日本空輸	2,788,000	299	833,612,000
パスコ	25,000	266	6,650,000
国際航業HLDGS	12,000	272	3,264,000
三菱倉庫	149,000	1,084	161,516,000
三井倉庫	97,000	345	33,465,000
住友倉庫	153,000	446	68,238,000
渋沢倉庫	55,000	276	15,180,000
ヤマタネ	104,000	124	12,896,000
東陽倉庫	30,000	192	5,760,000
日本トランスシティ	44,000	302	13,288,000
ケイヒン	40,000	99	3,960,000
安田倉庫	18,200	512	9,318,400
東洋埠頭	63,000	139	8,757,000
宇徳	15,800	258	4,076,400

上組	232,000	714	165,648,000
サンリツ	1,700	618	1,050,600
キムラユニティー	4,800	726	3,484,800
キューソー流通システム	7,000	859	6,013,000
郵船ロジスティクス	16,500	1,268	20,922,000
近鉄エクスプレス	18,700	2,519	47,105,300
東海運	12,400	214	2,653,600
バンテック	98	117,600	11,524,800
東京放送HD	111,400	1,164	129,669,600
日本テレビ放送網	18,130	13,440	243,667,200
テレビ朝日	524	144,300	75,613,200
スカパーJ S A T H D	1,580	31,600	49,928,000
テレビ東京HD	9,500	1,265	12,017,500
アイ・ティー・シーネットワーク	18,300	508	9,296,400
イー・アクセス	1,128	51,600	58,204,800
NECモバイリング	7,600	2,742	20,839,200
日本電信電話	775,000	3,985	3,088,375,000
KDDI	3,203	532,000	1,703,996,000
光通信	26,600	1,980	52,668,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	17,060	153,500	2,618,710,000
GMOインターネット	58,700	474	27,823,800
学研ホールディングス	91,000	186	16,926,000
ゼンリン	30,100	969	29,166,900
昭文社	12,900	735	9,481,500
角川グループHLDGS	19,600	2,144	42,022,400
インプレスホールディングス	18,300	149	2,726,700
東京電力	1,539,200	2,133	3,283,113,600
中部電力	644,000	2,144	1,380,736,000
関西電力	853,300	2,143	1,828,621,900
中国電力	289,100	1,741	503,323,100
北陸電力	214,600	2,044	438,642,400
東北電力	522,400	1,898	991,515,200
四国電力	211,900	2,453	519,790,700
九州電力	461,700	1,888	871,689,600
北海道電力	195,700	1,736	339,735,200
沖縄電力	12,500	4,020	50,250,000
電源開発	129,700	2,582	334,885,400
東京瓦斯	2,615,000	369	964,935,000
大阪瓦斯	2,103,000	311	654,033,000
東邦瓦斯	539,000	432	232,848,000
北海道瓦斯	43,000	252	10,836,000
西部瓦斯	237,000	211	50,007,000
静岡瓦斯	55,000	480	26,400,000
アイネット	10,300	496	5,108,800
松竹	127,000	615	78,105,000
東宝	135,200	1,324	179,004,800
エイチ・アイ・エス	22,300	2,084	46,473,200
東映	87,000	421	36,627,000
葵プロモーション	7,500	491	3,682,500
C & I HOLDINGS	136,500	5	682,500
NTTデータ	1,456	288,100	419,473,600
共立メンテナンス	10,000	1,380	13,800,000
イチネンホールディングス	23,200	449	10,416,800
建設技術研究所	13,700	459	6,288,300
インファーマシーズ	7,100	2,836	20,135,600
燦ホールディングス	4,900	1,379	6,757,100
スバル興業	3,000	239	717,000
東京テアトル	85,000	124	10,540,000
ホリプロ	8,000	840	6,720,000

よみうりランド	50,000	317	15,850,000
東京都競馬	153,000	123	18,819,000
常磐興産	69,000	126	8,694,000
カナモト	28,000	443	12,404,000
東京ドーム	163,000	205	33,415,000
D T S	19,700	917	18,064,900
スクウェア・エニックス・HD	67,500	1,521	102,667,500
シーイーシー	13,600	441	5,997,600
カプコン	44,000	1,579	69,476,000
東海観光	106,000	24	2,544,000
日本空港ビルデング	65,900	1,223	80,595,700
トランス・コスモス	28,400	857	24,338,800
乃村工藝社	43,000	323	13,889,000
ジャステック	12,200	494	6,026,800
住商情報システム	21,200	1,276	27,051,200
藤田観光	57,000	365	20,805,000
近畿日本ツーリスト	71,000	148	10,508,000
日本管財	8,300	1,400	11,620,000
白洋舎	5,000	223	1,115,000
セコム	227,200	4,065	923,568,000
C S K	73,500	313	23,005,500
日本システムウエア	8,200	371	3,042,200
セントラル警備保障	10,300	854	8,796,200
アイネス	28,100	684	19,220,400
丹青社	5,000	434	2,170,000
メイテック	32,000	1,800	57,600,000
T K C	15,600	1,657	25,849,200
アサツー ディ・ケイ	35,300	2,307	81,437,100
富士ソフト	27,800	1,402	38,975,600
応用地質	21,200	690	14,628,000
船井総合研究所	23,500	530	12,455,000
N S D	39,900	880	35,112,000
進学会	12,700	318	4,038,600
丸紅建材リース	23,000	99	2,277,000
コナミ	95,200	1,684	160,316,800
ベネッセホールディングス	69,200	3,715	257,078,000
イオンディライト	24,800	1,499	37,175,200
ナック	5,100	1,260	6,426,000
福井コンピュータ	1,500	430	645,000
ニチイ学館	38,300	744	28,495,200
ダイセキ	32,400	1,623	52,585,200
日鐵商事	46,000	262	12,052,000
元気寿司	6,500	1,063	6,909,500
トラスコ中山	26,000	1,416	36,816,000
ヤマダ電機	94,090	6,080	572,067,200
オートバックスセブン	26,700	3,295	87,976,500
アークランドサカモト	12,100	1,014	12,269,400
ニトリホールディングス	40,850	7,190	293,711,500
グルメ杵屋	15,000	501	7,515,000
愛眼	16,900	471	7,959,900
吉野家ホールディングス	560	104,700	58,632,000
加藤産業	30,000	1,433	42,990,000
イエローハット	19,500	869	16,945,500
富士エレクトロニクス	11,800	1,452	17,133,600
松屋フーズ	10,000	1,554	15,540,000
J B C Cホールディングス	17,300	561	9,705,300
J Kホールディングス	19,700	405	7,978,500
サガミチェーン	25,000	486	12,150,000
日伝	8,600	2,344	20,158,400

北沢産業	11,000	184	2,024,000
杉本商事	11,300	771	8,712,300
因幡電機産業	24,400	2,291	55,900,400
住金物産	97,000	222	21,534,000
ブレナス	26,000	1,371	35,646,000
ミニストップ	15,500	1,429	22,149,500
アークス	26,600	1,290	34,314,000
パロー	41,200	811	33,413,200
ミスミグループ本社	69,800	1,985	138,553,000
江守商事	4,600	875	4,025,000
アルテック	8,900	316	2,812,400
ベルク	10,400	1,019	10,597,600
大庄	11,100	1,021	11,333,100
タキヒヨー	32,000	410	13,120,000
ファーストリテイリング	48,200	12,830	618,406,000
ソフトバンク	913,900	3,305	3,020,439,500
スズケン	85,500	2,360	201,780,000
サンドラッグ	39,400	2,448	96,451,200
ジェコス	15,600	331	5,163,600
ヤマザワ	5,700	1,159	6,606,300
やまや	3,400	912	3,100,800
ペルーナ	25,750	599	15,424,250
合計	320,496,314		264,381,727,116

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株数
トヨタ自動車	500,000

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		114,197,502	2,901,832,238
コール・ローン		5,168,290,967	6,500,468,536
株式		277,648,602,650	273,387,520,090
投資信託受益証券		854,478,026	894,665,152
投資証券		3,064,745,118	3,563,818,122
派生商品評価勘定		6,992,501	98,011,705
未収入金		-	269,195,575
未収配当金		567,125,416	569,509,457
差入委託証拠金		331,323,539	1,698,708,601
流動資産合計		287,755,755,719	289,883,729,476
資産合計		287,755,755,719	289,883,729,476
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		922,556	10,805,080
未払金		-	283,617,590
未払解約金		5,113,060,000	6,570,960,000
流動負債合計		5,113,982,556	6,865,382,670
負債合計		5,113,982,556	6,865,382,670
純資産の部			
元本等			
元本		230,889,417,193	211,463,838,388
剰余金			
剰余金又は欠損金()		51,752,355,970	71,554,508,418
元本等合計		282,641,773,163	283,018,346,806
純資産合計		282,641,773,163	283,018,346,806
負債純資産合計		287,755,755,719	289,883,729,476

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	(1)先物取引 同左

	(2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	(2)為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月15日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月16日から平成24年2月15日までとなっております。

(追加情報)

自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券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	208,410,395,741円	230,889,417,193円
同期中追加設定元本額	91,010,592,100円	48,969,811,098円
同期中解約元本額	68,531,570,648円	68,395,389,903円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	677,515,462円	889,688,585円
D I A M外国株式インデックスファンド< DC年金>	23,857,437,556円	28,763,322,356円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 1 安定型	158,820,202円	175,686,010円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 2 安定・成長型	938,309,051円	990,180,130円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 3 成長型	1,199,726,425円	1,235,372,366円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	198,061,463円	203,263,880円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	507,589,655円	520,238,727円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	367,497,733円	367,609,658円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	85,813,790円	82,584,334円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	656,835,118円	760,893,311円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	104,084,917円
D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	632,485,236円	615,624,011円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,243,813,848円	6,108,729,541円
グローバル株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	3,795,222,785円	円
D I A M為替リスクコントロール型グローバル株式私募ファンド(適格機関投資家限定)	18,200,891,710円	17,000,035,639円
D I A Mワールドバランス25V A (適格機関投資家限定)	108,502,199円	94,414,283円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	10,778,560,162円	8,894,435,021円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	1,737,582,071円	1,535,076,284円
D I A M国際分散バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	203,406,461円	175,499,713円
D I A M国際分散バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	1,126,302,889円	1,013,850,723円
D I A M国内重視バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	105,164,165円	92,663,358円
D I A M国内重視バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	187,170,365円	168,357,517円
D I A M世界バランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	19,264,687,870円	16,797,514,456円
D I A M世界バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	9,468,385,371円	8,427,027,772円
D I A Mバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	3,393,404,331円	2,877,775,871円
D I A Mバランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	3,041,064,525円	2,565,365,866円
D I A Mバランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	8,103,595,711円	6,949,167,444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)	5,894,936,107円	5,295,294,010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)	7,529,039,456円	6,649,644,859円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	5,170,935,060円	4,457,852,898円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	4,480,067,385円	3,980,367,338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)	76,419,333円	58,961,297円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	513,508,305円	264,757,976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）	20,252,789,539円	18,784,057,814円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A（適格機 関投資家限定）	3,503,524,691円	3,269,823,724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）	139,785,636円	132,926,695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）	25,503,695,599円	22,798,120,447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）	2,705,303,163円	2,325,073,483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）	4,726,016,367円	4,159,672,173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）	15,595,707,695円	13,790,642,903円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	173,270円	166,471円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	266,674円	262,353円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A（適格機関投資 家限定）	19,759,158,004円	18,087,514,884円
D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	81,315円	77,713円
D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	163,440円	159,577円
（合 計）	230,889,417,193円	211,463,838,388円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	230,889,417,193口	211,463,838,388口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制		<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		<p>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。</p>
2. 時価の算定方法		<p>(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	--	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	277,648,602,650	6,963,792,528
投資信託受益証券	854,478,026	7,686,858
投資証券	3,064,745,118	144,013,730
合計	281,567,825,794	7,115,493,116

	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
株式	5,952,505,012	
投資信託受益証券	16,035,360	
投資証券	57,674,351	
合計	6,026,214,723	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。	
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	

3. 取引に係るリスクの内容	為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。	
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

取引の時価等に関する事項
(株式関連)

平成22年2月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	18,467,257	-	18,739,754	272,497
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	34,811,340	-	34,641,654	169,686
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	103,199,635	-	103,379,005	179,370
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	50,880,334	-	51,834,783	954,449
	米ドル S&P 500 FUTURE	268,707,196	-	273,839,027	5,131,831
	合 計	476,065,762	-	482,434,223	6,368,461

平成23年2月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	197,109,360	-	198,580,480	1,471,120
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	346,659,645	-	359,332,362	12,672,717
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	984,157,620	-	1,005,411,307	21,253,687
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	502,976,239	-	499,750,630	3,225,609
	米ドル S&P 500 FUTURE	2,454,093,447	-	2,509,078,362	54,984,915
	合 計	4,484,996,311	-	4,572,153,141	87,156,830

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

平成22年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	オーストラリアドル	112,991,200	-	112,980,000	11,200
	カナダドル	197,107,700	-	197,087,000	20,700
	ユーロ	622,286,900	-	622,251,000	35,900
	英ポンド	291,783,800	-	291,732,000	51,800
	米ドル	1,726,989,716	-	1,726,810,800	178,916
	合計	2,951,159,316	-	2,950,860,800	298,516

平成23年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	カナダドル	8,337,200	-	8,344,000	6,800
	ユーロ	19,273,325	-	19,240,600	32,725
	米ドル	65,838,720	-	65,560,000	278,720
	買建				
	オーストラリアドル	140,828,000	-	140,811,000	17,000
	カナダドル	250,326,600	-	250,320,000	6,600
	ユーロ	747,007,800	-	746,988,000	19,800
	英ポンド	370,059,200	-	370,048,000	11,200
	米ドル	1,844,075,250	-	1,843,875,000	200,250
	合計	3,445,746,095	-	3,445,186,600	49,795

(注) 時価の算定方法

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

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額	1,2241円	1,3384円
（1万口当たり純資産額）	（12,241円）	（13,384円）

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成23年2月25日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	199,576	89.650	17,891,988.400	
	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD	1,011	363.600	367,599.600	
	EVEREST RE GROUP LTD	8,102	86.380	699,850.760	
	PARTNERRE LTD	6,610	77.770	514,059.700	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19,644	35.790	703,058.760	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,493	66.830	567,587.190	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,949	87.560	608,454.440	
	BUNGE LTD	20,860	70.740	1,475,636.400	
	VALIDUS HOLDINGS LTD	9,579	30.100	288,327.900	
	INVESCO LTD	73,288	25.630	1,878,371.440	
	ULTRA PETROLEUM CORP	25,409	44.290	1,125,364.610	
	ACE LTD	50,521	62.640	3,164,635.440	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	75,148	44.700	3,359,115.600	
	WEATHERFORD INTL LTD	112,245	23.800	2,671,431.000	
	NOBLE CORP	39,396	43.550	1,715,695.800	
	GARMIN LTD	20,035	32.460	650,336.100	
	FOSTER WHEELER AG	21,365	35.440	757,175.600	
	TYCO ELECTRONICS LTD	67,857	35.490	2,408,244.930	
	SEAGATE TECHNOLOGY	78,988	12.740	1,006,307.120	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	25,326	62.650	1,586,673.900	
	XL GROUP PLC	53,089	22.970	1,219,454.330	
	INGERSOLL-RAND PLC	49,001	44.740	2,192,304.740	
	ACCENTURE PLC-CL A	94,010	51.750	4,865,017.500	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,253	38.300	928,889.900	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	11,995	23.210	278,403.950	
	COVIDIEN PLC	72,589	50.310	3,651,952.590	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,377	43.590	975,413.430	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	63,090	41.910	2,644,101.900	
	FLEXTRONICS INTL LTD	129,042	8.060	1,040,078.520	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,638	33.980	531,379.240	
	AMAZON.COM INC	52,667	177.750	9,361,559.250	
	ABBOTT LABORATORIES	235,311	47.200	11,106,679.200	
	AES CORP	110,231	12.070	1,330,488.170	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,529	56.200	816,529.800	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	185,555	160.770	29,831,677.350	
	ADVANCED MICRO DEVICES	93,282	9.100	848,866.200	
	ADOBE SYSTEMS INC	71,043	33.450	2,376,388.350	
	AGCO CORP	14,077	52.830	743,687.910	
	AIRGAS INC	11,689	62.130	726,237.570	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	31,068	90.860	2,822,838.480	
	ENERGEN CORP	11,608	59.700	692,997.600	
	ALLERGAN INC	45,042	73.000	3,288,066.000	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	138,226	53.040	7,331,507.040	
	POLO RALPH LAUREN CORP	9,673	123.790	1,197,420.670	
	ALLSTATE CORP	74,303	31.080	2,309,337.240	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	111,445	56.480	6,294,413.600	
	ALTERA CORPORATION	44,383	40.780	1,809,938.740	
	ALCOA INC	154,382	16.550	2,555,022.100	
	AMGEN INC	143,667	50.950	7,319,833.650	

HESS CORP	44,922	83.730	3,761,319.060
ALLEGHENY ENERGY INC	18,574	25.180	467,693.320
FORTUNE BRANDS INC	23,016	60.610	1,394,999.760
AMERICAN EXPRESS CO	165,252	43.560	7,198,377.120
AMERICAN ELECTRIC POWER	72,374	35.110	2,541,051.140
AFLAC INC	71,215	57.220	4,074,922.300
AMERICAN INTL GROUP	19,154	40.430	774,396.220
ANALOG DEVICES	44,684	39.270	1,754,740.680
ANADARKO PETROLEUM CORP	75,015	78.140	5,861,672.100
QWEST COMMUNICATIONS INTL	235,371	6.620	1,558,156.020
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,373	92.170	1,140,419.410
NABORS INDUSTRIES LTD	46,216	27.650	1,277,872.400
ARCH COAL INC	26,204	32.490	851,367.960
TIME WARNER	171,776	37.420	6,427,857.920
VALERO ENERGY CORP	85,331	26.800	2,286,870.800
APOLLO GROUP INC	22,209	45.160	1,002,958.440
APACHE CORP	57,926	120.500	6,980,083.000
APPLE INC	136,163	342.790	46,675,314.770
APPLIED MATERIALS INC	199,533	15.830	3,158,607.390
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	91,397	36.430	3,329,592.710
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	30,448	15.160	461,591.680
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,201	41.520	714,185.520
AMEREN CORP	33,127	27.140	899,066.780
ARROW ELECTRONICS INC	17,437	38.690	674,637.530
AUTOLIV INC	10,481	72.040	755,051.240
AUTODESK INC	36,986	40.430	1,495,343.980
AUTOMATIC DATA PROCESSING	73,579	48.990	3,604,635.210
AUTOZONE INC	4,387	253.250	1,111,007.750
AVERY DENNISON CORP	15,202	39.120	594,702.240
AVNET INC	22,835	33.870	773,421.450
AVON PRODUCTS INC	59,056	27.820	1,642,937.920
BMC SOFTWARE INC	26,711	48.360	1,291,743.960
BAKER HUGHES INC	66,664	68.940	4,595,816.160
BALL CORP	23,370	36.000	841,320.000
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	129,110	83.360	10,762,609.600
CONSTELLATION ENERGY GROUP	27,811	29.950	832,939.450
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	183,728	30.130	5,535,724.640
CR BARD INC	14,153	96.260	1,362,367.780
BAXTER INTERNATIONAL INC	89,280	51.680	4,613,990.400
BED BATH & BEYOND INC	39,669	47.330	1,877,533.770
BECKMAN COULTER INC	8,722	82.870	722,792.140
BECTON DICKINSON & CO	36,694	79.080	2,901,761.520
AMETEK INC	25,735	41.190	1,060,024.650
NII HOLDINGS INC	25,446	41.840	1,064,660.640
VERIZON COMM INC	427,200	35.580	15,199,776.000
WR BERKLEY CORP	18,150	29.420	533,973.000
BEST BUY CO INC	55,155	32.170	1,774,336.350
YUM! BRANDS INC	68,720	49.370	3,392,706.400
FIRSTENERGY CORP	42,523	38.160	1,622,677.680
SLM CORP	78,907	14.530	1,146,518.710
H&R BLOCK INC	44,991	14.910	670,815.810
BOEING CO	106,019	70.760	7,501,904.440
ROBERT HALF INTL INC	22,574	31.460	710,178.040
BORGWARNER INC	17,164	75.360	1,293,479.040
BOSTON SCIENTIFIC CORP	230,329	7.020	1,616,909.580
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	24,351	71.810	1,748,645.310
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	262,238	25.400	6,660,845.200
ONEOK INC	14,024	63.070	884,493.680
SEMPRA ENERGY	35,385	52.980	1,874,697.300

FEDEX CORP	45,072	89.810	4,047,916.320
VERISIGN INC	26,815	35.630	955,418.450
AMPHENOL CORP	26,334	56.710	1,493,401.140
BROWN-FORMAN CORP	11,945	67.710	808,795.950
QUANTA SERVICES INC	33,320	21.830	727,375.600
CSX CORP	57,647	71.890	4,144,242.830
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	37,409	36.360	1,360,191.240
CABOT OIL & GAS CORP	19,209	44.800	860,563.200
CAMPBELL SOUP CO	30,602	33.500	1,025,167.000
CONSTELLATION BRANDS INC	23,608	20.110	474,756.880
CARDINAL HEALTH INC	51,887	40.490	2,100,904.630
CATERPILLAR INC	90,583	100.570	9,109,932.310
CELGENE CORP	69,181	52.890	3,658,983.090
CITRIX SYSTEMS INC	28,958	68.240	1,976,093.920
CHESAPEAKE ENERGY CORP	98,778	34.350	3,393,024.300
CENTURYLINK INC	46,035	40.070	1,844,622.450
CEPHALON INC	10,949	56.070	613,910.430
CERNER CORP	10,714	97.630	1,046,007.820
JPMORGAN CHASE & CO	581,000	45.910	26,673,710.000
CHUBB CORP	45,961	59.590	2,738,815.990
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,222	72.960	745,797.120
CIGNA CORP	36,696	41.530	1,523,984.880
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,393	33.390	547,362.270
CINTAS CORP	18,563	27.660	513,452.580
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	146,854	8.290	1,217,419.660
CISCO SYSTEMS INC	830,000	18.350	15,230,500.000
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	20,415	93.320	1,905,127.800
CLOROX COMPANY	21,099	67.410	1,422,283.590
COCA-COLA CO/THE	315,312	63.880	20,142,130.560
COCA-COLA ENTERPRISES INC	45,062	26.000	1,171,612.000
COLGATE-PALMOLIVE CO	73,646	77.660	5,719,348.360
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	42,882	38.470	1,649,670.540
AON CORP	45,575	51.920	2,366,254.000
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	118,400	23.590	2,793,056.000
COMERICA INC	26,181	38.340	1,003,779.540
NRG ENERGY, INC.	36,050	19.300	695,765.000
COMCAST CORP-CL A	309,630	24.940	7,722,172.200
CA INC	66,524	24.380	1,621,855.120
COMPUTER SCIENCES CORP	23,064	47.480	1,095,078.720
CONAGRA FOODS INC	66,889	22.770	1,523,062.530
CONSOLIDATED EDISON INC	44,922	48.850	2,194,439.700
SARA LEE CORP	83,529	16.970	1,417,487.130
CAMERON INTERNATIONAL CORP	36,887	57.670	2,127,273.290
MOLSON COORS BREWING CO	24,259	44.660	1,083,406.940
CORNING INC	237,425	22.760	5,403,793.000
DIRECTV	126,914	45.700	5,799,969.800
COVANCE INC	7,471	55.500	414,640.500
CREE INC	17,229	52.370	902,282.730
COVENTRY HEALTH CARE INC	21,115	29.800	629,227.000
SEALED AIR CORP	23,230	27.220	632,320.600
BROADCOM CORP-CL A	68,999	40.960	2,826,199.040
CUMMINS INC	28,983	100.870	2,923,515.210
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	17,834	80.170	1,429,751.780
DR HORTON INC	51,100	11.770	601,447.000
DANAHER CORP	79,988	49.760	3,980,202.880
MOODY'S CORP	32,725	29.760	973,896.000
AMERICAN TOWER CORP	59,421	52.850	3,140,399.850
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	44,798	74.930	3,356,714.140
TARGET CORP	96,771	52.000	5,032,092.000

DIAMOND OFFSHORE DRILLING	9,740	76.320	743,356.800
DEERE & CO	59,200	88.910	5,263,472.000
DELL INC	260,298	15.050	3,917,484.900
MORGAN STANLEY	191,220	29.490	5,639,077.800
REPUBLIC SERVICES INC	53,213	29.060	1,546,369.780
DEVRY INC	10,352	53.650	555,384.800
THE WALT DISNEY CO	263,833	42.420	11,191,795.860
DOLLAR TREE INC	18,954	50.650	960,020.100
RR DONNELLEY & SONS CO	27,250	18.200	495,950.000
DOVER CORP	28,398	63.500	1,803,273.000
DOW CHEMICAL	176,990	35.490	6,281,375.100
OMNICOM GROUP	47,303	48.760	2,306,494.280
DTE ENERGY CO	25,544	46.620	1,190,861.280
DUKE ENERGY CORP	195,968	17.820	3,492,149.760
CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	42,136	41.860	1,763,812.960
FLOWERVE CORP	8,844	125.430	1,109,302.920
DARDEN RESTAURANTS INC	20,389	46.820	954,612.980
EBAY INC	181,062	33.090	5,991,341.580
EMC CORP/MASS	312,798	26.550	8,304,786.900
BANK OF AMERICA CORP	1,522,007	13.970	21,262,437.790
EL PASO CORP	106,896	17.780	1,900,610.880
CITIGROUP INC	4,281,831	4.690	20,081,787.390
EASTMAN CHEMICAL CO	11,841	89.980	1,065,453.180
EATON CORP	24,287	104.900	2,547,706.300
EATON VANCE CORP	19,507	31.400	612,519.800
DISH NETWORK CORP	30,117	22.620	681,246.540
ECOLAB INC	33,326	47.490	1,582,651.740
ELECTRONIC ARTS INC	47,221	18.800	887,754.800
SALESFORCE.COM INC	18,078	134.320	2,428,236.960
EMERSON ELECTRIC CO	107,928	59.230	6,392,575.440
ENTERGY CORP	27,589	70.810	1,953,577.090
EOG RESOURCES INC	38,172	110.170	4,205,409.240
EQUIFAX INC	16,637	34.780	578,634.860
EQT CORP	24,370	47.780	1,164,398.600
ESTEE LAUDER COS INC/THE	15,939	91.460	1,457,780.940
EXPEDITORS INTERNATIONAL	32,178	47.930	1,542,291.540
EXPRESS SCRIPTS INC	75,344	54.500	4,106,248.000
EXXON MOBIL CORP	754,565	85.970	64,869,953.050
FMC CORP	11,028	75.180	829,085.040
NEXTERA ENERGY INC	55,491	54.410	3,019,265.310
FAMILY DOLLAR STORES	18,264	50.040	913,930.560
ASSURANT INC	15,460	39.700	613,762.000
FASTENAL CO	19,624	60.850	1,194,120.400
FIFTH THIRD BANCORP	124,201	14.300	1,776,074.300
M&T BANK CORP	12,227	87.630	1,071,452.010
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	14,749	55.130	813,112.370
FISERV INC	20,754	62.010	1,286,955.540
FLIR SYSTEMS INC	25,251	31.740	801,466.740
MACY'S INC	64,505	23.170	1,494,580.850
FORD MOTOR CO	464,033	14.700	6,821,285.100
FOREST LABORATORIES INC	42,649	31.930	1,361,782.570
FRANKLIN RESOURCES INC	23,779	123.760	2,942,889.040
FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	142,632	51.860	7,396,895.520
GAP INC/THE	68,800	22.490	1,547,312.000
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	19,533	36.070	704,555.310
GENERAL DYNAMICS CORP	43,637	76.110	3,321,212.070
GENERAL MILLS INC	96,103	36.640	3,521,213.920
GENUINE PARTS CO	21,289	51.780	1,102,344.420
GENZYME CORP-GENL DIVISION	38,861	75.360	2,928,564.960

GILEAD SCIENCES INC	120,797	38.780	4,684,507.660
STARWOOD HOTELS&RESORTS	28,365	60.030	1,702,750.950
GOODRICH CORP	18,974	86.530	1,641,820.220
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	13.630	499,962.030
MCKESSON CORP	40,060	78.210	3,133,092.600
NVIDIA CORP	81,290	22.650	1,841,218.500
GENERAL ELECTRIC CO	1,575,000	20.580	32,413,500.000
WW GRAINGER INC	9,040	130.070	1,175,832.800
LIFE TECHNOLOGIES CORP	27,637	52.450	1,449,560.650
NUANCE COMMUNICATIONS INC	34,300	18.740	642,782.000
HALLIBURTON CO	139,312	45.550	6,345,661.600
HANSEN NATURAL CORP	12,038	54.690	658,358.220
GOLDMAN SACHS GROUP INC	71,008	163.440	11,605,547.520
HARLEY-DAVIDSON INC	36,670	40.700	1,492,469.000
HARRIS CORP	20,993	46.020	966,097.860
JEFFERIES GROUP INC NPR	18,639	24.000	447,336.000
CONSOL ENERGY INC	33,779	48.840	1,649,766.360
HASBRO INC	19,502	44.030	858,673.060
HENRY SCHEIN INC	13,991	67.620	946,071.420
DENBURY RESOURCES INC	62,511	23.350	1,459,631.850
HJ HEINZ CO	49,044	49.570	2,431,111.080
HELMERICH & PAYNE INC	15,984	61.930	989,889.120
HERSHEY FOODS CORP	23,225	52.280	1,214,203.000
HEWLETT-PACKARD CO	340,000	42.170	14,337,800.000
F5 NETWORKS INC	12,462	117.060	1,458,801.720
CROWN HOLDINGS INC NPR	24,661	37.890	934,405.290
REYNOLDS AMERICAN INC	49,821	33.750	1,681,458.750
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,066	42.440	639,401.040
HUMAN GENOME SCIENCES INC	28,494	24.920	710,070.480
JUNIPER NETWORKS INC	79,204	43.170	3,419,236.680
HOLOGIC INC	34,989	19.830	693,831.870
UNUM GROUP	49,083	26.230	1,287,447.090
HOME DEPOT INC	241,957	37.140	8,986,282.980
HORMEL FOODS CORP	24,530	26.820	657,894.600
HUDSON CITY BANCORP INC	62,940	11.180	703,669.200
CENTERPOINT ENERGY INC	56,954	15.470	881,078.380
HUMANA INC	24,958	62.720	1,565,365.760
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,239	40.790	621,598.810
RED HAT INC	30,089	40.590	1,221,312.510
BIOGEN IDEC INC	35,422	67.260	2,382,483.720
ILLINOIS TOOL WORKS	64,115	53.220	3,412,200.300
INTUIT INC	43,033	51.680	2,223,945.440
INTEL CORP	816,484	21.285	17,378,861.940
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,576	55.930	591,515.680
INTL GAME TECH	44,449	15.900	706,739.100
INTERNATIONAL PAPER CO	66,964	27.540	1,844,188.560
ITT CORP	26,239	57.560	1,510,316.840
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	69,653	11.620	809,367.860
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,580	48.830	956,091.400
JOHNSON & JOHNSON	415,020	60.250	25,004,955.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	68,367	28.710	1,962,816.570
JOHNSON CONTROLS INC	92,568	40.080	3,710,125.440
KLA-TENCOR CORP	24,308	47.780	1,161,436.240
DEVON ENERGY CORP	62,495	88.350	5,521,433.250
NSTAR	14,218	43.790	622,606.220
KELLOGG CO	37,319	53.100	1,981,638.900
KEYCORP	141,351	9.040	1,277,813.040
KIMBERLY-CLARK CORP	60,025	64.820	3,890,820.500
BLACKROCK INC/NEW YORK	13,142	201.200	2,644,170.400

KOHL'S CORP	45,466	53.800	2,446,070.800
KROGER CO	88,695	22.970	2,037,324.150
LSI CORP	110,142	6.260	689,488.920
LAM RESEARCH CORP	20,796	53.250	1,107,387.000
AKAMAI TECHNOLOGIES	27,255	39.660	1,080,933.300
LEGG MASON INC	22,970	35.510	815,664.700
LEGGETT & PLATT INC	19,896	22.440	446,466.240
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,481	32.120	1,043,289.720
ELI LILLY & CO	158,438	34.110	5,404,320.180
LIMITED BRANDS	42,413	32.140	1,363,153.820
LINCOLN NATIONAL CORP	46,505	30.910	1,437,469.550
LINEAR TECH CORP	29,045	33.970	986,658.650
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	109,953	73.680	8,101,337.040
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,348	41.150	1,948,370.200
LOCKHEED MARTIN CORP	44,007	80.220	3,530,241.540
LOEWS CORP	48,916	42.830	2,095,072.280
RANGE RESOURCES CORP	26,082	52.090	1,358,611.380
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,568	64.970	946,482.960
LOWE'S COS INC	212,394	25.110	5,333,213.340
LUBRIZOL CORP	11,172	105.760	1,181,550.720
DOMINION RESOURCES INC/VA	89,657	44.740	4,011,254.180
IRON MOUNTAIN INC	22,204	25.270	561,095.080
SCANA CORP	16,061	40.140	644,688.540
MDU RESOURCES GROUP INC	19,668	20.660	406,340.880
MGM RESORTS INTERNATIONAL	39,867	13.620	542,988.540
MCCORMICK & CO INC	16,978	47.020	798,305.560
MCDONALD'S CORPORATION	160,569	75.210	12,076,394.490
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	49,293	37.660	1,856,374.380
MCAFFEE INC	22,524	47.970	1,080,476.280
MANPOWER INC	13,462	62.560	842,182.720
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,245	84.580	1,374,002.100
MARSH & MCLENNAN COS	80,643	29.980	2,417,677.140
MARSHALL & ILSLEY CORP	82,632	7.610	628,829.520
ENERGIZER HOLDINGS INC	10,852	66.550	722,200.600
MASCO CORP	58,195	12.740	741,404.300
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	6,120	87.040	532,684.800
MATTEL INC	56,682	24.630	1,396,077.660
METLIFE INC	140,296	46.220	6,484,481.120
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	48,996	26.730	1,309,663.080
MEDTRONIC INC	159,287	39.500	6,291,836.500
ACTIVISION BLIZZARD INC	80,546	10.780	868,285.880
CVS CAREMARK CORP	201,227	32.510	6,541,889.770
MERCK & CO. INC.	459,372	32.030	14,713,685.160
MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	33,006	13.830	456,472.980
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,651	88.350	1,382,765.850
MICROSOFT CORP	1,144,943	26.760	30,638,674.680
MICRON TECH INC	134,484	10.910	1,467,220.440
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25,631	36.720	941,170.320
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	80,651	18.010	1,452,524.510
3M CO	99,247	90.030	8,935,207.410
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	56.920	509,889.360
PROGRESS ENERGY INC	47,954	45.150	2,165,123.100
MOTOROLA SOLUTIONS INC	48,368	37.530	1,815,251.040
MURPHY OIL CORPORATION	27,581	72.870	2,009,827.470
MYLAN LABORATORIES	52,377	22.130	1,159,103.010
ILLUMINA INC	17,594	68.100	1,198,151.400
XCEL ENERGY INC	76,825	23.520	1,806,924.000
NATIONAL OILWELL VARCO INC	63,577	77.890	4,952,012.530
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	37,397	15.050	562,824.850

NETAPP INC	54,353	50.840	2,763,306.520
SEARS HOLDINGS CORP	6,881	82.400	566,994.400
NEWFIELD EXPLORATION CO	22,269	69.320	1,543,687.080
NEWELL RUBBERMAID INC	41,069	19.230	789,756.870
DUN & BRADSTREET CORP	8,370	80.850	676,714.500
NEWMONT MINING CORP	71,728	54.760	3,927,825.280
NIKE INC-CL B	52,817	86.520	4,569,726.840
NOBLE ENERGY INC	26,663	86.760	2,313,281.880
NORDSTROM INC	26,726	45.000	1,202,670.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	55,333	64.110	3,547,398.630
NORTHEAST UTILITIES	29,133	33.170	966,341.610
NISOURCE INC	44,250	18.730	828,802.500
COACH INC	43,257	54.120	2,341,068.840
NORTHERN TRUST CORP	31,642	52.140	1,649,813.880
NORTHROP GRUMMAN CORP	42,168	67.000	2,825,256.000
WELLS FARGO & CO	754,934	31.440	23,735,124.960
NUCOR CORP	37,438	46.920	1,756,590.960
MONSANTO CO	77,191	70.540	5,445,053.140
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	68,735	50.630	3,480,053.050
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	124,018	101.760	12,620,071.680
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18,071	54.570	986,134.470
OLD REPUBLIC INTL CORP	38,339	12.210	468,119.190
OMNICARE INC	15,639	27.570	431,167.230
ORACLE CORP	609,018	32.250	19,640,830.500
OWENS-ILLINOIS INC	23,621	30.030	709,338.630
PACCAR INC	51,579	49.910	2,574,307.890
PALL CORP	16,605	53.650	890,858.250
EXELON CORP	99,073	41.200	4,081,807.600
PARKER HANNIFIN CORP	24,469	87.640	2,144,463.160
PATTERSON COS INC	13,261	32.640	432,839.040
PAYCHEX INC	45,660	32.540	1,485,776.400
JC PENNEY CO INC HOLDING CO	34,075	36.550	1,245,441.250
PPL CORPORATION	73,375	24.870	1,824,836.250
PEPSICO INC	239,954	63.030	15,124,300.620
PENTAIR INC	12,610	36.530	460,643.300
PERRIGO CO	11,741	72.400	850,048.400
PFIZER INC	1,202,153	18.900	22,720,691.700
CONOCOPHILLIPS	204,596	77.280	15,811,178.880
PETSMART INC	15,840	39.630	627,739.200
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	14,446	27.250	393,653.500
PG&E CORP	59,541	45.510	2,709,710.910
PITNEY BOWES INC	29,849	24.740	738,464.260
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,639	100.400	1,871,355.600
ALTRIA GROUP INC	318,900	24.710	7,880,019.000
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	79,775	61.170	4,879,836.750
AETNA INC	56,413	37.930	2,139,745.090
FLUOR CORP (NEW)	26,618	68.710	1,828,922.780
PPG INDUSTRIES INC	24,715	85.950	2,124,254.250
PRAXAIR INC	44,461	97.460	4,333,169.060
PRECISION CASTPARTS CORP	19,267	140.240	2,702,004.080

[前](#) [次](#)

平成23年2月25日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	COSTCO WHOLESALE CORP	66,240	72.980	4,834,195.200	
	T ROWE PRICE GROUP INC	38,520	66.300	2,553,876.000	
	QUEST DIAGNOSTICS	22,395	56.380	1,262,630.100	
	PROCTER & GAMBLE CO	422,849	63.050	26,660,629.450	
	PROGRESSIVE CORP	85,848	20.250	1,738,422.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	75,190	32.230	2,423,373.700	
	PULTE GROUP INC	52,991	6.970	369,347.270	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	62,881	18.290	1,150,093.490	
	QUALCOMM INC	240,257	57.800	13,886,854.600	
	US BANCORP	273,421	27.500	7,519,077.500	
	RALCORP HOLDINGS INC	9,036	64.320	581,195.520	
	ROSS STORES INC	16,911	70.860	1,198,313.460	
	ROPER INDUSTRIES INC	15,510	82.230	1,275,387.300	
	ROWAN COS INC	17,226	39.830	686,111.580	
	PEABODY ENERGY CORP	41,112	63.140	2,595,811.680	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	21,116	87.080	1,838,781.280	
	RAYTHEON COMPANY	58,666	50.890	2,985,512.740	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,269	64.620	728,202.780	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,505	77.250	657,011.250	
	FMC TECHNOLOGIES INC	18,402	89.500	1,646,979.000	
	KRAFT FOODS INC-A	266,712	31.780	8,476,107.360	
	SANDISK CORP	34,855	49.020	1,708,592.100	
	SAFEWAY INC	56,305	21.620	1,217,314.100	
	ROCKWELL COLLINS INC	23,208	64.250	1,491,114.000	
	ST JUDE MEDICAL INC	51,264	47.010	2,409,920.640	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	68,088	59.330	4,039,661.040	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	37,094	31.220	1,158,074.680	
	PRICELINE.COM INC	7,076	462.340	3,271,517.840	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	141,508	18.760	2,654,690.080	
	JOY GLOBAL INC	16,273	93.400	1,519,898.200	
	ZIMMER HOLDINGS INC	30,008	61.010	1,830,788.080	
	SPX CORP	9,093	78.290	711,890.970	
	SEI INVESTMENTS CO	20,856	22.400	467,174.400	
	WELLPOINT INC	61,216	66.090	4,045,765.440	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	41,426	36.730	1,521,576.980	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	29,280	40.340	1,181,155.200	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	51,227	33.380	1,709,957.260	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,280	81.120	1,077,273.600	
	SIGMA-ALDRICH	19,608	62.250	1,220,598.000	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	70,533	64.010	4,514,817.330	
	ADVANCE AUTO PARTS	12,466	61.320	764,415.120	
	UNITED STATES STEEL CORP	23,777	57.130	1,358,380.010	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	51,923	37.610	1,952,824.030	
	EDISON INTERNATIONAL	42,986	35.800	1,538,898.800	
	SOUTHERN CO	127,152	37.750	4,799,988.000	
	BB&T CORP	103,595	27.690	2,868,545.550	
	SOUTHWEST AIRLINES	15,732	11.760	185,008.320	
	AT&T INC	889,526	27.920	24,835,565.920	
	CHEVRON CORP	298,768	102.030	30,483,299.040	
	MEADWESTVACO CORP	22,905	29.220	669,284.100	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	23,521	74.230	1,745,963.830	
	STAPLES INC	114,366	20.710	2,368,519.860	
	STATE STREET CORP	76,270	44.270	3,376,472.900	
	STARBUCKS CORP	113,559	31.880	3,620,260.920	
	STRYKER CORP	43,744	61.560	2,692,880.640	

NETFLIX INC	6,637	215.180	1,428,149.660
SUNOCO INC	15,972	41.300	659,643.600
STERICYCLE INC	12,270	84.460	1,036,324.200
SUNTRUST BANKS INC	79,499	29.940	2,380,200.060
SYMANTEC CORP	110,233	17.820	1,964,352.060
SYNOPSYS INC	22,281	27.340	609,162.540
SYSCO CORP	88,122	27.780	2,448,029.160
INTUITIVE SURGICAL INC	5,976	328.010	1,960,187.760
TELEPHONE & DATA SYSTEMS INC	3,076	32.940	101,323.440
TEXAS INSTRUMENTS INC	171,033	35.430	6,059,699.190
TEXTRON INC	42,770	26.500	1,133,405.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	58,975	55.330	3,263,086.750
TIFFANY & CO	19,250	60.550	1,165,587.500
TOLL BROTHERS INC	17,548	20.940	367,455.120
TORCHMARK CORP	13,076	63.410	829,149.160
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	31,861	17.260	549,920.860
DAVITA INC	15,287	77.520	1,185,048.240
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	10,685	49.610	530,082.850
TYSON FOODS INC	47,556	18.290	869,799.240
URS CORP	11,295	45.440	513,244.800
MARATHON OIL CORP	108,408	48.130	5,217,677.040
UNION PACIFIC CORP	76,037	93.710	7,125,427.270
UNITED TECHNOLOGIES CORP	134,497	82.720	11,125,591.840
UNITEDHEALTH GROUP INC	162,340	42.750	6,940,035.000
SPRINT NEXTEL CORP	415,791	4.260	1,771,269.660
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18,206	67.880	1,235,823.280
VF CORP	12,722	96.000	1,221,312.000
CBS CORP	95,329	22.030	2,100,097.870
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30,017	43.580	1,308,140.860
VULCAN MATERIALS CO	20,011	43.300	866,476.300
URBAN OUTFITTERS INC	16,748	37.040	620,345.920
WALGREEN CO	137,054	41.320	5,663,071.280
WAL-MART STORES INC	299,304	52.090	15,590,745.360
WASTE MANAGEMENT INC	67,341	36.790	2,477,475.390
WATERS CORP	13,408	81.600	1,094,092.800
WASHINGTON POST	984	415.490	408,842.160
WATSON PHARMACEUTICALS INC	15,987	55.130	881,363.310
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,084	67.490	1,220,489.160
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	62,651	61.340	3,843,012.340
WESTERN DIGITAL CORP	34,951	30.690	1,072,646.190
WEYERHAEUSER CO	81,106	23.950	1,942,488.700
WHIRLPOOL CORP	11,190	80.690	902,921.100
WYNN RESORTS LTD	12,957	119.290	1,545,640.530
WHOLE FOODS MARKET INC	19,973	57.410	1,146,649.930
NASDAQ STOCK MARKET INC	23,790	28.020	666,595.800
CME GROUP INC	9,668	304.560	2,944,486.080
WILLIAMS COS INC	88,360	29.730	2,626,942.800
PEPCO HOLDINGS INC	29,814	18.460	550,366.440
ALLIANT ENERGY CORP	17,827	38.380	684,200.260
WISCONSIN ENERGY CORP	20,256	58.260	1,180,114.560
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,108	37.710	871,402.680
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	10,389	48.420	503,035.380
TD AMERITRADE HOLDING CORP	31,885	21.040	670,860.400
CARMAX INC	33,430	34.010	1,136,954.300
XEROX CORP	219,095	10.610	2,324,597.950
XILINX INC	39,758	32.970	1,310,821.260
YAHOO! INC	176,755	16.370	2,893,479.350
CIMAREX ENERGY CO	12,720	114.590	1,457,584.800
TJX COMPANIES INC	57,610	50.240	2,894,326.400

HOSPIRA INC	25,220	52.460	1,323,041.200
GENWORTH FINANCIAL INC	73,428	13.080	960,438.240
PETROHAWK ENERGY CORP	52,018	20.350	1,058,566.300
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	10,858	90.900	986,992.200
CB RICHARD ELLIS GROUP INC	25,354	24.210	613,820.340
LIBERTY GLOBAL INC	17,272	41.730	720,760.560
REGIONS FINANCIAL CORP	183,557	7.410	1,360,157.370
GOOGLE INC	37,362	608.820	22,746,732.840
METROPCS COMMUNICATIONS INC	35,132	13.530	475,335.960
LAS VEGAS SANDS CORP	51,811	44.980	2,330,458.780
MOSAIC CO/THE	23,023	82.200	1,892,490.600
NEWS CORP CLASS B	65,216	17.840	1,163,453.440
NEWS CORP INC CLASS A	251,665	16.760	4,217,905.400
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	8,633	51.120	441,318.960
CELANESE CORP	24,956	39.770	992,500.120
WINDSTREAM CORP	58,269	12.290	716,126.010
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	13,402	53.730	720,089.460
IHS INC-CLASS A	5,759	82.580	475,578.220
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	17,045	42.620	726,457.900
EXPEDIA INC	33,017	20.270	669,254.590
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,794	134.020	1,446,611.880
AMERIPRISE FINANCIAL INC	40,151	63.300	2,541,558.300
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	16,984	39.640	673,245.760
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	35,921	13.640	489,962.440
GAMESTOP CORP. - CL. A	23,332	19.510	455,207.320
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,509	123.640	1,299,332.760
VIACOM INC-CLASS B	83,312	43.940	3,660,729.280
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,402	245.300	834,510.600
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	12,917	24.110	311,428.870
NYSE EURONEXT	38,980	37.020	1,443,039.600
VIRGIN MEDIA INC	47,938	26.870	1,288,094.060
MASTERCARD INC	15,984	244.180	3,902,973.120
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	92,389	16.540	1,528,114.060
WESTERN UNION CO	90,185	21.000	1,893,885.000
SAIC INC	39,445	15.880	626,386.600
KBR INC	27,411	31.850	873,040.350
FIRST SOLAR INC	8,706	164.680	1,433,704.080
SPECTRA ENERGY CORP	99,681	26.100	2,601,674.100
TIME WARNER CABLE INC	53,676	70.900	3,805,628.400
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	51,685	12.910	667,253.350
DELTA AIR LINES INC	29,903	11.130	332,820.390
DISCOVER FINANCIAL	85,015	21.610	1,837,174.150
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,891	107.530	1,601,229.230
VMWARE INC	10,126	84.620	856,862.120
TERADATA CORP	24,722	46.870	1,158,720.140
CALPINE CORP NPR	39,350	14.670	577,264.500
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	272,431	62.290	16,969,726.990
VISA INC	71,528	73.910	5,286,634.480
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	32,682	35.840	1,171,322.880
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	27.080	777,873.000
LORILLARD INC	22,134	78.460	1,736,633.640
SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	15,156	51.440	779,624.640
LENDER PROCESSING SERVICES	16,352	33.200	542,886.400
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	22,552	37.860	853,818.720
CAREFUSION CORP	34,028	27.000	918,756.000
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	42,322	30.420	1,287,435.240
VERISK ANALYTICS INC	15,668	32.440	508,269.920
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	31,156	59.210	1,844,746.760
CIT GROUP INC	29,747	43.200	1,285,070.400

	DOLLAR GENERAL CORP	13,004	28.350	368,663.400
	QEP RESOURCES INC	27,559	37.940	1,045,588.460
	GENERAL MOTORS CO	71,296	33.020	2,354,193.920
米ドル小計	銘柄数 : 570	48,692,502		1,815,284,873.980
	組入時価比率 : 52.57%			(148,780,748,271)
	合計時価比率 : 53.55%			
英ポンド	XSTRATA PLC	315,220	13.595	4,285,415.900
	AMEC PLC	37,458	11.540	432,265.320
	ANTOFAGASTA PLC	58,837	13.480	793,122.760
	SEVERN TRENT PLC	32,783	14.510	475,681.330
	BHP BILLITON PLC	322,466	23.605	7,611,809.930
	BARCLAYS PLC	1,748,091	3.125	5,462,784.370
	BALFOUR BEATTY PLC	45,234	3.467	156,826.270
	AUTONOMY CORP PLC	33,254	16.300	542,040.200
	BT GROUP PLC	1,093,246	1.760	1,924,112.960
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	176,393	7.555	1,332,649.110
	AGGREKO PLC	44,550	13.890	618,799.500
	TULLOW OIL PLC	133,561	13.890	1,855,162.290
	BUNZL PLC	45,259	7.400	334,916.600
	CAPITA GROUP PLC	90,670	7.180	651,010.600
	AVIVA PLC	418,434	4.481	1,875,002.750
	DIAGEO PLC	373,778	11.970	4,474,122.660
	SCHRODERS PLC	15,818	17.320	273,967.760
	NATIONAL GRID PLC	520,429	5.660	2,945,628.140
	LONMIN	24,209	17.500	423,657.500
	KINGFISHER PLC	336,453	2.511	844,833.480
	BAE SYSTEMS PLC	521,872	3.255	1,698,693.360
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	300,149	23.965	7,193,070.780
	MAN GROUP PLC	271,583	2.809	762,876.640
	COBHAM PLC	193,291	2.165	418,475.010
	FIRSTGROUP PLC	78,089	3.630	283,463.070
	NEXT PLC	27,896	19.830	553,177.680
	REXAM PLC	155,173	3.567	553,502.090
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	150,005	19.630	2,944,598.150
	JOHNSON MATTHEY PLC	34,968	18.120	633,620.160
	SABMILLER PLC	144,503	20.270	2,929,075.810
	ANGLO AMERICAN PLC	191,100	31.785	6,074,113.500
	COMPASS GROUP PLC	288,611	5.460	1,575,816.060
	HSBC HOLDINGS PLC	2,606,233	6.948	18,108,106.880
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	911,820	1.160	1,057,711.200
	ARM HOLDINGS PLC	206,868	5.735	1,186,387.980
	CENTRICA PLC	791,517	3.336	2,640,500.710
	UNILEVER PLC	189,880	18.250	3,465,310.000
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	327,631	2.792	914,745.750
	INTL POWER PLC	230,301	3.267	752,393.360
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	119,146	5.810	692,238.260
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	507,864	1.389	705,423.090
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	52,877	10.220	540,402.940
	PEARSON PLC	120,001	10.130	1,215,610.130
	PRUDENTIAL PLC	386,040	6.805	2,627,002.200
	RIO TINTO PLC	211,705	41.700	8,828,098.500
	VODAFONE GROUP PLC	7,811,349	1.732	13,529,256.460
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	94,259	31.920	3,008,747.280
	REED ELSEVIER PLC	185,486	5.430	1,007,188.980
	OLD MUTUAL PLC	846,878	1.301	1,101,788.270
	ROLLS ROYCE GROUP	283,852	6.080	1,725,820.160
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,733,986	0.456	1,246,697.610
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	146,128	12.180	1,779,839.040
	SERCO GROUP PLC	87,197	5.435	473,915.690

	BP PLC	2,778,630	4.930	13,698,645.900
	SAGE GROUP PLC(THE)	220,158	2.805	617,543.190
	INVENSYS PLC	136,685	3.466	473,750.210
	SMITHS GROUP PLC	59,731	13.240	790,838.440
	STANDARD CHARTERED PLC	356,660	15.985	5,701,210.100
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,240,783	0.657	4,100,194.430
	BG GROUP PLC	494,687	14.810	7,326,314.470
	TESCO PLC	1,203,950	4.019	4,838,675.050
	3I GROUP PLC	140,522	3.077	432,386.190
	SMITH & NEPHEW PLC	122,605	7.100	870,495.500
	GLAXOSMITHKLINE PLC	776,222	11.780	9,143,895.160
	WEIR GROUP	19,104	16.080	307,192.320
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	27,822	8.930	248,450.460
	BABCOCK INT'L GROUP	60,664	5.485	332,742.040
	ASTRAZENECA PLC	212,126	29.450	6,247,110.700
	WHITBREAD PLC	27,936	17.490	488,600.640
	CARNIVAL PLC	26,075	26.850	700,113.750
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	242,817	3.478	844,517.520
	INTERTEK GROUP PLC	28,006	17.380	486,744.280
	BURBERRY GROUP PLC	61,455	11.400	700,587.000
	INVESTEC PLC	83,969	4.619	387,852.810
	CAIRN ENERGY	224,914	4.232	951,836.040
	INTERCONTINENTAL HOTELS	41,175	13.250	545,568.750
	VEDANTA RESOURCES PLC	16,418	22.680	372,360.240
	ICAP PLC	87,128	5.095	443,917.160
	ITV PLC	516,632	0.825	426,221.400
	SAINSBURY (J) PLC	181,016	3.722	673,741.550
	G4S PLC	201,526	2.634	530,819.480
	ADMIRAL GROUP PLC	29,856	16.590	495,311.040
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	536,015	22.075	11,832,531.120
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	392,056	21.900	8,586,026.400
	INMARSAT PLC	62,616	6.565	411,074.040
	KAZAKHMYS PLC	34,134	14.010	478,217.340
	STANDARD LIFE PLC	346,532	2.353	815,389.790
	HOME RETAIL GROUP	142,584	2.212	315,395.800
	EXPERIAN PLC	150,404	7.555	1,136,302.220
	THOMAS COOK GROUP PLC	129,781	1.889	245,156.300
	TUI TRAVEL PLC	96,617	2.365	228,499.200
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	42,150	9.280	391,152.000
	FRESNILLO PLC NPR	26,632	15.520	413,328.640
	ESSAR ENERGY PLC	39,162	4.910	192,285.420
	CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	429,358	0.718	308,279.040
	RESOLUTION LTD	208,800	2.785	581,508.000
	SHIRE PLC	85,724	16.850	1,444,449.400
	WPP PLC	182,393	8.205	1,496,534.560
	WOLSELEY PLC	45,294	21.000	951,174.000
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	12,861	50.050	643,693.050
	PETROFAC LTD	40,996	13.820	566,564.720
英債券小計	銘柄数 : 101	44,697,782		223,756,673.090
	組入時価比率 : 10.45%			(29,573,919,482)
	合計時価比率 : 10.64%			
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	24,705	67.700	1,672,528.500
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	19,198	26.290	504,715.420
	BARRICK GOLD CORP	153,369	50.230	7,703,724.870
	TMX GROUP INC	5,512	40.720	224,448.640
	TALISMAN ENERGY INC	155,897	24.010	3,743,086.970
	BANK OF MONTREAL	85,976	61.770	5,310,737.520
	BANK OF NOVA SCOTIA	156,212	59.350	9,271,182.200

NATIONAL BANK OF CANADA	25,510	73.600	1,877,536.000
BCE INC	40,524	35.400	1,434,549.600
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	77,427	31.900	2,469,921.300
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	41,678	39.400	1,642,113.200
BOMBARDIER INC 'B'	215,110	6.100	1,312,171.000
SAPUTO INC	19,337	40.740	787,789.380
RESEARCH IN MOTION LTD	67,931	64.790	4,401,249.490
CGI GROUP INC	44,501	19.450	865,544.450
CAE INC	50,233	12.370	621,382.210
CAMECO CORP	63,356	39.450	2,499,394.200
ROGERS COMM-CL B	62,118	34.250	2,127,541.500
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	59,768	82.430	4,926,676.240
CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,993	47.060	7,811,630.580
NEXEN INC	79,788	25.380	2,025,019.440
CANADIAN TIRE CORP-CL A	11,281	62.030	699,760.430
CANADIAN UTILITIES LTD	13,725	50.650	695,171.250
CANADIAN NATL RAILWAY CO	70,719	69.810	4,936,893.390
AGRIUM INC	24,811	90.050	2,234,230.550
YAMANA GOLD INC	126,445	12.040	1,522,397.800
GILDAN ACTIVEWEAR INC	19,386	30.480	590,885.280
OPEN TEXT CORP	9,281	56.770	526,882.370
ELDORADO GOLD CORP	91,513	16.160	1,478,850.080
OSISKO MINING CORP	40,858	13.450	549,540.100
KINROSS GOLD CORP	166,088	15.330	2,546,129.040
FINNING INTERNATIONAL INC	30,080	27.260	819,980.800
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	7,595	25.410	192,988.950
FORTIS INC	24,644	32.650	804,626.600
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	13,417	112.900	1,514,779.300
TELUS CORP-NON VOTE	29,878	45.640	1,363,631.920
GREAT WEST LIFE CO INC	45,535	26.980	1,228,534.300
IAMGOLD CORP	48,222	19.330	932,131.260
IMPERIAL OIL LTD	41,808	49.720	2,078,693.760
ENBRIDGE INC	55,928	57.080	3,192,370.240
IGM FINANCIAL INC	19,774	46.190	913,361.060
IVANHOE MINES LTD/CA	49,841	26.010	1,296,364.410
MANULIFE FINANCIAL CORP	270,518	18.290	4,947,774.220
LOBLAW CO LTD	17,526	38.870	681,235.620
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,264	31.420	1,327,934.880
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	16,912	40.260	680,877.120
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,562	49.630	1,616,052.060
SUN LIFE FINANCIAL INC	73,854	32.220	2,379,575.880
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,141	373.120	1,171,969.920
INMET MINING CORPORATION	6,327	67.270	425,617.290
METRO INC	16,380	43.700	715,806.000
HUSKY ENERGY INC	39,604	29.070	1,151,288.280
CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,887	45.760	1,642,189.120
NIKO RESOURCES LTD	7,050	81.860	577,113.000
ONEX CORP	17,569	34.000	597,346.000
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,683	36.050	709,572.150
GOLDCORP INC	119,042	44.450	5,291,416.900
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	137,373	57.060	7,838,503.380
POWER CORP OF CANADA	51,913	28.280	1,468,099.640
POWER FINANCIAL CORP	28,546	30.720	876,933.120
ROYAL BANK OF CANADA	216,450	56.640	12,259,728.000
SNC-LAVALIN GROUP INC	25,493	55.500	1,414,861.500
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	26,819	64.910	1,740,821.290
SHAW COMM INC-B	56,820	20.630	1,172,196.600
SHERRITT INTERNATIONAL CORP	51,741	8.900	460,494.900

	SINO-FOREST CORP	38,862	21.150	821,931.300	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	34,176	40.560	1,386,178.560	
	SUNCOR ENERGY INC	236,771	44.000	10,417,924.000	
	ENCANA CORP	112,016	31.500	3,528,504.000	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	83,853	52.580	4,408,990.740	
	THOMSON REUTERS CORP	59,197	38.240	2,263,693.280	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	133,464	79.350	10,590,368.400	
	TRANSCANADA CORP	104,862	38.150	4,000,485.300	
	TRANSALTA CORP	34,014	20.600	700,688.400	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,625	68.560	659,890.000	
	CENTERRA GOLD INC	9,187	17.110	157,189.570	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	28,115	12.910	362,964.650	
	INTACT FINANCIAL CORP	17,942	50.130	899,432.460	
	SILVER WHEATON CORP	49,630	38.000	1,885,940.000	
	VITERRA INC NPR	63,352	11.470	726,647.440	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	15,770	32.770	516,782.900	
	CI FINANCIAL CORP	23,137	22.490	520,351.130	
	PETROBAKKEN ENERGY LTD	11,734	22.020	258,382.680	
	TIM HORTONS INC	27,358	41.940	1,147,394.520	
	BAYTEX ENERGY CORP	13,717	53.890	739,209.130	
	MEG ENERGY CORP	4,381	47.930	209,981.330	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	38,473	16.500	634,804.500	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	114,147	36.830	4,204,034.010	
	ENERPLUS CORP	20,936	31.500	659,484.000	
	YELLOW MEDIA INC	41,248	5.580	230,163.840	
	VERMILION ENERGY INC	13,868	50.430	699,363.240	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	61,513	27.520	1,692,837.760	
	ARC RESOURCES LTD	24,544	26.480	649,925.120	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	51,000	29.460	1,502,460.000	
	BONAVISTA ENERGY CORP	4,802	30.510	146,509.020	
	PENGROWTH ENERGY CORP	35,994	12.340	444,165.960	
カナダドル 小計	銘柄数 : 96	5,386,134		201,565,229.710	
	組入時価比率 : 5.94%			(16,820,618,419)	
	合計時価比率 : 6.05%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	33,938	16.200	549,795.600	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	160,529	42.770	6,865,825.330	
	SYNGENTA AG	13,915	302.100	4,203,721.500	
	LOGITECH INTL-REG	27,879	17.310	482,585.490	
	NESTLE SA-REGISTERED	521,814	52.650	27,473,507.100	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	80,420	52.300	4,205,966.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	104,971	136.700	14,349,535.700	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,135	101.000	720,635.000	
	SIKA INHABER	325	1,952.000	634,400.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	861	1,565.000	1,347,465.000	
	SWISS RE-REG	53,667	55.950	3,002,668.650	
	NOVARTIS AG-REG SHS	319,033	51.150	16,318,537.950	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,984	98.750	887,170.000	
	SWISSCOM AG-REG	3,764	404.700	1,523,290.800	
	ABB LTD	334,715	22.290	7,460,797.350	
	ADECCO SA-REG	18,303	60.700	1,110,992.100	
	GEBERIT AG	5,934	197.800	1,173,745.200	
	LONZA GROUP AG-REG	6,109	79.000	482,611.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	27	28,220.000	761,940.000	
	UBS AG-REGISTERED	530,787	18.130	9,623,168.310	
	GIVAUDAN-REG	1,382	912.000	1,260,384.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	20,409	265.000	5,408,385.000	
	HOLCIM LTD-REG	30,745	67.150	2,064,526.750	

	ACTELION	14,440	51.300	740,772.000	
	SONOVA HOLDING AG	7,134	121.100	863,927.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,495	121.200	1,029,594.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,476	224.600	331,509.600	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,604	387.300	1,783,129.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	8,522	70.950	604,635.900	
	SCHINDLER NAMEN	4,151	100.400	416,760.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,952	149.000	737,848.000	
	ARYZTA AG	13,689	43.350	593,418.150	
	JULIUS BAER GROUP LTD	33,938	40.690	1,380,937.220	
	TRANSOCEAN LTD	44,875	74.000	3,320,750.000	
	SYNTHESES INC	9,280	127.000	1,178,560.000	
スイスフラン 小計	銘柄数 : 35	2,441,202		124,893,495.700	
	組入時価比率 : 3.91%			(11,065,563,719)	
	合計時価比率 : 3.98%				

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年2月25日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
スウェーデン クローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	10,366	557.500	5,779,045.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	95,060	154.000	14,639,240.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	69,569	138.600	9,642,263.400	
	ERICSSON LM-B SHS	443,075	78.700	34,870,002.500	
	GETINGE AB-B SHS	27,977	151.300	4,232,920.100	
	SKF AB-B SHS	57,192	166.900	9,545,344.800	
	SANDVIK AB	158,062	116.800	18,461,641.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	214,074	55.950	11,977,440.300	
	SKANSKA AB-B SHS	58,507	126.500	7,401,135.500	
	SWEDBANK AB	110,549	107.000	11,828,743.000	
	SSAB AB-A	26,362	98.800	2,604,565.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	87,453	104.800	9,165,074.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	65,642	208.600	13,692,921.200	
	VOLVO AB-B SHS	191,074	105.800	20,215,629.200	
	HOLMEN AB-B SHS	840	222.300	186,732.000	
	SCANIA AB	55,960	136.000	7,610,560.000	
	SWEDISH MATCH AB	37,451	196.900	7,374,101.900	
	TELE2 AB-B SHS	55,285	142.400	7,872,584.000	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,708	414.800	3,197,278.400	
	NORDEA AB	445,000	71.000	31,595,000.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	155.200	5,988,236.800	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	72.500	3,846,487.500	
	INVESTOR AB-B SHS	69,415	143.300	9,947,169.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	156,138	203.900	31,836,538.200	
	ASSA ABLOY AB-B	48,208	174.700	8,421,937.600	
	TELIASONERA AB	340,061	54.000	18,363,294.000	
	BOLIDEN AB	44,557	129.400	5,765,675.800	
	ALFA LAVAL AB	55,244	126.300	6,977,317.200	
	KINNEVIK INVESTMENT B	38,973	139.700	5,444,528.100	
	HUSQVARNA AB-B SHS	66,807	50.750	3,390,455.250	
	RATOS AB	16,902	229.300	3,875,628.600	
	HEXAGON AB	46,285	132.600	6,137,391.000	
スウェーデン クローネ小計	銘柄数 : 32	3,191,435		341,886,882.450	
	組入時価比率 : 1.55%			(4,393,246,439)	
	合計時価比率 : 1.58%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	51,397	10.320	530,417.040	
	OMV AG	19,320	30.950	597,954.000	
	VERBUND AG	10,151	28.370	287,983.870	
	VOEST-ALPINE AG	17,613	32.130	565,905.690	
	ERSTE GROUP BANK AG	31,044	38.000	1,179,672.000	
	IMMOFINANZ AG	152,609	3.085	470,798.760	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	42.710	388,618.290	
	UMICORE	18,212	36.155	658,454.860	
	DELHAIZE GROUP	15,041	56.200	845,304.200	
	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	25,919	29.890	774,718.910	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	107,191	39.995	4,287,104.040	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.003	118.220	
	SOLVAY SA	8,874	82.900	735,654.600	
	MOBISTAR SA	2,227	45.695	101,762.760	
	AGEAS	329,447	2.217	730,383.990	
	UCB SA	13,421	27.060	363,172.260	
	COLRUYT NV	14,070	36.400	512,148.000	
	BEKAERT NV	2,702	73.930	199,758.860	

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,830	66.410	852,040.300
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.009	4.640
DEXIA	82,352	3.067	252,573.580
BELGACOM SA	27,540	27.250	750,465.000
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD NPR	138,160	3.050	421,388.000
ADIDAS AG	32,657	45.660	1,491,118.620
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	50,066	57.000	2,853,762.000
COMMERZBANK AG	113,034	6.130	692,898.420
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,719	65.110	1,088,574.090
UNITED INTERNET	16,729	11.780	197,067.620
MAN SE	16,343	85.850	1,403,046.550
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	9,936	41.130	408,667.680
GEA GROUP AG	28,135	21.285	598,853.470
CONTINENTAL AG	7,740	58.000	448,920.000
DEUTSCHE POST AG-REG	126,843	13.095	1,661,009.080
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	14,421	55.000	793,155.000
MERCK KGAA	9,310	64.720	602,543.200
RWE AG	63,555	49.390	3,138,981.450
RWE AG-N VTG PFD	6,189	47.870	296,267.430
SAP AG	127,312	42.880	5,459,138.560
E.ON AG	264,134	23.845	6,298,275.230
HENKEL AG & CO KGAA	20,540	35.985	739,131.900
METRO AG	18,581	52.500	975,502.500
SIEMENS AG-REG	120,159	93.810	11,272,115.790
PUMA AG	1,129	209.600	236,638.400
BAYER AG	127,097	55.000	6,990,335.000
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	25,692	42.620	1,094,993.040
DAIMLER AG	138,109	50.490	6,973,123.410
BASF SE	141,020	59.000	8,320,180.000
CELESIO AG	13,447	19.875	267,259.120
BEIERSDORF AG	13,871	43.105	597,909.450
HOCHTIEF AG	6,942	69.490	482,399.580
HEIDELBERGCEMENT AG	21,539	49.680	1,070,057.520
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	29,260	47.305	1,384,144.300
ALLIANZ SE	69,535	101.800	7,078,663.000
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,098	14.530	539,033.940
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	28,784	119.800	3,448,323.200
SALZGITTER	6,090	59.010	359,370.900
VOLKSWAGEN AG	2,782	104.800	291,553.600
VOLKSWAGEN AG PFD	25,705	112.450	2,890,527.250
THYSSENKRUPP AG	50,311	29.475	1,482,916.720
TUI AG	18,532	9.410	174,386.120
LINDE AG	24,880	107.950	2,685,796.000
DEUTSCHE BANK AG-REG	142,863	45.820	6,545,982.660
BMW VORZUG	9,751	37.600	366,637.600
K & S	20,562	54.360	1,117,750.320
SUEDZUCKER AG	8,126	20.005	162,560.630
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	424,754	9.920	4,213,559.680
INFINEON TECHNOLOGIES AG	172,852	7.663	1,324,564.870
DEUTSCHE BOERSE AG	30,778	55.120	1,696,483.360
FRAPORT AG	5,722	50.010	286,157.220
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	7,732	52.120	402,991.840
WACKER-CHEMIE GMBH	2,443	131.400	321,010.200
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,438	38.540	132,500.520
BRENNTAG AG	1,842	72.960	134,392.320
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	45,024	14.340	645,644.160
IBERDROLA SA	622,136	6.206	3,860,976.010
INDRA SISTEMAS SA	14,163	13.960	197,715.480
REPSOL YPF SA	114,767	23.880	2,740,635.960

TELEFONICA S.A	606,744	18.000	10,921,392.000
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,850	32.640	745,824.000
BANKINTER S.A.	41,581	4.705	195,638.600
ACERINOX SA	17,369	12.750	221,454.750
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	652,635	8.759	5,716,429.960
ACCIONA S.A.	3,982	67.300	267,988.600
GAS NATURAL SDG SA	37,078	12.250	454,205.500
BANCO SANTANDER SA	1,260,781	8.743	11,023,008.280
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	12,298	37.770	464,495.460
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	10,230	22.385	228,998.550
BANCO POPULAR ESPANOL	146,617	4.378	641,889.220
BANCO SABADELL	145,368	3.109	451,949.110
INDITEX	35,155	53.150	1,868,488.250
MAPFRE SA	115,526	2.620	302,678.120
ENAGAS	22,140	15.425	341,509.500
GESTEVISION TELECINCO SA	20,321	8.810	179,028.010
GRIFOLS SA	10,798	11.590	125,148.820
FERROVIAL SA	73,959	8.621	637,600.530
CRITERIA CAIXACORP SA	149,185	5.068	756,069.580
IBERDROLA RENOVABLES	121,313	2.664	323,177.830
EDP RENOVAVEIS SA	38,800	4.350	168,780.000
AMADEUS IT HOLDING SA	26,144	14.310	374,120.640
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	167,491	2.647	443,348.670
KESKO OYJ-B	11,627	30.700	356,948.900
WARTSILA OYJ	13,218	53.200	703,197.600
NOKIAN RENKAAT OYJ	17,124	28.930	495,397.320
OUTOKUMPU OYJ	22,458	12.830	288,136.140
RAUTARUUKKI OYJ	5,312	16.510	87,701.120
UPM-KYMMENE OYJ	79,405	14.350	1,139,461.750
STORA ENSO OYJ-R SHS	88,398	8.155	720,885.690
SAMPO OYJ-A SHS	51,765	21.880	1,132,618.200
FORTUM OYJ	70,526	22.110	1,559,329.860
NOKIA OYJ	539,386	6.230	3,360,374.780
POHJOLA BANK PLC	23,199	9.810	227,582.190
ELISA CORP	20,563	16.530	339,906.390
METSO OYJ	21,261	36.080	767,096.880
NESTE OIL OYJ	23,509	12.650	297,388.850
KONE OYJ	24,265	38.400	931,776.000
ORION OYJ	12,180	16.400	199,752.000
AIR LIQUIDE	42,224	91.880	3,879,541.120
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	62,093	20.770	1,289,671.610
ERAMET	959	257.000	246,463.000
AXA	258,522	14.745	3,811,906.890
VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,269	23.310	1,195,080.390
DANONE	85,887	44.750	3,843,443.250
SAFRAN SA	29,066	25.105	729,701.930
ACCOR SA	23,704	32.700	775,120.800
BOUYGUES	27,508	32.780	901,712.240
BNP PARIBAS	146,442	54.650	8,003,055.300
THALES SA	9,053	26.640	241,171.920
CAP GEMINI SA	23,487	41.650	978,233.550
CASINO GUICHARD PERRACHON	7,870	70.960	558,455.200
CHRISTIAN DIOR	7,525	101.350	762,658.750
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	23,542	23.810	560,535.020
ALCATEL-LUCENT	374,010	3.342	1,249,941.420
NATIXIS	130,004	4.260	553,817.040
EIFFAGE	6,803	40.350	274,501.050

PUBLICIS GROUPE	18,014	39.745	715,966.430
IMERYSA SA	5,944	49.495	294,198.280
LAFARGE SA	29,460	43.700	1,287,402.000
L'OREAL	34,914	83.070	2,900,305.980
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	37,576	111.200	4,178,451.200
LAGARDERE S.C.A.	17,950	32.000	574,400.000
MICHELIN(CGDE)-B	26,638	57.430	1,529,820.340
PERNOD-RICARD	28,991	66.230	1,920,073.930
PEUGEOT SA	22,742	28.055	638,026.810
RENAULT SA	28,148	42.100	1,185,030.800
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	60,122	40.775	2,451,474.550
SOCIETE GENERALE-A	96,697	48.570	4,696,573.290
VINCI S.A.	66,410	42.360	2,813,127.600
SODEXO	14,377	49.055	705,263.730
SCHNEIDER ELECTRIC SA	37,222	114.500	4,261,919.000
VIVENDI SA	189,125	20.150	3,810,868.750
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,748	68.710	1,082,045.080
TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	21,519	13.490	290,291.310
TOTAL SA	308,253	43.655	13,456,784.710
AIR FRANCE	24,369	11.655	284,020.690
VALLOUREC	16,293	72.550	1,182,057.150
FRANCE TELECOM SA	285,037	15.960	4,549,190.520
BIC	3,183	61.710	196,422.930
DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	55.010	542,508.620
PPR	11,844	110.500	1,308,762.000
CNP ASSURANCES	22,436	15.400	345,514.400
NEOPOST SA	4,207	65.990	277,619.930
CARREFOUR SA	84,238	34.650	2,918,846.700
ATOS ORIGIN	6,851	39.525	270,785.770
SANOFI-AVENTIS	153,912	49.310	7,589,400.720
STMICROELECTRONICS NV	97,120	9.041	878,061.920
M6-METROPOLE TELEVISION	9,651	17.710	170,919.210
EURAZEO	4,851	51.860	251,572.860
ESSILOR INTL	28,810	51.520	1,484,291.200
CREDIT AGRICOLE SA	147,617	12.390	1,828,974.630
ILIAD SA	2,768	79.350	219,640.800
BIOMERIEUX	2,655	77.210	204,992.550
PAGESJAUNES GROUPE SA	24,382	6.925	168,845.350
GDF SUEZ	177,743	28.805	5,119,887.110
ALSTOM	31,638	42.525	1,345,405.950
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	28.000	488,600.000
ELECTRICITE DE FRANCE	36,351	31.620	1,149,418.620
LEGRAND SA	21,721	28.900	627,736.900
ADP	5,321	62.800	334,158.800
SCOR SE	26,944	20.610	555,315.840
BUREAU VERITAS SA	7,690	54.280	417,413.200
GROUPE EUROTUNNEL SA	74,636	7.108	530,512.680
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	43,144	15.480	667,869.120
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310
EDENRED	23,704	18.845	446,701.880
ALPHA BANK A.E.	71,683	5.010	359,131.830
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	26,713	19.610	523,841.930
NATIONAL BANK OF GREECE	149,407	7.010	1,047,343.070
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	33,942	7.250	246,079.500
EFG EUROBANK ERGASIAS	18,666	4.770	89,036.820
OPAP SA	37,174	15.010	557,981.740
PUBLIC POWER CORP	15,123	11.610	175,578.030
CRH PLC	114,679	16.000	1,834,864.000
KERRY GROUP PLC-A	24,173	26.150	632,123.950

ELAN CORPORATION PLC	79,484	4.610	366,421.240
ANGLO IRISH BANK CORP	91,316	0.160	14,610.560
ASSICURAZIONI GENERALI	171,461	15.810	2,710,798.410
INTESA SANPAOLO	1,159,601	2.388	2,769,127.180
INTESA SANPAOLO-RNC	137,310	2.060	282,858.600
UNICREDIT SPA	2,039,486	1.840	3,752,654.240
ENI SPA	399,340	17.300	6,908,582.000
MEDIOBANCA SPA	67,179	7.385	496,116.910
PIRELLI & C	43,558	5.660	246,538.280
SAIPEM	40,273	34.620	1,394,251.260
LUXOTTICA GROUP SPA	20,352	21.640	440,417.280
MEDIASET SPA	120,446	4.482	539,838.970
AUTOGRILL SPA	17,657	10.130	178,865.410
A2A SPA	207,015	1.126	233,098.890
FIAT SPA	119,079	6.695	797,233.900
ENEL SPA	925,169	4.250	3,931,968.250
FINMECCANICA SPA	67,914	9.000	611,226.000
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	336,391	0.958	322,262.570
SNAM RETE GAS	242,930	3.868	939,653.240
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	89,526	7.215	645,930.090
TELECOM ITALIA SPA	1,409,797	1.046	1,474,647.660
TELECOM ITALIA-RNC	897,290	0.879	788,717.910
ATLANTIA SPA	43,519	16.280	708,489.320
TERNA SPA	229,678	3.320	762,530.960
EXOR SPA	8,976	21.760	195,317.760
PARMALAT SPA	202,091	2.188	442,175.100
PRYSMIAN SPA	22,204	15.000	333,060.000
BANCO POPOLARE SPA	246,216	2.528	622,434.040
ENEL GREEN POWER SPA	134,751	1.750	235,814.250
FIAT INDUSTRIAL SPA	119,079	9.815	1,168,760.380
ARCELOR MITTAL (NL)	129,793	25.940	3,366,830.420
TENARIS SA	72,386	16.340	1,182,787.240
SES FDR	46,853	18.280	856,472.840
BOSKALIS WESTMINSTER CT	12,092	36.800	444,985.600
REED ELSEVIER NV	112,017	9.428	1,056,096.270
KONINKLIJKE DSM NV	16,599	42.120	699,149.880
SBM OFFSHORE NV	23,374	18.040	421,666.960
ING GROEP NV-CVA	587,141	8.879	5,213,224.930
RANDSTAD HOLDINGS	17,460	38.710	675,876.600
KONINKLIJKE AHOLD NV	175,097	9.741	1,705,619.870
HEINEKEN NV	38,530	37.245	1,435,049.850
AKZO NOBEL	35,469	49.015	1,738,513.030
ASML HOLDING NV	66,823	31.100	2,078,195.300
AEGON NV	248,023	5.391	1,337,091.990
TNT NV	57,215	18.980	1,085,940.700
UNILEVER NV-CVA	236,553	21.710	5,135,565.630
PHILIPS ELECTRONICS NV	149,945	23.020	3,451,733.900
WOLTERS KLUWER-CVA	44,589	16.765	747,534.580
QIAGEN N.V.	38,295	14.830	567,914.850
VOPAK (KON.)	11,504	33.770	388,490.080
KONINKLIJKE KPN NV	237,161	11.610	2,753,439.210
HEINEKEN HOLDING NV-A	18,770	32.715	614,060.550
FUGRO CERT	11,788	59.760	704,450.880
DELTA LLOYD NV	5,056	17.400	87,974.400
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	83,470	3.174	264,933.780
JERONIMO MARTINS	40,183	11.510	462,506.330
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	83,454	8.230	686,826.420
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,762	2.760	755,583.120
BRISA	33,394	5.161	172,346.430

	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	310,491	0.639	198,403.740	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	42,296	15.265	645,648.440	
ユーロ小計	銘柄数 : 254	26,582,678		371,621,162.470	
	組入時価比率 : 14.86%			(42,063,799,380)	
	合計時価比率 : 15.14%				
デンマーククローネ	CARLSBERG AS-B	15,339	569.500	8,735,560.500	
	A P MOLLER A/S	175	52,850.000	9,248,750.000	
	AP MOLLER MAERSK A	82	51,450.000	4,218,900.000	
	DANSKE BANK A/S	69,141	125.800	8,697,937.800	
	NOVOZYMES-B SHS	8,172	749.000	6,120,828.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	63,653	655.500	41,724,541.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,950	175.400	5,253,230.000	
	COLOPLAST-B	3,308	757.500	2,505,810.000	
	DSV A/S	29,112	118.000	3,435,216.000	
	WILLIAM DEMANT	3,754	443.200	1,663,772.800	
	TRYG A/S	4,588	279.000	1,280,052.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 11	227,274		92,884,598.600	
	組入時価比率 : 0.50%			(1,409,988,207)	
	合計時価比率 : 0.51%				
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	42,750	211.900	9,058,725.000	
	ACERGY SA	43,150	141.700	6,114,355.000	
	DNB HOLDING ASA	154,436	84.800	13,096,172.800	
	NORSK HYDRO ASA	129,248	43.720	5,650,722.560	
	TELENOR ASA	115,972	89.850	10,420,084.200	
	ORKLA ASA	114,066	50.100	5,714,706.600	
	STATOIL ASA	160,121	148.000	23,697,908.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,265	286.200	8,089,443.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	25,474	118.000	3,005,932.000	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	83,784	19.480	1,632,112.320	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 10	897,266		86,480,161.480	
	組入時価比率 : 0.45%			(1,263,475,159)	
	合計時価比率 : 0.45%				
香港ドル	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	46,000	24.250	1,115,500.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	40,500	63.600	2,575,800.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	425,000	5.470	2,324,750.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	384,000	31.300	12,019,200.000	
	BANK OF EAST ASIA	229,260	32.900	7,542,654.000	
	CLP HOLDINGS LTD	314,500	62.950	19,797,775.000	
	PCCW LTD	581,000	3.430	1,992,830.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	150,000	17.080	2,562,000.000	
	LI & FUNG LTD	398,200	46.200	18,396,840.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	215,000	116.600	25,069,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	76,000	37.600	2,857,600.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	154,400	164.100	25,337,040.000	
	MTR CORP	218,500	28.050	6,128,925.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	171,437	37.550	6,437,459.350	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	45.550	6,149,250.000	
	HANG SENG BANK LTD	114,500	122.500	14,026,250.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	146,000	47.200	6,891,200.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	232,500	51.100	11,880,750.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	230,750	54.750	12,633,562.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	679,137	17.300	11,749,070.100	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	329,000	87.500	28,787,500.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	77,000	34.700	2,671,900.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	123,500	37.350	4,612,725.000	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	519,000	23.350	12,118,650.000
	NEW WORLD DEVELOPMENT	433,800	13.580	5,891,004.000
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	17.700	4,071,000.000
	SINO LAND CO	300,000	13.880	4,164,000.000
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	215,000	121.400	26,101,000.000
	SWIRE PACIFIC LTD A	120,500	106.100	12,785,050.000
	WING HANG BANK LTD	36,000	96.250	3,465,000.000
	WHEELLOCK & CO LTD	169,000	27.550	4,655,950.000
	AIA GROUP LTD	1,178,800	21.100	24,872,680.000
	ASM PACIFIC TECH	38,300	99.400	3,807,020.000
	WYNN MACAU LTD	250,400	19.900	4,982,960.000
	SANDS CHINA LTD	393,600	17.960	7,069,056.000
香港ドル小計	銘柄数 : 35	9,355,584		347,542,950.950
	組入時価比率 : 1.29%			(3,652,676,414)
	合計時価比率 : 1.31%			
シンガポール・ドル	GENTING SINGAPORE PLC	945,400	1.920	1,815,168.000
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,248,640	0.625	780,400.000
	SINGAPORE TECH ENG	272,000	3.160	859,520.000
	SEBACORP INDUSTRIES	161,000	4.830	777,630.000
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.890	1,015,290.000
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	252,000	14.200	3,578,400.000
	CITY DEVELOPMENTS LTD	88,000	10.920	960,960.000
	SEBACORP MARINE	123,000	5.280	649,440.000
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	175,000	1.930	337,750.000
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	32.720	588,960.000
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	114,000	7.970	908,580.000
	CAPITALAND LTD	390,000	3.270	1,275,300.000
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	169,500	5.670	961,065.000
	KEPPEL CORP LTD	195,000	11.180	2,180,100.000
	NEPTUNE ORIENT	127,750	1.970	251,667.500
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	491,763	1.990	978,608.370
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	373,200	9.180	3,425,976.000
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,273,867	2.860	3,643,259.620
	SINGAPORE AIRLINES LTD	82,400	13.660	1,125,584.000
	KEPPEL LAND LTD	116,000	4.110	476,760.000
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	183,000	18.000	3,294,000.000
	OLAM INTERNATIONAL LTD	162,800	2.650	431,420.000
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	264,000	5.030	1,327,920.000
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	278,000	1.800	500,400.000
	CAPITAMALLS ASIA LTD	215,000	1.760	378,400.000
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	253,000	1.930	488,290.000
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 26	8,233,320		33,010,848.490
	組入時価比率 : 0.75%			(2,120,286,799)
	合計時価比率 : 0.76%			
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	141,121	16.680	2,353,898.280
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	216,948	16.700	3,623,031.600
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	282,651	9.760	2,758,673.760
	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES LTD	37,494	18.100	678,641.400
	DELEK GROUP LTD	639	863.000	551,457.000
	PARTNER COMMUNICATIONS	10,433	66.870	697,654.710
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	97,736	7.280	711,518.080
	ISRAEL CHEMICALS LTD	62,903	57.600	3,623,212.800
	NICE SYSTEMS LTD	7,624	121.800	928,603.200

	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	141,984	183.400	26,039,865.600	
	ISRAEL CORP LTD/THE	366	4,220.000	1,544,520.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	19,029	36.050	685,995.450	
	CELLCOM ISRAEL LTD	6,044	109.600	662,422.400	
イスラエル・シュケル小計	銘柄数 : 13	1,024,972		44,859,494.280	
	組入時価比率 : 0.36%			(1,004,852,672)	
	合計時価比率 : 0.36%				
オーストラリアドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	389,613	24.080	9,381,881.040	
	AMCOR LTD	178,713	7.030	1,256,352.390	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	454,012	23.480	10,660,201.760	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	203,778	6.460	1,316,405.880	
	TELSTRA CORP LTD	683,879	2.770	1,894,344.830	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	48,988	9.600	470,284.800	
	AMP LTD	298,501	5.470	1,632,800.470	
	ASX LTD	22,414	37.120	832,007.680	
	BHP BILLITON LTD	497,776	45.990	22,892,718.240	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	21,232	15.340	325,698.880	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	62,129	3.020	187,629.580	
	COMPUTERSHARE LT	62,694	9.510	596,219.940	
	CSL LIMITED	84,760	35.840	3,037,798.400	
	TRANSURBAN GROUP	192,723	5.380	1,036,849.740	
	COCA-COLA AMATIL LTD	82,960	11.990	994,690.400	
	COCHLEAR LTD	10,177	76.900	782,611.300	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,591	15.910	2,109,522.810	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	223,104	52.730	11,764,273.920	
	BORAL LIMITED	107,619	5.500	591,904.500	
	RIO TINTO LIMITED	66,770	84.250	5,625,372.500	
	CSR LIMITED	74,902	3.480	260,658.960	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	280,267	3.630	1,017,369.210	
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	37,106	8.400	311,690.400	
	ONESTEEL LIMITED	224,361	2.810	630,454.410	
	FOSTER'S GROUP LTD	294,041	5.610	1,649,570.010	
	MACARTHUR COAL LTD	17,904	11.790	211,088.160	
	OZ MINERALS LTD	555,136	1.650	915,974.400	
	ORICA LTD	53,835	25.720	1,384,636.200	
	FAIRFAX MEDIA LTD	362,918	1.345	488,124.710	
	LEIGHTON HLDGS LTD	19,582	30.950	606,062.900	
	BLUESCOPE STEEL LTD	255,174	2.130	543,520.620	
	MAP GROUP	76,167	3.020	230,024.340	
	MACQUARIE GROUP LTD	51,232	37.810	1,937,081.920	
	WORLEYPARSONS LTD	27,468	29.730	816,623.640	
	SUNCORP GROUP LTD	211,446	8.390	1,774,031.940	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	168,519	6.410	1,080,206.790	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	300,943	25.800	7,764,329.400	
	NEWCREST MINING LTD	111,475	39.110	4,359,787.250	
	PALADIN ENERGY LTD	117,788	4.940	581,872.720	
	INCITEC PIVOT LTD	236,186	4.380	1,034,494.680	
	TOLL HOLDINGS LTD	119,945	6.000	719,670.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,039	2.330	417,160.870	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	162,588	18.250	2,967,231.000	
	SANTOS LTD	125,011	14.210	1,776,406.310	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	27,467	18.580	510,336.860	
	SONIC HEALTHCARE	60,146	11.260	677,243.960	
	TABCORP HOLDINGS LTD	113,618	7.490	850,998.820	
	WESFARMERS LTD	148,033	32.600	4,825,875.800	
	ALUMINA LIMITED	397,286	2.370	941,567.820	

	WOODSIDE PETROLEUM LTD	94,193	41.850	3,941,977.050	
	WOOLWORTHS LTD	180,721	26.500	4,789,106.500	
	METCASH LTD	140,050	4.060	568,603.000	
	TATTS GROUP LTD	213,596	2.430	519,038.280	
	GOODMAN FIELDER LTD	96,716	1.265	122,345.740	
	AGL ENERGY LTD	78,763	14.600	1,149,939.800	
	BRAMBLES LTD	213,914	7.000	1,497,398.000	
	ASCIANO LTD	405,076	1.715	694,705.340	
	WESFARMERS LTD-PPS	23,287	33.030	769,169.610	
	CROWN LTD	74,398	8.380	623,455.240	
	QR NATIONAL LTD	127,448	3.080	392,539.840	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	70,178	6.570	461,069.460	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 61	10,352,356		134,203,011.020	
	組入時価比率 : 3.93%			(11,122,745,553)	
	合計時価比率 : 4.00%				
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	130,906	8.580	1,123,173.480	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	359,253	2.110	758,023.830	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 2	490,159		1,881,197.310	
	組入時価比率 : 0.04%			(115,599,575)	
	合計時価比率 : 0.04%				
合計				273,387,520,090	
				(273,387,520,090)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	294,800.00	521,796.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	177,906.00	361,149.180	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	472,706.00	882,945.180	
	組入時価比率 : 0.02%		(56,711,569)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	MIRVAC GROUP	541,250.00	695,506.250	
	CFS RETAIL PROPERTY	338,821.00	621,736.530	
	GPT GROUP	292,236.00	888,397.440	
	LEND LEASE GROUP	89,837.00	806,736.260	
	STOCKLAND	357,887.00	1,334,918.510	
	WESTFIELD GROUP	328,870.00	3,150,574.600	
	DEXUS PROPERTY GROUP	873,123.00	746,520.160	
	GOODMAN GROUP	994,208.00	671,090.400	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	456,093.00	1,194,963.660	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 9	4,272,325.00	10,110,443.810	
	組入時価比率 : 0.30%		(837,953,583)	
	合計時価比率 : 0.30%			
投資信託受益証券計			894,665,152	
			(894,665,152)	
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	23,290.00	2,153,160.500	

	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	106,230.00	1,882,395.600	
	AMB PROPERTY CORP	24,037.00	836,968.340	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,764.00	1,234,523.160	
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	503,525.570	
	EQUITY RESIDENTIAL	46,501.00	2,443,627.550	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,146.00	827,000.460	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	47,524.00	722,840.040	
	HCP INC	49,367.00	1,807,819.540	
	HEALTH CARE REIT INC	22,119.00	1,100,862.630	
	RAYONIER INC	10,481.00	621,418.490	
	KIMCO REALTY	66,054.00	1,212,751.440	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,897.00	489,217.480	
	THE MACERICH COMPANY	19,817.00	932,588.020	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	96,238.00	1,726,509.720	
	PLUM CREEK TIMBER CO	23,894.00	977,742.480	
	REGENCY	15,096.00	653,807.760	
	PROLOGIS	72,823.00	1,130,212.960	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	44,891.00	4,742,285.240	
	PUBLIC STORAGE	20,139.00	2,194,345.440	
	VENTAS INC	23,366.00	1,311,533.580	
	VORNADO REALTY TRUST	26,982.00	2,370,098.880	
米ドル小計	銘柄数 : 22	812,773.00	31,875,234.880	
	組入時価比率 : 0.92%		(2,612,494,251)	
	合計時価比率 : 0.94%			
	BRITISH LAND CO PLC	135,237.00	746,508.240	
	HAMMERSON PLC	101,418.00	451,411.510	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	117,753.00	867,839.610	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	83,396.00	315,236.880	
	SEGRO PLC	122,102.00	382,911.870	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	559,906.00	2,763,908.110	
	組入時価比率 : 0.13%		(365,305,735)	
	合計時価比率 : 0.13%			
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	41,673.00	699,272.940	
カナダドル小計	銘柄数 : 1	41,673.00	699,272.940	
	組入時価比率 : 0.02%		(58,354,327)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	GECINA SA	3,258.00	294,490.620	
	ICADE EMGP	4,185.00	335,302.200	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	14,188.00	2,013,986.600	
	KLEPIERRE	15,724.00	433,825.160	
	FONCIERE DES REGIONS	4,045.00	306,004.250	
	CORIO NV	9,364.00	439,920.720	
ユーロ小計	銘柄数 : 6	50,764.00	3,823,529.550	
	組入時価比率 : 0.15%		(432,785,310)	
	合計時価比率 : 0.16%			
	LINK REIT/THE	371,500.00	9,027,450.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	371,500.00	9,027,450.000	
	組入時価比率 : 0.03%		(94,878,500)	
	合計時価比率 : 0.03%			
投資証券計			3,563,818,122	
			(3,563,818,122)	

合計			4,458,483,274	
			(4,458,483,274)	

- (注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
 2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
 3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 570銘柄	52.57%	53.55%
米ドル	投資証券 22銘柄	0.92%	0.94%
英ポンド	株式 101銘柄	10.45%	10.64%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.13%	0.13%
カナダドル	株式 96銘柄	5.94%	6.05%
カナダドル	投資証券 1銘柄	0.02%	0.02%
スイスフラン	株式 35銘柄	3.91%	3.98%
スウェーデンクローネ	株式 32銘柄	1.55%	1.58%
ユーロ	株式 254銘柄	14.86%	15.14%
ユーロ	投資証券 6銘柄	0.15%	0.16%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	0.50%	0.51%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.45%	0.45%
香港ドル	株式 35銘柄	1.29%	1.31%
香港ドル	投資証券 1銘柄	0.03%	0.03%
シンガポール・ドル	株式 26銘柄	0.75%	0.76%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.02%	0.02%
イスラエル・シケル	株式 13銘柄	0.36%	0.36%
オーストラリアドル	株式 61銘柄	3.93%	4.00%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 9銘柄	0.30%	0.30%
ニュージーランドドル	株式 2銘柄	0.04%	0.04%

(注)「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「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

科目	注記 番号	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,779,186,182	537,983,640
国債証券		321,574,589,300	326,745,866,100
地方債証券		27,899,995,610	29,078,501,587
特殊債券		41,200,911,930	40,027,224,178
社債券		34,866,334,710	33,890,146,290
未収利息		1,662,199,894	1,704,114,684
前払費用		109,466,705	68,119,969
流動資産合計		430,092,684,331	432,051,956,448
資産合計		430,092,684,331	432,051,956,448
負債の部			
流動負債			
未払金		-	3,013,767,000
未払解約金		82,019,000	21,542,000
流動負債合計		82,019,000	3,035,309,000
負債合計		82,019,000	3,035,309,000
純資産の部			
元本等			
元本		392,786,689,803	385,632,006,164
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		37,223,975,528	43,384,641,284
元本等合計		430,010,665,331	429,016,647,448
純資産合計		430,010,665,331	429,016,647,448
負債純資産合計		430,092,684,331	432,051,956,448

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
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。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月14日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月15日から平成24年2月14日までとなっております。

(追加情報)

自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
----------------------------	----------------------------

	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。
--	---

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券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	222,300,832,660円	392,786,689,803円
同期中追加設定元本額	212,387,672,120円	65,036,938,109円
同期中解約元本額	41,901,814,977円	72,191,621,748円
同期末における元本の内訳		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	1,715,863,494円	3,209,564,465円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	6,344,293,028円	7,432,091,062円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	2,313,742,985円	2,562,878,656円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	3,780,584,562円	4,104,287,669円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,568,658,901円	1,686,301,944円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,157,999,209円	1,172,809,174円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,151,600,710円	1,169,078,848円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	143,751,648円	148,687,126円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	229,563,479円	218,593,777円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,787,952,654円	2,030,055,853円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	292,774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ロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042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）	12,151,309,479円	17,805,464,716円
D I A M国内債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）	- 円	111,008,492円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	952,466,087円	889,437,282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）	14,726,546,826円	13,048,880,654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）	786,018,791円	740,697,687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）	540,386,061円	500,164,300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）	1,275,821,028円	1,226,743,288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）	600,718,376円	568,055,346円
D I A M国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	425,842,616円	408,045,160円
D I A M世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	32,844,060,504円	30,634,046,472円
D I A M世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	10,722,175,553円	10,213,725,233円
D I A Mバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	15,510,236,223円	14,121,576,912円
D I A Mバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	5,932,816,297円	5,360,357,730円
D I A Mバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	9,196,957,380円	8,413,141,766円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	1,981,430,713円	1,902,588,560円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	7,069,601,768円	6,686,340,545円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	8,843,750,816円	8,176,856,086円
D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	15,339,330,521円	14,637,990,302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）	808,679,409円	745,905,317円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,140,302,159円	622,553,631円
D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	15,222,808,224円	15,005,351,997円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	8,243,521,450円	7,436,743,261円
D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,605,135,810円	1,559,111,528円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	116,203,038,255円	111,783,779,828円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	3,056,833,163円	2,831,884,536円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	10,701,408,645円	10,182,701,262円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	35,545,534,118円	33,845,447,022円
D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	2,387,258,932円	2,322,962,143円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	241,024円	245,550円

D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	147,578円	153,891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）	37,702,891,597円	36,916,578,873円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	147,183,120円	762,044,075円
D I A M国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	92,509,929円	188,677,518円
D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定）	795,186,117円	2,207,560,636円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	317,604円	321,225円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	226,079円	235,111円
（合計）	392,786,689,803円	385,632,006,164円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	392,786,689,803口	385,632,006,164口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法		<p>(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		<p>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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

自平成21年2月26日 至平成22年2月25日		
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	321,574,589,300	392,746,500
地方債証券	27,899,995,610	27,248,534
特殊債券	41,200,911,930	37,890,917
社債券	34,866,334,710	27,821,730
合計	425,541,831,550	485,707,681

自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,355,777,400
地方債証券	54,706,495
特殊債券	76,573,589
社債券	37,809,340
合計	1,524,866,824

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0948円 (10,948円)	1.1125円 (11,125円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	2 9 1 回 利付国庫債券（2年）	2,500,000,000	2,500,550,000	
	2 9 2 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,000,360,000	
	2 9 4 回 利付国庫債券（2年）	2,200,000,000	2,200,132,000	
	2 9 5 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,000,000,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券（2年）	2,500,000,000	2,495,950,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	2,994,900,000	
	2 9 8 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	1,996,240,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	1,999,460,000	
	3 0 0 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,499,295,000	
	6 3 回 利付国庫債券（5年）	7,500,000,000	7,580,100,000	
	6 4 回 利付国庫債券（5年）	7,200,000,000	7,322,400,000	
	6 6 回 利付国庫債券（5年）	5,700,000,000	5,778,945,000	
	6 8 回 利付国庫債券（5年）	2,000,000,000	2,031,780,000	
	6 9 回 利付国庫債券（5年）	3,800,000,000	3,846,740,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5年）	4,900,000,000	4,956,448,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5年）	4,900,000,000	5,038,376,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5年）	5,300,000,000	5,408,809,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5年）	4,000,000,000	4,065,560,000	
	8 1 回 利付国庫債券（5年）	6,200,000,000	6,285,064,000	
	8 3 回 利付国庫債券（5年）	4,400,000,000	4,473,832,000	
	8 5 回 利付国庫債券（5年）	5,200,000,000	5,251,896,000	
	8 7 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,010,250,000	
	8 8 回 利付国庫債券（5年）	5,500,000,000	5,505,445,000	
	8 9 回 利付国庫債券（5年）	5,500,000,000	5,475,635,000	
	9 1 回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,690,174,000	
	9 2 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	4,948,850,000	
	9 3 回 利付国庫債券（5年）	1,500,000,000	1,496,835,000	
	2 回 利付国庫債券（40年）	600,000,000	596,292,000	
	3 回 利付国庫債券（40年）	1,000,000,000	994,770,000	
	2 3 7 回 利付国庫債券（10年）	1,540,000,000	1,561,359,800	
	2 4 0 回 利付国庫債券（10年）	300,000,000	304,302,000	
	2 4 3 回 利付国庫債券（10年）	1,400,000,000	1,419,390,000	
	2 4 6 回 利付国庫債券（10年）	1,900,000,000	1,919,779,000	
	2 4 7 回 利付国庫債券（10年）	700,000,000	707,987,000	
	2 5 0 回 利付国庫債券（10年）	2,060,000,000	2,071,062,200	
	2 5 4 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,775,951,000	
	2 5 6 回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,575,350,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,028,810,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券（10年）	2,800,000,000	2,911,356,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,812,509,000	

266回 利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,832,830,000
269回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,065,960,000
270回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,964,410,000
272回 利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,910,236,000
274回 利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,508,432,000
277回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,628,300,000
280回 利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,990,092,000
282回 利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,279,738,000
284回 利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,282,931,000
285回 利付国庫債券(10年)	5,600,000,000	5,931,856,000
286回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,795,830,000
288回 利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,553,743,000
289回 利付国庫債券(10年)	4,400,000,000	4,598,704,000
290回 利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,357,962,000
293回 利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,321,050,000
296回 利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,163,840,000
297回 利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,332,552,000
299回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,905,408,000
301回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,245,714,000
303回 利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,691,620,000
305回 利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,581,510,000
306回 利付国庫債券(10年)	6,200,000,000	6,329,580,000
308回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,323,115,000
309回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,473,610,000
310回 利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,372,145,000
312回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,490,150,000
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	113,121,000
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	106,601,000
3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	210,078,000
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	229,348,000
5回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	206,054,000
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	212,340,000
7回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	313,872,000
8回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	478,330,000
11回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	375,128,000
12回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	302,544,000
13回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	296,976,000
14回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	531,130,000
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	216,064,000
16回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	432,368,000
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	212,386,000
18回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	855,079,600
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	208,616,000
20回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	324,432,000
21回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	521,410,000
22回 利付国庫債券(30年)	470,000,000	508,366,100
23回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	432,508,000
24回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	648,534,000
25回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	624,786,000
26回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,273,476,000
27回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,298,424,000

28回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,405,456,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,592,430,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,559,835,000	
31回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,039,340,000	
32回	利付国庫債券(30年)	2,200,000,000	2,289,694,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,559,440,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	688,500,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	447,744,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	791,568,000	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	897,360,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	986,798,400	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	996,291,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	545,280,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,034,987,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	558,250,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	827,127,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	641,658,000	
52回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	809,070,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	762,202,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	864,367,200	
57回	利付国庫債券(20年)	830,000,000	876,480,000	
58回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	948,996,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	989,495,100	
61回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	952,370,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	926,340,000	
64回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,046,670,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,358,032,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,355,263,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,596,479,000	
72回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,541,045,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,456,970,200	
75回	利付国庫債券(20年)	1,540,000,000	1,630,182,400	
78回	利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,597,600,500	
81回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,767,745,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,890,738,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,833,877,500	
88回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,037,180,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,006,970,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,769,275,000	
93回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,025,540,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	831,432,000	
95回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,130,040,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,888,200,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,858,860,000	
100回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,092,080,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,038,282,000	
105回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,155,272,000	
107回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,050,480,000	
109回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,185,304,000	
111回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,594,775,000	
113回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,450,712,000	

	1 1 4 回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,549,825,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,690,272,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,402,926,000	
	1 1 9 回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,455,180,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(20年)	3,100,000,000	3,054,275,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,017,070,000	
国債証券計			326,745,866,100	
地方債証券	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	152,040,400	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	209,082,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	168,200,635	
	6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	207,082,000	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,405,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	206,736,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	207,954,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	206,522,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,084,100	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	206,402,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,201,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	104,655,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	513,636,500	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,162,307	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	106,672,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	212,538,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	213,148,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	159,094,500	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	106,231,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	212,972,925	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	308,040,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	311,367,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	202,934,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	494,790,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	193,868,000	
	1 5 年度 2 回 北海道公募公債	203,000,000	206,101,840	
	1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	250,000,000	256,385,000	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	202,571,985	
	1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	106,949,000	
	1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	319,530,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	205,464,000	
	1 1 8 回 神奈川県公募公債	145,090,000	147,135,769	
	1 2 5 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,990,000	
	1 2 6 回 神奈川県公募公債	178,870,000	184,851,412	
	1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,500,000	
	1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,586,000	
	1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	161,453,006	
	1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	209,164,000	
	1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,183,000	
	1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	304,920,000	
	2 5 1 回 大阪府公募公債	110,100,000	111,493,866	
	2 5 2 回 大阪府公募公債	100,000,000	100,804,000	
	2 6 1 回 大阪府公募公債	129,000,000	132,693,270	

278回 大阪府公募公債	200,000,000	205,424,000	
285回 大阪府公募公債	100,000,000	103,737,000	
286回 大阪府公募公債	200,000,000	207,568,000	
289回 大阪府公募公債	200,000,000	210,704,000	
293回 大阪府公募公債	200,000,000	214,116,000	
301回 大阪府公募公債	100,000,000	105,740,000	
310回 大阪府公募公債	240,000,000	250,017,600	
336回 大阪府公募公債	200,000,000	202,358,000	
1回 大阪府公募公債 7年	500,000,000	516,730,000	
15年度3回 京都府公募公債	219,300,000	226,109,265	
16年度2回 京都府公募公債	100,000,000	103,570,000	
18年度1回 京都府公募公債	100,000,000	105,476,000	
14年度5回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,866,000	
15年度1回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,665,000	
16年度4回 兵庫県公募公債	251,970,000	260,715,878	
16年度8回 兵庫県公募公債	111,500,000	116,702,590	
17年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	206,336,000	
17年度9回 兵庫県公募公債	306,000,000	319,148,820	
17年度13回 兵庫県公募公債	105,000,000	110,168,100	
18年度1回 兵庫県公募公債	120,000,000	126,549,600	
14年度3回 静岡県公募公債	147,610,000	150,097,228	
15年度1回 静岡県公募公債	268,500,000	269,493,450	
15年度3回 静岡県公募公債	116,130,000	119,278,284	
18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	137,973,506	
21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	199,866,350	
15年度1回 愛知県公募公債	303,600,000	311,830,596	
16年度2回 愛知県公募公債	200,000,000	207,962,000	
18年度2回 愛知県公募公債	160,300,000	171,410,393	
20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	104,263,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	198,366,000	
16年度2回 広島県公募公債	200,000,000	207,576,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	202,054,000	
14年度2回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,447,000	
15年度3回 埼玉県公募公債	100,000,000	103,148,000	
17年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	206,186,000	
18年度1回 埼玉県公募公債	200,000,000	211,654,000	
21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	451,343,200	
16年度3回 福岡県公募公債	131,040,000	134,963,337	
17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	103,595,000	
17年度5回 福岡県公募公債	100,000,000	104,226,000	
18年度1回 福岡県公募公債	104,000,000	111,873,840	
21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	206,440,000	
15年度4回 千葉県公募公債	100,000,000	102,879,000	
16年度3回 千葉県公募公債	100,000,000	104,918,000	
16年度8回 千葉県公募公債	200,000,000	205,992,000	
17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	206,210,000	
19年度5回 千葉県公募公債	300,000,000	319,119,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	204,066,000	
18年度2回 新潟県公募公債	169,000,000	179,697,700	
2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,601,000	
3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,369,000	

8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,276,000	
9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	216,526,800	
11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,914,000	
12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	133,868,800	
13回 共同発行市場公募地方債	221,000,000	228,361,510	
18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,924,000	
19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	135,164,900	
20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,660,000	
21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,972,000	
23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,996,000	
25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	314,506,240	
28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,278,000	
29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,186,000	
31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,234,000	
32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,246,000	
33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,935,000	
35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,504,000	
36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,796,000	
37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	158,731,500	
38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	181,728,300	
39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	155,352,760	
40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,284,500	
47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	171,438,208	
55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,746,000	
57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,054,000	
61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,612,000	
65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,492,000	
75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	520,405,000	
80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	720,573,000	
14年度3回 大阪市公募公債	146,500,000	148,385,455	
14年度6回 大阪市公募公債	116,800,000	118,552,000	
17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	102,637,000	
17年度7回 大阪市公募公債	200,000,000	206,222,000	
17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	208,118,000	
17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	104,191,000	
18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	106,339,000	
18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	160,372,500	
19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	143,897,850	
12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,604,000	
12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	206,266,000	
12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	372,503,115	
17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,457,000	
18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	108,297,279	
16年度5回 神戸市公募公債	200,000,000	206,256,000	
17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	107,627,790	
14年度3回 横浜市公募公債	153,500,000	155,483,220	
14年度5回 横浜市公募公債	281,100,000	283,877,268	
15年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	205,276,000	
16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	207,168,000	
17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	309,003,000	
14年度5回 札幌市公募公債	106,000,000	106,995,340	

	14年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	100,793,000	
	16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	103,788,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	103,176,000	
	19回 川崎市公募公債 5年	100,000,000	102,446,000	
	14年度2回 北九州市公募公債	100,000,000	101,237,000	
	14年度1回 福岡市公募公債	200,000,000	203,270,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	105,854,000	
	16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	103,205,000	
	16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	103,242,000	
地方債証券計			29,078,501,587	
特殊債券	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	106,727,700	
	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	129,634,560	
	16回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,409,000	
	7回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,676,000	
	9回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,933,000	
	13回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,366,000	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,148,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	209,470,000	
	12回 日本道路・機構承継債	100,000,000	101,778,000	
	34回 日本道路・機構承継債	200,000,000	207,532,000	
	314回 政保道路債	200,000,000	202,694,000	
	315回 政保道路債	300,000,000	302,643,000	
	319回 政保道路債	132,000,000	133,861,200	
	322回 政保道路債	106,000,000	109,313,560	
	323回 政保道路債	200,000,000	206,360,000	
	324回 政保道路債	200,000,000	205,936,000	
	328回 政保道路債	200,000,000	206,970,000	
	329回 政保道路債	100,000,000	103,862,000	
	333回 政保道路債	300,000,000	312,291,000	
	335回 政保道路債	237,000,000	245,148,060	
	338回 政保道路債	264,000,000	274,451,760	
	339回 政保道路債	301,000,000	311,811,920	
	342回 政保道路債	100,000,000	100,715,000	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	427,792,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	317,211,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	417,880,000	
	48回 高速道路機構債	700,000,000	729,736,000	
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,143,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	219,255,630	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,344,920	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,486,000	
	16回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	322,524,510	
	17回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	130,801,080	
	19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,149,000	
	21回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	398,291,250	
	23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,007,000	
	29回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,662,000	
	30回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,049,000	
	33回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	313,896,330	

3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	367,856,400	
4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	353,868,790	
4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,460,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,798,000	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	168,125,220	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	418,760,290	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	617,004,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,116,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,213,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	304,122,000	
1 6 回 日本道路・機構承継債	430,000,000	435,370,700	
2 6 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	206,874,000	
4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	310,824,000	
5 回 公営企業債券	100,000,000	100,904,000	
8 1 8 回 政保公営企業債券	107,000,000	108,684,180	
8 2 1 回 政保公営企業債券	405,000,000	410,961,600	
8 2 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	202,070,000	
8 2 4 回 政保公営企業債券	300,000,000	303,171,000	
8 2 8 回 政保公営企業債券	210,000,000	210,921,900	
8 2 9 回 政保公営企業債券	400,000,000	407,440,000	
8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	306,287,380	
8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	213,636,420	
8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	445,318,560	
8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	620,568,000	
8 3 9 回 政保公営企業債券	260,000,000	269,045,400	
8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,693,000	
8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,960,000	
8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,230,000	
8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	271,286,010	
8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	309,732,000	
8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,750,760	
8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	315,290,560	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,504,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	216,047,970	
8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	253,256,350	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,084,000	
8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	212,250,000	
8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,245,840	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	108,338,280	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	509,430,620	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	672,203,070	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,133,020	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,265,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,144,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	504,475,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	195,680,000	
6 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	201,274,000	
1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,806,000	
1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,545,000	
1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	309,465,000	
1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,298,000	

20回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	214,162,000	
24回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	320,166,000	
191回 政保首都高速道路債券	113,000,000	118,200,260	
142回 政保阪神高速道路債	100,000,000	103,421,000	
148回 政保阪神高速道路債	107,000,000	110,519,230	
5回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	103,970,000	
176回 政保中小企業債券	100,000,000	103,197,000	
180回 政保中小企業債券	142,000,000	148,499,340	
186回 政保中小企業債券	104,000,000	107,417,440	
26回 中小企業債券	400,000,000	414,780,000	
15回 国際協力銀行債券	200,000,000	208,086,000	
8回 国際協力銀行債券	300,000,000	301,779,000	
12回 国際協力銀行債券	200,000,000	206,856,000	
2回 都市再生債券	100,000,000	105,208,000	
19回 都市再生機構債券	200,000,000	213,534,000	
23回 都市再生機構債券	200,000,000	204,340,000	
2回 本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	103,882,000	
6回 政保中部国際空港債券	100,000,000	103,056,000	
140回 政保預金保険機構債券	300,000,000	302,301,000	
143回 政保預金保険機構債券	280,000,000	282,682,400	
11回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	209,222,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,077,000	
6回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	161,007,000	168,221,723	
8回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	111,128,000	115,333,083	
9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	167,598,000	174,293,540	
2回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	185,433,000	193,549,402	
13回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	77,075,000	80,279,007	
14回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	395,335,000	405,601,849	
4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	108,708,000	111,573,542	
43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,767,000	72,997,909	
44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	278,228,000	290,692,614	
51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	217,959,000	226,252,339	
1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	373,430,000	387,963,895	
29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	452,760,000	462,679,971	
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	768,728,000	777,560,684	
14回 政保国民生活債券	132,000,000	136,831,200	
683号 利附商工債	100,000,000	101,244,000	
685号 利附商工債	200,000,000	203,348,000	
691号 利附商工債	200,000,000	203,978,000	
692号 利附商工債	200,000,000	203,310,000	
704号 利附商工債	200,000,000	205,308,000	
706号 利付商工債	300,000,000	308,202,000	
714号 利付商工債	300,000,000	303,972,000	
723号 利付商工債	300,000,000	298,419,000	
684号 利附農林債	250,000,000	253,282,500	
688号 利附農林債	200,000,000	203,250,000	
694号 利附農林債	400,000,000	406,320,000	
695号 利附農林債	200,000,000	203,262,000	
698号 利附農林債	300,000,000	307,764,000	
701号 利附農林債	200,000,000	205,290,000	
709号 利附農林債	400,000,000	408,188,000	

	713号 利附農林債	300,000,000	302,478,000	
	717号 利附農林債	300,000,000	301,638,000	
	721号 利附農林債	120,000,000	119,796,000	
	210回 利附信金中金債	100,000,000	101,326,000	
	215回 利附信金中金債	200,000,000	203,944,000	
	217回 利附信金中金債	200,000,000	203,758,000	
	222回 利附信金中金債	200,000,000	204,596,000	
	226回 利附信金中金債	300,000,000	307,215,000	
	229回 利附信金中金債	400,000,000	410,872,000	
	233回 利附信金中金債	300,000,000	308,205,000	
	236回 利附信金中金債	300,000,000	303,969,000	
	241回 利附信金中金債	300,000,000	301,572,000	
	1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,791,440	
	2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,331,890	
	4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,369,100	
	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	182,149,900	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	316,203,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	211,132,000	
	1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	210,535,440	
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	275,104,620	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	124,275,060	
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	313,890,000	
特殊債券計			40,027,224,178	
社債券	345回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,505,000	
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	100,953,000	
	14回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	102,219,000	
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	102,917,000	
	15回 シティグループ円貨社債	100,000,000	100,096,000	
	22回 シティグループ円貨社債	200,000,000	205,204,000	
	3回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	101,376,000	
	7回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	101,188,000	
	2回 オーストラリア連邦保証オーストラリア・ ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,310,000	
	1回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,428,000	
	5回 日本たばこ産業社債	100,000,000	102,054,000	
	25回 住友化学工業社債	100,000,000	102,957,000	
	33回 住友化学社債	100,000,000	101,509,000	
	25回 三菱化学社債	100,000,000	102,631,000	
	34回 三井化学社債	100,000,000	104,605,000	
	2回 花王社債	100,000,000	103,398,000	
	19回 新日本石油社債	100,000,000	101,649,000	
	8回 旭硝子社債	100,000,000	100,528,000	
	48回 新日本製鐵社債	100,000,000	101,560,000	
	52回 新日本製鐵社債	100,000,000	103,511,000	
	11回 豊田自動織機社債	100,000,000	101,380,000	
	12回 日立製作所社債	100,000,000	100,534,000	
	7回 パナソニック社債	200,000,000	205,356,000	
	24回 シャープ社債	100,000,000	100,990,000	
	16回 ソニー社債	100,000,000	101,207,000	
	17回 ソニー社債	100,000,000	103,642,000	

19回	ソニー社債	100,000,000	102,237,000	
4回	デンソー社債	100,000,000	101,160,000	
15回	三菱重工業社債	100,000,000	101,188,000	
19回	三菱重工業社債	100,000,000	106,597,000	
6回	トヨタ自動車社債	200,000,000	203,006,000	
7回	トヨタ自動車社債	300,000,000	307,131,000	
45回	三井物産社債	100,000,000	100,662,000	
29回	住友商事社債	100,000,000	101,941,000	
16回	三菱商事社債	100,000,000	107,164,000	
14回	クレディセゾン社債	100,000,000	101,034,000	
1回	みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	208,218,000	
6回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,626,000	
7回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	107,012,000	
9回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,594,000	
11回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,812,000	
13回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,634,000	
14回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	102,933,000	
15回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,002,000	
18回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,910,000	
92回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,852,000	
100回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	204,676,000	
106回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	304,044,000	
112回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	200,726,000	
114回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	200,604,000	
3回2号	三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	200,000,000	203,640,000	
3回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	205,204,000	
6回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,853,000	
8回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,749,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	100,000,000	107,312,000	
5回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,865,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	103,560,000	
5回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	106,587,000	
41回	三井住友銀行社債	100,000,000	101,671,000	
45回	三井住友銀行社債	200,000,000	204,524,000	
47回	三井住友銀行社債	200,000,000	202,724,000	
51回	三井住友銀行社債	200,000,000	197,432,000	
6回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,823,000	
7回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,109,000	
8回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,540,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,222,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,988,000	
1回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,367,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,523,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,065,000	
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	199,340,000	
14回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,075,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,337,000	
23回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,180,000	
26回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,328,000	
115回	オリックス社債	100,000,000	101,116,000	
118回	オリックス社債	100,000,000	103,661,000	

144回	オリックス社債	100,000,000	100,316,000	
6回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,409,000	
7回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,778,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,661,000	
9回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,661,000	
13回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,717,000	
15回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,249,000	
17回	野村ホールディングス社債	200,000,000	203,778,000	
22回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,738,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	104,230,000	
53回	三菱地所社債	100,000,000	101,463,000	
60回	三菱地所社債	100,000,000	101,501,000	
66回	三菱地所社債	100,000,000	100,824,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	107,658,000	
18回	京王電鉄社債	100,000,000	103,182,000	
2回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	234,104,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,265,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,098,000	
25回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	302,733,000	
31回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	206,854,000	
41回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,193,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,182,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,878,000	
1回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,455,000	
2回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	232,968,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,416,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	196,549,300	
19回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	203,024,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,061,000	
48回	日本電信電話社債	400,000,000	415,112,000	
50回	日本電信電話社債	100,000,000	104,236,000	
51回	日本電信電話社債	200,000,000	213,936,000	
2回	KDDI社債	100,000,000	101,176,000	
5回	KDDI社債	100,000,000	113,501,000	
16回	NTTドコモ社債	200,000,000	204,476,000	
18回	NTTドコモ社債	200,000,000	202,534,000	
441回	東京電力社債	200,000,000	227,994,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	214,992,000	
457回	東京電力社債	100,000,000	107,263,000	
473回	東京電力社債	300,000,000	307,371,000	
501回	東京電力社債	200,000,000	202,310,000	
502回	東京電力社債	200,000,000	202,490,000	
505回	東京電力社債	100,000,000	100,912,000	
507回	東京電力社債	300,000,000	308,445,000	
510回	東京電力社債	200,000,000	205,562,000	
511回	東京電力社債	100,000,000	103,654,000	
514回	東京電力社債	300,000,000	311,247,000	
515回	東京電力社債	200,000,000	206,778,000	
516回	東京電力社債	100,000,000	103,418,000	
517回	東京電力社債	100,000,000	103,209,000	
518回	東京電力社債	300,000,000	309,837,000	

5 1 9回	東京電力社債	372,000,000	388,676,760	
5 2 2回	東京電力社債	300,000,000	321,573,000	
5 2 7回	東京電力社債	500,000,000	516,455,000	
5 3 5回	東京電力社債	500,000,000	528,295,000	
5 3 6回	東京電力社債	200,000,000	209,908,000	
5 4 1回	東京電力社債	500,000,000	507,980,000	
5 4 2回	東京電力社債	500,000,000	521,715,000	
5 5 7回	東京電力社債	500,000,000	506,790,000	
4 0 7回	中部電力社債	100,000,000	112,076,000	
4 0 9回	中部電力社債	300,000,000	349,842,000	
4 6 0回	中部電力社債	200,000,000	202,854,000	
4 6 3回	中部電力社債	200,000,000	202,018,000	
4 6 7回	中部電力社債	100,000,000	103,752,000	
4 6 8回	中部電力社債	100,000,000	103,383,000	
4 7 1回	中部電力社債	300,000,000	309,051,000	
4 7 6回	中部電力社債	100,000,000	107,874,000	
4 7 8回	中部電力社債	100,000,000	106,301,000	
4 8 0回	中部電力社債	200,000,000	211,662,000	
4 8 4回	中部電力社債	200,000,000	206,294,000	
4 8 7回	中部電力社債	140,000,000	143,040,800	
4 9 6回	中部電力社債	500,000,000	496,730,000	
4 1 0回	関西電力社債	300,000,000	320,643,000	
4 2 7回	関西電力社債	100,000,000	102,621,000	
4 3 1回	関西電力社債	100,000,000	101,455,000	
4 3 2回	関西電力社債	300,000,000	304,635,000	
4 3 3回	関西電力社債	200,000,000	205,622,000	
4 4 1回	関西電力社債	200,000,000	207,146,000	
4 4 6回	関西電力社債	200,000,000	211,064,000	
2 9 8回	中国電力社債	200,000,000	229,260,000	
3 1 0回	中国電力社債	200,000,000	229,448,000	
3 3 7回	中国電力社債	219,000,000	222,497,430	
3 4 1回	中国電力社債	100,000,000	103,488,000	
3 5 0回	中国電力社債	200,000,000	207,506,000	
2 4 5回	北陸電力社債	200,000,000	227,200,000	
2 6 0回	北陸電力社債	100,000,000	109,124,000	
2 8 1回	北陸電力社債	200,000,000	213,768,000	
2 8 9回	北陸電力社債	300,000,000	309,735,000	
3 6 8回	東北電力社債	300,000,000	340,665,000	
3 7 5回	東北電力社債	100,000,000	113,178,000	
3 8 0回	東北電力社債	300,000,000	346,878,000	
4 1 1回	東北電力社債	200,000,000	203,044,000	
4 2 0回	東北電力社債	100,000,000	102,724,000	
4 2 7回	東北電力社債	200,000,000	207,214,000	
4 3 2回	東北電力社債	500,000,000	535,960,000	
2 3 7回	四国電力社債	100,000,000	107,278,000	
2 5 7回	四国電力社債	200,000,000	206,454,000	
3 6 9回	九州電力社債	300,000,000	304,332,000	
3 7 4回	九州電力社債	300,000,000	308,430,000	
3 8 2回	九州電力社債	100,000,000	103,423,000	
3 8 3回	九州電力社債	100,000,000	103,573,000	
3 8 7回	九州電力社債	200,000,000	210,168,000	

	257回 北海道電力社債	200,000,000	231,970,000	
	282回 北海道電力社債	200,000,000	205,708,000	
	284回 北海道電力社債	500,000,000	520,090,000	
	286回 北海道電力社債	100,000,000	103,609,000	
	7回 沖縄電力社債	100,000,000	101,600,000	
	2回 電源開発社債	100,000,000	102,781,000	
	4回 電源開発社債	200,000,000	204,868,000	
	6回 電源開発社債	100,000,000	103,525,000	
	14回 電源開発社債	100,000,000	104,060,000	
	17回 電源開発社債	100,000,000	106,992,000	
	14回 東京ガス社債	100,000,000	115,468,000	
	24回 東京瓦斯社債	200,000,000	205,390,000	
	9回 大阪ガス社債	100,000,000	113,148,000	
	24回 大阪瓦斯社債	100,000,000	103,806,000	
	20回 NTTデータ社債	100,000,000	101,664,000	
	社債券計		33,890,146,290	
	合計		429,741,738,155	

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。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		5,478,697,498	5,116,823,307
コール・ローン		252,476,623	191,885,361
国債証券		402,153,180,827	385,269,775,107
派生商品評価勘定		53,865	950,920
未収利息		4,958,987,407	4,703,378,656
前払費用		485,852,153	244,705,957
流動資産合計		413,329,248,373	395,527,519,308
資産合計		413,329,248,373	395,527,519,308
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		133,569	348,000
未払解約金		105,012,000	222,431,000
流動負債合計		105,145,569	222,779,000
負債合計		105,145,569	222,779,000
純資産の部			
元本等			
元本		340,044,873,488	345,284,212,026
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		73,179,229,316	50,020,528,282
元本等合計		413,224,102,804	395,304,740,308
純資産合計		413,224,102,804	395,304,740,308
負債純資産合計		413,329,248,373	395,527,519,308

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左

	(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成22年2 月23日から平成23年2月21日まで となっております。	(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成23年2 月22日から平成24年2月21日まで となっております。
--	--	--

(追加情報)

自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
	当計算期間より、「金融商品に關する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に關する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に關する注記)

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券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	261,176,061,856円	340,044,873,488円
同期中追加設定元本額	117,650,377,551円	47,591,167,052円
同期中解約元本額	38,781,565,919円	42,351,828,514円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	1,418,161,055円	4,617,711,048円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	2,968,326,212円	3,569,552,218円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	252,478,515円	297,561,636円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	931,799,463円	1,083,613,768円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	999,582,493円	1,181,500,654円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	292,448,604円	323,613,584円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	573,220,319円	632,799,046円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	367,672,743円	424,763,594円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	192,266,231円	174,192,617円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,490,290,122円	1,611,183,169円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	839,479円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	14,789,578,578円	8,675,277,313円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	3,775,534,976円	4,057,469,028円
D I A M外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	7,769,155,834円	7,820,305,763円
D I A M外国債券パッシブファンド2（適格機関投資家向け）	2,004,335,773円	円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	948,875,990円	947,377,584円

D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	257,816,113円	264,971,288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)	52,576,046,897円	51,086,745,591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)	2,808,919,682円	2,902,426,874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)	482,515,571円	489,729,476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)	758,725,567円	800,269,682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)	214,130,120円	219,257,981円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	94,829,816円	99,827,730円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	29,293,250,512円	29,965,120,361円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,381,624,019円	6,666,128,697円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	12,093,729,741円	12,086,222,523円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,729,433,392円	5,681,457,193円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,198,212,279円	8,230,245,027円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	2,949,481,282円	3,108,153,931円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	8,832,264,377円	9,159,870,982円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	10,521,193,612円	10,661,402,167円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	50,164,155,552円	52,525,580,188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)	286,126,637円	270,088,311円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,018,932,796円	610,881,068円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,794,980,312円	7,332,934,639円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	16,078,241,526円	16,388,291,644円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	281,671,446円	288,332,022円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	25,906,978,059円	27,298,720,049円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	31,722,542,216円	33,111,826,046円

D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	798,019,553円	851,719,069円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	214,723円	240,989円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	131,359円	150,746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）	26,774,474,180円	28,895,467,355円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	39,656,511円	226,705,158円
D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定）	212,526,144円	643,321,327円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	201,433円	225,302円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	121,153円	138,109円
（合計）	340,044,873,488円	345,284,212,026円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	340,044,873,488口	345,284,212,026口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)国債証券 「注記表（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)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	402,153,180,827	2,103,579,838
合計	402,153,180,827	2,103,579,838

	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
国債証券	1,729,867,007	
合計	1,729,867,007	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	自平成22年2月26日 至平成23年2月25日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

平成22年2月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	13,537,425	-	13,533,000	4,425
	買建 カナダドル	152,115,725	-	152,099,750	15,975
	ポーランドズロチ	50,610,080	-	50,659,520	49,440
	ユーロ	893,903,868	-	893,845,260	58,608
	米ドル	591,360,866	-	591,301,880	58,986
	合 計		1,701,527,964	-	1,701,439,410

平成23年2月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	スイスフラン	66,502,875	-	66,442,500	60,375
	英ポンド	33,418,250	-	33,040,000	378,250
	米ドル	120,978,795	-	120,466,500	512,295
	買建				
	オーストラリアドル	38,934,800	-	38,930,100	4,700
	カナダドル	77,601,060	-	77,599,200	1,860
	ポーランドズロチ	78,270,500	-	77,962,500	308,000
	ユーロ	312,386,460	-	312,376,800	9,660
	英ポンド	77,976,760	-	77,974,400	2,360
	米ドル	195,062,420	-	195,041,000	21,420
	合 計	1,001,131,920	-	999,833,000	602,920

（注）時価の算定方法

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

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年2月25日現在	平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.2152円	1.1449円
（1万口当たり純資産額）	(12,152円)	(11,449円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 4.75 01/31/12	7,000,000.00	7,291,200.000	
	US T N/B 4.875 02/15/12	22,000,000.00	22,977,900.000	
	US T N/B 0.875 02/29/12	40,000,000.00	40,232,800.000	
	US T N/B 4.5 03/31/12	32,000,000.00	33,456,000.000	
	US T N/B 4.5 04/30/12	40,000,000.00	41,951,200.000	
	US T N/B 1.875 06/15/12	35,000,000.00	35,672,350.000	
	US T N/B 1.5 07/15/12	36,000,000.00	36,543,960.000	
	US T N/B 4.375 08/15/12	35,000,000.00	37,028,600.000	
	US T N/B 1.375 09/15/12	33,000,000.00	33,438,240.000	
	US T N/B 4.0 11/15/12	44,000,000.00	46,585,000.000	
	US T N/B 1.125 12/15/12	35,000,000.00	35,300,650.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	34,022,400.000	
	US T N/B 1.375 03/15/13	28,000,000.00	28,355,320.000	
	US T N/B 1.75 04/15/13	25,000,000.00	25,508,750.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	30,830,480.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	20,000,000.00	21,224,200.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	37,859,850.000	
	US T N/B 0.5 10/15/13	30,000,000.00	29,585,100.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	43,468,400.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	43,350,000.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	38,874,500.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	31,235,100.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,721,040.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	28,848,680.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	32,983,500.000	
	US T N/B 2.125 11/30/14	25,000,000.00	25,484,250.000	
	US T N/B 2.625 12/31/14	12,000,000.00	12,446,160.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.00	21,818,600.000	
	US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.00	23,592,020.000	
	US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.00	20,575,000.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.00	19,717,020.000	
	US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.00	15,004,650.000	
	US T N/B 1.75 07/31/15	8,000,000.00	7,944,960.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.00	16,523,400.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	15,000,000.00	14,543,550.000	
	US T N/B 1.25 09/30/15	8,000,000.00	7,738,400.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.00	20,015,100.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	10,000,000.00	9,681,600.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.00	17,797,440.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	20,145,200.000	

	US T N/B 7.25 05/15/16	15,000,000.00	18,732,300.000	
	US T N/B 3.25 06/30/16	20,000,000.00	20,954,600.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	18,000,000.00	20,389,140.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	20,634,200.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	17,823,680.000	
	US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.00	20,304,600.000	
	US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.00	20,828,000.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	13,417,440.000	
	US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.00	20,514,000.000	
	US T N/B 3.125 04/30/17	10,000,000.00	10,296,800.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,504,670.000	
	US T N/B 4.5 05/15/17	15,000,000.00	16,645,200.000	
	US T N/B 2.5 06/30/17	13,000,000.00	12,875,070.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.00	16,864,350.000	
	US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.00	7,593,680.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	8,000,000.00	7,574,320.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	11,000,000.00	12,017,500.000	
	US T N/B 2.25 11/30/17	8,000,000.00	7,731,840.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.00	14,602,560.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	15,000,000.00	15,980,850.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	10,000,000.00	10,721,800.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	17,000,000.00	17,892,500.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	7,000,000.00	9,955,260.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	22,000,000.00	21,499,720.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	20,000,000.00	20,034,200.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	7,000,000.00	9,653,980.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	22,000,000.00	22,776,820.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	25,000,000.00	25,302,500.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	26,000,000.00	26,723,060.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	19,000,000.00	19,274,550.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	7,000,000.00	10,125,920.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	25,000,000.00	23,458,750.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	22,000,000.00	20,544,040.000	
	US T N/B 8.125 05/15/21	5,000,000.00	7,035,150.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	11,000,000.00	15,422,330.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	4,022,790.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	4,000,000.00	5,326,240.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	8,000,000.00	9,963,120.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	3,000,000.00	4,155,450.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	3,000,000.00	4,206,540.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	3,500,000.00	4,623,255.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	5,000,000.00	6,105,450.000	
	US T N/B 6.75 08/15/26	2,000,000.00	2,623,580.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	3,845,370.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,298,350.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	2,000,000.00	2,539,520.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	6,000,000.00	7,434,360.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	3,480,210.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	4,000,000.00	4,510,280.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	4,000,000.00	4,512,160.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	3,000,000.00	3,729,360.000	

	US T N/B 6.25 05/15/30	5,000,000.00	6,309,350.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	6,000,000.00	6,858,720.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	9,000,000.00	9,048,510.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	6,000,000.00	6,261,060.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	4,000,000.00	4,331,560.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	6,000,000.00	5,878,080.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	8,000,000.00	7,993,680.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	10,000,000.00	8,344,500.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	13,000,000.00	12,415,910.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	14,000,000.00	13,936,440.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	16,000,000.00	15,582,400.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	18,000,000.00	18,267,120.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	13,000,000.00	12,644,450.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	16,000,000.00	14,252,480.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	14,000,000.00	13,323,940.000	
米ドル小計	銘柄数 : 106	1,775,500,000.00	1,873,902,185.000	
	組入時価比率 : 38.85%		(153,585,023,083)	
	合計時価比率 : 39.86%			
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	9,000,000.00	9,375,300.000	
	UK TREASURY 5.25 06/07/12	10,500,000.00	11,057,550.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	10,000,000.00	10,607,000.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,493,500.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	10,100,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	9,000,000.00	9,871,200.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	9,500,000.00	9,643,450.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	8,753,600.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	3,000,000.00	3,733,500.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	2,000,000.00	1,936,000.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	9,000,000.00	9,542,700.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,025,400.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,000,000.00	5,556,000.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	7,500,000.00	8,033,250.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	10,000,000.00	10,130,000.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	8,000,000.00	8,685,600.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	7,000,000.00	7,020,300.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	5,000,000.00	6,810,000.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	5,000,000.00	5,061,000.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	6,000,000.00	6,607,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	6,000,000.00	6,021,600.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,500,000.00	5,503,050.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,500,000.00	6,860,750.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	6,500,000.00	6,414,200.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	5,500,000.00	5,586,350.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	8,000,000.00	7,835,200.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	6,700,000.00	7,118,750.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	5,500,000.00	5,402,100.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	5,000,000.00	4,897,000.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	7,000,000.00	7,179,900.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	7,000,000.00	6,899,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	6,500,000.00	6,419,400.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	5,500,000.00	5,465,900.000	

	UK TREASURY 4.0 01/22/60	4,000,000.00	3,782,000.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 34	223,700,000.00	235,427,950.000	
	組入時価比率 : 7.87%		(31,116,512,152)	
	合計時価比率 : 8.08%			
	CANADA 1.5 03/01/12	3,000,000.00	3,003,750.000	
	CANADA 5.25 06/01/12	9,500,000.00	9,945,360.000	
	CANADA 2.0 09/01/12	9,500,000.00	9,558,045.000	
	CANADA 5.25 06/01/13	10,000,000.00	10,744,800.000	
	CANADA 2.5 09/01/13	8,000,000.00	8,102,400.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	10,875,900.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,000,000.00	6,919,010.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.00	8,661,760.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	3,000,000.00	3,054,600.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	6,000,000.00	6,383,820.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	5,000,000.00	5,319,300.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	4,500,000.00	4,852,350.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	7,000,000.00	7,278,810.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,500,000.00	4,570,425.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,000,000.00	987,170.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	2,300,000.00	3,327,709.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,700,000.00	2,727,701.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	2,500,000.00	3,832,150.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	5,000,000.00	6,358,950.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	5,000,000.00	6,504,750.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	5,500,000.00	6,626,620.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	6,000,000.00	6,310,500.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 22	124,000,000.00	135,945,880.000	
	組入時価比率 : 2.87%		(11,344,683,686)	
	合計時価比率 : 2.94%			
	SWEDEN 5.5 10/08/12	23,000,000.00	24,214,630.000	
	SWEDEN 6.75 05/05/14	30,000,000.00	33,633,900.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	23,000,000.00	24,470,390.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	17,934,300.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	19,000,000.00	19,664,240.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	33,000,000.00	35,381,610.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	33,000,000.00	37,619,670.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	15,467,840.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 8	195,000,000.00	208,386,580.000	
	組入時価比率 : 0.68%		(2,677,767,553)	
	合計時価比率 : 0.70%			
	AUSTRIA 5.0 07/15/12	4,000,000.00	4,193,480.000	
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,500,000.00	2,620,000.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	7,000,000.00	7,469,700.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,111,000.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	4,000,000.00	4,164,000.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	5,000,000.00	5,292,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	4,000,000.00	4,282,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	4,000,000.00	4,366,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	5,000,000.00	5,352,500.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	5,000,000.00	5,150,000.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	5,000,000.00	4,952,500.000	

	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,500,000.00	1,498,500.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,500,000.00	2,776,000.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	3,000,000.00	3,848,700.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,500,000.00	3,577,000.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/12	9,000,000.00	9,392,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	7,000,000.00	7,217,700.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	5,000,000.00	5,100,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	2,000,000.00	2,063,000.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	9,000,000.00	9,348,300.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	5,040,500.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,064,500.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.00	2,885,700.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	4,893,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	4,000,000.00	4,043,600.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	4,000,000.00	4,386,800.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	4,026,800.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	4,000,000.00	4,000,800.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	6,500,000.00	6,288,100.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	1,000,000.00	999,100.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	5,000,000.00	4,886,500.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	6,000,000.00	6,682,800.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,300,000.00	5,637,769.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	1,800,000.00	1,695,060.000	
	BUNDESUBL 4.0 04/13/12	5,000,000.00	5,155,750.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/12	16,000,000.00	16,788,800.000	
	BUNDESUBL 4.25 10/12/12	16,000,000.00	16,735,840.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	19,000,000.00	20,057,350.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	18,000,000.00	18,891,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	18,000,000.00	19,241,100.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	19,000,000.00	20,433,550.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	19,000,000.00	20,193,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	18,000,000.00	18,808,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	12,000,000.00	12,646,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	10,000,000.00	10,779,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	8,000,000.00	8,516,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	8,000,000.00	8,738,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	8,000,000.00	8,615,200.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	9,000,000.00	9,831,600.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	9,000,000.00	9,508,500.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	9,000,000.00	9,339,300.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	9,000,000.00	9,133,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	8,000,000.00	7,932,000.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	6,000,000.00	5,590,200.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	5,000,000.00	4,738,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	4,000,000.00	5,186,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	4,500,000.00	6,106,500.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	5,500,000.00	6,870,600.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	4,500,000.00	5,142,600.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	3,500,000.00	4,742,500.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	6,500,000.00	8,145,150.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	8,000,000.00	9,355,200.000	

	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	9,000,000.00	9,522,720.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	5,500,000.00	6,135,250.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	6,500,000.00	7,857,850.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,500,000.00	1,414,650.000	
	SPAIN 5.0 07/30/12	11,000,000.00	11,399,410.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	11,000,000.00	11,660,990.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	10,000,000.00	10,244,200.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	8,000,000.00	8,153,600.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	6,000,000.00	6,223,260.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	5,000,000.00	4,917,750.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	7,084,000.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.00	5,748,600.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	8,500,000.00	8,043,550.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	5,000,000.00	4,772,500.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	6,000,000.00	6,280,260.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	5,699,400.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	5,000,000.00	4,835,500.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	6,000,000.00	5,670,300.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	5,000,000.00	4,597,000.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	5,000,000.00	4,857,750.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,000,000.00	2,014,000.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	6,000,000.00	5,579,100.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,500,000.00	4,908,200.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	7,000,000.00	7,069,510.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,500,000.00	5,370,200.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	6,000,000.00	4,606,980.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	5,000,000.00	4,222,500.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,500,000.00	2,868,250.000	
	FINLAND 4.25 09/15/12	2,000,000.00	2,081,000.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	3,000,000.00	3,252,750.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,556,400.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	2,000,000.00	2,155,500.000	
	FINLAND 1.75 04/15/16	3,000,000.00	2,889,600.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	3,000,000.00	3,172,500.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,167,300.000	
	FINLAND 3.375 04/15/20	1,000,000.00	1,003,750.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	2,800,000.00	2,903,880.000	
	FRANCE OAT 5.0 04/25/12	9,000,000.00	9,380,700.000	
	FR TREASURY 4.5 07/12/12	2,000,000.00	2,078,580.000	
	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	18,000,000.00	18,936,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	18,000,000.00	18,865,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	14,000,000.00	14,840,000.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,157,500.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	14,000,000.00	14,834,400.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	13,000,000.00	13,819,000.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	16,000,000.00	16,696,000.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	17,000,000.00	17,336,600.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	13,000,000.00	13,357,500.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,150,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	9,000,000.00	9,424,800.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,600,800.000	

	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.00	9,513,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.00	8,586,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	10,500,000.00	11,241,300.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,000,000.00	5,559,200.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	8,000,000.00	8,237,600.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/20	10,000,000.00	10,053,000.000	
	FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,000,000.00	6,438,950.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	11,500,000.00	11,719,650.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	5,921,600.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	9,500,000.00	10,028,200.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.00	7,503,600.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,000,000.00	5,785,200.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,000,000.00	9,592,000.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,000,000.00	10,032,000.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	7,000,000.00	7,798,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	9,500,000.00	9,508,550.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,000,000.00	5,429,750.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	6,000,000.00	6,019,200.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,000,000.00	2,992,200.000	
	IRISH 3.9 03/05/12	2,000,000.00	1,980,220.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	3,000,000.00	2,863,140.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	2,664,150.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	2,493,750.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,293,350.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,228,280.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	3,000,000.00	2,436,600.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,165,940.000	
	IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.00	1,465,200.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	2,157,900.000	
	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	13,000,000.00	13,366,210.000	
	ITALY BTPS 4.0 04/15/12	10,000,000.00	10,215,500.000	
	ITALY BTPS 4.25 10/15/12	17,000,000.00	17,481,100.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	14,000,000.00	14,519,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	16,000,000.00	16,444,800.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	12,000,000.00	12,174,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	19,000,000.00	19,492,100.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	13,000,000.00	13,305,500.000	
	ITALY BTPS 3.0 04/15/15	10,000,000.00	9,755,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.00	15,034,500.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	12,500,000.00	12,451,250.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	9,000,000.00	9,000,900.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	9,000,000.00	9,542,700.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	9,000,000.00	9,123,300.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	8,000,000.00	8,074,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,500,000.00	8,408,200.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	8,500,000.00	8,520,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	9,000,000.00	8,823,600.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	9,000,000.00	8,938,800.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	9,000,000.00	8,734,500.000	
	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	9,000,000.00	8,525,700.000	
	ITALY BTPS 3.75 03/01/21	6,500,000.00	5,974,150.000	

	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	11,000,000.00	10,126,600.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,000,000.00	6,860,000.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	5,000,000.00	6,813,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	7,500,000.00	7,372,125.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/26	4,000,000.00	3,721,600.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	4,000,000.00	4,810,000.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	10,500,000.00	11,762,100.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	11,000,000.00	10,893,300.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	11,500,000.00	12,236,000.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	6,000,000.00	6,201,600.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,500,000.00	8,015,500.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	9,500,000.00	7,709,250.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	7,500,000.00	6,987,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	6,800,000.00	6,312,440.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/12	7,000,000.00	7,344,400.000	
	NETHERLANDS 1.75 01/15/13	1,500,000.00	1,506,150.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	7,000,000.00	7,414,400.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,388,500.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	5,000,000.00	5,096,500.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,223,200.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,343,500.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	6,000,000.00	6,560,400.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	5,000,000.00	5,308,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	6,000,000.00	6,349,800.000	
	NETHERLANDS 3.5 07/15/20	6,000,000.00	6,085,800.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,248,250.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	5,519,250.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,500,000.00	4,723,650.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,800,000.00	2,854,320.000	
	PORTUGUESE 5.0 06/15/12	3,000,000.00	3,040,500.000	
	PORTUGUESE 5.45 09/23/13	3,000,000.00	2,988,990.000	
	PORTUGUESE 4.375 06/16/14	4,000,000.00	3,754,800.000	
	PORTUGUESE 3.35 10/15/15	2,000,000.00	1,738,400.000	
	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	4,330,000.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	1,688,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	2,520,600.000	
	PORTUGUESE 4.75 06/14/19	2,000,000.00	1,695,100.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	2,262,630.000	
	PORTUGUESE 4.95 10/25/23	3,000,000.00	2,415,000.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	2,145,000.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 204	1,435,500,000.00	1,480,926,784.000	
	組入時価比率 : 42.40%		(167,626,102,681)	
	合計時価比率 : 43.51%			
	DENMARK 4.0 11/15/12	24,000,000.00	25,020,000.000	
	DENMARK 5.0 11/15/13	35,000,000.00	37,884,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	32,000,000.00	34,172,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	25,000,000.00	26,770,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	33,000,000.00	35,019,600.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	11,000,000.00	15,226,200.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	38,000,000.00	44,751,840.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 7	198,000,000.00	218,844,440.000	

	組入時価比率 : 0.84%		(3,322,058,599)
	合計時価比率 : 0.86%		
	NORWAY 6.5 05/15/13	20,000,000.00	21,682,000.000
	NORWAY 5.0 05/15/15	20,000,000.00	21,520,000.000
	NORWAY 4.25 05/19/17	17,000,000.00	17,782,000.000
	NORWAY 4.5 05/22/19	9,000,000.00	9,562,500.000
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 4	66,000,000.00	70,546,500.000
	組入時価比率 : 0.26%		(1,030,684,365)
	合計時価比率 : 0.27%		
	POLAND 4.75 04/25/12	19,000,000.00	19,019,000.000
	POLAND 10/25/12	4,000,000.00	3,686,200.000
	POLAND 5.25 04/25/13	14,000,000.00	14,041,440.000
	POLAND 5.0 10/24/13	10,000,000.00	9,950,000.000
	POLAND 5.75 04/25/14	18,000,000.00	18,173,700.000
	POLAND 6.25 10/24/15	16,000,000.00	16,420,000.000
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	11,566,200.000
	POLAND 5.5 10/25/19	12,000,000.00	11,417,400.000
	POLAND 5.25 10/25/20	4,000,000.00	3,701,600.000
	POLAND 5.75 09/23/22	12,000,000.00	11,430,000.000
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.00	2,758,050.000
ポーランドズロチ小計	銘柄数 : 11	124,000,000.00	122,163,590.000
	組入時価比率 : 0.88%		(3,464,559,412)
	合計時価比率 : 0.90%		
	SINGAPORE 2.625 04/01/12	3,000,000.00	3,072,090.000
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	3,000,000.00	3,138,150.000
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,435,440.000
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	3,000,000.00	3,335,970.000
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,806,325.000
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	2,949,408.000
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,700,000.00	1,746,597.000
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,000,000.00	2,085,500.000
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	300,000.00	282,963.000
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 9	22,300,000.00	23,852,443.000
	組入時価比率 : 0.39%		(1,532,042,414)
	合計時価比率 : 0.40%		
	MALAYSIA 3.718 06/15/12	15,000,000.00	15,151,800.000
	MALAYSIA 3.702 02/25/13	8,000,000.00	8,093,760.000
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,683,800.000
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,240,870.000
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	7,070,700.000
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,159,950.000
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	6,000,000.00	6,173,160.000
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,435,750.000
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,161,540.000
マレーシアリングット小計	銘柄数 : 9	70,000,000.00	71,171,330.000
	組入時価比率 : 0.48%		(1,907,391,644)
	合計時価比率 : 0.50%		
	AUSTRALIAN 5.75 04/15/12	5,500,000.00	5,553,130.000
	AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	9,000,000.00	9,271,890.000
	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	7,500,000.00	7,734,450.000
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	6,000,000.00	6,214,440.000

	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	2,500,000.00	2,426,800.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	6,000,000.00	6,175,500.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	5,000,000.00	4,914,600.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,500,000.00	4,164,615.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	4,000,000.00	4,053,560.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,000,000.00	2,022,340.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 10	52,000,000.00	52,531,325.000	
	組入時価比率 : 1.10%		(4,353,796,216)	
	合計時価比率 : 1.13%			
	MEXICAN BONDS 9.0 12/20/12	85,000,000.00	90,579,400.000	
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	120,000,000.00	132,684,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.00	72,431,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	60,000,000.00	62,043,600.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	45,000,000.00	53,413,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	43,000,000.00	44,412,550.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	35,000,000.00	35,407,750.000	
メキシコ ペソ小計	銘柄数 : 7	458,000,000.00	490,972,300.000	
	組入時価比率 : 0.84%		(3,309,153,302)	
	合計時価比率 : 0.86%			
合計			385,269,775,107	
			(385,269,775,107)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 106銘柄	38.85%	39.86%
英ポンド	国債証券 34銘柄	7.87%	8.08%
カナダドル	国債証券 22銘柄	2.87%	2.94%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	0.68%	0.70%
ユーロ	国債証券 204銘柄	42.40%	43.51%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.84%	0.86%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	0.26%	0.27%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	0.88%	0.90%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.39%	0.40%
マレーシアリングgit	国債証券 9銘柄	0.48%	0.50%
オーストラリアドル	国債証券 10銘柄	1.10%	1.13%
メキシコ ペソ	国債証券 7銘柄	0.84%	0.86%

(注)「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

平成23年2月28日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	4,442,339,512円
負債総額	17,453,251円
純資産総額（ - ）	4,424,886,261円
発行済数量	3,790,923,660口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1672円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

平成23年2月28日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	10,885,606,635円
負債総額	26,401,398円
純資産総額（ - ）	10,859,205,237円
発行済数量	8,971,334,326口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2104円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

平成23年2月28日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	8,728,969,516円
負債総額	25,315,204円
純資産総額（ - ）	8,703,654,312円
発行済数量	6,991,086,503口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2450円

(参考) マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	276,342,113,170円
負債総額	105,682,000円
純資産総額（ - ）	276,236,431,170円
発行済数量	222,749,743,528口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2401円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	288,612,446,862円
負債総額	140,550,416円
純資産総額（ - ）	288,471,896,446円
発行済数量	213,995,609,168口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3480円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	444,524,980,353円
負債総額	12,270,096,000円
純資産総額（ - ）	432,254,884,353円
発行済数量	388,553,660,106口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1125円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	393,888,491,520円
負債総額	143,389,640円
純資産総額（ - ）	393,745,101,880円
発行済数量	345,967,676,090口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1381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。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(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

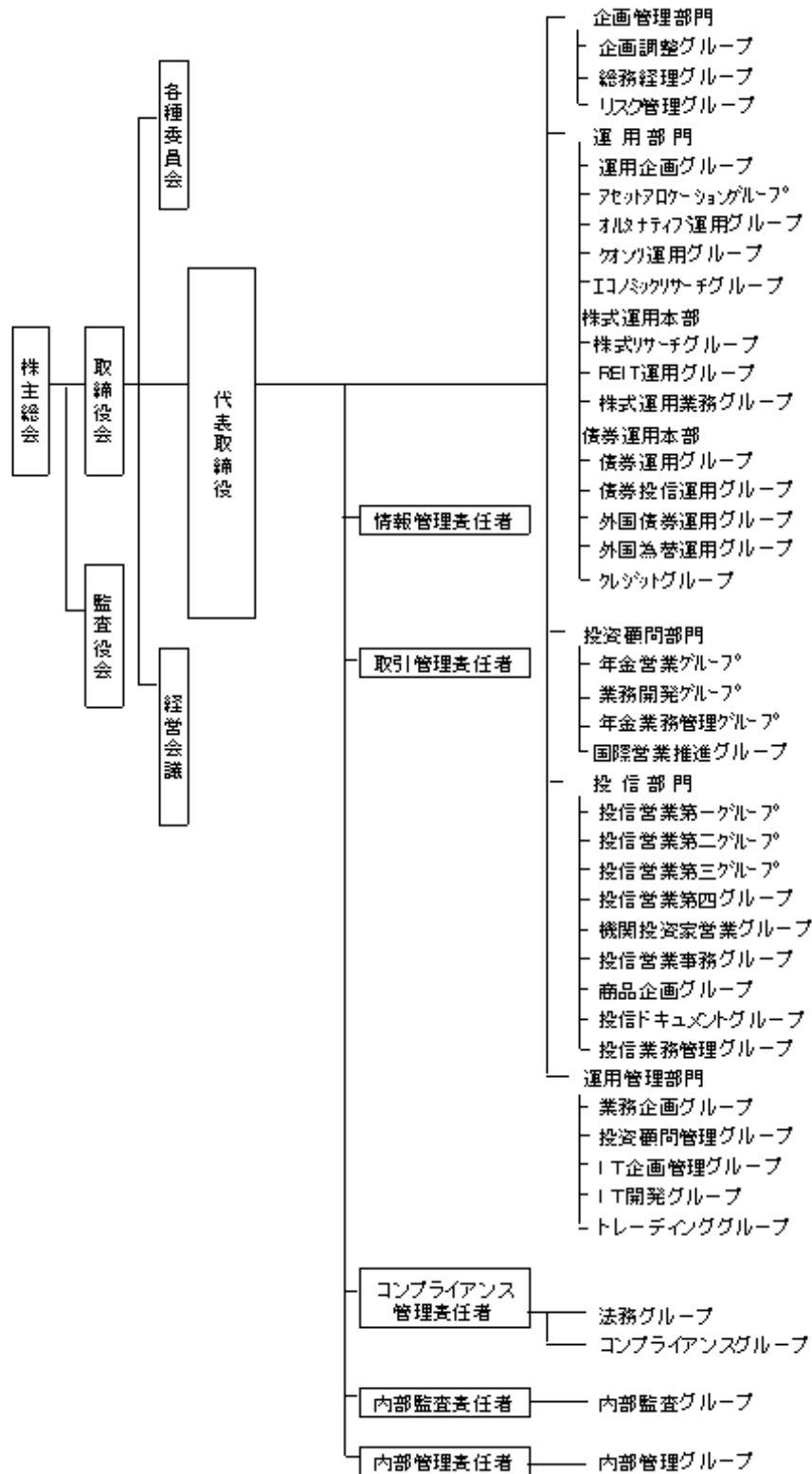
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

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

会社の組織図



上記組織は、平成23年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

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。

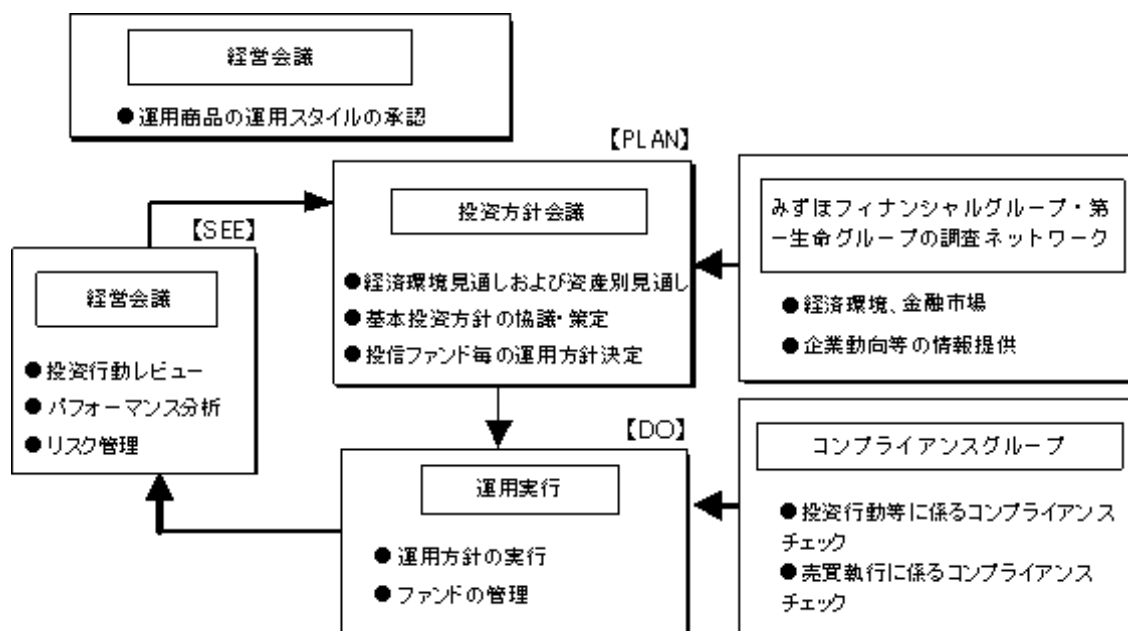
投資運用の意思決定機構

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23年2月28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」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は283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	18	76,217,626,291
追加型株式投資信託	251	4,223,166,294,931
単位型公社債投資信託	13	110,051,164,480
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	307,143,149
合計	283	4,409,742,228,851

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、以下「財務諸表等規則」という。）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、以下「中間財務諸表等規則」という。）、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。

なお、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表およ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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）および第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22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26期中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22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24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,558,999	13,820,588
金銭の信託	-	399,833
前払費用	54,242	33,221
未収委託者報酬	2,254,741	3,169,323
未収運用受託報酬	1,046,291	1,000,785
未収投資助言報酬	2 252,337	2 271,577
未収収益	197,045	247,552
未収消費税等	98,402	-
繰延税金資産	369,826	383,608
その他	23,865	21,009
流動資産計	16,855,752	19,347,501
固定資産		
有形固定資産	501,481	599,421
建物	1 283,511	1 237,642
器具備品	1 201,169	1 351,237
建設仮勘定	16,799	10,541
無形固定資産	721,812	964,184
商標権	1 1,335	1 804
ソフトウェア	1 555,121	1 557,870
ソフトウェア仮勘定	157,595	397,829
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 611	1 531
投資その他の資産	4,051,090	5,247,891
投資有価証券	498,041	1,194,081
関係会社株式	1,661,144	2,161,144
繰延税金資産	442,390	403,908
長期差入保証金	1,169,961	1,187,070
その他	306,478	328,612
貸倒引当金	26,925	26,925
固定資産計	5,274,384	6,811,497
資産合計	22,130,137	26,158,999

（単位：千円）

	第24期 （平成21年3月31日現在）	第25期 （平成22年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	37,445	119,466
未払金	1,293,636	1,526,031
未払収益分配金	8,201	7,837
未払償還金	48,993	96,340
未払手数料	931,529	1,206,815
その他未払金	304,912	215,038
未払費用	2 1,040,620	2 1,522,325
未払法人税等	179,557	1,283,275
未払消費税等	-	113,923
賞与引当金	618,303	572,614
その他	20,741	38,231
流動負債計	3,190,304	5,175,867
固定負債		
退職給付引当金	404,437	488,790
役員退職慰労引当金	145,732	96,342
固定負債計	550,169	585,133
負債合計	3,740,474	5,761,000
（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	13,962,732	15,737,995
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	10,040,000	11,650,000
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	3,299,438	3,464,702
株主資本計	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,547	231,525
評価・換算差額等計	1,547	231,525
純資産合計	18,389,662	20,397,999
負債・純資産合計	22,130,137	26,158,999

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)		第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	24,552,133		26,734,588	
運用受託報酬	4,509,994		4,297,349	
投資助言報酬	1,228,096		1,027,153	
その他営業収益	697,007		723,055	
営業収益計		30,987,232		32,782,146
営業費用				
支払手数料	10,967,681		13,000,141	
広告宣伝費	488,151		218,782	
公告費	-		1,767	
調査費	5,076,631		5,056,427	
調査費	2,506,175		2,555,070	
委託調査費	2,570,455		2,501,356	
委託計算費	325,174		351,370	
営業雑経費	812,013		679,608	
通信費	35,872		32,088	
印刷費	732,985		613,198	
協会費	25,313		21,225	
諸会費	41		41	
支払販売手数料	17,800		13,054	
営業費用計		17,669,652		19,308,097
一般管理費				
給料	4,587,983		4,678,614	
役員報酬	1 234,353		1 244,725	
給料・手当	3,647,502		3,840,052	
賞与	706,127		593,836	
交際費	44,085		45,342	
寄付金	4,462		3,450	
旅費交通費	308,237		269,516	
租税公課	82,762		85,030	
不動産賃借料	801,086		791,980	
退職給付費用	106,223		132,513	
固定資産減価償却費	330,412		397,252	
福利厚生費	22,556		22,233	
修繕費	6,755		5,615	
賞与引当金繰入	618,303		572,614	
役員退職慰労引当金繰入	42,570		45,086	
役員退職金	13,175		18,129	
機器リース料	973		2,191	
事務委託費	247,087		285,449	
消耗品費	84,099		78,753	
器具備品費	6,094		2,046	
諸経費	177,386		88,728	
一般管理費計		7,484,253		7,524,549
営業利益		5,833,325		5,949,500

（単位：千円）

	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）		第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		4,558		5,287
受取利息		59,458		18,745
時効成立分配金		164		157
投資信託解約益		-		559,971
先物利益		180,422		-
雑収入		5,482		3,431
営業外収益計		250,086		587,592
営業外費用				
為替差損		24,553		17,771
時効成立後支払分配金		517		444
投資信託解約損		38,254		-
先物損失		-		719,577
金銭の信託運用損		-		1,116
営業外費用計		63,325		738,911
経常利益		6,020,086		5,798,181
特別損失				
固定資産除却損	2	14,476	2	21,626
固定資産売却損		-		2,464
ゴルフ会員権評価損		6,000		-
投資有価証券評価損		484,009		-
特別損失計		504,485		24,090
税引前当期純利益		5,515,600		5,774,091
法人税、住民税及び事業税		2,301,373		2,508,095
法人税等調整額		30,266		135,267
法人税等合計		2,271,106		2,372,828
当期純利益		3,244,494		3,401,263

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	7,040,000	10,040,000
当期変動額	3,000,000	1,610,000
当期末残高	10,040,000	11,650,000
研究開発積立金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
前期末残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	6,054,944	3,299,438
当期変動額		
剰余金の配当	3,000,000	1,626,000
別途積立金の積立	3,000,000	1,610,000
当期純利益	3,244,494	3,401,263
当期末残高	3,299,438	3,464,702
株主資本合計		
前期末残高	18,146,716	18,391,210
当期変動額	244,494	1,775,263
当期末残高	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	10,012	1,547
当期変動額（純額）	8,464	233,073
当期末残高	1,547	231,525
純資産合計		
前期末残高	18,136,703	18,389,662
当期変動額	252,958	2,008,336
当期末残高	18,389,662	20,397,999

[次へ](#)

重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）</p>	<p style="text-align: center;">第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）</p>
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 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> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>4. 外貨建の資産およ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。</p> <p>5. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</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、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期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。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. 金銭の信託の評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左</p> <p>5. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>6. 引当金の計上基準 (1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>(3) 同左</p> <p>（会計方針の変更） 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正（その3）」（企業会計基準委員会 平成20年7月31日 企業会計基準第19号）を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> <p>(4) 同左</p>

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
<p>6. リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p>

会計方針の変更

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>	<p>_____</p>

表示方法の変更

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<p>(貸借対照表)</p> <p>1. 前事業年度において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当事業年度から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。</p> <p>2. 前事業年度において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。</p> <p>(損益計算書)</p> <p>前事業年度において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。</p>	<hr/>

追加情報

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<hr/>	<p>当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）																																
<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr><td>建物</td><td>426,679千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>290,397千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>6,351千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>648,713千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>985千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産およ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。</p> <table border="1"> <tr> <td>流動資産</td> <td>未収投資助言報酬</td> <td>251,392千円</td> </tr> <tr> <td>流動負債</td> <td>未払費用</td> <td>345,744千円</td> </tr> </table>	建物	426,679千円	器具備品	290,397千円	商標権	6,351千円	ソフトウェア	648,713千円	電話施設利用権	985千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円	流動負債	未払費用	345,744千円	<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr><td>建物</td><td>471,484千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>356,326千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>6,882千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>684,370千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>1,065千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産およ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。</p> <table border="1"> <tr> <td>流動資産</td> <td>未収投資助言報酬</td> <td>270,492千円</td> </tr> <tr> <td>流動負債</td> <td>未払費用</td> <td>400,075千円</td> </tr> </table>	建物	471,484千円	器具備品	356,326千円	商標権	6,882千円	ソフトウェア	684,370千円	電話施設利用権	1,065千円	流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動負債	未払費用	400,075千円
建物	426,679千円																																
器具備品	290,397千円																																
商標権	6,351千円																																
ソフトウェア	648,713千円																																
電話施設利用権	985千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円																															
流動負債	未払費用	345,744千円																															
建物	471,484千円																																
器具備品	356,326千円																																
商標権	6,882千円																																
ソフトウェア	684,370千円																																
電話施設利用権	1,065千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円																															
流動負債	未払費用	400,075千円																															

(損益計算書関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1. 役員報酬の限度額 取締役 年額250,000千円 監査役 年額 50,000千円 2. 固定資産除却損の内訳 建物 2,251千円 器具備品 9,818千円 ソフトウェア 2,406千円	1. 役員報酬の限度額 同左 2. 固定資産除却損の内訳 建物 1,199千円 器具備品 15,159千円 ソフトウェア 5,267千円

(株主資本等変動計算書関係)

第24期(自平成20年4月1日 至平成21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	前事業年度末 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20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

第25期(自平成21年4月1日 至平成22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	前事業年度末 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21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(リース取引関係)

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)				第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)			
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額 相当額	52,335千円	-	52,335千円	減価償却累計額 相当額	75,063千円	-	75,063千円
期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円	期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円	未経過リース料 期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払 利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払 利息相当額			
支払リース料		24,096千円		支払リース料		24,096千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		22,727千円	
支払利息相当額		1,501千円		支払利息相当額		845千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定 額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との 差額を利息相当額とし、各期への配分方法につい ては、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2. オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のもの に係る未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
	1,609千円	1,475千円	3,084千円		1,609千円	1,475千円	3,084千円

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	
(1)金融商品に対する取組方針	<p>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。</p> <p>デリバティブは、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。</p> <p>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。</p>
(2)金融商品の内容およびそのリスク	<p>投資有価証券および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であり、為替およ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。</p> <p>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・保証金であります。</p> <p>デリバティブ取引は、投資有価証券および金銭の信託に係る為替および市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引および株価指数先物取引等であります。</p>
(3)金融商品に係るリスク管理体制	<p>信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理</p> <p>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。</p> <p>市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理</p> <p>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、損益およ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。</p> <p>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</p> <p>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。</p>
(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価およ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）。

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	13,820,588	13,820,588	-
(2) 金銭の信託	399,833	399,833	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	1,111,335	1,111,335	-
(4) 長期差入保証金	61,485	61,485	-
資産計	15,393,243	15,393,243	-
(1) 未払法人税等	1,283,275	1,283,275	-
負債計	1,283,275	1,283,275	-
デリバティブ取引(*)	(38,094)	(38,094)	-

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

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。

(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。

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、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。

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）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（貸借対照表計上額2,161,144千円）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。

長期差入保証金のうち、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・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

(注3) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,819,459	-	-	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
(3) 長期差入保証金(*)	61,485	-	-	-
合計	13,880,945	-	-	-

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である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・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

(注4) 社債、新株予約権付社債およ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）

第24期（平成21年3月31日現在）

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で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	146,101	146,101	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	271,802	269,192	2,610
小計	417,904	415,294	2,610
合計	417,904	415,294	2,610

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

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
3,021,000	20,615	58,869

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 82,746千円

8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

第25期（平成22年3月31日現在）

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. 子会社株式および関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）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

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	368,968	146,101	222,866
債券	-	-	-
その他（投資信託）	716,414	544,802	171,611
小計	1,085,382	690,904	394,477
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）	25,953	30,000	4,047
小計	25,953	30,000	4,047
合計	1,111,335	720,904	390,430

（注）非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）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

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
2,070,000	563,988	4,017

（金銭の信託関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

該当事項はありません。

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。

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	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	399,833	838

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）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
<p>(1)取引の内容 為替予約取引及び株価指数先物取引を利用しております。</p> <p>(2)取引に対する取組方針 実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。</p> <p>(3)取引の利用目的 その他有価証券に含まれる為替変動リスク及び株価変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(4)取引に係るリスクの内容 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。</p> <p>(5)取引に係るリスク管理体制 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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。</p> <p>(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

2. 取引の時価等に関する事項

(1) 通貨関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	24,432	-	24,960	528
	香港ドル	34,020	-	34,412	392
	豪ドル	77,510	-	78,736	1,226
	シンガポールドル	12,564	-	12,672	107
合計		148,527	-	150,782	2,255

(注1) 時価の算定方法

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。

(2) 株式関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	212,667	-	230,215	17,547
合計		212,667	-	230,215	17,547

(注2) 時価の算定方法

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。

第25期(平成22年3月31日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	22,960	-	743	743
	香港ドル	27,416	-	264	264
	豪ドル	101,481	-	1,076	1,076
	シンガポールドル	14,547	-	154	154
合計		166,405	-	2,238	2,238

(注1) 時価の算定方法

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。

(2) 株式関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	561,971	-	29,413	29,413
合計		561,971	-	29,413	29,413

(注2) 時価の算定方法

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) 不動産投資信託関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	REIT指数先物取引 売建	104,418	-	6,442	6,442
合計		104,418	-	6,442	6,442

(注3) 時価の算定方法

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。

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)

第24期(平成21年3月31日現在)

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. 退職給付債務に関する事項

当社は、原則法を適用しております。

(1) 退職給付債務 (平成21年3月31日現在) (千円)

退職給付債務	431,448
未認識数理計算上の差異	27,011
退職給付引当金	404,437

(2) 退職給付費用 (千円)

勤務費用	71,958
確定拠出年金 拠出額	34,264
退職給付費用	106,223

3. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第24期 (平成21年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

第25期（平成22年3月31日現在）

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．退職給付債務に関する事項

第25期
（平成22年3月31日現在）（千円）

（1）	退職給付債務	530,305
（2）	未認識数理計算上の差異	41,515
	退職給付引当金	488,790

3．退職給付費用に関する事項

第25期
（自平成21年4月1日
至平成22年3月31日）（千円）

（1）	勤務費用	82,653
（2）	利息費用	6,471
（3）	数理計算上の差異の費用処理額	5,402
（4）	確定拠出年金 拠出額	37,987
	退職給付費用	132,513

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第25期 （平成22年3月31日）	
（1）	割引率（％）	1.5
（2）	退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
（3）	数理計算上の差異の処理年数（年）	5

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	19,218	108,541
未払事業所税	6,269	6,290
賞与引当金	251,649	233,054
未払法定福利費	27,146	26,912
未払確定拠出年金掛金	2,667	2,712
減価償却超過額	7,579	17,598
減価償却超過額（一括償却資産）	8,559	6,098
繰延資産償却超過額（税法上）	46,274	89,657
その他（未払金等）	461	-
退職給付引当金	164,605	198,937
役員退職慰労引当金	59,313	39,211
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	196,991	66,421
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	1,062	-
繰延税金資産合計	812,216	815,851
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	28,334
繰延税金負債合計	-	28,334
差引繰延税金資産の純額	812,216	787,517

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

第24期については、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。

第25期については、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。

（関連当事者との取引）

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

(1)親会社および法人主要株主等

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	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円(基金および基金償却積立金)	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向3名, 転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投信の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	718,870	未収投資助言報酬	172,117
								販売手数料の支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

取引条件およ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）支払販売手数料は、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3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

（注4）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

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	933,784	未払費用	236,518
	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	324,748	未払費用	109,093

取引条件およ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）上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

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	6,500 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	1,531,236	未払 手数料	96,917
								預金の引出 (純額)	300,370	現金・ 預金	322,365
								受取利息	894	未収 収益	-
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほコー ポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 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	701,162	未払 手数料	91,628
								預金の引出 (純額)	1,034,219	現金・ 預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収 収益	4,158
その他の 関係会 社の子 会社	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 運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	299,054	未払 費用	117,438
								業務委託料 の支払	17,550	未払 費用	2,677

取引条件およ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3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 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5) 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。

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

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	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円(基金償却積立金)	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向3名, 転籍2名	資産の運用および助言, 当社設定投資の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	711,279	未収投資助言報酬	190,025
								販売手数料の支払	13,054	-	-
								保険料の支払	6,572	-	-

取引条件およ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) 支払販売手数料は、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3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- (注4) 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5) 平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	785,924	未払費用	296,169
	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	244,629	未払費用	98,673

取引条件およ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) 上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

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	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	1,434,905	未払 手数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	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	613,204	未払 手数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	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 運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	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)	401,000	金銭の 信託	399,833
								信託報酬の 支払	130		

取引条件およ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3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 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5) 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6) 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24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

(注) 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24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
<p>平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management(HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。</p> <p>当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。</p> <p><子会社の概要> 商号：DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容：資産運用業務 設立年月日：平成21年3月19日 資本金：500,000千円 発行済株式総数：500,000株 出資の総額：500,000千円 出資比率：当社100%</p>	—

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,413,600
金銭の信託		2,920,386
前払費用		70,721
未収委託者報酬		2,870,054
未収運用受託報酬		1,587,601
未収投資助言報酬		258,177
未収収益		248,853
繰延税金資産		379,771
その他		27,218
	流動資産計	19,776,384
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,226
器具備品	1	275,229
無形固定資産		
商標権	1	657
ソフトウェア	1	843,268
ソフトウェア仮勘定		201,594
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	491
投資その他の資産		
投資有価証券		744,900
関係会社株式		2,161,144
繰延税金資産		501,175
長期差入保証金		1,126,064
その他		274,365
貸倒引当金		26,925
	固定資産計	6,309,341
資産合計		26,085,726

（単位：千円）

	第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	48,469
未払金	1,382,417
未払収益分配金	5,782
未払償還金	96,340
未払手数料	1,104,913
その他未払金	175,381
未払費用	1,319,766
未払法人税等	1,403,804
未払消費税等	127,640
前受収益	4,618
賞与引当金	574,949
その他	1,954
流動負債計	4,863,621
固定負債	
退職給付引当金	527,297
役員退職慰労引当金	114,975
固定負債計	642,273
負債合計	5,505,894
（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	16,008,292
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	13,430,000
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	1,954,999
株主資本計	20,436,770
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	143,061
評価・換算差額等計	143,061
純資産合計	20,579,831
負債・純資産合計	26,085,726

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,201,192	
運用受託報酬	2,208,627	
投資助言報酬	507,704	
その他営業収益	389,513	
営業収益計		15,307,036
営業費用		
支払手数料	5,187,472	
広告宣伝費	138,372	
公告費	2,297	
調査費	2,474,627	
調査費	1,342,551	
委託調査費	1,132,076	
委託計算費	170,599	
営業雑経費	360,908	
通信費	15,757	
印刷費	314,154	
協会費	11,780	
諸会費	19	
支払販売手数料	19,198	
営業費用計		8,334,278
一般管理費		
給料	2,017,035	
役員報酬	114,069	
給料・手当	1,902,965	
交際費	19,811	
寄付金	3,335	
旅費交通費	125,337	
租税公課	48,553	
不動産賃借料	379,036	
退職給付費用	66,781	
固定資産減価償却費	1 243,188	
福利厚生費	11,501	
修繕費	20,312	
賞与引当金繰入	574,949	
役員退職慰労引当金繰入	26,751	
役員退職金	540	
機器リース料	1,135	
事務委託費	140,006	
消耗品費	35,920	
器具備品費	258	
諸経費	78,421	
一般管理費計		3,792,878
営業利益		3,179,879

（単位：千円）

	第26期中間会計期間 （自平成22年4月1日至平成22年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	4,651	
受取利息	5,935	
時効成立分配金	15	
為替差益	4,255	
投資信託解約益	86,546	
先物利益	26,131	
金銭信託運用益	20,662	
雑収入	7,666	
営業外収益計		155,865
経常利益		3,335,745
特別損失		
固定資産除却損	27,791	
固定資産売却損	1,440	
特別損失計		29,232
税引前中間純利益		3,306,512
法人税、住民税及び事業税		1,388,928
法人税等調整額		32,712
法人税等合計		1,356,215
中間純利益		1,950,296

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	前期末残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	前期末残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	前期末残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	前期末残高	11,650,000
	当中間期変動額	1,780,000
	当中間期末残高	13,430,000
	研究開発積立金	
	前期末残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	前期末残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	前期末残高	3,464,702
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	1,680,000
	別途積立金の積立	1,780,000
	中間純利益	1,950,296
	当中間期末残高	1,954,999
	利益剰余金合計	
	前期末残高	15,737,995
	当中間期変動額	270,296
	当中間期末残高	16,008,292
	株主資本合計	
	前期末残高	20,166,473
	当中間期変動額	270,296

	当中間期末残高	20,436,770
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	前期末残高	231,525
	当中間期変動額(純額)	88,464
	当中間期末残高	143,061
純資産合計		
	前期末残高	20,397,999
	当中間期変動額	181,832
	当中間期末残高	20,579,831

[前へ](#) [次へ](#)

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

項目	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)
1. 有価証券の評価基準および評価方法	(1)子会社株式および関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)其他有価証券 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および評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：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。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
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、数理計算上の差異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 (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. 外貨建ての資産およ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. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8. 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：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)

1. 固定資産の減価償却累計額	建物	...	468,310千円
	器具備品	...	423,931千円
	商標権	...	2,281千円
	ソフトウェア	...	667,311千円
	電話施設利用権	...	1,105千円

(中間損益計算書関係)

項目	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)		
	1. 減価償却実施額	有形固定資産	...
	無形固定資産	...	142,297千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22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	前事業年度末 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22年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(リース取引関係)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1. ファイナンス・リース取引

(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース資産の内容

該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項「4. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および中間期末残高相当額

	器具備品
取得価額相当額	56,261千円
減価償却累計額相当額	50,252千円
中間期末残高相当額	6,009千円

未経過リース料中間期末残高相当額

	1年以内	1年超	合計
	6,401千円	-	6,401千円

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額

支払リース料	10,125千円
減価償却費相当額	9,528千円
支払利息相当額	176千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

2. オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料中間期末残高相当額

	1年以内	1年超	合計
	1,609千円	670千円	2,279千円

（金融商品関係）

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,413,600	11,413,600	-
(2) 金銭の信託	2,920,386	2,920,386	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	662,154	662,154	-
資産計	14,996,141	14,996,141	-
(1) 未払法人税等	1,403,804	1,403,804	-
負債計	1,403,804	1,403,804	-
デリバティブ取引(*)	(195)	(195)	-

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

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所の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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額82,746千円）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（中間貸借対照表計上額2,161,144千円）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。

長期差入保証金のうち、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・保証金等（中間貸借対照表計上額1,126,064千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成22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. 子会社株式および関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,161,144千円）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	339,574	146,101	193,472
債券	-	-	-
その他（投資信託）	299,201	244,802	54,398
小計	638,775	390,904	247,870
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）	23,379	30,000	6,621
小計	23,379	30,000	6,621
合計	662,154	420,904	241,249

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額82,746千円）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26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

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
該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

区分	種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	21,781	-	565	565
	香港ドル	24,339	-	128	128
	豪ドル	92,448	-	229	229
	シンガポールドル	13,986	-	17	17
	合計	152,556	-	481	481

(注1) 時価の算定方法

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。

(2) 株式関連

区分	種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	292,423	-	676	676
	合計	292,423	-	676	676

(注2) 時価の算定方法

取引所の価格によっております。

(セグメント情報等)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、投資信託およ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	12,201,192	2,716,331	389,513	15,307,036

(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。

(追加情報)

当中間会計期間より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

(持分法損益等)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）	
1株当たり純資産額	857,492円 98銭
1株当たり中間純利益金額	81,262円 37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26期中間会計期間 （自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
中間純利益	1,950,296千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,950,296千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

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21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。

・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更

- (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22年3月31日現在 247,260百万円

c.事業の内容

日本において信託銀行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。

(平成22年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
労働金庫連合会	(1)120,000	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央機関です。
第一生命保険株式会社(2)	(2)210,200	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパン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います。

(1)出資の総額

(2)平成22年4月1日

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。
（委託会社の略称： D I A M 、当ファンドの略称： D C バラ 1、D C バラ 2、D C バラ 3）

独立監査人の監査報告書

平成23年4月6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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 渉 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バランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成22年2月26日から平成23年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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バランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成23年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年4月6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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 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バランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型の平成22年2月26日から平成23年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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バランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型の平成23年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年4月6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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 渉 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バランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成22年2月26日から平成23年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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バランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成23年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#) [委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30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 浅野 功 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 近藤 敏弘 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21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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。

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）上記は、独立監査人の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。

[ファンド監査報告書3へ](#) [委託会社の監査報告書（中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月10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	浅野 功 印
--------------------	-------	--------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 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22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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22年4月1日から平成22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。

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）上記は、独立監査人の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。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年4月7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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 渉 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バランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成21年2月26日から平成22年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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バランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成22年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年4月7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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 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バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成21年2月26日から平成22年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成22年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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せん。

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年4月7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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 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バランス・ファンド< D C年金> 3成長型の平成21年2月26日から平成22年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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バランス・ファンド< D C年金> 3成長型の平成22年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#) [委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月29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	山本禎良	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内正彦	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20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績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。

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）上記は、独立監査人の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。

[ファンド監査報告書3へ](#)