

【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24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」、「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また各々、「D I A Mバランス・ファンド< 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24年5月26日から平成25年5月24日まで

お申込みの取扱いは、販売会社の毎営業日に行われます。

ニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）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

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が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/バッシブファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式/バッシブファンド・マザーファンド、国内債券/バッシブファンド・マザーファンド、外国債券/バッシブファンド・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<sup>(注)</sup>に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。
- 運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティ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。

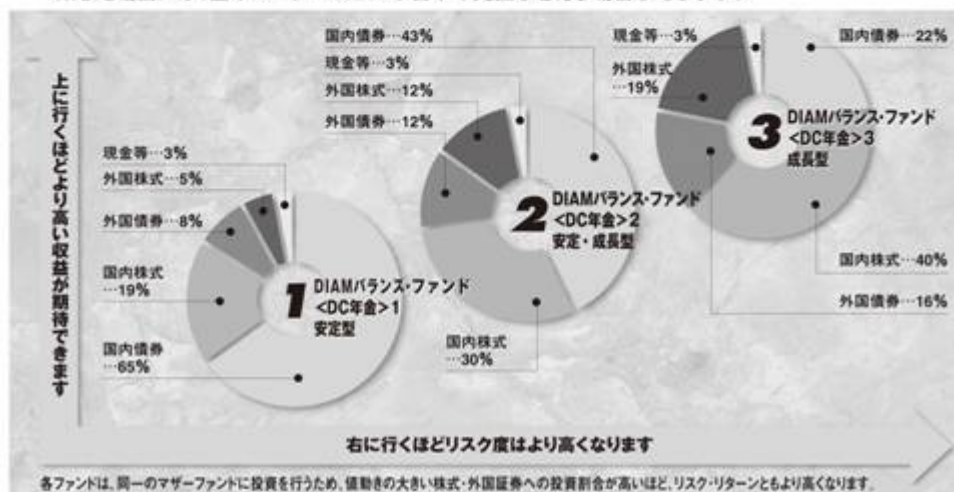
### 2

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



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

### 分配方針

年1回の決算時(2月25日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

### 商品分類表

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型」

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外	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

「D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 1 安定型」

「D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 2 安定・成長型」

「D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 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	年1回	グローバル (日本を含む)			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
債券 一般 公債 社債	年6回 (隔月)	欧州			
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産配 分固定型))		アフリカ			その他 (MSCIコク サイ・インデッ クス、NOMU RA-BPI総 合、シティグル ープ世界国債イ ンデックス)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		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

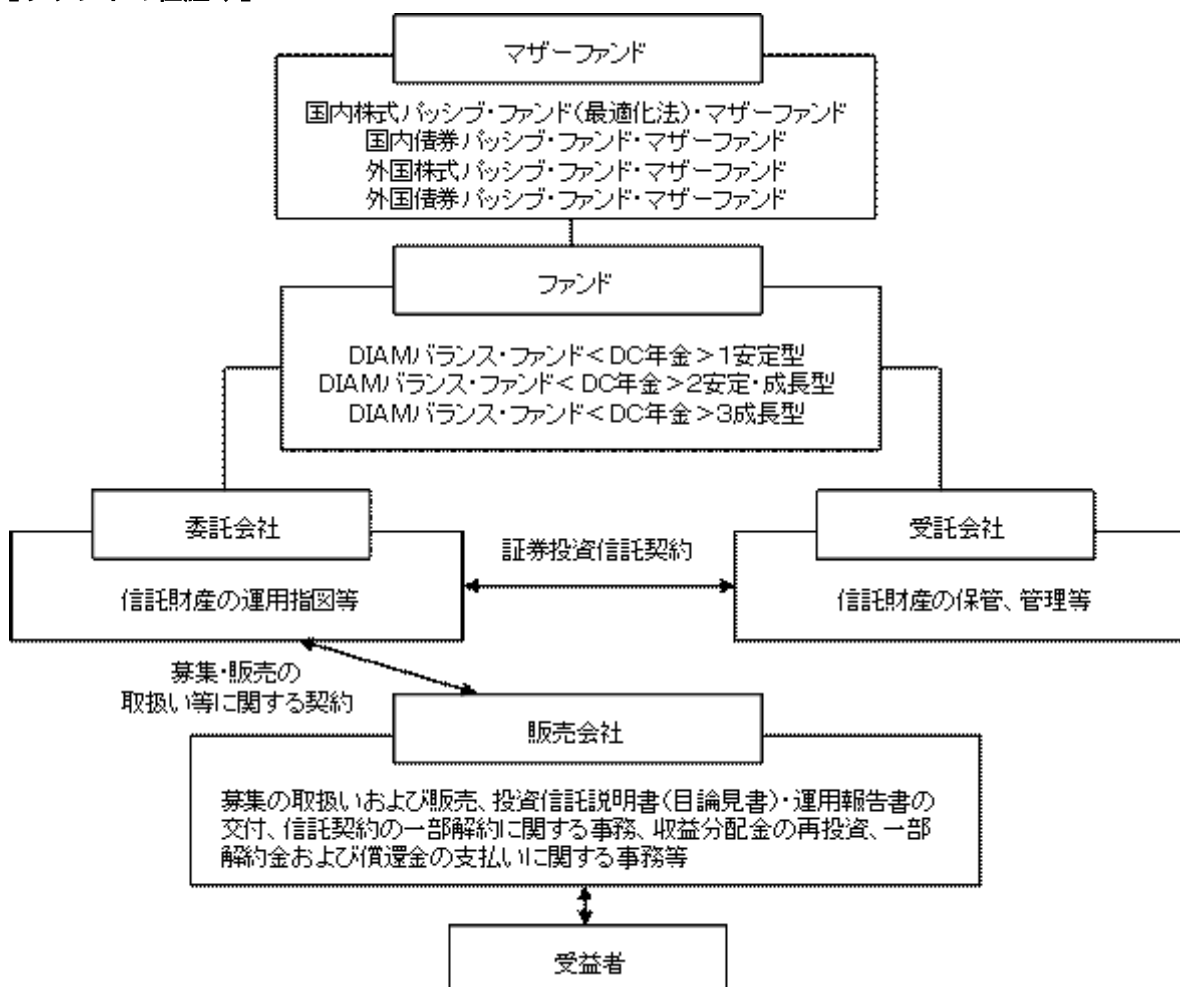
ホームページ URL <http://www.toushin.or.jp/>

## (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

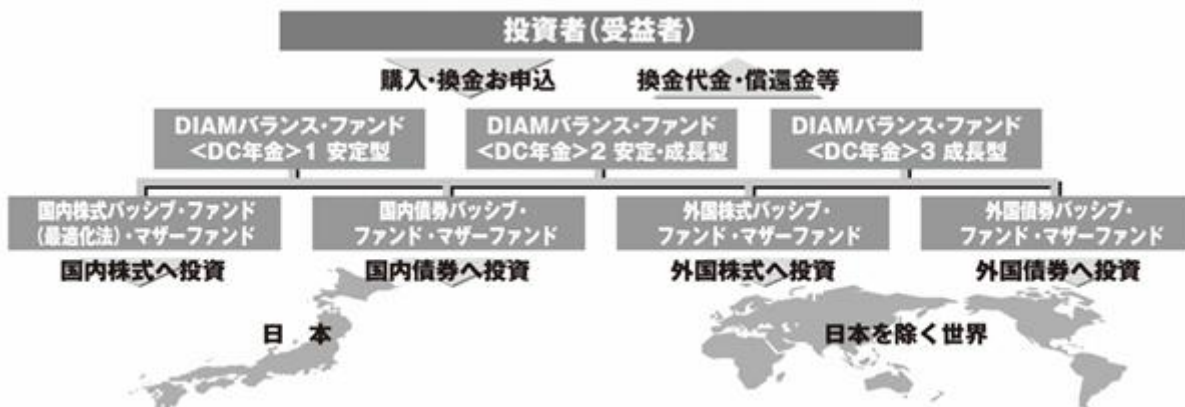
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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。



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24年2月29日現在）

委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日

平成10年 3月31日

平成10年12月 1日

平成11年10月 1日

会社設立

「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  
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  
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24年2月29日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## &lt;基本方針&gt;

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。

## &lt;投資態度&gt;

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&lt;DC年金&gt; 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&lt;DC年金&gt; 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&lt;DC年金&gt; 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)<sup>(注1)</sup>、国内債券についてはN O M U R A - B P I 総合<sup>(注2)</sup>、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)<sup>(注3)</sup>、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)<sup>(注4)</sup>、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<sup>1</sup>) 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<sup>2</sup>) 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<sup>3</sup>) 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<sup>4</sup>) 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・マーケッツ・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ません。)
  - 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書
- (6) 国債証券

- (7) 地方債証券
  - (8) 特別の法律により法人の発行する債券
  - (9) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - (10) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - (11) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  - (12) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  - (13) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  - (14) コマーシャル・ペーパー
  - (15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - (16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
  - (17) 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
  - (18) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  - (19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - (20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  - (21) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - (23) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - (24) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  - (25) 貸付債権信託受益権であ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	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul> </li> </ol>

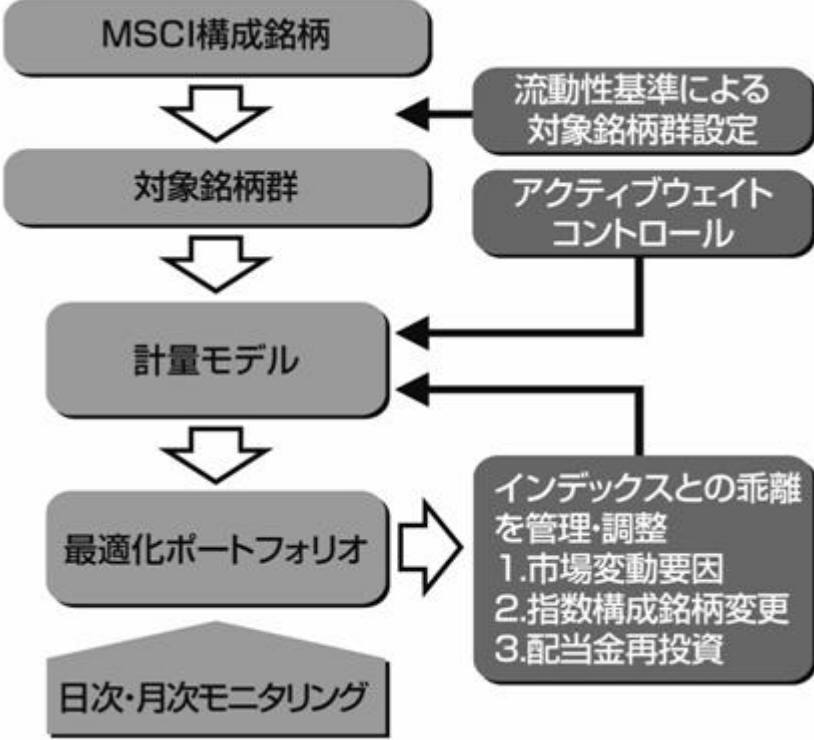
	<pre> graph TD     A[TOPIX 構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B     G[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.配当金再投資 3.新規上場・合併等] --&gt; D   </pre>
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

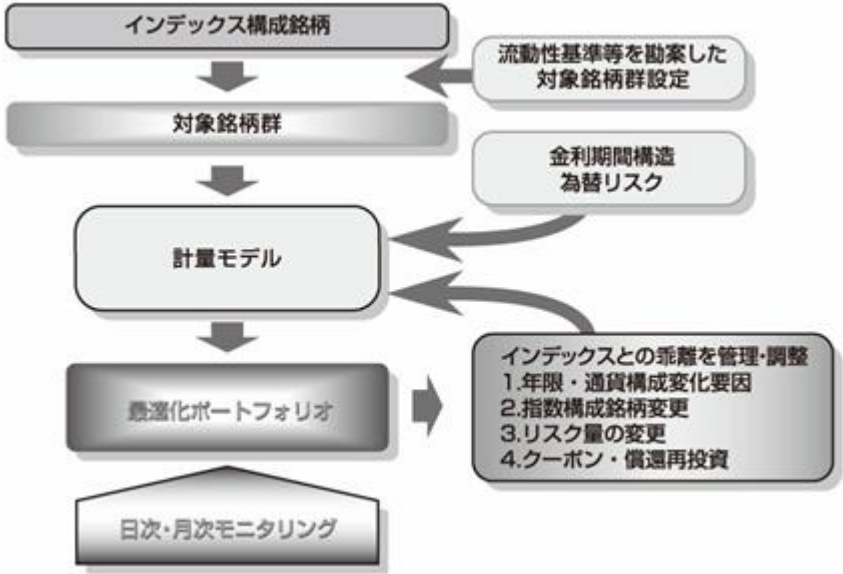
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</li> </ol>

運用プロセス	<p>1) 流動性基準等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。</p> <p>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。</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"> <li>・ 年限構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン、償還再投資</li> </ul>
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、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

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。

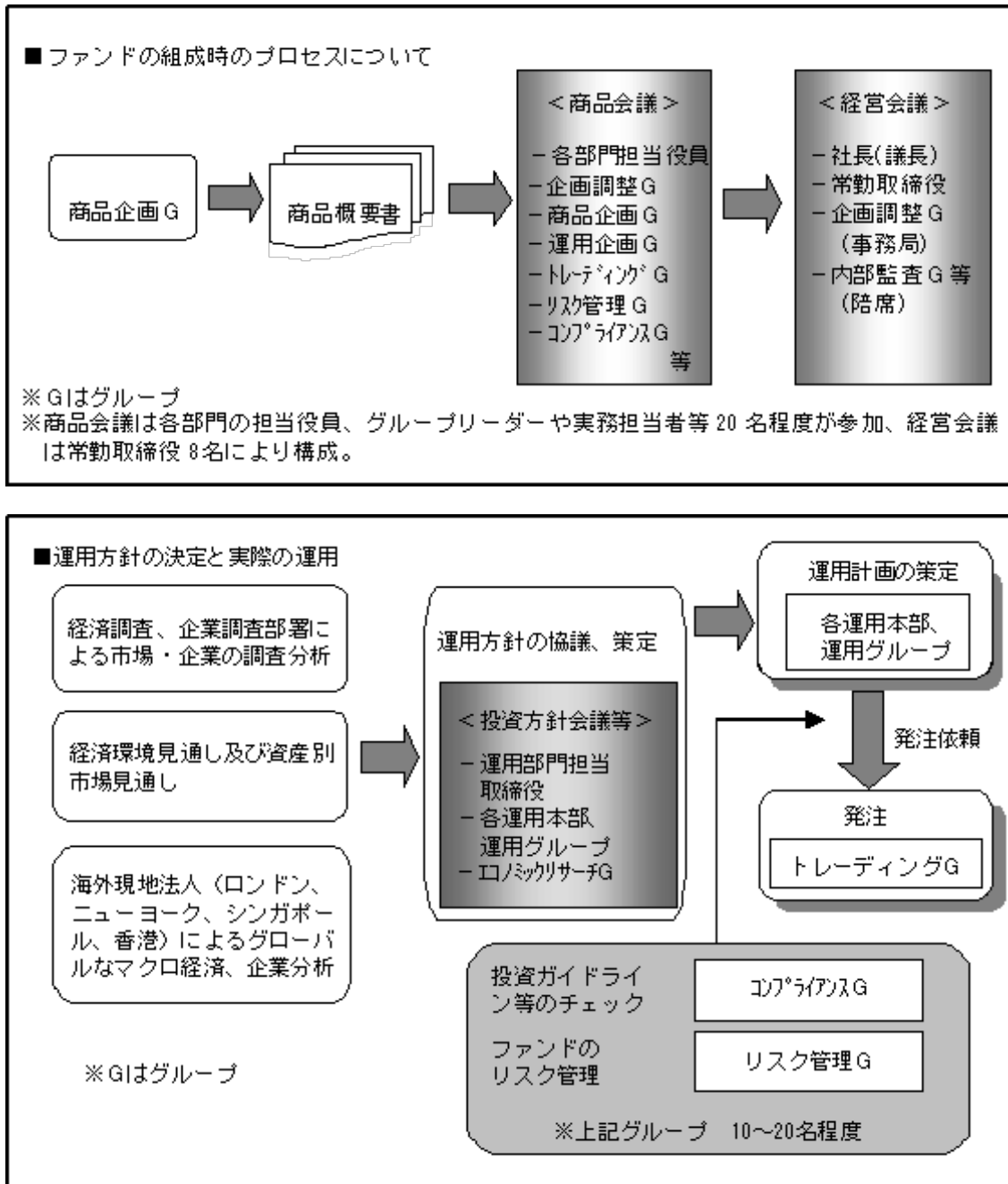


主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
運用プロセス	<p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 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"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul> 
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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ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>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ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"> <li>・年限・通貨構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン・償還再投資</li> </ul> 
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します。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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。

## &lt; ファンドの組成時のプロセスについて &gt;

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。

## &lt; 運用方針の決定と実際の運用 &gt;

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24年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4)【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時（原則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再投資される性格を有します。

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

**(5)【投資制限】**

「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1)～6)に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1)～6)に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 1)信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - 2)株式分割により取得する株券
  - 3)有償増資により取得する株券
  - 4)売出しにより取得する株券
  - 5)信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
  - 6)信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(9)先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第22条）

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

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

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

(b)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および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1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

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

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

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

#### (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 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動きのほか、為替変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

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貨建資産を保有します。外貨建資産に投資する場合には、一般的に為替リスクがあります。

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

#### (4)資産配分リスク

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

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

#### (5)カントリーリスク

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

#### < 分配金に関する留意点 >

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

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

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

#### < その他の留意点 >

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

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

当ファンドは、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。

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。

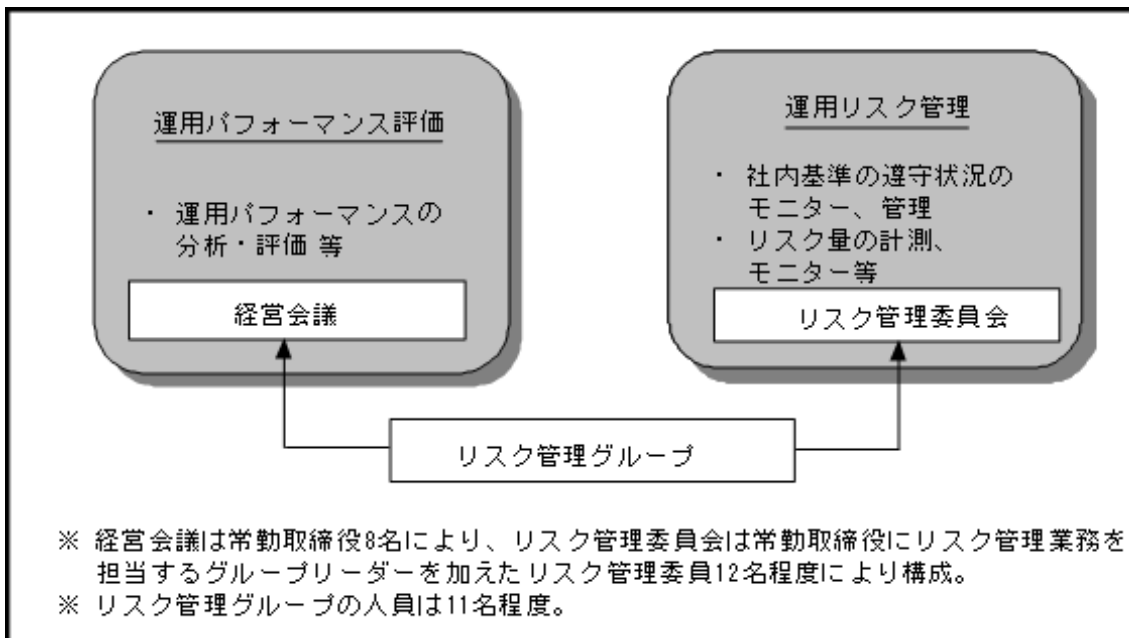
各ファンドにつき、受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合等、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）させる場合があります。

#### 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。
- ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります。これによる損失は購入者が負担することとなります。

#### リスク管理体制

##### <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24年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

**4【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。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

**(4)【その他の手数料等】**

## 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

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】**

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

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。

#### 個人の受益者に対する課税

時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して10%
換金（解約）時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して10%

税金は表に記載の時期に適用されます。

上記の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

上記は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは10.147%の税率となります。また、平成26年1月1日以降は20.315%の税率となる予定です。

#### 法人の受益者に対する課税

平成24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換金（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%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

上記7%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））となります。

また、上記7.147%の税率は平成26年1月1日からは、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））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。

上記は、平成24年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、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 >

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

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

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



支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 1 安定型

平成24年2月29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	4,873,771,830	97.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		150,616,340	3.00
合 計（純資産総額）		5,024,388,170	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。

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 2 安定・成長型

平成24年2月29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	11,598,790,006	97.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		358,671,694	3.00
合 計（純資産総額）		11,957,461,700	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&lt; D C年金&gt; 3 成長型

平成24年2月29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	9,005,090,069	97.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		278,657,201	3.00
合 計（純資産総額）		9,283,747,270	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24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	263,886,178,002	98.86
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,053,384,563	1.14
合 計（純資産総額）		266,939,562,565	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24年2月29日現在

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

株式	米国	151,930,608,133	52.75
	英国	28,132,250,441	9.77
	カナダ	15,928,797,178	5.53
	スイス	12,610,633,639	4.38
	スウェーデン	4,221,185,994	1.47
	デンマーク	1,523,640,692	0.53
	ノルウェー	1,091,052,498	0.38
	アイルランド	1,812,908,096	0.63
	オランダ	3,408,910,637	1.18
	ベルギー	1,284,868,038	0.45
	ルクセンブルク	592,072,464	0.21
	フランス	11,594,229,930	4.03
	ドイツ	11,163,843,934	3.88
	ポルトガル	268,114,915	0.09
	スペイン	4,038,287,754	1.40
	イタリア	3,023,083,243	1.05
	フィンランド	1,143,941,128	0.40
	オーストリア	320,963,254	0.11
	ギリシャ	121,173,195	0.04
	香港	3,487,112,496	1.21
	中国	23,040,576	0.01
	シンガポール	2,300,921,084	0.80
	イスラエル	774,234,954	0.27
	オーストラリア	10,361,276,042	3.60
	ニュージーランド	124,941,751	0.04
	パナマ	168,213,342	0.06
	バミューダ諸島	696,778,933	0.24
	オランダ領キュラソー	1,318,171,057	0.46
	ケイマン諸島	295,099,041	0.10
	ガーンジー・チャネル諸島	62,709,884	0.02
	ジャージー・チャネル諸島	926,206,183	0.32
	マン島	91,134,294	0.03
	リベリア	50,658,861	0.02
モーリシャス	38,740,901	0.01	
小計	274,929,804,564	95.46	
投資信託受益証券	シンガポール	72,501,318	0.03
	オーストラリア	852,105,712	0.30
	小計	924,607,030	0.32
投資証券	米国	3,559,183,408	1.24
	英国	302,749,338	0.11
	カナダ	89,505,196	0.03
	オランダ	49,153,232	0.02
	フランス	333,835,462	0.12
	香港	121,058,080	0.04
	小計	4,455,484,716	1.55
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		7,698,670,820	2.67
合 計（純資産総額）		288,008,567,130	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24年2月29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	326,864,705,000	77.25
地方債証券	日本	28,837,112,180	6.82
特殊債券	日本	35,259,738,748	8.33
社債券	日本	29,823,646,640	7.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,325,442,681	0.55
合 計（純資産総額）		423,110,645,249	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24年2月29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	156,352,010,467	40.12
	英国	32,785,447,005	8.41
	カナダ	11,369,307,466	2.92
	スウェーデン	2,346,738,486	0.60
	デンマーク	3,351,417,266	0.86
	ノルウェー	1,238,486,540	0.32
	アイルランド	2,420,854,553	0.62
	オランダ	9,884,957,443	2.54
	ベルギー	10,058,127,073	2.58
	フランス	36,845,124,089	9.45
	ドイツ	35,814,890,556	9.19
	スペイン	17,506,616,958	4.49
	イタリア	36,112,199,873	9.27
	フィンランド	2,367,184,713	0.61
	ポーランド	2,964,652,202	0.76
	オーストリア	6,785,121,878	1.74
	シンガポール	1,577,167,081	0.40
	マレーシア	1,654,745,699	0.42
	オーストラリア	5,634,800,402	1.45
	メキシコ	3,270,807,981	0.84
小計	380,340,657,729	97.59	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,381,970,871	2.41
合 計（純資産総額）		389,722,628,600	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<DC年金>1安定型

### 【投資有価証券の主要銘柄】

平成24年2月29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	2,785,204,803	11,418.06	31,800,163,334	11,429.00	31,833,210,569	63.36
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	901,295,432	11,148.00	10,004,764,148	11,156.00	10,005,485,183	20.01
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	336,794,400	12,210.00	411,225,962	12,171.00	409,912,464	8.16
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	205,101,084	13,470.00	276,271,160	13,416.00	275,163,614	5.48

(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24年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.00
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。

#### 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24年2月29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	4,281,875,224	11,418.06	48,889,068,974	11,429.00	48,893,755,193	40.93
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	3,371,121,264	11,148.00	37,758,125,985	11,156.00	37,760,822,882	31.45

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	1,129,874,746	13,470.00	1,521,941,282	13,416.00	1,515,839,959	12.68
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	1,173,586,371	12,210.00	1,432,948,958	12,171.00	1,428,371,972	11.95

(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24年2月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.00
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。

#### 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24年2月29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	3,410,179,746	11,148.00	3,801,668,380	11,156.00	3,804,396,524	40.98
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	1,689,321,610	11,418.14	1,928,891,888	11,429.00	1,930,725,668	20.80
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	1,349,118,541	13,470.00	1,817,262,674	13,416.00	1,809,977,434	19.50
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	1,199,564,903	12,210.00	1,464,668,746	12,171.00	1,459,990,443	15.73

(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24年2月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.00
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。

## (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24年2月29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	3,000,900	2,986.00	8,960,687,400	3,355.00	10,068,019,500	3.77
2	三菱UFJ フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	17,290,500	380.00	6,570,390,000	420.00	7,262,010,000	2.72
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,952,500	2,764.00	5,396,710,000	3,095.00	6,042,987,500	2.26
4	キヤノン	株式	日本	電気機 器	1,437,500	3,395.00	4,880,312,500	3,680.00	5,290,000,000	1.98
5	三井住友フ ィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,727,300	2,542.00	4,390,796,600	2,757.00	4,762,166,100	1.78
6	日本電信電 話	株式	日本	情報・ 通信業	1,051,700	3,785.00	3,980,684,500	3,835.00	4,033,269,500	1.51
7	みずほフ ィナンシャル G	株式	日本	銀行業	29,344,900	121.00	3,550,732,900	136.00	3,990,906,400	1.50
8	ファナック	株式	日本	電気機 器	240,900	12,960.00	3,122,064,000	14,730.00	3,548,457,000	1.33
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	907,900	3,340.00	3,032,386,000	3,670.00	3,331,993,000	1.25
10	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,663,500	1,794.00	2,984,319,000	1,991.00	3,312,028,500	1.24
11	三井物産	株式	日本	卸売業	1,971,700	1,321.00	2,604,615,700	1,399.00	2,758,408,300	1.03
12	小松製作所	株式	日本	機械	1,130,400	2,198.00	2,484,619,200	2,422.00	2,737,828,800	1.03
13	エヌ・ティ ・ティ・ド コモ	株式	日本	情報・ 通信業	18,819	137,300.00	2,583,848,700	138,800.00	2,612,077,200	0.98

14	ソニー	株式	日本	電気機器	1,443,800	1,513.00	2,184,469,400	1,737.00	2,507,880,600	0.94
15	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1,034,700	2,160.00	2,234,952,000	2,421.00	2,505,008,700	0.94
16	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	5,749	406,500.00	2,336,968,500	432,000.00	2,483,568,000	0.93
17	日立	株式	日本	電気機器	5,197,000	428.00	2,224,316,000	473.00	2,458,181,000	0.92
18	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	2,923,400	756.00	2,210,090,400	832.00	2,432,268,800	0.91
19	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,599,000	1,266.00	2,024,334,000	1,470.00	2,350,530,000	0.88
20	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	955,400	2,167.00	2,070,351,800	2,246.00	2,145,828,400	0.80
21	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	402,400	4,915.00	1,977,796,000	5,210.00	2,096,504,000	0.79
22	パナソニック	株式	日本	電気機器	2,643,800	636.00	1,681,456,800	759.00	2,006,644,200	0.75
23	東京海上HD	株式	日本	保険業	867,100	2,013.00	1,745,472,300	2,245.00	1,946,639,500	0.73
24	信越化学	株式	日本	化学	434,700	4,150.00	1,804,005,000	4,355.00	1,893,118,500	0.71
25	野村ホールディングス	株式	日本	証券、商品先物取引業	4,943,800	311.00	1,537,521,800	375.00	1,853,925,000	0.69
26	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3,545	479,500.00	1,699,827,500	516,000.00	1,829,220,000	0.69
27	国際石油開発帝石	株式	日本	鉱業	3,152	505,000.00	1,591,760,000	577,000.00	1,818,704,000	0.68
28	アステラス製薬	株式	日本	医薬品	538,100	3,205.00	1,724,610,500	3,340.00	1,797,254,000	0.67
29	東芝	株式	日本	電気機器	4,872,000	319.00	1,554,168,000	356.00	1,734,432,000	0.65
30	三菱電機	株式	日本	電気機器	2,314,000	670.00	1,550,380,000	729.00	1,686,906,000	0.63

(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24年2月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	13.50
	輸送用機器	10.42
	銀行業	9.74
	情報・通信業	6.03
	化学	5.81
	卸売業	5.63
	機械	5.14
	医薬品	4.67



小売業	3.98
陸運業	3.81
食料品	3.43
電気・ガス業	3.00
不動産業	2.46
保険業	2.42
建設業	2.34
鉄鋼	1.94
サービス業	1.83
その他製品	1.58
精密機器	1.39
証券、商品先物取引業	1.23
非鉄金属	1.21
ガラス・土石製品	1.13
繊維製品	0.89
石油・石炭製品	0.84
その他金融業	0.79
鉱業	0.77
ゴム製品	0.77
金属製品	0.69
海運業	0.42
パルプ・紙	0.37
空運業	0.29
倉庫・運輸関連業	0.23
水産・農林業	0.10
合計	98.86

(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24年2月29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	APPLE INC	株式	米国	コンピ ュータ・周 辺機器	143,670	41,103.23	5,905,301,456	43,196.88	6,206,095,577	2.15
2	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ガ ス・消耗 燃料	741,914	6,831.18	5,068,144,814	7,030.46	5,215,993,139	1.81

3	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	1,171,545	2,440.57	2,859,237,581	2,571.27	3,012,360,387	1.05
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術サービス	182,786	15,508.31	2,834,701,879	15,973.03	2,919,645,604	1.01
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	308,431	8,591.61	2,649,919,851	8,843.33	2,727,558,596	0.95
6	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	512,110	4,893.89	2,506,211,288	5,002.14	2,561,648,220	0.89
7	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロマリット	1,623,952	1,528.08	2,481,527,273	1,545.83	2,510,351,771	0.87
8	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	426,326	5,202.25	2,217,852,899	5,437.03	2,317,945,205	0.80
9	AT&T INC	株式	米国	各種電気通信サービス	919,700	2,426.05	2,231,235,978	2,463.16	2,265,368,620	0.79
10	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	424,085	5,212.73	2,210,642,638	5,258.72	2,230,145,289	0.77
11	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,192,572	1,720.90	2,052,302,402	1,712.03	2,041,718,564	0.71
12	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	39,554	49,195.44	1,945,876,307	49,891.71	1,973,416,507	0.69
13	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	2,744,523	721.36	1,979,786,503	718.53	1,972,029,548	0.68
14	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	771,768	2,454.29	1,894,139,089	2,530.93	1,953,292,019	0.68
15	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	2,921,870	635.67	1,857,343,817	641.45	1,874,235,586	0.65
16	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	584,698	3,059.39	1,788,816,642	3,163.46	1,849,670,372	0.64
17	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	269,268	6,587.52	1,773,808,874	6,765.82	1,821,820,112	0.63
18	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	317,816	5,558.85	1,766,692,107	5,554.82	1,765,410,037	0.61
19	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	789,212	2,160.61	1,705,179,655	2,197.72	1,734,469,522	0.60
20	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	7,756,164	223.41	1,732,799,403	221.35	1,716,856,452	0.60
21	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	569,445	2,995.28	1,705,646,109	2,981.15	1,697,598,883	0.59
22	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	361,655	4,672.88	1,689,969,693	4,459.98	1,612,974,935	0.56

23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	108,456	14,632.06	1,586,934,916	14,271.22	1,547,799,653	0.54
24	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	491,216	3,153.30	1,548,951,708	3,116.69	1,530,965,539	0.53
25	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	334,286	4,465.52	1,492,759,147	4,556.24	1,523,086,492	0.53
26	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	620,314	2,278.40	1,413,325,403	2,371.19	1,470,879,376	0.51
27	MERCK & CO. INC.	株式	米国	医薬品	472,231	3,082.78	1,455,785,604	3,096.50	1,462,262,536	0.51
28	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・生活必需品小売り	297,000	5,019.91	1,490,913,151	4,754.47	1,412,078,303	0.49
29	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	775,953	1,849.97	1,435,488,220	1,803.72	1,399,601,014	0.49
30	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	米国	各種電気通信サービス	440,447	3,069.07	1,351,761,441	3,077.94	1,355,670,320	0.47

(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24年2月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.62
	商業銀行	7.19
	医薬品	6.26
	保険	3.88
	金属・鉱業	3.86
	各種電気通信サービス	3.00
	コンピュータ・周辺機器	2.95
	化学	2.86
	食品	2.77
	ソフトウェア	2.51
	メディア	2.47
	情報技術サービス	2.27
	各種金融サービス	2.18
	食品・生活必需品小売り	2.17
	飲料	2.16
	コングロマリット	2.08
	機械	1.93
	資本市場	1.85
	電力	1.79
	航空宇宙・防衛	1.77
タバコ	1.68	

エネルギー設備・サービス	1.66
半導体・半導体製造装置	1.65
ホテル・レストラン・レジャー	1.61
家庭用品	1.45
通信機器	1.44
専門小売り	1.41
総合公益事業	1.34
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.33
ヘルスケア機器・用品	1.24
インターネットソフトウェア・サービス	1.02
繊維・アパレル・贅沢品	1.01
自動車	0.99
バイオテクノロジー	0.86
無線通信サービス	0.85
陸運・鉄道	0.82
電気設備	0.78
複合小売り	0.63
不動産管理・開発	0.63
航空貨物・物流サービス	0.55
インターネット販売・カタログ販売	0.51
消費者金融	0.46
建設・土木	0.43
商業サービス・用品	0.41
専門サービス	0.39
自動車部品	0.38
電子装置・機器・部品	0.32
建設資材	0.31
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.29
パーソナル用品	0.26
商社・流通業	0.24
紙製品・林産品	0.19
運送インフラ	0.18
家庭用耐久財	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.17
建設関連製品	0.17
容器・包装	0.17
ガス	0.16
販売	0.12
海運業	0.10
旅客航空輸送業	0.10
水道	0.08
レジャー用品	0.06
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06
事務用電子機器	0.06
不動産投資信託	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
各種消費者サービス	0.04
株式計	95.46

投資信託受益証券		0.32
投資証券		1.55
合計		97.33

(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24年2月29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	313回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	6,500,000,000	103.75	6,743,815,000	103.82	6,748,365,000	1.30	2021/ 3/20	1.59
2	81回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,700,000,000	101.41	5,780,610,000	101.42	5,780,655,000	0.80	2014/ 3/20	1.37
3	312回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,500,000,000	103.14	5,672,701,000	103.20	5,676,055,000	1.20	2020/ 12/20	1.34
4	289回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,300,000,000	106.20	5,628,760,000	106.29	5,633,317,000	1.50	2017/ 12/20	1.33
5	293回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	108.22	5,410,850,000	108.29	5,414,700,000	1.80	2018/ 6/20	1.28
6	315回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	102.63	5,131,400,000	102.70	5,135,200,000	1.20	2021/ 6/20	1.21
7	93回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.97	5,048,450,000	101.09	5,054,550,000	0.50	2015/ 12/20	1.19
8	88回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.00	5,049,875,000	101.07	5,053,700,000	0.50	2015/ 3/20	1.19
9	99回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.41	5,020,350,000	100.54	5,026,900,000	0.40	2016/ 9/20	1.19
10	285回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	106.82	4,807,080,000	106.90	4,810,455,000	1.70	2017/ 3/20	1.14

11	75回 利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,600,000,000	101.56	4,671,852,000	101.53	4,670,564,000	1.10	2013/ 9/20	1.10
12	310回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	101.69	4,576,005,000	101.76	4,579,290,000	1.00	2020/ 9/20	1.08
13	317回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	101.50	4,567,320,000	101.53	4,569,030,000	1.10	2021/ 9/20	1.08
14	89回 利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.65	4,529,070,000	100.77	4,534,605,000	0.40	2015/ 6/20	1.07
15	97回 利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.49	4,522,140,000	100.59	4,526,730,000	0.40	2016/ 6/20	1.07
16	305回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,300,000,000	104.73	4,503,390,000	104.86	4,509,023,000	1.30	2019/ 12/20	1.07
17	299回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,100,000,000	105.05	4,307,012,000	105.12	4,309,879,000	1.30	2019/ 3/20	1.02
18	72回 利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,200,000,000	101.85	4,277,616,000	101.80	4,275,642,000	1.50	2013/ 6/20	1.01
19	296回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	106.38	4,255,120,000	106.44	4,257,520,000	1.50	2018/ 9/20	1.01
20	306回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	105.36	4,214,240,000	105.45	4,217,960,000	1.40	2020/ 3/20	1.00
21	301回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	106.44	4,044,606,000	106.55	4,048,862,000	1.50	2019/ 6/20	0.96
22	92回 利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.30	4,011,980,000	100.41	4,016,200,000	0.30	2015/ 9/20	0.95
23	102回 利 付国庫債券 (5年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.02	4,000,840,000	100.02	4,000,920,000	0.30	2016/ 12/20	0.95
24	288回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,600,000,000	107.19	3,858,984,000	107.29	3,862,260,000	1.70	2017/ 9/20	0.91
25	87回 利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	100.95	3,835,948,000	101.03	3,839,140,000	0.50	2014/ 12/20	0.91
26	266回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,700,000,000	103.50	3,829,611,000	103.54	3,830,832,000	1.40	2014/ 12/20	0.91

27	286回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	107.57	3,764,880,000	107.65	3,767,645,000	1.80	2017/ 6/20	0.89
28	282回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,400,000,000	106.34	3,615,458,000	106.42	3,618,280,000	1.70	2016/ 9/20	0.86
29	85回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	101.43	3,550,085,000	101.47	3,551,485,000	0.70	2014/ 9/20	0.84
30	78回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	101.44	3,550,400,000	101.42	3,549,805,000	0.90	2013/ 12/20	0.84

(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24年2月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.25
地方債証券	6.82
特殊債券	8.33
社債券	7.05
合計	99.45

(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24年2月29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 02/15/14	国債 証券	米国	3,227,200,000	107.34	3,463,915,120	107.27	3,461,914,256	4.00	2014/ 2/15	0.89
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,227,200,000	106.84	3,447,779,120	106.80	3,446,520,512	4.25	2013/ 11/15	0.88
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債 証券	米国	3,227,200,000	101.04	3,260,827,424	101.07	3,261,601,952	1.00	2013/ 7/15	0.84
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,823,800,000	109.84	3,101,520,730	109.77	3,099,769,974	4.75	2014/ 5/15	0.80
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,823,800,000	105.88	2,989,895,916	105.90	2,990,347,724	4.25	2013/ 8/15	0.77

6	US T N/B 0.125 08/31/13	国債 証券	米国	2,823,800,000	99.79	2,817,841,782	99.83	2,818,943,064	0.13	2013/ 8/31	0.72
7	US T N/B 3.5 05/31/13	国債 証券	米国	2,581,760,000	104.25	2,691,562,253	104.17	2,689,341,939	3.50	2013/ 5/31	0.69
8	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,581,760,000	103.65	2,675,942,605	103.55	2,673,515,750	3.88	2013/ 2/15	0.69
9	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,420,400,000	110.55	2,675,655,384	110.41	2,672,460,456	4.25	2014/ 11/15	0.69
10	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,420,400,000	105.34	2,549,625,156	105.34	2,549,721,972	2.63	2014/ 6/30	0.65
11	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,259,040,000	109.66	2,477,172,902	109.55	2,474,868,682	4.25	2014/ 8/15	0.64
12	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,339,720,000	104.22	2,438,409,390	104.16	2,436,958,763	3.63	2013/ 5/15	0.63
13	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,420,400,000	100.37	2,429,282,868	100.40	2,430,130,008	0.50	2013/ 10/15	0.62
14	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,259,040,000	105.16	2,375,516,102	105.16	2,375,606,464	2.38	2014/ 9/30	0.61
15	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債 証券	ドイツ	2,173,000,000	107.46	2,334,997,150	107.51	2,336,083,650	4.25	2014/ 1/4	0.60
16	US T N/B 1.375 03/15/13	国債 証券	米国	2,259,040,000	101.25	2,287,187,638	101.22	2,286,555,107	1.38	2013/ 3/15	0.59
17	US T N/B 3.125 05/15/21	国債 証券	米国	2,017,000,000	110.73	2,233,343,420	111.48	2,248,470,920	3.13	2021/ 5/15	0.58
18	US T N/B 3.625 02/15/21	国債 証券	米国	1,936,320,000	115.07	2,228,123,424	115.87	2,243,555,894	3.63	2021/ 2/15	0.58
19	US T N/B 3.25 06/30/16	国債 証券	米国	2,017,000,000	110.76	2,233,968,690	110.89	2,236,651,300	3.25	2016/ 6/30	0.57
20	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債 証券	フランス	2,064,350,000	105.39	2,175,618,465	105.44	2,176,650,640	4.00	2013/ 10/25	0.56
21	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債 証券	ドイツ	1,955,700,000	109.12	2,133,962,055	109.49	2,141,198,145	3.25	2015/ 7/4	0.55
22	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債 証券	イタリア	2,064,350,000	102.24	2,110,591,440	103.04	2,127,106,240	4.25	2014/ 8/1	0.55
23	US T N/B 2.125 11/30/14	国債 証券	米国	2,017,000,000	104.72	2,112,162,060	104.71	2,112,000,700	2.13	2014/ 11/30	0.54
24	US T N/B 1.75 03/31/14	国債 証券	米国	2,017,000,000	103.04	2,078,215,950	103.00	2,077,510,000	1.75	2014/ 3/31	0.53



25	US T N/B 1.75 04/15/13	国債 証券	米国	2,017,000,000	101.76	2,052,438,690	101.73	2,051,894,100	1.75	2013/ 4/15	0.53
26	US T N/B 0.75 12/15/13	国債 証券	米国	2,017,000,000	100.83	2,033,700,760	100.85	2,034,164,670	0.75	2013/ 12/15	0.52
27	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債 証券	ドイツ	1,847,050,000	109.53	2,023,073,865	109.73	2,026,675,613	3.75	2015/ 1/4	0.52
28	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	1,847,050,000	109.27	2,018,179,183	109.37	2,020,118,585	4.25	2014/ 7/4	0.52
29	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	国債 証券	イタリア	1,955,700,000	101.27	1,980,537,390	102.09	1,996,574,130	3.75	2013/ 12/15	0.51
30	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	国債 証券	フランス	1,847,050,000	106.56	1,968,216,480	107.11	1,978,319,844	3.25	2016/ 4/25	0.51

(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24年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.59
合計	97.59

(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24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
第9期末（平成24年2月27日現在）	4,993	4,993	1.1720	1.1720
平成23年2月末	4,424		1.1672	
3月末	4,482		1.1546	
4月末	4,522		1.1558	
5月末	4,506		1.1513	
6月末	4,586		1.1547	
7月末	4,663		1.1501	
8月末	4,604		1.1304	
9月末	4,647		1.1266	
10月末	4,700		1.1352	
11月末	4,627		1.1174	
12月末	4,788		1.1245	
平成24年1月末	4,852		1.1354	
2月末	5,024		1.1723	

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 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
第9期末（平成24年2月27日現在）	11,905	11,905	1.1984	1.1984
平成23年2月末	10,859		1.2104	
3月末	10,844		1.1911	
4月末	10,941		1.1917	
5月末	10,854		1.1799	
6月末	10,999		1.1825	
7月末	10,951		1.1705	
8月末	10,636		1.1317	
9月末	10,671		1.1205	
10月末	10,895		1.1408	
11月末	10,632		1.1095	
12月末	11,059		1.1180	
平成24年1月末	11,282		1.1356	
2月末	11,957		1.1980	

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 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
第9期末（平成24年2月27日現在）	9,234	9,234	1.2166	1.2166
平成23年2月末	8,703		1.2450	
3月末	8,626		1.2200	
4月末	8,701		1.2204	
5月末	8,578		1.2015	
6月末	8,676		1.2031	
7月末	8,571		1.1837	
8月末	8,204		1.1266	
9月末	8,130		1.1080	
10月末	8,385		1.1403	
11月末	8,098		1.0959	
12月末	8,365		1.1058	
平成24年1月末	8,574		1.1296	
2月末	9,283		1.2156	

## 【分配の推移】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 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	-
第9期	-

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 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	-

第9期	-
-----	---

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 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	-
第9期	-

## 【収益率の推移】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 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
第9期	0.59

(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&lt; D C年金&gt; 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
第9期	0.67

(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&lt; D C年金&gt; 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
第9期	1.85

(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

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

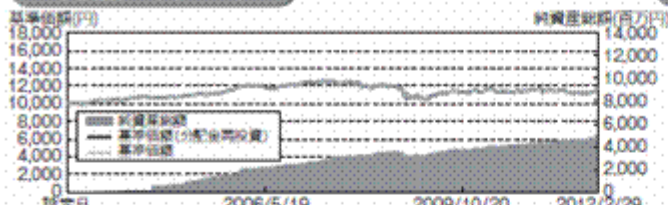
データの基準日:2012年2月29日

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 1 安定型

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2002年12月13日)～2012年2月29日)

## 分配の推移(税引前)



期	分配日	分配額
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
第9期	(2012.02.27)	0円
設定来累計		0円

(注) 分配金は1万口当たりです。

※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)  
 ※基準価額は信託有価証券後です。

## 主要な資産の状況

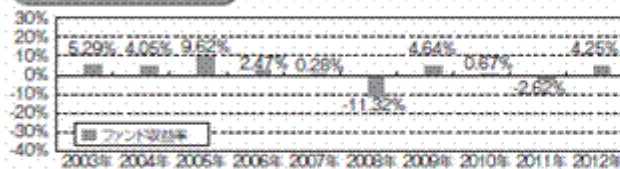
(注) 投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内債券(バランファンドマザーファンド)	63.36
2	国内株式(バランファンド(最適化法)マザーファンド)	20.01
3	外国債券(バランファンドマザーファンド)	8.16
4	外国株式(バランファンドマザーファンド)	5.48

※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



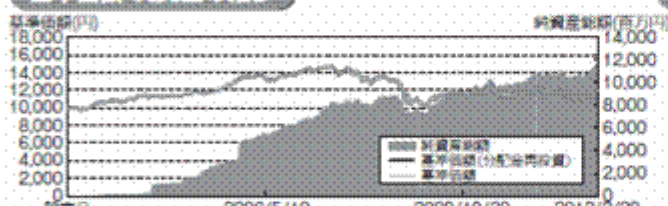
※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 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)～2012年2月29日)

## 分配の推移(税引前)



期	分配日	分配額
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
第9期	(2012.02.27)	0円
設定来累計		0円

(注) 分配金は1万口当たりです。

※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)  
 ※基準価額は信託有価証券後です。

## 主要な資産の状況

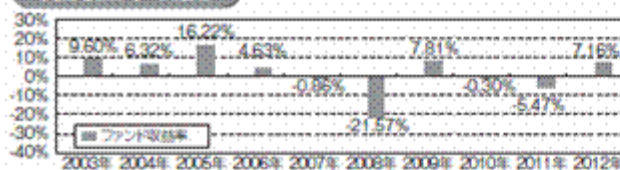
(注) 投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内債券(バランファンドマザーファンド)	40.93
2	国内株式(バランファンド(最適化法)マザーファンド)	31.45
3	外国債券(バランファンドマザーファンド)	12.68
4	外国株式(バランファンドマザーファンド)	11.95

※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として算出しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2012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。

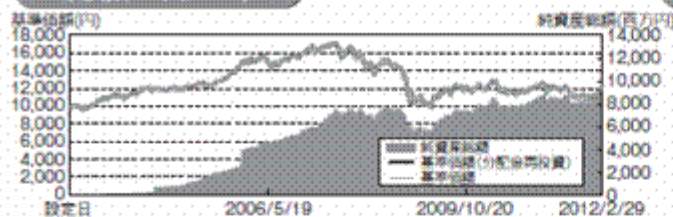
データの基準日:2012年2月29日

## DIAM/バランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 3 成長型

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2002年12月13日)~2012年2月29日)

## 分配の推移(税引前)



期	日	金額
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
第9期	(2012.02.27)	0円
設定未累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定後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。

## 主要な資産の状況

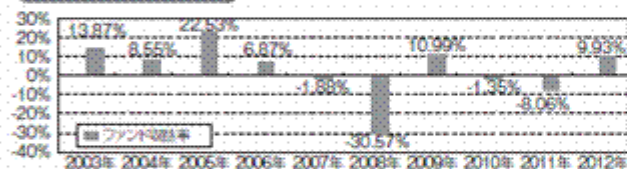
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内株式(バシブ・ファンド(最適化法)-マザーファンド)	40.55
2	国内債券(バシブ・ファンドマザーファンド)	20.80
3	外国株式(バシブ・ファンドマザーファンド)	19.50
4	外国債券(バシブ・ファンドマザーファンド)	15.73

※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として算出しております。

※当ファンドの収益率は、毎年ベースで表示しています。但し、2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## 各マザーファンドの主要な資産の状況

## 国内株式(バシブ・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	98.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.14
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	電気機器	13.50
2	輸送用機器	10.42
3	銀行業	9.74
4	情報・通信業	6.03
5	化学	5.81

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	業種	国名	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.77
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.72
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	1.98
5	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.78
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.51
7	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.50
8	ファナック	株式	日本	電気機器	1.33
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	1.25
10	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.24

○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:2012年2月29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	52.75
	英国	9.77
	カナダ	5.53
	スイス	4.38
	フランス	4.03
	その他	19.00
	小計	95.46
投資信託受益証券	オーストラリア	0.30
	シンガポール	0.03
	小計	0.32
投資証券	米国	1.24
	フランス	0.12
	英国	0.11
	豪州	0.04
	カナダ	0.03
	その他	0.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.55
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	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ等/機器	2.15
2	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油ガス/燃料燃料	1.81
3	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	1.05
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術サービス	1.01
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油ガス/燃料燃料	0.95
6	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.89
7	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロメイト	0.87
8	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	0.80
9	AT&T INC	株式	米国	情報通信サービス	0.79
10	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	0.77

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	石油ガス/燃料燃料	10.62
2	商業銀行	7.19
3	医薬品	6.26
4	保険	3.88
5	金融/銀行	3.86

## ■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	77.25
地方債証券	日本	6.82
特殊債証券	日本	6.33
社債証券	日本	7.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.55
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	313回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2021/3/20	1.59
2	81回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.80	2014/3/20	1.37
3	312回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2020/12/20	1.34
4	289回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	1.50	2017/12/20	1.33
5	293回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	1.60	2018/6/20	1.28
6	315回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2021/6/20	1.21
7	93回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.50	2015/12/20	1.19
8	88回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.50	2015/3/20	1.19
9	99回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.40	2016/9/20	1.19
10	285回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	1.70	2017/3/20	1.14

## ■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	40.12
	フランス	9.45
	イタリア	9.27
	ドイツ	9.19
	英国	8.41
	その他	21.15
	小計	97.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.41
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 02/15/14	国債証券	米国	4.00	2014/2/15	0.89
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/11/15	0.88
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債証券	米国	1.00	2013/7/15	0.84
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	米国	4.75	2014/5/15	0.80
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/8/15	0.77
6	US T N/B 0.125 08/31/13	国債証券	米国	0.13	2013/8/31	0.72
7	US T N/B 3.5 05/31/13	国債証券	米国	3.50	2013/5/31	0.69
8	US T N/B 3.875 02/15/13	国債証券	米国	3.88	2013/2/15	0.69
9	US T N/B 4.25 11/15/14	国債証券	米国	4.25	2014/11/15	0.69
10	US T N/B 2.625 06/30/14	国債証券	米国	2.63	2014/6/30	0.65

○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提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&lt; D C年金&gt; 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
第9期	891,096,153	423,802,872

(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&lt; D C年金&gt; 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
第9期	1,799,986,538	838,294,174

(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&lt; D C年金&gt; 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
第9期	1,241,120,741	648,446,247

(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

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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】

- 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。
- 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

- 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。
- 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、新聞公告または書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更

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

- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～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、新聞公告または書面に付記します。
- h. 上記b.に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

#### 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

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性質を有します。

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

#### 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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します。）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

#### 一部解約請求権

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

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に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には、振替受益権をもって行うものとし、受益証券をお手許で保有されている方は、解約のお申込みに際して、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）及び第9期計算期間（平成23年2月26日から平成24年2月27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&lt; D C年金 &gt; 1 安定型】

## ( 1 )【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第 8 期 平成23年 2 月25日現在	第 9 期 平成24年 2 月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	141,192,132	163,759,165
親投資信託受益証券	4,286,622,077	4,844,524,604
未収入金	7,400,000	2,000,000
流動資産合計	4,435,214,209	5,010,283,769
<b>資産合計</b>		
	4,435,214,209	5,010,283,769
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,633,882	10,438,633
未払受託者報酬	680,786	754,807
未払委託者報酬	5,219,631	5,787,143
その他未払費用	113,377	119,422
流動負債合計	15,647,676	17,100,005
<b>負債合計</b>		
	15,647,676	17,100,005
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,793,238,337	4,260,531,618
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	626,328,196	732,652,146
( 分配準備積立金 )	136,036,044	122,527,639
元本等合計	4,419,566,533	4,993,183,764
<b>純資産合計</b>		
	4,419,566,533	4,993,183,764
<b>負債純資産合計</b>		
	4,435,214,209	5,010,283,769

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 8 期	第 9 期
	自 平成22年 2月26日 至 平成23年 2月25日	自 平成23年 2月26日 至 平成24年 2月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	99,431	105,089
有価証券売買等損益	116,411,706	52,608,527
営業収益合計	116,511,137	52,713,616
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,316,001	1,458,279
委託者報酬	10,089,872	11,180,737
その他費用	219,163	230,720
営業費用合計	11,625,036	12,869,736
営業利益	104,886,101	39,843,880
経常利益	104,886,101	39,843,880
当期純利益	104,886,101	39,843,880
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,701,841	9,911,478
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	466,419,621	626,328,196
剰余金増加額又は欠損金減少額	105,725,335	125,798,016
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	105,725,335	125,798,016
剰余金減少額又は欠損金増加額	47,001,020	69,229,424
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	47,001,020	69,229,424
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	626,328,196	732,652,146

## (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 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 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 当ファンドの計算期間は計算期 間末日が休業日のため、平成23年 2月26日から平成24年2月27日ま でとなっております。

(追加情報)

第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27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 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
*1 期首元本額	3,417,759,228円	3,793,238,337円
期中追加設定元本額	717,088,658円	891,096,153円
期中解約元本額	341,609,549円	423,802,872円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	3,793,238,337口	4,260,531,618口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（83,210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（610,124,507円）及び分配準備積立金（122,444,429円）より分配対象収益は732,652,146円（1万口当たり1,719.63円）であります。分配を行っておりません。</p>
--	---	---

## （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 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	第 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	110,990,784	61,019,324
合計	110,990,784	61,019,324

## （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 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1651円 (11,651円)	1.1720円 (11,720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24年2月27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	904,435,009	1,008,264,148	
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	2,757,718,808	3,148,763,334	
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	205,101,084	276,271,160	
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	336,794,400	411,225,962	
合 計		4,204,049,301	4,844,524,604	

## 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 8 期 平成23年 2 月25日現在	第 9 期 平成24年 2 月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	358,823,732	370,892,410
親投資信託受益証券	10,499,450,059	11,560,685,199
未収入金	6,000,000	13,500,000
流動資産合計	10,864,273,791	11,945,077,609
資産合計	10,864,273,791	11,945,077,609
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	21,502,634	21,977,307
未払受託者報酬	1,635,146	1,743,899
未払委託者報酬	14,171,512	15,114,193
その他未払費用	272,435	276,022
流動負債合計	37,581,727	39,111,421
負債合計	37,581,727	39,111,421
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,973,433,484	9,935,125,848
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,853,258,580	1,970,840,340
（ 分配準備積立金 ）	638,650,522	583,969,394
元本等合計	10,826,692,064	11,905,966,188
純資産合計	10,826,692,064	11,905,966,188
負債純資産合計	10,864,273,791	11,945,077,609

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 8 期	第 9 期
	自 平成22年 2月26日 至 平成23年 2月25日	自 平成23年 2月26日 至 平成24年 2月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	239,998	246,838
有価証券売買等損益	386,770,267	5,915,140
営業収益合計	387,010,265	6,161,978
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	3,180,586	3,430,184
委託者報酬	27,565,768	29,728,966
その他費用	529,921	542,939
営業費用合計	31,276,275	33,702,089
営業利益又は営業損失（ ）	355,733,990	27,540,111
経常利益又は経常損失（ ）	355,733,990	27,540,111
当期純利益又は当期純損失（ ）	355,733,990	27,540,111
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	5,876,680	43,161,087
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,356,098,843	1,853,258,580
剰余金増加額又は欠損金減少額	257,514,251	272,636,392
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	257,514,251	272,636,392
剰余金減少額又は欠損金増加額	110,211,824	170,675,608
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	110,211,824	170,675,608
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,853,258,580	1,970,840,340



## (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 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 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 当ファンドの計算期間は計算期 間末日が休業日のため、平成23年 2月26日から平成24年2月27日ま でとなっております。

(追加情報)

第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27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 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
*1 期首元本額	8,173,859,814円	8,973,433,484円
期中追加設定元本額	1,458,689,281円	1,799,986,538円
期中解約元本額	659,115,611円	838,294,174円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	8,973,433,484口	9,935,125,848口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（78,328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（2,403,280,530円）及び分配準備積立金（583,891,066円）より分配対象収益は2,987,249,924円（1万口当たり3,006.76円）であります。分配を行っておりません。</p>
--	--	---

## （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 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	第 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	373,695,820	21,566,650
合計	373,695,820	21,566,650

## (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 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.2065円	1.1984円
(1万口当たり純資産額)	(12,065円)	(11,984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24年2月27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	3,374,709,352	3,762,125,985	
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	4,242,134,327	4,843,668,974	
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	1,129,874,746	1,521,941,282	
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	1,173,586,371	1,432,948,958	
合 計		9,920,304,796	11,560,685,199	

## 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8期 平成23年2月25日現在	第9期 平成24年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	286,700,540	288,340,708
親投資信託受益証券	8,411,644,756	8,965,891,688
未収入金	3,000,000	3,500,000
流動資産合計	8,701,345,296	9,257,732,396
資産合計	8,701,345,296	9,257,732,396
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	13,402,245	8,429,216
未払受託者報酬	1,298,850	1,330,477
未払委託者報酬	12,556,060	12,861,674
その他未払費用	216,388	210,579
流動負債合計	27,473,543	22,831,946
負債合計	27,473,543	22,831,946
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,997,960,350	7,590,634,844
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,675,911,403	1,644,265,606
（分配準備積立金）	630,649,498	576,549,297
元本等合計	8,673,871,753	9,234,900,450
純資産合計	8,673,871,753	9,234,900,450
負債純資産合計	8,701,345,296	9,257,732,396

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 8 期	第 9 期
	自 平成22年 2月26日 至 平成23年 2月25日	自 平成23年 2月26日 至 平成24年 2月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	192,320	191,644
有価証券売買等損益	376,884,723	95,470,068
営業収益合計	377,077,043	95,278,424
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,541,156	2,659,620
委託者報酬	24,565,516	25,710,449
その他費用	423,362	420,943
営業費用合計	27,530,034	28,791,012
営業利益又は営業損失（ ）	349,547,009	124,069,436
経常利益又は経常損失（ ）	349,547,009	124,069,436
当期純利益又は当期純損失（ ）	349,547,009	124,069,436
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	2,723,977	50,115,131
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,218,600,555	1,675,911,403
剰余金増加額又は欠損金減少額	228,141,563	194,992,463
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	228,141,563	194,992,463
剰余金減少額又は欠損金増加額	117,653,747	152,683,955
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	117,653,747	152,683,955
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,675,911,403	1,644,265,606

## (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 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 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 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成23年2月26日から平成24年2月27日までとなっております。

(追加情報)

第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27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 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
*1 期首元本額	6,448,618,015円	6,997,960,350円
期中追加設定元本額	1,167,657,064円	1,241,120,741円
期中解約元本額	618,314,729円	648,446,247円
*2 計算期間末日における受益権の総数	6,997,960,350口	7,590,634,844口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,729,497,584円）及び分配準備積立金（576,549,297円）より分配対象収益は3,306,046,881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。</p>
--	--	--

## （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 8 期 自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	第 9 期 自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	第 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	366,734,582	79,605,299
合計	366,734,582	79,605,299

## （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 8 期 平成23年2月25日現在	第 9 期 平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2395円 (12,395円)	1.2166円 (12,166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24年2月27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	3,410,179,746	3,801,668,380	
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	1,648,530,293	1,882,291,888	
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	1,349,118,541	1,817,262,674	
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	1,199,564,903	1,464,668,746	
合計		7,607,393,483	8,965,891,688	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,133,270,232	2,593,824,482
株式	*2	264,381,727,116	263,710,678,910
派生商品評価勘定		47,203,959	276,395,498
未収入金		9,716,660,290	10,101,825,339
未収配当金		338,180,312	354,937,637
流動資産合計		277,617,041,909	277,037,661,866
資産合計		277,617,041,909	277,037,661,866

負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		30,823,445	105,848
前受金		11,090,000	278,373,000
未払解約金		7,164,018,000	10,057,414,000
流動負債合計		7,205,931,445	10,335,892,848
負債合計		7,205,931,445	10,335,892,848
純資産の部			
元本等			
元本		220,196,722,346	239,247,265,270
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		50,214,388,118	27,454,503,748
元本等合計		270,411,110,464	266,701,769,018
純資産合計		270,411,110,464	266,701,769,018
負債純資産合計		277,617,041,909	277,037,661,866

## 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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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 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。	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24年2 月8日から平成25年2月7日までと なっております。

## （追加情報）

自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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23年2月25日現在	平成24年2月27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	233,574,423,007円	220,196,722,346円
同期中追加設定元本額	39,969,597,768円	66,311,911,782円
同期中解約元本額	53,347,298,429円	47,261,368,858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	1,590,840,264円	2,720,571,053円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,047,651,439円	1,032,469,457円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	30,830,403,842円	34,396,680,678円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	700,002,526円	904,435,009円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,742,299,301円	3,374,709,352円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,874,194,929円	3,410,179,746円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	435,640,513円	488,821,629円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,341,511,810円	1,528,076,702円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,024,991,073円	1,156,519,223円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	145,238,096円	130,777,901円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,335,828,864円	1,460,029,523円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,643,790円	20,978,540円

D I A Mワールドバランス25 V A (適格機関投資家限定)	244,604,947円	248,643,355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)	9,867,955,132円	10,390,875,360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)	1,702,994,850円	1,738,933,259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)	194,710,307円	205,022,001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)	749,714,375円	793,541,289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)	204,600,270円	215,008,295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)	280,211,174円	289,970,352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)	18,635,488,207円	19,791,046,205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)	6,231,615,021円	6,563,250,759円
D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	4,790,801,907円	5,060,295,735円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A (適格機関投資家限 定)	3,252,926,220円	3,327,966,623円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	7,709,381,095円	7,752,392,609円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A (適格機関投資 家限定)	1,160,684,000円	1,186,505,341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)	2,429,481,845円	2,565,301,364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)	2,471,661,142円	2,614,376,367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)	13,265,254,995円	14,523,304,854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)	204,230,422円	246,895,382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)	291,738,856円	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 )	4,563,474,472円	4,777,527,019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 )	8,532,106,085円	9,398,032,927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 )	425,829,736円	462,181,207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 )	37,946,928,846円	40,957,872,509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 )	2,579,508,320円	2,666,336,975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 )	4,614,978,702円	5,023,376,784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 )	22,954,362,059円	25,029,935,571円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	261,737,293円	283,382,696円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	91,930円	105,664円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	144,867円	162,492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 )	20,067,408,457円	21,908,751,524円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	209,319,294円	292,690,317円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	73,184,000円	92,517,764円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	198,128,463円	216,564,619円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	86,168円	99,142円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	132,442円	150,097円
( 合 計 )	220,196,722,346円	239,247,265,270円
*2 差入代用有価証券	株式 1,877,500,000円	株式 1,690,000,000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	220,196,722,346口	239,247,265,270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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左

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>	<p>(1)株式 同左</p> <p>(2)派生商品評価勘定 同左</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</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> <p>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。</p>	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	470,551,754	19,687,439,286
合計	470,551,754	19,687,439,286

(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)

(株式関連)

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

平成24年2月27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	2,629,242,000	-	2,905,800,000	276,289,650
合計		2,629,242,000	-	2,905,800,000	276,289,650

(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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.2280円	1.1148円
(1万口当たり純資産額)	(12,280円)	(11,148円)

[次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

平成24年2月27日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	105,000	200	21,000,000	
日本水産	300,100	281	84,328,100	
マルハニチロホールディングス	516,000	144	74,304,000	
ハウスイ	19,000	126	2,394,000	
サカタのタネ	38,700	1,132	43,808,400	
ホクト	26,600	1,719	45,725,400	
ショーボンドHD	23,300	1,894	44,130,200	
ミライト・ホールディングス	74,200	601	44,594,200	
住石ホールディングス	76,600	106	8,119,600	
日鉄鉱業	66,000	409	26,994,000	
三井松島	169,000	184	31,096,000	
国際石油開発帝石	3,152	588,000	1,853,376,000	
日本海洋掘削	6,500	2,829	18,388,500	
関東天然瓦斯	27,000	439	11,853,000	
石油資源開発	37,000	3,985	147,445,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	170,000	3,740,000	
間組	93,800	267	25,044,600	
東急建設	92,370	221	20,413,770	
コムシスホールディングス	126,500	878	111,067,000	
ミサワホーム	25,100	724	18,172,400	
高松コンストラクショングP	19,900	1,254	24,954,600	
東建コーポレーション	9,700	2,940	28,518,000	
ヤマウラ	8,500	237	2,014,500	
大成建設	1,313,000	210	275,730,000	
大 林 組	778,000	363	282,414,000	
清水建設	794,000	329	261,226,000	
飛島建設	159,400	115	18,331,000	
長谷工コーポレーション	1,620,500	62	100,471,000	
松井建設	2,000	330	660,000	
鹿島建設	1,217,000	250	304,250,000	
不動テトラ	184,700	163	30,106,100	
大末建設	93,000	66	6,138,000	
鉄建建設	148,000	116	17,168,000	
安藤建設	87,000	133	11,571,000	
太平工業	46,000	419	19,274,000	
西松建設	340,000	196	66,640,000	
三井住友建設	164,400	79	12,987,600	
大豊建設	69,000	120	8,280,000	
前田建設	161,000	325	52,325,000	
佐田建設	90,000	84	7,560,000	

ナカノフドー建設	20,500	184	3,772,000
奥村組	248,000	328	81,344,000
大和小田急建設	13,500	224	3,024,000
東鉄工業	34,000	752	25,568,000
イチケン	30,000	163	4,890,000
浅沼組	80,000	79	6,320,000
戸田建設	279,000	290	80,910,000
熊谷組	186,000	90	16,740,000
青木あすなろ建設	18,500	441	8,158,500
北野建設	58,000	189	10,962,000
植木組	33,000	204	6,732,000
三井ホーム	34,000	441	14,994,000
矢作建設	32,500	406	13,195,000
ピーエス三菱	16,700	425	7,097,500
大東建託	98,500	7,110	700,335,000
新日本建設	31,300	236	7,386,800
N I P P O	60,000	869	52,140,000
東亜道路	49,000	238	11,662,000
前田道路	75,000	947	71,025,000
日本道路	78,000	338	26,364,000
東亜建設	227,000	172	39,044,000
若築建設	142,000	114	16,188,000
東洋建設	393,000	84	33,012,000
五洋建設	329,500	273	89,953,500
大林道路	31,000	258	7,998,000
世紀東急	69,000	66	4,554,000
福田組	39,000	290	11,310,000
住友林業	178,700	725	129,557,500
日本基礎技術	29,400	331	9,731,400
日成ビルド工業	77,000	194	14,938,000
エス・バイ・エル	132,000	174	22,968,000
バコーボレーション	33,500	326	10,921,000
パナホーム	98,000	538	52,724,000
大和ハウス	647,000	1,039	672,233,000
ライト工業	54,600	500	27,300,000
積水ハウス	730,000	755	551,150,000
日特建設	64,000	118	7,552,000
北陸電気工事	15,000	245	3,675,000
ユアテック	36,000	485	17,460,000
西部電気工業	1,000	359	359,000
四電工	6,000	343	2,058,000
中電工	38,000	866	32,908,000
関電工	119,000	426	50,694,000
きんでん	173,000	631	109,163,000
東京エネシス	27,000	484	13,068,000
トーエネック	37,000	460	17,020,000
住友電設	18,500	564	10,434,000
日本電設工業	48,000	747	35,856,000

協和エクシオ	85,300	733	62,524,900
新日本空調	21,300	470	10,011,000
日本工営	82,000	289	23,698,000
日本電話施設	45,000	259	11,655,000
九電工	49,000	514	25,186,000
三機工業	60,000	443	26,580,000
日揮	242,000	2,310	559,020,000
中外炉工業	84,000	294	24,696,000
ヤマト	16,000	314	5,024,000
太平電業	34,000	642	21,828,000
高砂熱学	75,000	657	49,275,000
三晃金属	29,000	254	7,366,000
N E C ネットズエスアイ	22,000	1,142	25,124,000
朝日工業社	29,000	342	9,918,000
アタカ大機	16,000	293	4,688,000
大 氣 社	40,000	1,616	64,640,000
ダイダン	25,000	539	13,475,000
日比谷総合設	32,500	880	28,600,000
東芝プラントシステム	42,000	908	38,136,000
日本製粉	164,000	377	61,828,000
日清製粉G本社	235,500	959	225,844,500
日東富士製粉	8,000	309	2,472,000
昭和産業	109,000	259	28,231,000
鳥越製粉	23,800	683	16,255,400
協同飼料	93,000	101	9,393,000
中部飼料	23,400	541	12,659,400
日本配合飼料	81,000	119	9,639,000
東洋精糖	41,000	106	4,346,000
日本甜菜糖	145,000	194	28,130,000
三井製糖	92,000	281	25,852,000
ネクスト	9,500	375	3,562,500
日本M & A センター	48	399,500	19,176,000
ノバレーゼ	49	52,000	2,548,000
アコーディア・ゴルフ	984	62,400	61,401,600
パソナグループ	242	73,100	17,690,200
リンクアンドモチベーション	51	49,600	2,529,600
テンプホールディングス	33,200	751	24,933,200
クックパッド	3,600	1,669	6,008,400
森永製菓	257,000	192	49,344,000
中 村 屋	61,000	418	25,498,000
江崎グリコ	94,000	898	84,412,000
名糖産業	12,100	1,009	12,208,900
不 二 家	150,000	170	25,500,000
山崎製パン	190,000	1,090	207,100,000
第一屋製パン	38,000	98	3,724,000
モロゾフ	43,000	274	11,782,000
カルビー	14,000	3,695	51,730,000
森永乳業	220,000	307	67,540,000

ヤクルト	139,100	2,491	346,498,100
明治ホールディングス	76,900	3,405	261,844,500
雪印メグミルク	56,000	1,512	84,672,000
プリマハム	147,000	136	19,992,000
日本ハム	197,000	1,021	201,137,000
伊藤ハム	143,000	323	46,189,000
林兼産業	85,000	85	7,225,000
丸大食品	125,000	319	39,875,000
米久	23,300	729	16,985,700
S Foods	17,000	675	11,475,000
学情	8,600	265	2,279,000
スタジオアリス	11,300	1,205	13,616,500
シミックホールディングス	7,900	1,201	9,487,900
システナ	272	60,500	16,456,000
NECフィールドینگ	19,600	1,043	20,442,800
新日鉄ソリューションズ	15,100	1,567	23,661,700
総合警備保障	88,100	957	84,311,700
日本駐車場開発	2,556	3,845	9,827,820
コア	8,800	730	6,424,000
カカクコム	37,600	2,356	88,585,600
アイロムホールディングス	542	2,825	1,531,150
ルネサンス	11,800	457	5,392,600
新日本科学	15,100	259	3,910,900
エムスリー	190	309,500	58,805,000
ベストブライダル	54	81,000	4,374,000
ディー・エヌ・エー	108,300	2,600	281,580,000
博報堂DYHLDGS	30,730	4,935	151,652,550
ぐるなび	17,000	938	15,946,000
一休	176	37,150	6,538,400
ジャパンベストレスキューS	37	74,500	2,756,500
ジェイコムホールディングス	4,300	703	3,022,900
PGMホールディングス	342	53,100	18,160,200
サッポロホールディングス	425,000	300	127,500,000
アサヒグループホールディング	486,700	1,782	867,299,400
キリンHD	1,040,000	964	1,002,560,000
宝ホールディングス	220,000	508	111,760,000
オエノンホールディングス	69,000	192	13,248,000
養命酒	3,000	796	2,388,000
三国コカ・コ・ラ	28,000	694	19,432,000
コカ・コーラウエスト	88,000	1,383	121,704,000
コカコーラセントラルジャパン	29,800	1,022	30,455,600
ダイドードリンコ	12,100	3,180	38,478,000
伊藤園	72,400	1,351	97,812,400
キーコーヒー	23,200	1,500	34,800,000
ユニカフェ	6,100	383	2,336,300
ジャパンフーズ	3,900	850	3,315,000
日清オイリオグループ	100,000	343	34,300,000
不二製油	63,200	1,098	69,393,600

J - オイルミルズ	98,000	233	22,834,000
ローソン	72,000	4,760	342,720,000
インターニックス	9,800	401	3,929,800
サンエー	7,800	3,080	24,024,000
キリン堂	10,100	508	5,130,800
ダイユーエイト	3,500	831	2,908,500
カワチ薬品	15,900	1,720	27,348,000
エービーシー・マート	32,400	2,792	90,460,800
ハードオフコーポレーション	11,200	649	7,268,800
高千穂交易	9,800	923	9,045,400
アスクル	15,700	1,251	19,640,700
ゲオホールディングス	377	93,000	35,061,000
ポイント	19,260	3,030	58,357,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	151	755,000
伊藤忠食品	5,800	2,916	16,912,800
くらコーポレーション	11,900	1,198	14,256,200
キャンドウ	125	86,600	10,825,000
エレマテック	18,300	1,415	25,894,500
パル	6,650	3,235	21,512,750
JALUX	7,300	821	5,993,300
エディオン	90,800	585	53,118,000
サーラコーポレーション	20,000	505	10,100,000
トーメンデバイス	3,400	2,020	6,868,000
あみやき亭	35	203,000	7,105,000
東京エレクトロニクスデバイス	46	150,900	6,941,400
ひらまつ	98	70,800	6,938,400
双日	1,530,100	152	232,575,200
ゲンキー	1,700	1,876	3,189,200
アルフレッサホールディングス	59,800	3,530	211,094,000
ハニーズ	20,080	1,183	23,754,640
キッコーマン	212,000	886	187,832,000
味の素	683,000	941	642,703,000
キューピー	132,300	1,138	150,557,400
ハウス食品	92,400	1,412	130,468,800
カゴメ	100,600	1,590	159,954,000
焼津水産化工	13,100	780	10,218,000
アリアケジャパン	23,900	1,620	38,718,000
ニチレイ	292,000	383	111,836,000
横浜冷凍	53,800	628	33,786,400
東洋水産	112,000	2,006	224,672,000
日清食品HD	101,400	3,010	305,214,000
永谷園	7,000	895	6,265,000
フジッコ	29,000	1,025	29,725,000
ロックフィールド	13,600	1,394	18,958,400
日本たばこ産業	5,749	436,500	2,509,438,500
わらべや日洋	14,700	1,103	16,214,100
なとり	13,100	900	11,790,000
片倉工業	30,500	749	22,844,500

グンゼ	181,000	255	46,155,000
昭栄	41,500	356	14,774,000
神栄	27,000	158	4,266,000
山下医科器械	2,200	987	2,171,400
ラサ商事	11,100	404	4,484,400
アルペン	17,400	1,477	25,699,800
アルコニックス	6,000	1,867	11,202,000
ビックカメラ	865	44,350	38,362,750
DCMホールディングス	118,100	588	69,442,800
MonotaRO	13,100	999	13,086,900
あいホールディングス	36,900	365	13,468,500
J.フロントリテイリング	539,000	392	211,288,000
ドトール・日レスHD	36,500	1,058	38,617,000
マツモトキヨシHLDGS	42,300	1,684	71,233,200
物語コーポレーション	2,500	1,293	3,232,500
ココカラファイン	23,800	2,232	53,121,600
三越伊勢丹HD	453,700	881	399,709,700
東洋紡績	1,024,000	118	120,832,000
ユニチカ	534,000	51	27,234,000
富士紡ホールディングス	101,000	176	17,776,000
日清紡ホールディングス	154,000	774	119,196,000
倉敷紡績	250,000	165	41,250,000
ダイワボウHD	221,000	187	41,327,000
シキボウ	157,000	115	18,055,000
日東紡績	178,000	282	50,196,000
トヨタ紡織	80,800	1,046	84,516,800
クリエイトSDH	9,700	1,833	17,780,100
バイタルKSKHD	43,000	700	30,100,000
八洲電機	15,600	373	5,818,800
UKCホールディングス	13,500	1,058	14,283,000
丸善CHIHD	6,700	216	1,447,200
TOKAIホールディングス	111,700	388	43,339,600
日本毛織	83,000	586	48,638,000
大東紡織	38,000	89	3,382,000
トーア紡コーポレーション	106,000	64	6,784,000
ダイドーリミテッド	30,400	698	21,219,200
東京建物不動産販	9,200	256	2,355,200
野村不動産HLDGS	109,400	1,427	156,113,800
常和ホールディングス	4,300	1,489	6,402,700
ヒューリック	74,100	1,050	77,805,000
帝国繊維	23,000	595	13,685,000
ブックオフコーポレーション	12,600	725	9,135,000
日本コークス工業	195,000	134	26,130,000
ミタチ産業	3,800	418	1,588,400
JFE商事HLDGS	154,000	414	63,756,000
あさひ	13,200	1,517	20,024,400
サークルKサンクス	49,600	1,773	87,940,800
日本調剤	2,910	2,540	7,391,400

コスモス薬品	10,100	3,560	35,956,000
シップヘルスケアHD	29,700	1,556	46,213,200
ソフトクリエイト	2,600	1,150	2,990,000
セブン&アイ・HLDGS	955,400	2,216	2,117,166,400
ツルハホールディングス	18,700	4,030	75,361,000
サンマルクホールディングス	6,500	3,115	20,247,500
フェリシモ	6,600	1,086	7,167,600
トリドール	19,700	821	16,173,700
クスリのアオキ	3,400	1,801	6,123,400
帝人	990,000	275	272,250,000
東レ	1,758,000	578	1,016,124,000
クラレ	385,300	1,170	450,801,000
旭化成	1,411,000	512	722,432,000
サカイオーベックス	69,000	145	10,005,000
稲葉製作所	12,000	948	11,376,000
宮地エンジニアリングG	76,000	169	12,844,000
三協・立山HLDGS	327,000	148	48,396,000
トーカロ	13,700	1,674	22,933,800
アルファCO	8,300	1,049	8,706,700
SUMCO	148,100	854	126,477,400
川田テクノロジーズ	5,600	1,258	7,044,800
住江織物	61,000	168	10,248,000
日本フェルト	14,700	423	6,218,100
イチカワ	14,000	175	2,450,000
日本バイリン	31,000	360	11,160,000
エコナックホールディングス	73,000	49	3,577,000
日東製網	28,000	178	4,984,000
芦森工業	58,000	122	7,076,000
アツギ	190,000	102	19,380,000
ダイニック	47,000	169	7,943,000
共和レザー	13,400	306	4,100,400
セーレン	60,400	491	29,656,400
東海染工	35,000	122	4,270,000
小松精練	38,000	396	15,048,000
ワコールホールディングス	144,000	1,009	145,296,000
ホギメディカル	15,400	3,405	52,437,000
レナウン	52,800	160	8,448,000
クラウドディア	3,000	1,097	3,291,000
T S Iホールディングス	108,100	449	48,536,900
デジタルハーツ	19	143,000	2,717,000
I Tホールディングス	69,200	937	64,840,400
グリー	116,800	2,449	286,043,200
コーエーテクモHD	45,300	645	29,218,500
三菱総合研究所	8,900	1,624	14,453,600
ボルテージ	2,100	1,184	2,486,400
ネクソン	114,700	1,236	141,769,200
特種東海製紙	153,000	183	27,999,000
ドワンゴ	114	129,700	14,785,800



ベリサーブ	13	140,000	1,820,000
マクロミル	22,200	793	17,604,600
ティーガイア	147	144,000	21,168,000
GMOペイメントゲートウェイ	50	330,500	16,525,000
ザッパラス	126	94,200	11,869,200
インターネットイニシアティブ	134	247,100	33,111,400
ソネットエンタテインメント	129	312,500	40,312,500
S R Aホールディングス	12,100	886	10,720,600
J B I Sホールディングス	24,000	309	7,416,000
朝日ネット	20,000	365	7,300,000
王子製紙	1,070,000	405	433,350,000
三菱製紙	347,000	82	28,454,000
北越紀州製紙	150,500	518	77,959,000
中越パルプ	93,000	178	16,554,000
巴川製紙	41,000	194	7,954,000
大王製紙	102,000	545	55,590,000
日本製紙G本社	116,900	1,755	205,159,500
レンゴー	194,000	567	109,998,000
トーモク	77,000	228	17,556,000
ザ・パック	14,300	1,269	18,146,700
コ - プケミカル	37,000	125	4,625,000
昭和電工	1,506,000	184	277,104,000
住友化学	1,665,000	346	576,090,000
日本化成	47,000	148	6,956,000
住友精化	46,000	378	17,388,000
日産化学	184,600	824	152,110,400
ラサ工業	98,000	131	12,838,000
クレハ	157,000	411	64,527,000
テイカ	42,000	305	12,810,000
石原産業	407,000	89	36,223,000
片倉チツカリン	13,000	235	3,055,000
日本曹達	145,000	374	54,230,000
東ソー	648,000	246	159,408,000
トクヤマ	377,000	298	112,346,000
セントラル硝子	232,000	371	86,072,000
東亜合成	304,000	371	112,784,000
ダイソー	98,000	264	25,872,000
関東電化	54,000	322	17,388,000
電気化学	509,000	331	168,479,000
イビデン	151,700	1,929	292,629,300
信越化学	434,700	4,395	1,910,506,500
日本カ - バイド	76,000	137	10,412,000
堺化学	76,000	317	24,092,000
エア・ウォーター	197,000	1,061	209,017,000
大陽日酸	318,000	540	171,720,000
日本化学工業	97,000	154	14,938,000
日本パ - カライジング	57,000	1,224	69,768,000
高圧ガス	37,000	494	18,278,000

チタン工業	27,000	379	10,233,000
四国化成	34,000	479	16,286,000
戸田工業	31,000	636	19,716,000
ステラ ケミファ	11,500	2,224	25,576,000
保土谷化学	49,000	293	14,357,000
日本触媒	176,000	980	172,480,000
大日精化	87,000	382	33,234,000
カネカ	302,000	475	143,450,000
協和発酵キリン	332,000	865	287,180,000
三菱瓦斯化学	417,000	527	219,759,000
三井化学	1,028,000	279	286,812,000
J S R	220,600	1,681	370,828,600
東京応化工業	43,600	1,902	82,927,200
大阪有機化学	15,200	446	6,779,200
三菱ケミカルH L D G S	1,515,000	480	727,200,000
日本合成化学	50,000	498	24,900,000
ダイセル	315,000	525	165,375,000
住友ベークライト	208,000	490	101,920,000
積水化学	504,000	685	345,240,000
日本ゼオン	226,000	768	173,568,000
アイカ工業	63,600	1,151	73,203,600
宇部興産	1,015,000	241	244,615,000
積水樹脂	35,000	822	28,770,000
タキロン	57,000	287	16,359,000
旭有機材	87,000	230	20,010,000
日立化成	104,800	1,529	160,239,200
ニチバン	22,000	275	6,050,000
リケンテクノス	40,000	255	10,200,000
大倉工業	58,000	261	15,138,000
積水化成成品	62,000	295	18,290,000
群栄化学	67,000	221	14,807,000
タイガース ポリマー	12,200	325	3,965,000
日本カクリット	20,000	419	8,380,000
日本化薬	171,000	767	131,157,000
イーピーエス	130	174,300	22,659,000
パナソニック電工 I S	5,400	2,153	11,626,200
フェイス	774	9,610	7,438,140
アミューズ	7,100	1,103	7,831,300
野村総合研究所	129,200	1,893	244,575,600
ドリームインキュベータ	79	72,700	5,743,300
サイバネットシステム	191	22,130	4,226,830
T A C	13,600	210	2,856,000
ケネディクス	2,633	15,120	39,810,960
電通	219,900	2,462	541,393,800
インテージ	6,800	1,539	10,465,200
テイクアンドギヴニーズ	1,041	7,060	7,349,460
ぴあ	7,600	879	6,680,400
シンプレクスホールディング	380	26,040	9,895,200

[次へ](#)

平成24年2月27日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
イオンファンタジー	8,100	1,307	10,586,700	
ソースネクスト	59	15,850	935,150	
ネクシィーズ	952	2,050	1,951,600	
メディカルシステムネットワーク	3,900	1,049	4,091,100	
日本精化	20,900	570	11,913,000	
A D E K A	104,600	788	82,424,800	
日油	193,000	402	77,586,000	
ミヨシ油脂	85,000	114	9,690,000	
ハリマ化成	20,900	568	11,871,200	
花 王	642,800	2,050	1,317,740,000	
第一工業製薬	45,000	246	11,070,000	
三洋化成	76,000	568	43,168,000	
武田薬品	907,900	3,645	3,309,295,500	
アステラス製薬	538,100	3,285	1,767,658,500	
大日本住友製薬	171,800	841	144,483,800	
塩野義製薬	378,500	1,123	425,055,500	
田辺三菱製薬	242,000	1,113	269,346,000	
わかもと製薬	7,000	250	1,750,000	
あすか製薬	29,000	534	15,486,000	
日本新薬	51,000	975	49,725,000	
中外製薬	281,600	1,308	368,332,800	
科研製薬	95,000	1,032	98,040,000	
エーザイ	298,400	3,275	977,260,000	
ロート製薬	102,000	954	97,308,000	
小野薬品	118,600	4,370	518,282,000	
久光製薬	75,300	3,570	268,821,000	
有機合成薬品	18,000	223	4,014,000	
持田製薬	86,000	936	80,496,000	
参天製薬	81,400	3,180	258,852,000	
扶桑薬品	83,000	229	19,007,000	
日本ケミファ	37,000	385	14,245,000	
ツムラ	66,200	2,333	154,444,600	
日医工	41,000	1,788	73,308,000	
テ ル モ	163,800	3,900	638,820,000	
みらかホールディングス	63,100	3,080	194,348,000	
キッセイ薬品工業	45,200	1,592	71,958,400	
生化学工業	46,600	919	42,825,400	
栄研化学	19,100	1,077	20,570,700	
日水製薬	10,500	732	7,686,000	
鳥居薬品	16,700	1,508	25,183,600	
東和薬品	12,400	3,500	43,400,000	
沢井製薬	15,900	7,870	125,133,000	
ゼリア新薬工業	35,000	1,358	47,530,000	

第一三共	815,200	1,489	1,213,832,800
キョーリン製薬HD	59,000	1,452	85,668,000
大幸薬品	11,300	851	9,616,300
ダイト	6,800	1,130	7,684,000
大塚ホールディングス	480,900	2,242	1,078,177,800
大正製薬HD	58,300	7,070	412,181,000
大日本塗料	140,000	101	14,140,000
日本ペイント	229,000	649	148,621,000
関西ペイント	274,000	783	214,542,000
トウペ	22,000	108	2,376,000
中国塗料	75,000	557	41,775,000
日本特殊塗料	19,300	358	6,909,400
藤倉化成	30,700	443	13,600,100
太陽ホールディングス	20,000	2,277	45,540,000
D I C	924,000	169	156,156,000
サカタインクス	46,000	391	17,986,000
東洋インキSCホールディン	218,000	336	73,248,000
アルプス技研	11,100	628	6,970,800
サニックス	35,600	235	8,366,000
ダイオーズ	4,700	499	2,345,300
日本空調サービス	6,600	740	4,884,000
オリエンタルランド	65,400	8,280	541,512,000
ダスキン	72,700	1,660	120,682,000
パーク24	118,500	991	117,433,500
明光ネットワークジャパン	22,600	779	17,605,400
ファルコSDホールディングス	13,300	935	12,435,500
クレスコ	5,900	640	3,776,000
フジ・メディア・HD	2,378	123,600	293,920,800
秀英予備校	4,100	312	1,279,200
田谷	900	708	637,200
ラウンドワン	75,600	548	41,428,800
リゾートトラスト	37,200	1,261	46,909,200
オービック	7,140	15,440	110,241,600
ティーディーシーソフトウェア	4,800	779	3,739,200
ヤフー	16,722	25,320	423,401,040
ビー・エム・エル	15,900	2,011	31,974,900
ワタベウェディング	7,500	725	5,437,500
トレンドマイクロ	100,800	2,339	235,771,200
もしもしホットライン	40,100	810	32,481,000
東急コミュニティー	6,400	2,536	16,230,400
リソー教育	2,509	5,310	13,322,790
日本オラクル	45,600	2,815	128,364,000
アルファシステムズ	6,300	1,338	8,429,400
フューチャーアーキテクト	275	35,200	9,680,000
ウェアハウス	5,100	246	1,254,600
シーエーシー	15,700	686	10,770,200
ソフトバンク・テクノ	5,700	736	4,195,200
トーセ	6,000	524	3,144,000

ユー・エス・エス	31,520	7,910	249,323,200
オービックビジネスC	5,800	3,565	20,677,000
伊藤忠テクノソリューションズ	26,900	3,435	92,401,500
アイティフォー	25,700	305	7,838,500
東京個別指導学院	12,500	175	2,187,500
東計電算	4,300	1,042	4,480,600
エクスネット	18	123,000	2,214,000
テー・オー・ダブリュー	8,500	484	4,114,000
大塚商会	18,200	5,810	105,742,000
総合メディカル	5,500	2,610	14,355,000
サイボウズ	418	33,200	13,877,600
ソフトブレーン	333	8,550	2,847,150
アグレックス	6,500	786	5,109,000
セントラルスポーツ	7,900	1,078	8,516,200
電通国際情報S	14,200	640	9,088,000
ウェザーニューズ	6,000	2,118	12,708,000
C I J	23,600	337	7,953,200
WOWOW	71	200,200	14,214,200
フルキャストホールディングス	198	17,440	3,453,120
富士フイルムHLDGS	517,600	2,052	1,062,115,200
コニカミノルタHLDGS	611,000	692	422,812,000
資生堂	402,300	1,389	558,794,700
ライオン	280,000	465	130,200,000
高砂香料	80,000	388	31,040,000
マンダム	24,300	1,991	48,381,300
ミルボン	13,000	2,347	30,511,000
ファンケル	61,100	1,059	64,704,900
コーセー	39,100	1,829	71,513,900
ドクターシーラボ	146	380,000	55,480,000
ポーラ・オルビスHD	24,800	2,070	51,336,000
エステー	15,100	1,020	15,402,000
コニシ	17,700	1,092	19,328,400
長谷川香料	31,000	1,222	37,882,000
小林製薬	33,700	3,925	132,272,500
荒川化学工業	19,200	746	14,323,200
メック	17,700	330	5,841,000
日本高純度化学	69	209,500	14,455,500
荏原ユージライト	3,400	2,282	7,758,800
アース製薬	17,500	2,865	50,137,500
イハラケミカル	42,000	354	14,868,000
北興化学	11,000	243	2,673,000
大成ラミック	6,900	2,587	17,850,300
クミアイ化学	57,000	352	20,064,000
日本農薬	56,000	349	19,544,000
昭和シェル石油	216,600	558	120,862,800
コスモ石油	670,000	243	162,810,000
富士興産	83,000	87	7,221,000
ニチレキ	33,000	472	15,576,000

東燃ゼネラル石油	365,000	764	278,860,000
ユシロ化学	13,200	903	11,919,600
ビーピー・カストロール	9,800	342	3,351,600
AOCホールディングス	56,200	573	32,202,600
MORESCO	5,300	896	4,748,800
出光興産	28,700	8,420	241,654,000
JXホールディングス	2,689,300	512	1,376,921,600
横浜ゴム	296,000	547	161,912,000
東洋ゴム	183,000	222	40,626,000
ブリヂストン	759,400	1,929	1,464,882,600
住友ゴム	188,800	1,020	192,576,000
藤倉ゴム	15,300	319	4,880,700
オカモト	89,000	309	27,501,000
アキレス	198,000	120	23,760,000
フコク	10,200	767	7,823,400
ニッタ	23,900	1,418	33,890,200
クリエートメディック	7,000	805	5,635,000
東海ゴム工業	44,800	1,006	45,068,800
三ツ星ベルト	64,000	443	28,352,000
バンドー化学	86,000	309	26,574,000
鬼怒川ゴム	53,000	623	33,019,000
旭硝子	1,193,000	745	888,785,000
日本板硝子	1,038,000	146	151,548,000
石塚硝子	31,000	158	4,898,000
有沢製作所	40,400	345	13,938,000
日本山村硝子	97,000	209	20,273,000
日本電気硝子	465,000	762	354,330,000
オハラ	9,200	905	8,326,000
住友大阪セメント	492,000	248	122,016,000
太平洋セメント	1,423,000	179	254,717,000
デイ・シイ	22,900	291	6,663,900
リゾートソリューション	23,000	174	4,002,000
日本ヒュ-ム	21,000	391	8,211,000
日本コンクリ-ト	38,000	273	10,374,000
東海カーボン	210,000	443	93,030,000
日本カーボン	111,000	228	25,308,000
東洋炭素	11,900	3,360	39,984,000
ノリタケ	125,000	262	32,750,000
TOTO	374,000	612	228,888,000
日本碍子	315,000	1,111	349,965,000
日本特殊陶業	209,000	1,091	228,019,000
ダントーホールディングス	37,000	107	3,959,000
MARUWA	7,200	3,450	24,840,000
品川リフラクトリーズ	61,000	242	14,762,000
黒崎播磨	52,000	283	14,716,000
東京窯業	30,000	206	6,180,000
ニッカトー	9,000	527	4,743,000
フジインコーポレーテッド	22,100	1,048	23,160,800

エーアンドエーマテリアル	51,000	90	4,590,000
ニチアス	108,000	457	49,356,000
新日本製鐵	6,358,000	235	1,494,130,000
住友金属工業	4,489,000	170	763,130,000
神戸製鋼所	3,357,000	145	486,765,000
日新製鋼	858,000	145	124,410,000
中山製鋼所	123,000	94	11,562,000
合同製鐵	136,000	220	29,920,000
J F Eホールディングス	573,900	1,796	1,030,724,400
東京製鐵	122,500	687	84,157,500
共英製鋼	25,900	1,488	38,539,200
大和工業	55,400	2,624	145,369,600
東京鐵鋼	47,000	305	14,335,000
大阪製鐵	15,200	1,545	23,484,000
淀川製鋼所	172,000	367	63,124,000
東洋鋼鈹	58,000	325	18,850,000
住友鋼管	14,200	674	9,570,800
丸一鋼管	74,300	1,815	134,854,500
モリ工業	37,000	301	11,137,000
大同特殊鋼	406,000	540	219,240,000
日本高周波	96,000	109	10,464,000
日本金属工業	187,000	78	14,586,000
日本冶金工	178,500	152	27,132,000
山陽特殊製鋼	120,000	437	52,440,000
愛知製鋼	129,000	455	58,695,000
日立金属	158,000	1,011	159,738,000
日本金属	58,000	157	9,106,000
大平洋金属	169,000	461	77,909,000
日本電工	87,000	361	31,407,000
栗本鉄工所	116,000	209	24,244,000
旭テック	200,000	33	6,600,000
日本鑄鉄管	26,000	188	4,888,000
日本製鋼所	374,000	611	228,514,000
三菱製鋼	146,000	267	38,982,000
日亜鋼業	38,000	215	8,170,000
日本精線	16,000	401	6,416,000
日本軽金属	548,000	125	68,500,000
大紀アルミニウム	38,000	303	11,514,000
三井金属	659,000	254	167,386,000
東邦亜鉛	137,000	357	48,909,000
三菱マテリアル	1,512,000	266	402,192,000
住友鋳山	627,000	1,223	766,821,000
D O W Aホールディングス	290,000	543	157,470,000
古河機金	408,000	84	34,272,000
大阪チタニウム	23,800	3,500	83,300,000
東邦チタニウム	39,300	1,425	56,002,500
住友軽金属	583,000	85	49,555,000
古河スカイ	98,000	263	25,774,000



古河電工	762,000	236	179,832,000
住友電工	855,700	1,062	908,753,400
フジクラ	363,000	285	103,455,000
昭和電線HLDGS	313,000	84	26,292,000
東京特殊電線	33,000	105	3,465,000
タツタ電線	46,000	428	19,688,000
日立電線	190,000	193	36,670,000
沖電線	26,000	169	4,394,000
カナレ電気	3,400	1,265	4,301,000
平河ヒューテック	4,400	796	3,502,400
リョービ	135,000	326	44,010,000
アサヒHD	33,900	1,664	56,409,600
東洋製罐	171,200	1,171	200,475,200
ホッカンホールディングス	58,000	245	14,210,000
コロナ	11,200	1,253	14,033,600
横河ブリッジHLDGS	50,000	570	28,500,000
日本橋梁	8,850	489	4,327,650
駒井ハルテック	47,000	263	12,361,000
サクラダ	216,000	24	5,184,000
高田機工	22,000	229	5,038,000
三和ホールディングス	242,000	287	69,454,000
文化シャツタ-	63,000	295	18,585,000
東洋シャツタ-	7,500	399	2,992,500
住生活グループ	314,900	1,677	528,087,300
日本ファイルコン	17,900	413	7,392,700
ノーリツ	47,600	1,519	72,304,400
長府製作所	23,400	1,966	46,004,400
リンナイ	39,000	5,800	226,200,000
ユニプレス	36,900	2,285	84,316,500
ダイニチ工業	12,500	773	9,662,500
日東精工	32,000	243	7,776,000
三洋工業	31,000	178	5,518,000
岡部	48,200	427	20,581,400
日立ツール	14,100	863	12,168,300
中国工業	38,000	112	4,256,000
東プレ	46,900	799	37,473,100
高周波熱錬	32,300	761	24,580,300
東京製綱	153,000	187	28,611,000
パイオラックス	10,400	1,962	20,404,800
日本発条	175,200	841	147,343,200
中央発條	28,000	317	8,876,000
アドバネクス	49,000	97	4,753,000
三浦工業	36,100	2,253	81,333,300
タクマ	82,000	402	32,964,000
ツガミ	61,000	612	37,332,000
オークマ	146,000	675	98,550,000
東芝機械	132,000	434	57,288,000
アマダ	342,000	580	198,360,000

アイダエンジニア	62,900	468	29,437,200
牧野フライス	121,000	584	70,664,000
オーエスジー	106,700	1,221	130,280,700
ダイジェット	29,000	180	5,220,000
旭ダイヤモンド	59,500	1,122	66,759,000
森精機製作所	127,600	837	106,801,200
ディスコ	24,400	4,520	110,288,000
日東工器	14,200	1,867	26,511,400
豊田自動織機	210,600	2,543	535,555,800
豊和工業	127,000	79	10,033,000
大阪機工	94,000	120	11,280,000
石川製作所	53,000	78	4,134,000
東洋機械金属	18,100	239	4,325,900
津田駒工業	59,000	204	12,036,000
エンシュウ	60,000	97	5,820,000
島精機製作所	31,600	1,575	49,770,000
日阪製作所	31,000	898	27,838,000
やまびこ	9,600	1,160	11,136,000
ペガサスミシン製造	22,500	228	5,130,000
ナブテスコ	100,500	1,871	188,035,500
三井海洋開発	20,000	1,654	33,080,000
レオン自動機	21,000	210	4,410,000
S M C	72,300	13,840	1,000,632,000
新川	18,800	495	9,306,000
ホソカワミクロン	37,000	440	16,280,000
ユニオンツール	13,300	1,510	20,083,000
オイレス工業	26,900	1,534	41,264,600
サト - ホールディングス	25,400	1,116	28,346,400
日本エアーテック	6,800	393	2,672,400
日精樹脂工業	19,400	395	7,663,000
ワイエイシイ	9,800	694	6,801,200
小松製作所	1,148,300	2,425	2,784,627,500
住友重機械	618,000	451	278,718,000
日立建機	123,600	1,703	210,490,800
日工	33,000	328	10,824,000
巴工業	9,100	1,642	14,942,200
井関農機	248,000	206	51,088,000
T O W A	21,600	510	11,016,000
丸山製作所	55,000	186	10,230,000
北川鉄工所	111,000	165	18,315,000
シンニッタン	21,000	459	9,639,000
クボタ	1,109,000	804	891,636,000
荏原実業	6,100	1,214	7,405,400
東洋エンジニア	139,000	357	49,623,000
三菱化工機	75,000	177	13,275,000
月島機械	36,000	692	24,912,000
帝国電機製作所	8,200	1,550	12,710,000
東京機械	79,000	68	5,372,000

新東工業	52,900	852	45,070,800
渋谷工業	14,400	902	12,988,800
アイチ コーポレーション	40,400	370	14,948,000
小森コーポレーション	68,900	609	41,960,100
鶴見製作所	14,000	648	9,072,000
住友精密	34,000	513	17,442,000
酒井重工業	47,000	192	9,024,000
荏原製作所	395,000	306	120,870,000
石井鉄工所	36,000	177	6,372,000
西島製作所	27,900	1,082	30,187,800
千代田化工建	206,000	966	198,996,000
ダイキン工業	294,900	2,409	710,414,100
オルガノ	46,000	602	27,692,000
ト - ヨ - カネツ	130,000	188	24,440,000
栗田工業	133,600	2,082	278,155,200
椿本チエイン	124,000	482	59,768,000
大同工業	48,000	153	7,344,000
日本コンベヤ	76,000	88	6,688,000
日 機 装	75,000	730	54,750,000
木村化工機	22,200	404	8,968,800
新興プランテック	53,200	706	37,559,200
アネスト岩田	38,000	356	13,528,000
ダイフク	106,000	471	49,926,000
加藤製作所	55,000	322	17,710,000
油研工業	43,000	181	7,783,000
タダノ	112,000	588	65,856,000
フジテック	68,000	509	34,612,000
シーケーディ	64,900	616	39,978,400
キトー	99	66,200	6,553,800
平和	50,200	1,570	78,814,000
理想科学工業	16,600	1,249	20,733,400
SANKYO	70,100	3,885	272,338,500
日本金銭機械	21,600	618	13,348,800
マースエンジニアリング	13,100	1,458	19,099,800
福島工業	6,700	1,161	7,778,700
オーイズミ	8,400	256	2,150,400
ダイコク電機	10,700	958	10,250,600
ア マ ノ	70,100	750	52,575,000
JUKI	140,000	184	25,760,000
サンデン	121,000	306	37,026,000
蛇の目ミシン	225,000	73	16,425,000
ブラザー工業	299,000	1,059	316,641,000
マックス	36,000	1,030	37,080,000
モリタホールディングス	37,000	528	19,536,000
グローリー	69,100	1,755	121,270,500
大和冷機工業	34,000	429	14,586,000
セガサミーホールディングス	248,700	1,568	389,961,600
日本ピストンリング	84,000	205	17,220,000

リケン	84,000	359	30,156,000
T P R	25,600	1,170	29,952,000
ホシザキ電機	46,800	1,797	84,099,600
大豊工業	16,300	914	14,898,200
日本精工	515,000	647	333,205,000
N T N	535,000	362	193,670,000
ジェイテクト	221,200	923	204,167,600
不二越	233,000	455	106,015,000
ミネベア	344,000	388	133,472,000
日本トムソン	74,000	541	40,034,000
T H K	153,800	1,774	272,841,200
ユーシン精機	11,600	1,618	18,768,800
前澤給装工業	9,200	1,113	10,239,600
イーグル工業	29,000	764	22,156,000
前澤工業	17,100	227	3,881,700
日本ピラ - 工業	23,000	636	14,628,000
キッツ	95,200	361	34,367,200
日立	5,197,000	474	2,463,378,000
東芝	4,872,000	350	1,705,200,000
三菱電機	2,314,000	738	1,707,732,000
富士電機	698,000	223	155,654,000
東洋電機製造	42,000	329	13,818,000
安川電機	272,000	786	213,792,000
シンフォニアテクノロジー	140,000	190	26,600,000
明電舎	230,000	301	69,230,000
オリジン電気	34,000	318	10,812,000
デンヨー	22,100	1,028	22,718,800
日立工機	62,000	718	44,516,000
三桜工業	29,400	653	19,198,200
マキタ	150,900	3,365	507,778,500
東芝テック	145,000	310	44,950,000
芝浦メカトロニクス	41,000	248	10,168,000
マブチモーター	31,500	3,765	118,597,500
日本電産	125,100	7,560	945,756,000
宮越ホールディングス	8,000	447	3,576,000
高岳製作所	92,000	253	23,276,000
ダイヘン	137,000	300	41,100,000
J V C ケンウッド	139,700	382	53,365,400
第一精工	5,400	2,652	14,320,800
日新電機	47,000	554	26,038,000
大崎電気	34,000	851	28,934,000
オムロン	257,700	1,789	461,025,300
日東工業	35,100	922	32,362,200
I D E C	30,500	828	25,254,000
エルピーダメモリ	312,300	334	104,308,200
ジーエス・ユアサコーポ	446,000	443	197,578,000
サクサホールディングス	59,000	208	12,272,000
メルコホールディングス	12,800	2,055	26,304,000

[前](#) [次](#)

平成24年2月27日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
テクノメディカ	13	317,500	4,127,500	
日本電気	3,181,000	162	515,322,000	
富士通	2,231,000	445	992,795,000	
沖電気	894,000	93	83,142,000	
岩崎通信機	104,000	85	8,840,000	
電気興業	71,000	402	28,542,000	
サンケン電気	117,000	373	43,641,000	
ナカヨ通信機	23,000	349	8,027,000	
アイホン	13,500	1,554	20,979,000	
ルネサスエレクトロニクス	59,900	606	36,299,400	
セイコーエプソン	157,800	1,102	173,895,600	
ワコム	456	149,800	68,308,800	
アルバック	46,100	1,040	47,944,000	
アクセル	10,800	1,781	19,234,800	
ピクセラ	9,700	208	2,017,600	
ナナオ	19,700	1,833	36,110,100	
日本信号	54,100	523	28,294,300	
京三製作所	50,000	363	18,150,000	
能美防災	31,000	542	16,802,000	
ホーチキ	19,000	449	8,531,000	
日本無線	50,000	216	10,800,000	
パナソニック	2,643,800	751	1,985,493,800	
シャープ	1,117,000	584	652,328,000	
アンリツ	111,000	974	108,114,000	
富士通ゼネラル	55,000	520	28,600,000	
日立国際電気	53,000	710	37,630,000	
ソニー	1,443,800	1,760	2,541,088,000	
T D K	121,000	4,180	505,780,000	
帝国通信工業	55,000	153	8,415,000	
ミツミ電機	81,800	780	63,804,000	
タムラ製作所	78,000	237	18,486,000	
アルプス電気	182,600	727	132,750,200	
池上通信機	74,000	65	4,810,000	
パイオニア	328,100	417	136,817,700	
日本電波工業	17,900	1,177	21,068,300	
日本トリム	2,750	2,040	5,610,000	
ローランド ディー・ジー	10,300	1,003	10,330,900	
日本コロムビア	231,000	34	7,854,000	
山水電気	1,498,000	2	2,996,000	
フオスタ - 電機	21,900	1,331	29,148,900	
クラリオン	142,000	174	24,708,000	
S M K	74,000	292	21,608,000	
ヨコオ	18,100	480	8,688,000	

東光	105,000	189	19,845,000
ティアック	126,000	36	4,536,000
ホシデン	62,800	632	39,689,600
ヒロセ電機	40,300	8,120	327,236,000
日本航空電子	53,000	663	35,139,000
T O A	26,000	599	15,574,000
ユニデン	68,000	323	21,964,000
アルパイン	45,100	1,115	50,286,500
スミダコーポレーション	14,300	577	8,251,100
アイコム	12,900	2,005	25,864,500
リオン	5,300	753	3,990,900
船井電機	20,800	1,942	40,393,600
横河電機	251,300	785	197,270,500
新電元工業	82,000	398	32,636,000
山武	59,600	1,790	106,684,000
日本光電工業	46,200	2,068	95,541,600
チノール	42,000	238	9,996,000
共和電業	3,000	250	750,000
日本電子材料	9,400	415	3,901,000
堀場製作所	42,800	2,564	109,739,200
アドバンテスト	172,100	1,137	195,677,700
小野測器	23,000	298	6,854,000
エスベック	24,200	603	14,592,600
パナソニック電工SUNX	20,600	416	8,569,600
キーエンス	51,600	20,850	1,075,860,000
日置電機	11,300	1,362	15,390,600
シスメックス	81,400	2,873	233,862,200
メガチップス	19,000	1,473	27,987,000
O B A R A G R O U P	16,500	1,057	17,440,500
日本電産コパル電子	24,000	481	11,544,000
ミヤチテクノス	10,500	711	7,465,500
東京電波	7,000	428	2,996,000
澤藤電機	13,000	237	3,081,000
デンソー	571,700	2,704	1,545,876,800
コーセル	33,700	1,174	39,563,800
日立メディコ	17,000	970	16,490,000
新日本無線	14,000	197	2,758,000
オブテックス	16,200	1,004	16,264,800
千代田インテグレ	11,300	994	11,232,200
東光電気	15,000	364	5,460,000
スタンレー電気	155,100	1,382	214,348,200
岩崎電気	85,000	185	15,725,000
ウシオ電機	140,300	1,222	171,446,600
岡谷電機	12,900	374	4,824,600
ヘリオステクノH	20,000	157	3,140,000
日本セラミック	15,200	1,456	22,131,200
日本デジタル研究所	19,500	920	17,940,000
古河電池	17,000	401	6,817,000

双信電機	11,500	375	4,312,500	
山一電機	23,600	197	4,649,200	
図研	15,200	671	10,199,200	
日本電子	86,000	231	19,866,000	
カシオ	220,500	571	125,905,500	
ファナック	240,900	14,320	3,449,688,000	
日本シイエムケイ	49,900	451	22,504,900	
エンプラス	11,700	1,687	19,737,900	
ローム	114,000	4,035	459,990,000	
浜松ホトニクス	90,300	2,867	258,890,100	
三井ハイテック	30,500	422	12,871,000	
新光電気工業	77,700	701	54,467,700	
京セラ	192,400	6,900	1,327,560,000	
協栄産業	28,000	160	4,480,000	
太陽誘電	103,900	842	87,483,800	
村田製作所	242,800	4,810	1,167,868,000	
ユーシン	32,200	667	21,477,400	
双葉電子工業	39,600	1,380	54,648,000	
日東電工	199,700	3,395	677,981,500	
北陸電気工業	94,000	127	11,938,000	
東海理化電機	54,100	1,493	80,771,300	
ニチコン	72,900	1,012	73,774,800	
日本ケミコン	133,000	338	44,954,000	
K O A	29,200	822	24,002,400	
三井造船	895,000	157	140,515,000	
日立造船	915,500	110	100,705,000	
佐世保重工業	151,000	151	22,801,000	
三菱重工業	3,879,000	387	1,501,173,000	
川崎重工業	1,681,000	257	432,017,000	
I H I	1,581,000	207	327,267,000	
日本車輛	85,000	368	31,280,000	
日本輸送機	31,000	260	8,060,000	
近畿車輛	35,000	316	11,060,000	
日産自動車	2,923,400	837	2,446,885,800	
いすゞ自動車	1,463,000	439	642,257,000	
トヨタ自動車	3,000,900	3,380	10,143,042,000	*
日野自動車	331,000	575	190,325,000	
三菱自動車工業	5,174,000	99	512,226,000	
エフテック	8,000	1,346	10,768,000	
武蔵精密工業	22,400	1,941	43,478,400	
日産車体	68,000	844	57,392,000	
新明和工業	103,000	387	39,861,000	
極東開発工業	40,100	748	29,994,800	
日信工業	42,300	1,430	60,489,000	
トピー工業	173,000	242	41,866,000	
ティラド	84,000	340	28,560,000	
曙ブレーキ	117,200	437	51,216,400	
タチエス	30,200	1,626	49,105,200	



N O K	111,900	1,608	179,935,200
フタバ産業	65,500	498	32,619,000
カヤバ工業	160,000	460	73,600,000
シロキ工業	51,000	269	13,719,000
市光工業	56,000	174	9,744,000
大同メタル工業	36,000	985	35,460,000
プレス工業	107,000	471	50,397,000
カルソニックカンセイ	138,000	471	64,998,000
太平洋工業	47,000	444	20,868,000
ケーヒン	47,800	1,660	79,348,000
河西工業	28,000	453	12,684,000
アイシン精機	190,500	2,899	552,259,500
富士機工	27,000	314	8,478,000
マ ッ ダ	1,919,000	140	268,660,000
ダイハツ	215,000	1,522	327,230,000
愛知機械	52,000	335	17,420,000
今仙電機製作所	17,000	1,098	18,666,000
本田技研	1,952,500	3,140	6,130,850,000
スズキ	483,700	1,955	945,633,500
富士重工業	731,000	632	461,992,000
ヤマハ発動機	376,900	1,195	450,395,500
ショーワ	49,200	662	32,570,400
小糸製作所	116,000	1,395	161,820,000
T B K	23,000	535	12,305,000
エクセディ	31,400	2,393	75,140,200
ミツバ	43,000	800	34,400,000
豊田合成	65,300	1,545	100,888,500
愛三工業	24,000	761	18,264,000
ヨ ロ ズ	13,900	1,766	24,547,400
エフ・シー・シー	37,800	1,905	72,009,000
新家工業	54,000	142	7,668,000
シマノ	87,600	4,655	407,778,000
タカタ	41,800	2,088	87,278,400
テイ・エス テック	48,900	1,563	76,430,700
小 野 建	20,000	736	14,720,000
はるやま商事	9,800	434	4,253,200
佐鳥電機	17,000	504	8,568,000
カップクリエイト	16,800	1,800	30,240,000
エコトレーディング	5,900	743	4,383,700
伯東	14,100	824	11,618,400
コンドーテック	16,800	531	8,920,800
中山福	13,700	635	8,699,500
ライトオン	17,300	600	10,380,000
ナガイレーベン	30,400	1,206	36,662,400
ジーンズメイト	7,800	215	1,677,000
三菱食品	21,000	2,115	44,415,000
良品計画	24,200	3,815	92,323,000
三城ホールディングス	28,300	602	17,036,600

松田産業	16,900	1,343	22,696,700
メディバルHD	245,900	972	239,014,800
アドヴァン	13,900	762	10,591,800
S P K	5,700	1,424	8,116,800
アズワン	15,000	1,779	26,685,000
スズデン	8,000	536	4,288,000
尾家産業	6,800	858	5,834,400
シモジマ	14,100	1,100	15,510,000
ドウシシャ	10,900	2,231	24,317,900
コナカ	26,900	653	17,565,700
高速	13,700	673	9,220,100
ハウス ローゼ	2,700	1,305	3,523,500
G - 7ホールディングス	6,000	419	2,514,000
イオン北海道	14,400	352	5,068,800
コジマ	30,500	502	15,311,000
コーナン商事	24,700	1,212	29,936,400
黒田電気	28,300	868	24,564,400
ネットワンシステムズ	516	197,300	101,806,800
エコス	8,400	485	4,074,000
ワタミ	27,100	1,732	46,937,200
マルシェ	6,300	727	4,580,100
ドン・キホーテ	60,900	2,807	170,946,300
丸文	18,200	393	7,152,600
メガネトップ	32,700	823	26,912,100
西松屋チェーン	49,900	641	31,985,900
ゼンショーホールディングス	86,900	997	86,639,300
ハピネット	12,300	727	8,942,100
幸楽苑	14,300	1,260	18,018,000
トーマンエレクトロニクス	10,400	1,155	12,012,000
ハークスレイ	5,700	514	2,929,800
サイゼリヤ	33,700	1,275	42,967,500
エクセル	10,500	816	8,568,000
マルカキカイ	7,600	766	5,821,600
アルゴグラフィックス	8,600	1,133	9,743,800
ガリバーインターナショナル	6,930	3,220	22,314,600
日本エム・ディ・エム	19,500	274	5,343,000
ポプラ	6,700	490	3,283,000
ユナイテッドアローズ	24,600	1,623	39,925,800
進和	13,700	954	13,069,800
エスケイジャパン	5,500	263	1,446,500
ダイトエレクトロン	10,400	432	4,492,800
ハイデイ日高	12,120	1,271	15,404,520
シークス	14,500	1,178	17,081,000
京都きもの友禅	15,400	963	14,830,200
コロワイド	76,000	607	46,132,000
田中商事	7,400	464	3,433,600
オーハシテクニカ	13,100	591	7,742,100
壱番屋	9,300	2,317	21,548,100

マクニカ	11,700	1,942	22,721,400
白銅	7,800	806	6,286,800
トップカルチャー	8,500	393	3,340,500
スギホールディングス	40,900	2,173	88,875,700
島津製作所	277,000	694	192,238,000
J M S	36,000	258	9,288,000
クボテック	52	23,650	1,229,800
モリテックス	5,300	341	1,807,300
長野計器	16,500	800	13,200,000
ブイ・テクノロジー	31	329,000	10,199,000
スター精密	37,300	785	29,280,500
東京計器	80,000	173	13,840,000
愛知時計	26,000	286	7,436,000
日本電産トーソク	11,300	1,031	11,650,300
東京精密	41,500	1,762	73,123,000
ニコン	403,200	2,141	863,251,200
トプコン	53,500	505	27,017,500
オリンパス	272,900	1,373	374,691,700
理研計器	19,000	613	11,647,000
大日本スクリーン	219,000	680	148,920,000
キヤノン電子	21,200	2,026	42,951,200
タムロン	19,800	2,324	46,015,200
HOYA	562,600	1,877	1,056,000,200
ノーリツ鋼機	21,000	427	8,967,000
エー・アンド・デイ	22,800	263	5,996,400
キヤノン	1,437,500	3,680	5,290,000,000
リコー	695,000	749	520,555,000
日本電産コパル	18,200	964	17,544,800
日本電産サンキョー	55,000	538	29,590,000
シチズンホールディングス	276,900	499	138,173,100
リズム時計	105,000	150	15,750,000
大研医器	3,100	811	2,514,100
パラマウントベッドHD	19,900	2,116	42,108,400
SHOBI	3,700	498	1,842,600
永大産業	31,000	406	12,586,000
SRIスポーツ	15,000	930	13,950,000
バンダイナムコHLDGS	247,900	1,136	281,614,400
共立印刷	27,200	271	7,371,200
フランスベッドHLDGS	156,000	164	25,584,000
パイロットコーポレーション	202	153,700	31,047,400
エイベックス・グループHD	43,300	997	43,170,100
トッパン・フォームズ	49,600	706	35,017,600
フジシールインターナショナル	25,900	1,515	39,238,500
タカラトミー	76,000	580	44,080,000
廣済堂	20,100	277	5,567,700
アーク	79,300	87	6,899,100
レック	7,300	1,280	9,344,000
タカノ	9,500	474	4,503,000

プロネクサス	26,300	415	10,914,500
ホクシン	17,600	169	2,974,400
ウッドワン	39,000	336	13,104,000
大建工業	95,000	283	26,885,000
きもと	19,700	548	10,795,600
凸版印刷	704,000	638	449,152,000
大日本印刷	705,000	826	582,330,000
図書印刷	38,000	169	6,422,000
共同印刷	79,000	231	18,249,000
日本写真印刷	38,900	1,162	45,201,800
光村印刷	3,000	287	861,000
藤森工業	17,500	1,287	22,522,500
宝印刷	13,700	603	8,261,100
前澤化成工業	17,400	862	14,998,800
アシックス	215,400	979	210,876,600
ツツミ	11,600	2,150	24,940,000
ジェイ エス ピー	15,800	1,283	20,271,400
ニチハ	26,900	947	25,474,300
ローランド	23,900	783	18,713,700
エフピコ	10,700	5,130	54,891,000
小松ウオール工業	8,900	847	7,538,300
ヤマハ	170,100	786	133,698,600
河合楽器	87,000	174	15,138,000
クリナップ	27,400	521	14,275,400
ビジョン	20,400	2,844	58,017,600
天馬	19,500	837	16,321,500
兼松日産農林	36,000	185	6,660,000
キングジム	19,600	634	12,426,400
リンテック	43,900	1,744	76,561,600
T A S A K I	48,000	58	2,784,000
信越ポリマー	47,700	387	18,459,900
東リ	64,000	175	11,200,000
イトーキ	49,100	339	16,644,900
任天堂	132,300	12,660	1,674,918,000
三菱鉛筆	19,100	1,400	26,740,000
タカラスタンダ - ド	107,000	611	65,377,000
コクヨ	120,300	594	71,458,200
ナカバヤシ	50,000	206	10,300,000
ニフコ	54,100	2,221	120,156,100
グローブライド	113,000	110	12,430,000
岡村製作所	81,000	584	47,304,000
日本バルカー	94,000	242	22,748,000
M U T O Hホールディングス	24,000	404	9,696,000
伊藤忠	1,822,200	924	1,683,712,800
丸紅	1,998,000	579	1,156,842,000
スクロール	29,800	335	9,983,000
高島	40,000	217	8,680,000
F & Aアクアホールディングス	17,700	780	13,806,000

三陽商会	118,000	218	25,724,000
長瀬産業	129,400	971	125,647,400
ナイガイ	69,000	59	4,071,000
蝶理	137,000	105	14,385,000
豊田通商	254,600	1,592	405,323,200
オンワ - ドホールディングス	149,000	648	96,552,000
三共生興	39,600	300	11,880,000
兼松	487,000	92	44,804,000
美津濃	115,000	436	50,140,000
ツカモトコーポレーション	41,000	191	7,831,000
ファミリーマート	70,100	3,140	220,114,000
ルック	40,000	236	9,440,000
三井物産	1,971,700	1,397	2,754,464,900
日本紙パルプ	119,000	290	34,510,000
東京エレクトロン	194,600	4,465	868,889,000
日立ハイテクノロジーズ	69,300	1,871	129,660,300
カメイ	30,000	1,003	30,090,000
東都水産	39,000	164	6,396,000
スターゼン	78,000	263	20,514,000
セイコーHD	134,000	188	25,192,000
山善	88,500	648	57,348,000
椿本興業	24,000	261	6,264,000
住友商事	1,348,100	1,199	1,616,371,900
日本ユニシス	54,900	551	30,249,900
内田洋行	53,000	291	15,423,000
三菱商事	1,663,500	2,008	3,340,308,000
第一実業	49,000	389	19,061,000
キヤノンマーケティングJPN	75,900	1,032	78,328,800
西華産業	86,000	243	20,898,000
佐藤商事	20,600	547	11,268,200
菱洋エレクトロ	25,800	908	23,426,400
東京産業	24,500	292	7,154,000
ユアサ商事	236,000	141	33,276,000
神鋼商事	59,000	205	12,095,000
阪和興業	229,000	383	87,707,000
カナデン	2,000	550	1,100,000
菱電商事	34,000	506	17,204,000
ニプロ	91,900	630	57,897,000
フルサト工業	13,600	760	10,336,000
岩谷産業	255,000	276	70,380,000
すてきナイスグループ	100,000	246	24,600,000
昭光通商	84,000	140	11,760,000
ニチモウ	34,000	222	7,548,000
極東貿易	28,000	194	5,432,000
イワキ	35,000	203	7,105,000
兼松エレクトロニクス	14,800	855	12,654,000
三愛石油	55,000	390	21,450,000
稲畑産業	61,700	531	32,762,700

G S Iクレオス	56,000	128	7,168,000
明和産業	18,500	297	5,494,500
ゴ-ルドウイン	55,000	454	24,970,000
ユニ・チャ-ム	133,800	4,120	551,256,000
デサント	61,000	416	25,376,000
ヤマトインタ-ナショナル	15,300	387	5,921,100
東邦ホールディングス	73,200	1,279	93,622,800
サンゲツ	40,500	2,132	86,346,000
ミツウロコグループ	37,100	533	19,774,300
シナネン	50,000	384	19,200,000
伊藤忠エネクス	50,700	478	24,234,600
サンリオ	57,600	3,405	196,128,000
サンワ テクノス	11,200	811	9,083,200
リョ-サン	37,200	1,689	62,830,800
新光商事	25,300	732	18,519,600
トーホ-	50,000	313	15,650,000
三信電気	32,800	808	26,502,400
東陽テクニカ	33,700	891	30,026,700
モスフード サービス	30,100	1,573	47,347,300
加賀電子	24,800	856	21,228,800
三益半導体	20,400	796	16,238,400
ソーダニツカ	2,000	370	740,000
立花エレテック	14,000	729	10,206,000
木曽路	26,200	1,556	40,767,200
千 趣 会	41,200	541	22,289,200
タカキュー	18,000	175	3,150,000
ケーヨー	43,000	526	22,618,000
アデランス	29,200	950	27,740,000
上新電機	49,000	856	41,944,000
日本瓦斯	21,900	1,267	27,747,300
ベスト電器	71,500	214	15,301,000
マルエツ	47,000	312	14,664,000
ロイヤルホールディングス	38,600	930	35,898,000
東 天 紅	17,000	173	2,941,000
いなげや	25,800	943	24,329,400
島 忠	51,600	1,803	93,034,800
チヨダ	30,000	1,437	43,110,000
ライフコーポレーション	14,400	1,405	20,232,000
カ ス ミ	47,100	525	24,727,500
リンガーハット	20,800	1,073	22,318,400
さ が 美	18,000	134	2,412,000
MR MAX	23,200	352	8,166,400
テンアライド	18,200	274	4,986,800
A O K Iホールディングス	20,200	1,310	26,462,000
オークワ	33,000	1,123	37,059,000
コメリ	31,200	2,357	73,538,400
青山商事	62,900	1,467	92,274,300
しまむら	26,500	8,670	229,755,000

[前](#) [次](#)

平成24年2月27日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
C F Sコーポレーション	15,200	388	5,897,600	
高島屋	309,000	597	184,473,000	
松屋	46,000	511	23,506,000	
エイチ・ツー・オーリテイリング	119,000	566	67,354,000	
丸栄	39,000	112	4,368,000	
ニッセンHD	45,500	405	18,427,500	
パルコ	41,400	855	35,397,000	
丸井グループ	298,300	636	189,718,800	
クレディセゾン	187,200	1,526	285,667,200	
原信ナルスHLDGS	12,800	1,378	17,638,400	
井筒屋	123,000	57	7,011,000	
ダイエー	141,350	290	40,991,500	
イズミヤ	80,000	429	34,320,000	
イオン	804,900	1,032	830,656,800	
ユニー	171,300	804	137,725,200	
イズミ	68,400	1,368	93,571,200	
東武ストア	31,000	281	8,711,000	
平和堂	42,000	1,017	42,714,000	
フジ	25,500	1,863	47,506,500	
ヤオコー	10,100	2,600	26,260,000	
ゼビオ	27,500	1,913	52,607,500	
ケーズホールディングス	56,900	2,762	157,157,800	
P a l t a c	23,900	1,096	26,194,400	
O L Y M P I C	15,400	859	13,228,600	
日産東京販売HD	34,000	206	7,004,000	
新生銀行	1,779,000	105	186,795,000	
あおぞら銀行	712,000	237	168,744,000	
三菱UFJフィナンシャルG	17,290,500	420	7,262,010,000	
りそなホールディングス	1,987,200	391	776,995,200	
三井住友トラストHD	4,477,000	286	1,280,422,000	
三井住友フィナンシャルG	1,727,300	2,756	4,760,438,800	
第四銀行	298,000	278	82,844,000	
北越銀行	236,000	176	41,536,000	
西日本シティ銀行	801,000	236	189,036,000	
札幌北洋ホール	343,900	298	102,482,200	
千葉銀行	901,000	507	456,807,000	
横浜銀行	1,466,000	389	570,274,000	
常陽銀行	880,000	366	322,080,000	
群馬銀行	521,000	437	227,677,000	
武蔵野銀行	36,800	2,775	102,120,000	
千葉興業銀行	43,400	462	20,050,800	
筑波銀行	94,900	293	27,805,700	
東京都民銀行	43,300	997	43,170,100	



七十七銀行	358,000	366	131,028,000
青森銀行	172,000	257	44,204,000
秋田銀行	158,000	261	41,238,000
山形銀行	140,000	391	54,740,000
岩手銀行	15,400	3,705	57,057,000
東邦銀行	193,000	285	55,005,000
東北銀行	125,000	157	19,625,000
みちのく銀行	115,000	170	19,550,000
ふくおかフィナンシャルG	926,000	346	320,396,000
静岡銀行	689,000	813	560,157,000
十六銀行	287,000	282	80,934,000
スルガ銀行	222,000	749	166,278,000
八十二銀行	422,000	477	201,294,000
山梨中央銀行	139,000	386	53,654,000
大垣共立銀行	306,000	288	88,128,000
福井銀行	197,000	255	50,235,000
北國銀行	273,000	311	84,903,000
清水銀行	7,800	3,375	26,325,000
滋賀銀行	215,000	504	108,360,000
南都銀行	213,000	399	84,987,000
百五銀行	206,000	360	74,160,000
京都銀行	408,000	696	283,968,000
三重銀行	95,000	198	18,810,000
ほくほくフィナンシャルG	1,600,000	161	257,600,000
広島銀行	673,000	371	249,683,000
山陰合同銀行	136,000	631	85,816,000
中国銀行	187,000	1,070	200,090,000
鳥取銀行	73,000	165	12,045,000
伊予銀行	244,000	739	180,316,000
百十四銀行	251,000	390	97,890,000
四国銀行	165,000	313	51,645,000
阿波銀行	202,000	524	105,848,000
鹿児島銀行	148,000	528	78,144,000
大分銀行	148,000	245	36,260,000
宮崎銀行	152,000	220	33,440,000
肥後銀行	177,000	471	83,367,000
佐賀銀行	138,000	210	28,980,000
十八銀行	146,000	257	37,522,000
沖縄銀行	17,400	3,395	59,073,000
琉球銀行	48,100	996	47,907,600
八千代銀行	11,900	2,098	24,966,200
セブン銀行	642,900	174	111,864,600
みずほフィナンシャルG	29,344,900	136	3,990,906,400
紀陽ホールディングス	911,000	129	117,519,000
山口フィナンシャルG	228,000	747	170,316,000
フィデック	141	10,700	1,508,700
芙蓉総合リース	22,200	2,922	64,868,400
興銀リース	32,300	1,956	63,178,800

東京センチュリーリース	61,900	1,602	99,163,800
S B Iホールディングス	24,241	7,940	192,473,540
日本証券金融	95,400	495	47,223,000
大阪証券金融	28,500	192	5,472,000
アイフル	211,800	147	31,134,600
日本アジア投資	170,000	75	12,750,000
ポケットカード	24,200	285	6,897,000
長野銀行	77,000	170	13,090,000
名古屋銀行	207,000	288	59,616,000
愛知銀行	8,300	4,910	40,753,000
第三銀行	130,000	176	22,880,000
中京銀行	95,000	227	21,565,000
東日本銀行	110,000	187	20,570,000
大光銀行	82,000	269	22,058,000
愛媛銀行	144,000	247	35,568,000
トマト銀行	90,000	159	14,310,000
みなと銀行	207,000	167	34,569,000
京葉銀行	187,000	391	73,117,000
関西アーバン銀行	318,000	131	41,658,000
栃木銀行	114,000	303	34,542,000
北日本銀行	7,200	2,084	15,004,800
東和銀行	228,000	95	21,660,000
福島銀行	265,000	76	20,140,000
大東銀行	148,000	76	11,248,000
リコーリース	16,300	1,994	32,502,200
イオン クレジットサービス	102,600	1,159	118,913,400
アコム	46,440	1,561	72,492,840
ジャックス	141,000	279	39,339,000
オリコ	338,000	90	30,420,000
日立キャピタル	45,900	1,236	56,732,400
オリックス	118,830	7,740	919,744,200
三菱UFJリース	58,290	3,535	206,055,150
ジャフコ	28,200	1,837	51,803,400
トモニホールディングス	175,800	386	67,858,800
大和証券G本社	2,262,000	339	766,818,000
野村ホールディングス	4,943,800	378	1,868,756,400
岡三証券グループ	195,000	338	65,910,000
丸三証券	77,200	375	28,950,000
東洋証券	87,000	166	14,442,000
東海東京HD	262,000	312	81,744,000
光世証券	57,000	91	5,187,000
水戸証券	69,000	158	10,902,000
いちよし証券	51,400	553	28,424,200
松井証券	135,900	508	69,037,200
N K S Jホールディングス	477,600	1,858	887,380,800
だいこう証券ビジ	14,200	347	4,927,400
マネックスG	1,833	17,690	32,425,770
カブドットコム証券	93,200	310	28,892,000

極東証券	30,800	695	21,406,000
岩井コスモホールディング	21,800	380	8,284,000
フィデアホール	131,000	213	27,903,000
池田泉州HD	939,300	122	114,594,600
MS & AD	682,600	1,701	1,161,102,600
SONY FH	218,900	1,453	318,061,700
小林洋行	5,200	207	1,076,400
第一生命	12,215	106,100	1,296,011,500
東京海上HD	867,100	2,221	1,925,829,100
アサックス	32	91,900	2,940,800
NECキャピタルソリューション	8,000	1,307	10,456,000
T & Dホールディングス	832,500	930	774,225,000
三井不動産	1,013,000	1,548	1,568,124,000
三菱地所	1,599,000	1,459	2,332,941,000
平和不動産	216,500	214	46,331,000
東京建物	436,000	323	140,828,000
ダイビル	67,200	587	39,446,400
サンケイビル	40,900	739	30,225,100
東急不動産	460,000	397	182,620,000
京阪神ビルディング	27,600	400	11,040,000
住友不動産	547,000	1,884	1,030,548,000
東宝不動産	24,400	539	13,151,600
太平洋興発	79,000	86	6,794,000
大京	352,000	207	72,864,000
テオーシー	89,000	425	37,825,000
東京楽天地	27,000	296	7,992,000
レオパレス21	176,700	191	33,749,700
フジ住宅	29,400	426	12,524,400
空港施設	24,200	397	9,607,400
明和地所	11,600	430	4,988,000
住友不動産販売	8,270	3,690	30,516,300
ゴールドクレスト	20,600	1,594	32,836,400
東栄住宅	15,600	849	13,244,400
リロ・ホールディング	7,400	2,244	16,605,600
日本エスリード	9,100	809	7,361,900
東急リバブル	20,800	762	15,849,600
飯田産業	21,600	704	15,206,400
日神不動産	13,600	539	7,330,400
アーネストワン	37,900	947	35,891,300
タカラレーベン	26,400	569	15,021,600
サンヨーハウジ 名古屋	101	77,200	7,797,200
イオンモール	104,100	1,839	191,439,900
フージャースコーポレーション	353	55,700	19,662,100
タクトホーム	122	73,900	9,015,800
ランド	24,700	15	370,500
トーセイ	223	28,080	6,261,840
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,418	64,800	91,886,400
サンフロンティア不動産	191	12,710	2,427,610

ランドビジネス	160	16,500	2,640,000
東武鉄道	1,315,000	409	537,835,000
相鉄ホールディングス	371,000	256	94,976,000
東京急行	1,362,000	388	528,456,000
京浜急行	595,000	709	421,855,000
小田急電鉄	742,000	765	567,630,000
京王電鉄	647,000	572	370,084,000
京成電鉄	372,000	586	217,992,000
富士急行	64,000	491	31,424,000
新京成電鉄	23,000	353	8,119,000
東日本旅客鉄道	402,400	5,180	2,084,432,000
西日本旅客鉄道	201,200	3,275	658,930,000
東海旅客鉄道	2,008	664,000	1,333,312,000
西日本鉄道	301,000	383	115,283,000
ハマキョウレックス	6,600	2,400	15,840,000
サカイ引越センター	4,200	1,735	7,287,000
近畿日本鉄道	2,091,000	305	637,755,000
阪急阪神HLDGS	1,553,000	343	532,679,000
南海電鉄	483,000	359	173,397,000
京阪電鉄	519,000	403	209,157,000
名糖運輸	10,100	642	6,484,200
名古屋鉄道	808,000	224	180,992,000
日本通運	916,000	314	287,624,000
ヤマトホールディングス	470,900	1,272	598,984,800
山 九	281,000	325	91,325,000
日 新	88,000	217	19,096,000
丸 運	12,500	214	2,675,000
丸全昭和運輸	78,000	268	20,904,000
センコー	93,000	319	29,667,000
トナミホールディングス	48,000	199	9,552,000
日本梱包運輸	69,400	915	63,501,000
日石輸送	28,000	208	5,824,000
福山通運	140,000	447	62,580,000
セイノーホールディングス	179,000	591	105,789,000
神奈川中央交通	25,000	435	10,875,000
日立物流	48,200	1,329	64,057,800
日本郵船	1,832,000	248	454,336,000
商船三井	1,213,000	378	458,514,000
川崎汽船	715,000	181	129,415,000
NSユニテッド海運	99,000	144	14,256,000
乾 汽 船	25,400	340	8,636,000
明治海運	20,900	412	8,610,800
飯野海運	111,900	397	44,424,300
共栄タンカー	20,000	228	4,560,000
第一中央汽船	151,000	134	20,234,000
全日本空輸	3,085,000	249	768,165,000
パスコ	22,000	300	6,600,000
国際航業HLDGS	14,000	200	2,800,000

三菱倉庫	164,000	939	153,996,000
三井倉庫	108,000	316	34,128,000
住友倉庫	169,000	398	67,262,000
渋沢倉庫	55,000	248	13,640,000
ヤマタネ	115,000	129	14,835,000
東陽倉庫	38,000	190	7,220,000
日本トランスシティ	49,000	291	14,259,000
ケイヒン	43,000	123	5,289,000
安田倉庫	18,600	529	9,839,400
東洋埠頭	67,000	158	10,586,000
宇徳	15,800	297	4,692,600
上組	256,000	690	176,640,000
サンリツ	1,700	554	941,800
キムラユニティー	4,800	730	3,504,000
キューソー流通システム	7,900	867	6,849,300
郵船ロジスティクス	18,200	1,203	21,894,600
近鉄エクスプレス	20,700	2,602	53,861,400
東海運	15,100	261	3,941,100
東京放送HD	136,900	1,149	157,298,100
日本テレビ放送網	20,050	12,130	243,206,500
テレビ朝日	579	135,100	78,222,900
スカパーJ S A T H D	1,739	38,600	67,125,400
テレビ東京HD	14,600	1,104	16,118,400
アイ・ティー・シーネットワーク	20,400	538	10,975,200
イー・アクセス	1,736	21,320	37,011,520
NECモバイルリング	8,400	2,813	23,629,200
日本電信電話	1,051,700	3,750	3,943,875,000
KDDI	3,545	507,000	1,797,315,000
光通信	20,900	2,292	47,902,800
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,819	137,800	2,593,258,200
GMOインターネット	67,800	393	26,645,400
学研ホールディングス	69,000	173	11,937,000
ゼンリン	33,100	816	27,009,600
昭文社	13,000	639	8,307,000
角川グループHLDGS	21,600	2,572	55,555,200
インプレスホールディングス	19,300	154	2,972,200
東京電力	1,847,500	238	439,705,000
中部電力	762,600	1,486	1,133,223,600
関西電力	944,300	1,325	1,251,197,500
中国電力	319,900	1,504	481,129,600
北陸電力	226,700	1,537	348,437,900
東北電力	578,200	920	531,944,000
四国電力	213,000	2,240	477,120,000
九州電力	511,100	1,184	605,142,400
北海道電力	216,600	1,189	257,537,400
沖縄電力	13,800	3,380	46,644,000
電源開発	143,500	2,090	299,915,000
東京瓦斯	2,792,000	361	1,007,912,000

大阪瓦斯	2,246,000	307	689,522,000
東邦瓦斯	589,000	473	278,597,000
北海道瓦斯	42,000	277	11,634,000
西部瓦斯	262,000	223	58,426,000
静岡瓦斯	60,500	521	31,520,500
アイネット	10,400	485	5,044,000
松竹	151,000	769	116,119,000
東宝	163,500	1,411	230,698,500
エイチ・アイ・エス	24,700	2,124	52,462,800
東映	96,000	396	38,016,000
葵プロモーション	7,500	497	3,727,500
NTTデータ	1,410	266,700	376,047,000
共立メンテナンス	12,100	1,624	19,650,400
イチネンホールディングス	25,500	444	11,322,000
建設技術研究所	13,700	527	7,219,900
アインファーマシーズ	12,700	3,765	47,815,500
燦ホールディングス	5,800	1,613	9,355,400
スバル興業	3,000	273	819,000
東京テアトル	95,000	124	11,780,000
よみうりランド	49,000	261	12,789,000
東京都競馬	190,000	125	23,750,000
常磐興産	76,000	100	7,600,000
カナモト	31,000	920	28,520,000
東京ドーム	194,000	226	43,844,000
D T S	23,600	1,059	24,992,400
スクウェア・エニックス・HD	74,700	1,589	118,698,300
シーイーシー	13,900	392	5,448,800
カプコン	43,800	1,787	78,270,600
東海観光	101,000	24	2,424,000
日本空港ビルデング	72,900	1,134	82,668,600
トランス・コスモス	31,500	1,042	32,823,000
乃村工藝社	48,000	284	13,632,000
ジャステック	15,200	495	7,524,000
S C S K	46,400	1,240	57,536,000
藤田観光	62,000	285	17,670,000
近畿日本ツーリスト	77,000	109	8,393,000
日本管財	9,100	1,504	13,686,400
トーカイ	9,900	1,633	16,166,700
白洋舎	5,000	217	1,085,000
セコム	234,700	3,775	885,992,500
日本システムウエア	8,000	332	2,656,000
セントラル警備保障	11,300	790	8,927,000
アイネス	27,600	628	17,332,800
丹青社	23,000	232	5,336,000
メイテック	38,000	1,674	63,612,000
T K C	19,200	1,624	31,180,800
アサツー ディ・ケイ	42,300	2,255	95,386,500
富士ソフト	30,000	1,578	47,340,000

応用地質	25,600	1,012	25,907,200
船井総合研究所	26,000	540	14,040,000
N S D	44,100	696	30,693,600
進学会	12,700	323	4,102,100
丸紅建材リース	23,000	188	4,324,000
コナミ	103,100	2,190	225,789,000
ベネッセホールディングス	74,900	3,685	276,006,500
イオンディライト	27,300	1,512	41,277,600
ナック	6,400	1,503	9,619,200
福井コンピュータ	1,500	434	651,000
ニチイ学館	47,500	950	45,125,000
ダイセキ	38,900	1,449	56,366,100
日鐵商事	51,000	228	11,628,000
元気寿司	7,300	1,036	7,562,800
トラスコ中山	28,800	1,665	47,952,000
ヤマダ電機	111,040	5,200	577,408,000
オートバックスセブン	27,100	3,920	106,232,000
アークランドサカモト	14,900	1,369	20,398,100
ニトリホールディングス	45,200	6,850	309,620,000
グルメ杵屋	15,000	470	7,050,000
愛眼	18,600	368	6,844,800
吉野家ホールディングス	620	107,200	66,464,000
加藤産業	33,100	1,563	51,735,300
イノテック	13,900	571	7,936,900
イエローハット	21,500	1,197	25,735,500
富士エレクトロニクス	11,700	1,211	14,168,700
松屋フーズ	11,100	1,657	18,392,700
J B C Cホールディングス	18,300	574	10,504,200
J Kホールディングス	19,400	404	7,837,600
サガミチェーン	27,000	569	15,363,000
日伝	9,500	2,277	21,631,500
北沢産業	11,000	185	2,035,000
杉本商事	12,700	764	9,702,800
因幡電機産業	27,100	2,419	65,554,900
住金物産	108,000	225	24,300,000
プレナス	25,600	1,300	33,280,000
ミニストップ	17,000	1,451	24,667,000
アークス	31,400	1,470	46,158,000
バロー	45,500	1,202	54,691,000
ミスミグループ本社	84,400	1,988	167,787,200
江守商事	4,800	959	4,603,200
アルテック	11,400	242	2,758,800
ベルク	11,300	1,210	13,673,000
大庄	10,900	1,023	11,150,700
タキヒヨー	35,000	456	15,960,000
ファーストリテイリング	53,400	16,380	874,692,000
ソフトバンク	1,034,700	2,359	2,440,857,300
スズケン	87,800	2,400	210,720,000

サンドラッグ	43,400	2,306	100,080,400	
ジェコス	16,400	392	6,428,800	
ヤマザワ	6,100	1,433	8,741,300	
やまや	3,900	1,101	4,293,900	
ベルーナ	28,550	622	17,758,100	
合計	356,425,405		263,710,678,910	

\*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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		2,901,832,238	5,376,719,297
コール・ローン		6,500,468,536	148,359,003
株式		273,387,520,090	276,129,010,449
投資信託受益証券		894,665,152	922,793,182
投資証券		3,563,818,122	4,527,419,288
派生商品評価勘定		98,011,705	299,871,201
未収入金		269,195,575	7,808,291,979
未収配当金		569,509,457	562,878,726
差入委託証拠金		1,698,708,601	1,104,917,725
流動資産合計		289,883,729,476	296,880,260,850
資産合計		289,883,729,476	296,880,260,850
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		10,805,080	120,174,188
未払金		283,617,590	366,560,671
未払解約金		6,570,960,000	7,293,105,000
流動負債合計		6,865,382,670	7,779,839,859
負債合計		6,865,382,670	7,779,839,859
純資産の部			
元本等			
元本		211,463,838,388	214,623,769,712
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		71,554,508,418	74,476,651,279
元本等合計		283,018,346,806	289,100,420,991
純資産合計		283,018,346,806	289,100,420,991
負債純資産合計		289,883,729,476	296,880,260,850

## 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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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、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。 (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。	(1)先物取引 同左  (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。	(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24年2月16日から平成25年2月15日までとなっております。

## (追加情報)

自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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23年2月25日現在	平成24年2月27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	230,889,417,193円	211,463,838,388円
同期中追加設定元本額	48,969,811,098円	59,510,990,961円
同期中解約元本額	68,395,389,903円	56,351,059,637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	889,688,585円	1,134,231,187円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	28,763,322,356円	32,721,881,911円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	175,686,010円	205,101,084円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	990,180,130円	1,129,874,746円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,235,372,366円	1,349,118,541円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	203,263,880円	207,457,346円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	520,238,727円	550,872,856円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	367,609,658円	389,229,605円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	82,584,334円	72,987,652円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	760,893,311円	814,782,811円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	104,084,917円	157,970,845円
D I A M外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	615,624,011円	593,083,701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）	6,108,729,541円	5,743,343,596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）	17,000,035,639円	16,600,882,451円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	94,414,283円	89,661,472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）	8,894,435,021円	8,716,736,174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）	1,535,076,284円	1,458,824,372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）	175,499,713円	171,981,703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）	1,013,850,723円	998,698,445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）	92,663,358円	90,435,386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）	168,357,517円	162,519,028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）	16,797,514,456円	16,602,062,653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）	8,427,027,772円	8,260,069,373円
D I A Mバランスファンド25 VA（適格機関投資家限定）	2,877,775,871円	2,828,884,367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）	2,565,365,866円	2,442,581,825円
D I A Mバランスファンド50 VA（適格機関投資家限定）	6,949,167,444円	6,503,464,849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）	5,295,294,010円	5,237,855,986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）	6,649,644,859円	6,802,695,670円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30VA（適格 機関投資家限定）	4,457,852,898円	4,388,100,803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）	3,980,367,338円	4,055,212,451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）	58,961,297円	62,370,773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）	264,757,976円	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）	18,784,057,814円	19,026,329,383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）	3,269,823,724円	3,198,492,340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）	132,926,695円	131,922,457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）	22,798,120,447円	22,900,524,360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）	2,325,073,483円	2,236,670,322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）	4,159,672,173円	4,213,651,841円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	13,790,642,903円	13,994,931,782円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	166,471円	176,886円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	262,353円	271,714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）	18,087,514,884円	18,377,573,752円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	77,713円	83,044円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	159,577円	168,169円
（合計）	211,463,838,388円	214,623,769,712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	211,463,838,388口	214,623,769,712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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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。	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	5,952,505,012	3,604,757,318
投資信託受益証券	16,035,360	28,381,711
投資証券	57,674,351	17,184,634
合計	6,026,214,723	3,615,954,395

(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)

(株式関連)

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

平成24年2月27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	319,973,049	-	325,599,435	5,626,386
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	446,207,450	-	457,257,715	11,050,265
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,380,130,563	-	1,450,366,313	70,235,750
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	751,618,338	-	786,424,529	34,806,191
	米ドル S&P 500 FUTURE	4,061,199,626	-	4,238,966,630	177,767,004
	合 計	6,959,129,026	-	7,258,614,622	299,485,596

## (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

平成24年2月27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				
	イスラエル・シケル	58,014,900	-	57,915,000	99,900
	オーストラリアドル	257,631,000	-	260,220,000	2,589,000
	カナダドル	328,822,050	-	333,043,000	4,220,950
	シンガポール・ドル	46,028,880	-	46,526,400	497,520
	スイスフラン	193,562,200	-	198,009,400	4,447,200
	スウェーデンクローネ	50,447,409	-	51,749,700	1,302,291
	デンマーククローネ	33,383,640	-	34,127,200	743,560
	ノルウェークローネ	23,792,490	-	24,365,300	572,810
	ユーロ	247,818,290	-	251,620,000	3,801,710
	英ポンド	819,208,000	-	838,825,000	19,617,000
	香港ドル	100,409,708	-	101,970,400	1,560,692
	米ドル	5,145,768,250	-	5,226,304,000	80,535,750
合 計	7,304,886,817	-	7,424,675,400	119,788,583	

## (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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3384円 (13,384円)	1.3470円 (13,470円)

[前](#) [次](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

平成24年2月27日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	EVEREST RE GROUP LTD	8,102	88.940	720,591.880	
	PARTNERRE LTD	7,570	64.620	489,173.400	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	12,784	31.750	405,892.000	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,493	73.030	620,243.790	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,239	37.190	789,878.410	
	BUNGE LTD	19,670	67.910	1,335,789.700	
	INVESCO LTD	65,700	24.880	1,634,616.000	
	ULTRA PETROLEUM CORP	22,514	23.840	536,733.760	
	ACE LTD	52,602	73.130	3,846,784.260	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	73,611	51.150	3,765,202.650	
	WEATHERFORD INTL LTD	113,841	16.500	1,878,376.500	
	NOBLE CORP	40,324	38.940	1,570,216.560	
	GARMIN LTD	20,043	48.050	963,066.150	
	TE CONNECTIVITY LTD	65,610	35.970	2,359,991.700	
	SCHLUMBERGER LTD	207,391	79.850	16,560,171.350	
	SEAGATE TECHNOLOGY	62,318	27.490	1,713,121.820	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	22,783	60.170	1,370,853.110	
	XL GROUP PLC	53,089	20.080	1,066,027.120	
	INGERSOLL-RAND PLC	50,200	40.480	2,032,096.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	97,895	59.650	5,839,436.750	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	25,010	35.270	882,102.700	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	27,146	16.330	443,294.180	
	COVIDIEN PLC	75,986	52.880	4,018,139.680	
	HERBALIFE LTD	16,408	66.450	1,090,311.600	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,377	28.490	637,520.730	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	43,628	44.150	1,926,176.200	
	NIELSEN HOLDINGS NV	16,327	27.900	455,523.300	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	69,475	29.970	2,082,165.750	
	FLEXTRONICS INTL LTD	110,408	7.170	791,625.360	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	34,354	36.320	1,247,737.280	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	1,027,000	0.795	816,465.000	
	AMAZON.COM INC	57,151	179.130	10,237,458.630	
	ABBOTT LABORATORIES	242,805	56.700	13,767,043.500	
	AES CORP	99,276	13.800	1,370,008.800	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,815	48.140	713,194.100	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	182,786	197.760	36,147,759.360	
	ADVANCED MICRO DEVICES	93,282	7.460	695,883.720	
	ADOBE SYSTEMS INC	72,416	33.410	2,419,418.560	
	AGCO CORP	14,077	52.670	741,435.590	
	AIRGAS INC	12,208	81.850	999,224.800	

	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	34,175	91.940	3,142,049.500	
	ENERGEN CORP	12,554	54.910	689,340.140	
	ALLERGAN INC	47,692	87.420	4,169,234.640	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	137,673	50.990	7,019,946.270	
	RALPH LAUREN CORP	9,673	173.320	1,676,524.360	
	ALLSTATE CORP	76,609	31.360	2,402,458.240	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	110,304	59.270	6,537,718.080	
	ALTERA CORPORATION	50,199	38.880	1,951,737.120	
	ALCOA INC	165,402	10.430	1,725,142.860	
	AMGEN INC	122,854	67.730	8,320,901.420	
	HESS CORP	47,762	67.000	3,200,054.000	
	BEAM INC	19,343	55.600	1,075,470.800	
	AMERICAN EXPRESS CO	161,215	53.330	8,597,595.950	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	75,772	37.730	2,858,877.560	
	AFLAC INC	73,710	46.900	3,456,999.000	
	AMERICAN INTL GROUP	67,479	28.410	1,917,078.390	
	ANALOG DEVICES	48,702	38.850	1,892,072.700	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	76,297	87.300	6,660,728.100	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	27,690	84.630	2,343,404.700	
	NABORS INDUSTRIES LTD	49,134	22.310	1,096,179.540	
	ARCH COAL INC	33,405	14.290	477,357.450	
	TIME WARNER	154,277	37.690	5,814,700.130	
	VALERO ENERGY CORP	88,182	24.390	2,150,758.980	
	APOLLO GROUP INC	16,586	52.140	864,794.040	
	APACHE CORP	58,499	111.570	6,526,733.430	
	APPLE INC	143,670	522.410	75,054,644.700	
	APPLIED MATERIALS INC	206,845	12.630	2,612,452.350	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	99,776	31.960	3,188,840.960	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	18,364	47.510	872,473.640	
	AMEREN CORP	39,448	32.240	1,271,803.520	
	ARROW ELECTRONICS INC	17,437	40.640	708,639.680	
	AUTOLIV INC	14,963	68.210	1,020,626.230	
	AUTODESK INC	38,885	37.620	1,462,853.700	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	77,786	53.820	4,186,442.520	
	AUTOZONE INC	3,428	359.800	1,233,394.400	
	AVERY DENNISON CORP	15,202	30.800	468,221.600	
	AVNET INC	22,835	36.270	828,225.450	
	AVON PRODUCTS INC	61,411	18.920	1,161,896.120	
	BMC SOFTWARE INC	28,920	39.150	1,132,218.000	
	BAKER HUGHES INC	69,228	51.960	3,597,086.880	
	BALL CORP	20,878	39.780	830,526.840	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	141,215	80.040	11,302,848.600	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	31,946	36.490	1,165,709.540	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	181,697	21.670	3,937,373.990	
	CR BARD INC	14,153	94.070	1,331,372.710	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	85,958	57.640	4,954,619.120	
	BED BATH & BEYOND INC	38,406	60.350	2,317,802.100	
	BECTON DICKINSON & CO	34,887	77.280	2,696,067.360	

	AMETEK INC	25,735	48.250	1,241,713.750
	NII HOLDINGS INC	31,218	20.250	632,164.500
	VERIZON COMM INC	440,447	38.140	16,798,648.580
	WR BERKLEY CORP	18,150	36.250	657,937.500
	BEST BUY CO INC	47,734	24.990	1,192,872.660
	YUM! BRANDS INC	69,520	65.540	4,556,340.800
	FIRSTENERGY CORP	67,136	44.070	2,958,683.520
	SLM CORP	92,921	16.190	1,504,390.990
	H&R BLOCK INC	42,326	16.380	693,299.880
	BOEING CO	107,106	76.060	8,146,482.360
	ROBERT HALF INTL INC	24,240	28.870	699,808.800
	BORGWARNER INC	16,519	82.430	1,361,661.170
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	208,603	6.250	1,303,768.750
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	26,111	67.210	1,754,920.310
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	264,005	32.600	8,606,563.000
	ONEOK INC	15,305	83.870	1,283,630.350
	SEMPRA ENERGY	35,687	58.040	2,071,273.480
	FEDEX CORP	45,491	90.240	4,105,107.840
	VERISIGN INC	21,938	37.640	825,746.320
	AMPHENOL CORP	24,477	56.300	1,378,055.100
	BROWN-FORMAN CORP	13,755	81.100	1,115,530.500
	QUANTA SERVICES INC	33,320	21.070	702,052.400
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,732	23.580	606,760.560
	SIRIUS XM RADIO INC	614,899	2.200	1,352,777.800
	CSX CORP	173,731	21.660	3,763,013.460
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	37,409	15.620	584,328.580
	CABOT OIL & GAS CORP	33,398	35.690	1,191,974.620
	CAMPBELL SOUP CO	30,602	33.710	1,031,593.420
	WHITING PETROLEUM CORP	17,265	62.470	1,078,544.550
	CONSTELLATION BRANDS INC	21,923	21.570	472,879.110
	CARDINAL HEALTH INC	55,062	42.050	2,315,357.100
	CATERPILLAR INC	98,214	116.000	11,392,824.000
	CELGENE CORP	67,991	74.890	5,091,845.990
	CITRIX SYSTEMS INC	30,333	75.160	2,279,828.280
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	101,910	25.450	2,593,609.500
	CENTURYLINK INC	92,807	39.920	3,704,855.440
	CERNER CORP	20,155	73.760	1,486,632.800
	JPMORGAN CHASE & CO	584,698	38.280	22,382,239.440
	CHUBB CORP	44,763	68.600	3,070,741.800
	CHURCH & DWIGHT CO INC	23,516	47.860	1,125,475.760
	CIGNA CORP	38,955	45.090	1,756,480.950
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,804	35.760	851,231.040
	CINTAS CORP	13,173	38.800	511,112.400
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	164,569	4.640	763,600.160
	CISCO SYSTEMS INC	826,960	20.140	16,654,974.400
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	21,907	67.860	1,486,609.020
	CLOROX COMPANY	21,099	67.790	1,430,301.210
	COCA-COLA CO/THE	317,816	69.000	21,929,304.000

	COCA-COLA ENTERPRISES INC	49,318	28.710	1,415,919.780	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	74,150	93.300	6,918,195.000	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	42,730	34.730	1,484,012.900	
	AON CORP	46,043	47.530	2,188,423.790	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	110,849	28.310	3,138,135.190	
	COMERICA INC	31,637	29.320	927,596.840	
	NRG ENERGY, INC.	31,248	17.850	557,776.800	
	COMCAST CORP-CL A	320,840	29.190	9,365,319.600	
	CA INC	53,086	26.930	1,429,605.980	
	COMPUTER SCIENCES CORP	23,064	32.090	740,123.760	
	CONAGRA FOODS INC	66,889	26.840	1,795,300.760	
	CONSOLIDATED EDISON INC	47,195	58.840	2,776,953.800	
	SARA LEE CORP	90,891	20.270	1,842,360.570	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	38,217	56.850	2,172,636.450	
	MOLSON COORS BREWING CO	24,801	43.920	1,089,259.920	
	CORNING INC	249,781	13.750	3,434,488.750	
	DIRECTV	107,801	45.610	4,916,803.610	
	COVANCE INC	10,195	47.840	487,728.800	
	CREE INC	21,128	29.350	620,106.800	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	18,825	32.420	610,306.500	
	SEALED AIR CORP	30,348	19.830	601,800.840	
	BROADCOM CORP-CL A	76,142	36.750	2,798,218.500	
	CUMMINS INC	29,309	121.780	3,569,250.020	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	14,299	70.280	1,004,933.720	
	DR HORTON INC	39,483	13.980	551,972.340	
	DANAHER CORP	91,324	53.320	4,869,395.680	
	MOODY'S CORP	30,243	38.880	1,175,847.840	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	48,164	72.180	3,476,477.520	
	TARGET CORP	100,689	55.220	5,560,046.580	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	9,386	67.190	630,645.340	
	DEERE & CO	62,186	83.270	5,178,228.220	
	DELL INC	254,732	17.430	4,439,978.760	
	MORGAN STANLEY	222,531	18.490	4,114,598.190	
	REPUBLIC SERVICES INC	53,213	29.840	1,587,875.920	
	THE WALT DISNEY CO	262,139	41.310	10,828,962.090	
	DOLLAR TREE INC	18,954	87.820	1,664,540.280	
	DOVER CORP	27,697	65.670	1,818,861.990	
	DOW CHEMICAL	174,047	33.820	5,886,269.540	
	OMNICOM GROUP	42,885	48.610	2,084,639.850	
	DTE ENERGY CO	28,132	54.850	1,543,040.200	
	DUKE ENERGY CORP	213,159	21.100	4,497,654.900	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	42,768	52.550	2,247,458.400	
	FLOWERVE CORP	8,844	119.290	1,055,000.760	
	DARDEN RESTAURANTS INC	21,227	49.190	1,044,156.130	
	EBAY INC	178,160	36.360	6,477,897.600	
	EMC CORP/MASS	310,773	27.520	8,552,472.960	

	BANK OF AMERICA CORP	1,586,241	7.880	12,499,579.080	
	EL PASO CORP	120,489	27.160	3,272,481.240	
	CITIGROUP INC	446,560	32.350	14,446,216.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	23,682	53.800	1,274,091.600	
	EATON CORP	51,780	51.750	2,679,615.000	
	EATON VANCE CORP	11,913	28.770	342,737.010	
	DISH NETWORK CORP	30,117	28.800	867,369.600	
	ECOLAB INC	46,301	62.690	2,902,609.690	
	ELECTRONIC ARTS INC	52,870	16.930	895,089.100	
	SALESFORCE.COM INC	19,372	143.640	2,782,594.080	
	EMERSON ELECTRIC CO	110,737	50.880	5,634,298.560	
	ENTERGY CORP	27,589	67.140	1,852,325.460	
	EOG RESOURCES INC	40,959	117.550	4,814,730.450	
	EQUIFAX INC	15,777	42.390	668,787.030	
	EQT CORP	21,454	54.040	1,159,374.160	
	ESTEE LAUDER COS INC/THE	33,570	56.840	1,908,118.800	
	EXPEDITORS INTERNATIONAL	34,083	43.340	1,477,157.220	
	EXPRESS SCRIPTS INC	71,550	52.410	3,749,935.500	
	EXXON MOBIL CORP	741,914	87.340	64,798,768.760	
	FMC CORP	9,929	98.560	978,602.240	
	NEXTERA ENERGY INC	62,598	60.770	3,804,080.460	
	FAMILY DOLLAR STORES	18,264	54.330	992,283.120	
	ASSURANT INC	14,771	42.950	634,414.450	
	FASTENAL CO	45,490	51.970	2,364,115.300	
	FIFTH THIRD BANCORP	148,746	13.600	2,022,945.600	
	M&T BANK CORP	15,930	81.770	1,302,596.100	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	18,192	45.820	833,557.440	
	FISERV INC	23,158	66.870	1,548,575.460	
	FLIR SYSTEMS INC	20,650	26.070	538,345.500	
	MACY'S INC	65,941	37.060	2,443,773.460	
	FORD MOTOR CO	552,345	12.230	6,755,179.350	
	FOREST LABORATORIES INC	40,759	32.290	1,316,108.110	
	FOSSIL INC	8,025	121.780	977,284.500	
	FRANKLIN RESOURCES INC	24,134	118.840	2,868,084.560	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	148,121	43.910	6,503,993.110	
	GAP INC/THE	42,827	22.570	966,605.390	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	22,388	38.400	859,699.200	
	GENERAL DYNAMICS CORP	49,345	72.400	3,572,578.000	
	GENERAL MILLS INC	105,604	38.150	4,028,792.600	
	GENUINE PARTS CO	24,938	62.230	1,551,891.740	
	GILEAD SCIENCES INC	114,280	45.260	5,172,312.800	
	STARWOOD HOTELS&RESORTS	31,505	54.990	1,732,459.950	
	GOODRICH CORP	19,092	125.880	2,403,300.960	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	13.110	480,887.910	
	MCKESSON CORP	40,111	82.000	3,289,102.000	
	NVIDIA CORP	88,899	15.790	1,403,715.210	
	GENERAL ELECTRIC CO	1,623,952	19.240	31,244,836.480	
	WW GRAINGER INC	8,547	207.290	1,771,707.630	

	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	22,545	66.180	1,492,028.100	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	23,927	47.690	1,141,078.630	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	41,880	25.080	1,050,350.400	
	HALLIBURTON CO	140,466	38.510	5,409,345.660	
	MONSTER BEVERAGE CORP	22,576	56.380	1,272,834.880	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	70,857	115.870	8,210,200.590	
	HARLEY-DAVIDSON INC	36,670	47.040	1,724,956.800	
	HARRIS CORP	21,855	43.110	942,169.050	
	CONSOL ENERGY INC	36,761	36.330	1,335,527.130	
	HASBRO INC	17,406	34.860	606,773.160	
	HENRY SCHEIN INC	13,991	74.740	1,045,687.340	
	DENBURY RESOURCES INC	68,370	20.910	1,429,616.700	
	HJ HEINZ CO	52,070	53.430	2,782,100.100	
	HELMERICH & PAYNE INC	15,984	62.720	1,002,516.480	
	HERSHEY FOODS CORP	25,491	61.110	1,557,755.010	
	HEWLETT-PACKARD CO	302,922	26.640	8,069,842.080	
	F5 NETWORKS INC	11,354	127.480	1,447,407.920	
	CROWN HOLDINGS INC NPR	20,737	36.600	758,974.200	
	REYNOLDS AMERICAN INC	56,345	41.280	2,325,921.600	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	12,207	46.840	571,775.880	
	JUNIPER NETWORKS INC	85,477	23.720	2,027,514.440	
	HOLLYFRONTIER CORP	35,010	33.890	1,186,488.900	
	HOLOGIC INC	34,080	21.330	726,926.400	
	UNUM GROUP	49,083	23.180	1,137,743.940	
	HOME DEPOT INC	236,018	46.980	11,088,125.640	
	HORMEL FOODS CORP	24,530	28.770	705,728.100	
	HUDSON CITY BANCORP INC	86,651	6.890	597,025.390	
	CENTERPOINT ENERGY INC	56,244	18.800	1,057,387.200	
	HUMANA INC	25,341	89.000	2,255,349.000	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	13,732	50.800	697,585.600	
	RED HAT INC	28,834	50.010	1,441,988.340	
	BIOGEN IDEC INC	36,831	116.390	4,286,760.090	
	ILLINOIS TOOL WORKS	64,118	55.920	3,585,478.560	
	INTUIT INC	44,821	58.060	2,602,307.260	
	INTEL CORP	789,212	26.700	21,071,960.400	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,144	57.630	757,488.720	
	INTL GAME TECH	44,449	15.250	677,847.250	
	INTERNATIONAL PAPER CO	67,397	32.920	2,218,709.240	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	57,675	11.620	670,183.500	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,580	47.190	923,980.200	
	JOHNSON & JOHNSON	424,085	64.460	27,336,519.100	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	63,376	20.480	1,297,940.480	
	JOHNSON CONTROLS INC	100,080	33.190	3,321,655.200	
	KLA-TENCOR CORP	24,993	47.750	1,193,415.750	
	DEVON ENERGY CORP	58,245	75.190	4,379,441.550	
	NSTAR	17,088	46.820	800,060.160	
	KELLOGG CO	38,305	52.750	2,020,588.750	



KEYCORP	141,232	8.060	1,138,329.920
KIMBERLY-CLARK CORP	62,968	71.810	4,521,732.080
BLACKROCK INC/NEW YORK	15,706	196.000	3,078,376.000
KOHL'S CORP	40,351	49.440	1,994,953.440
KROGER CO	94,372	23.540	2,221,516.880
LSI CORP	89,888	8.500	764,048.000
LAM RESEARCH CORP	20,796	40.560	843,485.760
AKAMAI TECHNOLOGIES	25,490	37.210	948,482.900
LEGG MASON INC	22,970	26.940	618,811.800
LEGGETT & PLATT INC	19,896	22.590	449,450.640
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,757	28.800	885,801.600
ELI LILLY & CO	165,226	39.050	6,452,075.300
LIMITED BRANDS	35,739	46.260	1,653,286.140
LINCOLN NATIONAL CORP	44,623	25.080	1,119,144.840
LINEAR TECH CORP	29,706	33.340	990,398.040
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	112,794	76.500	8,628,741.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	49,164	43.020	2,115,035.280
LOCKHEED MARTIN CORP	46,098	89.530	4,127,153.940
LOEWS CORP	51,052	39.140	1,998,175.280
RANGE RESOURCES CORP	23,850	65.940	1,572,669.000
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	12,442	44.210	550,060.820
LOWE'S COS INC	190,148	27.160	5,164,419.680
DOMINION RESOURCES INC/VA	88,598	51.320	4,546,849.360
IRON MOUNTAIN INC	18,556	31.440	583,400.640
SCANA CORP	17,601	45.350	798,205.350
MDU RESOURCES GROUP INC	20,489	22.030	451,372.670
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,383	14.000	565,362.000
MCCORMICK & CO INC	19,813	50.280	996,197.640
MCDONALD'S CORPORATION	159,475	100.320	15,998,532.000
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	45,478	46.030	2,093,352.340
MANPOWER INC	13,462	45.270	609,424.740
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,151	74.260	1,273,633.260
MARSH & MCLENNAN COS	85,095	31.770	2,703,468.150
ENERGIZER HOLDINGS INC	11,343	77.330	877,154.190
MASCO CORP	58,195	11.570	673,316.150
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	87.730	447,598.460
MATTEL INC	51,106	32.160	1,643,568.960
METLIFE INC	157,776	37.760	5,957,621.760
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,676	28.370	1,210,718.120
MEDTRONIC INC	162,150	38.120	6,181,158.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	85,641	12.115	1,037,540.710
CVS CAREMARK CORP	201,291	44.070	8,870,894.370
MERCK & CO. INC.	472,231	38.200	18,039,224.200
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,651	89.080	1,394,191.080
MICROSOFT CORP	1,171,545	31.480	36,880,236.600
MICRON TECH INC	123,712	7.950	983,510.400
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,818	36.370	975,370.660
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	77,055	15.460	1,191,270.300

	3M CO	102,002	88.200	8,996,576.400
	MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	62.410	559,068.780
	PROGRESS ENERGY INC	50,830	53.690	2,729,062.700
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	41,067	49.430	2,029,941.810
	KANSAS CITY SOUTHERN	16,023	69.240	1,109,432.520
	MURPHY OIL CORPORATION	30,207	64.760	1,956,205.320
	MYLAN LABORATORIES	60,562	23.480	1,421,995.760
	ILLUMINA INC	20,615	51.220	1,055,900.300
	XCEL ENERGY INC	76,360	26.480	2,022,012.800
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	65,384	86.040	5,625,639.360
	NETAPP INC	56,606	43.080	2,438,586.480
	SEARS HOLDINGS CORP	6,881	68.310	470,041.110
	NEWFIELD EXPLORATION CO	20,264	36.600	741,662.400
	NEWELL RUBBERMAID INC	50,723	18.380	932,288.740
	DUN & BRADSTREET CORP	5,033	82.360	414,517.880
	NEWMONT MINING CORP	79,243	62.510	4,953,479.930
	NIKE INC-CL B	54,826	106.290	5,827,455.540
	NOBLE ENERGY INC	29,400	104.570	3,074,358.000
	NORDSTROM INC	26,726	53.170	1,421,021.420
	NORFOLK SOUTHERN CORP	54,576	70.030	3,821,957.280
	NORTHEAST UTILITIES	29,133	35.860	1,044,709.380
	NISOURCE INC	44,250	23.680	1,047,840.000
	COACH INC	45,740	75.280	3,443,307.200
	NORTHERN TRUST CORP	31,465	43.860	1,380,054.900
	NORTHROP GRUMMAN CORP	41,587	59.920	2,491,893.040
	WELLS FARGO & CO	771,768	30.180	23,291,958.240
	NUCOR CORP	49,784	43.860	2,183,526.240
	MONSANTO CO	81,260	79.520	6,461,795.200
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	75,600	49.290	3,726,324.000
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	123,998	103.860	12,878,432.280
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18,841	85.670	1,614,108.470
	OMNICARE INC	18,060	34.750	627,585.000
	ORACLE CORP	620,314	29.250	18,144,184.500
	OWENS-ILLINOIS INC	23,621	24.500	578,714.500
	PACCAR INC	52,618	45.840	2,412,009.120
	PALL CORP	19,300	63.410	1,223,813.000
	EXELON CORP	102,041	39.270	4,007,150.070
	PARKER HANNIFIN CORP	20,916	89.630	1,874,701.080
	PATTERSON COS INC	12,490	32.140	401,428.600
	PAYCHEX INC	46,374	31.420	1,457,071.080
	JC PENNEY CO INC HOLDING CO	25,588	41.720	1,067,531.360
	PPL CORPORATION	90,174	28.850	2,601,519.900
	PEPSICO INC	243,546	63.310	15,418,897.260
	PENTAIR INC	14,352	38.830	557,288.160
	PERRIGO CO	13,145	96.240	1,265,074.800
	PFIZER INC	1,192,572	21.180	25,258,674.960
	CONOCOPHILLIPS	195,067	75.950	14,815,338.650
	PETSMART INC	18,380	54.780	1,006,856.400

	PG&E CORP	62,245	41.750	2,598,728.750	
	PITNEY BOWES INC	24,423	18.000	439,614.000	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,254	116.240	2,005,604.960	
	ALTRIA GROUP INC	321,907	29.990	9,653,990.930	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	79,818	59.380	4,739,592.840	
	AETNA INC	56,047	46.890	2,628,043.830	
	FLUOR CORP (NEW)	26,148	63.400	1,657,783.200	
	PPG INDUSTRIES INC	25,285	91.670	2,317,875.950	
	PRAXAIR INC	44,618	109.890	4,903,072.020	
	PRECISION CASTPARTS CORP	22,805	168.770	3,848,799.850	
	COSTCO WHOLESALE CORP	69,155	84.400	5,836,682.000	
	T ROWE PRICE GROUP INC	40,535	61.030	2,473,851.050	
	QUEST DIAGNOSTICS	24,069	57.240	1,377,709.560	
	PROCTER & GAMBLE CO	426,326	66.710	28,440,207.460	
	PROGRESSIVE CORP	97,111	21.430	2,081,088.730	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	79,277	30.430	2,412,399.110	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	70,124	12.880	903,197.120	
	QUALCOMM INC	258,139	63.440	16,376,338.160	
	US BANCORP	293,521	28.730	8,432,858.330	
	RALCORP HOLDINGS INC	9,036	74.660	674,627.760	
	ROSS STORES INC	33,430	52.790	1,764,769.700	
	ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,158	68.000	690,744.000	
	ROPER INDUSTRIES INC	16,209	94.580	1,533,047.220	
	ROWAN COS INC	21,239	38.780	823,648.420	
	PEABODY ENERGY CORP	41,483	36.330	1,507,077.390	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	23,328	82.670	1,928,525.760	
	RAYTHEON COMPANY	55,910	50.780	2,839,109.800	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,444	81.650	1,097,702.600	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,505	121.880	1,036,589.400	
	FMC TECHNOLOGIES INC	36,804	52.270	1,923,745.080	
	KRAFT FOODS INC-A	262,871	37.880	9,957,553.480	
	SANDISK CORP	38,624	49.140	1,897,983.360	
	SAFEWAY INC	56,305	20.930	1,178,463.650	
	ROCKWELL COLLINS INC	23,945	59.880	1,433,826.600	

[前](#) [次](#)

平成24年2月27日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	ST JUDE MEDICAL INC	49,860	43.230	2,155,447.800	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	68,088	58.600	3,989,956.800	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	34,060	31.070	1,058,244.200	
	PRICELINE.COM INC	7,926	590.410	4,679,589.660	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	165,176	13.520	2,233,179.520	
	JOY GLOBAL INC	16,611	90.650	1,505,787.150	
	ZIMMER HOLDINGS INC	25,985	62.210	1,616,526.850	
	SPX CORP	7,436	75.710	562,979.560	
	SEI INVESTMENTS CO	15,882	19.760	313,828.320	
	WELLPOINT INC	55,584	66.110	3,674,658.240	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	44,825	37.700	1,689,902.500	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	48,798	27.850	1,359,024.300	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,042	101.060	1,520,144.520	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	24,554	30.090	738,829.860	
	SIGMA-ALDRICH	20,592	72.600	1,494,979.200	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	74,340	61.090	4,541,430.600	
	ADVANCE AUTO PARTS	12,466	84.580	1,054,374.280	
	UNITED STATES STEEL CORP	20,827	28.130	585,863.510	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	55,432	35.210	1,951,760.720	
	EDISON INTERNATIONAL	46,526	42.230	1,964,792.980	
	SOUTHERN CO	139,276	44.540	6,203,353.040	
	BB&T CORP	102,369	29.480	3,017,838.120	
	SOUTHWEST AIRLINES	17,528	8.680	152,143.040	
	AT&T INC	919,700	30.340	27,903,698.000	
	CHEVRON CORP	308,431	109.080	33,643,653.480	
	MEADWESTVACO CORP	27,873	30.510	850,405.230	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	24,464	74.850	1,831,130.400	
	STAPLES INC	107,183	15.280	1,637,756.240	
	STATE STREET CORP	73,971	40.530	2,998,044.630	
	STARBUCKS CORP	116,933	48.300	5,647,863.900	
	STRYKER CORP	44,084	54.780	2,414,921.520	
	NETFLIX INC	7,832	111.670	874,599.440	
	SUNOCO INC	17,700	39.390	697,203.000	
	STERICYCLE INC	12,270	89.230	1,094,852.100	
	SUNTRUST BANKS INC	80,614	22.300	1,797,692.200	
	SYMANTEC CORP	108,592	17.880	1,941,624.960	
	SYNOPSIS INC	22,281	30.690	683,803.890	
	SYSCO CORP	92,867	29.270	2,718,217.090	
	INTUITIVE SURGICAL INC	5,872	512.760	3,010,926.720	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	174,293	33.320	5,807,442.760	
	TEXTRON INC	42,770	27.650	1,182,590.500	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	55,446	56.660	3,141,570.360	
	TIFFANY & CO	19,250	64.680	1,245,090.000	

	TOLL BROTHERS INC	20,812	22.620	470,767.440	
	TORCHMARK CORP	13,057	48.800	637,181.600	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,367	21.960	535,099.320	
	DAVITA INC	13,301	86.800	1,154,526.800	
	TYSON FOODS INC	47,556	18.990	903,088.440	
	URS CORP	10,094	46.620	470,582.280	
	MARATHON OIL CORP	110,823	35.010	3,879,913.230	
	UNION PACIFIC CORP	74,668	112.620	8,409,110.160	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	131,450	83.970	11,037,856.500	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	169,243	55.650	9,418,372.950	
	SPRINT NEXTEL CORP	516,213	2.470	1,275,046.110	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18,206	66.560	1,211,791.360	
	VF CORP	12,611	146.420	1,846,502.620	
	CBS CORP	90,469	29.750	2,691,452.750	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	35,939	38.390	1,379,698.210	
	VULCAN MATERIALS CO	20,011	46.170	923,907.870	
	URBAN OUTFITTERS INC	19,027	29.620	563,579.740	
	WALGREEN CO	134,024	33.860	4,538,052.640	
	WAL-MART STORES INC	297,000	58.790	17,460,630.000	
	WASTE MANAGEMENT INC	64,451	35.640	2,297,033.640	
	WATERS CORP	12,959	88.560	1,147,649.040	
	WASHINGTON POST	998	397.560	396,764.880	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	18,235	58.170	1,060,729.950	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,084	74.740	1,351,598.160	
	WALTER INDUSTRIES INC	10,524	66.310	697,846.440	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	59,765	64.140	3,833,327.100	
	WESTERN DIGITAL CORP	34,785	39.780	1,383,747.300	
	WEYERHAEUSER CO	88,971	21.060	1,873,729.260	
	WHIRLPOOL CORP	11,190	71.300	797,847.000	
	WYNN RESORTS LTD	12,936	118.100	1,527,741.600	
	WHOLE FOODS MARKET INC	21,819	81.100	1,769,520.900	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	18,704	26.670	498,835.680	
	CME GROUP INC	9,764	292.390	2,854,895.960	
	WILLIAMS COS INC	90,353	29.310	2,648,246.430	
	PEPCO HOLDINGS INC	36,572	19.840	725,588.480	
	ALLIANT ENERGY CORP	17,827	43.290	771,730.830	
	WISCONSIN ENERGY CORP	35,977	34.370	1,236,529.490	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,108	46.500	1,074,522.000	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	12,983	54.410	706,405.030	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	40,324	17.930	723,009.320	
	CARMAX INC	38,348	30.180	1,157,342.640	
	XEROX CORP	205,853	8.360	1,720,931.080	
	XILINX INC	36,827	37.230	1,371,069.210	
	YAHOO! INC	185,952	14.890	2,768,825.280	
	CIMAREX ENERGY CO	12,720	86.410	1,099,135.200	
	TJX COMPANIES INC	113,926	35.970	4,097,918.220	
	HOSPIRA INC	25,220	36.160	911,955.200	
	GENWORTH FINANCIAL INC	73,428	9.140	671,131.920	

	CBRE GROUP INC	50,310	18.510	931,238.100	
	LIBERTY GLOBAL INC	17,272	49.250	850,646.000	
	REGIONS FINANCIAL CORP	180,755	5.800	1,048,379.000	
	GOOGLE INC	39,554	609.900	24,123,984.600	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	48,345	12.010	580,623.450	
	LAS VEGAS SANDS CORP	56,529	53.350	3,015,822.150	
	MOSAIC CO/THE	49,222	58.680	2,888,346.960	
	NEWS CORP CLASS B	72,381	20.170	1,459,924.770	
	NEWS CORP INC CLASS A	258,899	19.560	5,064,064.440	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	11,212	38.890	436,034.680	
	CELANESE CORP	24,956	48.520	1,210,865.120	
	WINDSTREAM CORP	73,694	12.160	896,119.040	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	37,286	20.460	762,871.560	
	IHS INC-CLASS A	8,495	93.520	794,452.400	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	17,131	44.530	762,843.430	
	EXPEDIA INC	14,880	32.970	490,593.600	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,581	183.880	1,761,754.280	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	35,319	56.410	1,992,344.790	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	19,052	47.030	896,015.560	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	32,655	17.600	574,728.000	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	23,332	22.730	530,336.360	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,969	139.740	1,532,808.060	
	VIACOM INC-CLASS B	75,586	47.450	3,586,555.700	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,577	387.420	1,773,221.340	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	17,227	20.410	351,603.070	
	NYSE EURONEXT	43,767	30.840	1,349,774.280	
	VIRGIN MEDIA INC	47,938	25.100	1,203,243.800	
	MASTERCARD INC	17,030	415.610	7,077,838.300	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP	78,760	18.390	1,448,396.400	
	WESTERN UNION CO	102,998	17.880	1,841,604.240	
	SAIC INC	31,598	12.600	398,134.800	
	KBR INC	23,562	36.560	861,426.720	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	37,702	14.550	548,564.100	
	FIRST SOLAR INC	11,035	35.580	392,625.300	
	SPECTRA ENERGY CORP	100,338	31.730	3,183,724.740	
	TIME WARNER CABLE INC	53,147	78.210	4,156,626.870	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	59,253	12.460	738,292.380	
	DELTA AIR LINES INC	41,454	9.530	395,056.620	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,159	94.750	583,565.250	
	DISCOVER FINANCIAL	85,015	30.190	2,566,602.850	
	CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,891	113.430	1,689,086.130	
	LULULEMON ATHLETICA INC	16,598	66.590	1,105,260.820	
	VMWARE INC	12,728	100.520	1,279,418.560	
	TERADATA CORP	26,391	65.480	1,728,082.680	
	CALPINE CORP NPR	39,169	15.600	611,036.400	

	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	269,268	83.020	22,354,629.360	
	VISA INC	80,611	117.540	9,475,016.940	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	32,381	38.590	1,249,582.790	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	33.920	974,352.000	
	LORILLARD INC	20,630	130.010	2,682,106.300	
	SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	11,070	44.990	498,039.300	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	22,552	41.140	927,789.280	
	MARATHON PETROLEUM CORP	53,294	42.860	2,284,180.840	
	CAREFUSION CORP	34,028	25.890	880,984.920	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	15,230	33.240	506,245.200	
	XYLEM INC	31,066	27.260	846,859.160	
	HCA HOLDINGS INC	24,003	26.740	641,840.220	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	48,273	39.730	1,917,886.290	
	VERISK ANALYTICS INC	19,955	42.000	838,110.000	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	29,958	78.020	2,337,323.160	
	CIT GROUP INC	30,698	40.340	1,238,357.320	
	DOLLAR GENERAL CORP	24,246	41.670	1,010,330.820	
	QEP RESOURCES INC	25,069	34.320	860,368.080	
	LIBERTY MEDIA CORP - LIBERTY CAPITAL	16,283	88.280	1,437,463.240	
	GENERAL MOTORS CO	116,861	26.070	3,046,566.270	
米ドル小計	銘柄数 : 563	47,422,255		1,935,956,566.800	
	組入時価比率 : 54.44%			(157,373,909,315)	
	合計時価比率 : 55.89%				
英ポンド	XSTRATA PLC	307,169	12.150	3,732,103.350	
	AMEC PLC	48,992	11.230	550,180.160	
	ANTOFAGASTA PLC	58,006	13.360	774,960.160	
	SEVERN TRENT PLC	38,266	15.400	589,296.400	
	BHP BILLITON PLC	330,144	20.730	6,843,885.120	
	BARCLAYS PLC	1,799,408	2.476	4,455,334.200	
	BALFOUR BEATTY PLC	141,722	2.857	404,899.750	
	BT GROUP PLC	1,193,348	2.165	2,583,598.420	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	192,735	6.880	1,326,016.800	
	AGGREKO PLC	36,191	22.500	814,297.500	
	TULLOW OIL PLC	140,954	15.430	2,174,920.220	
	BUNZL PLC	38,195	9.305	355,404.470	
	CAPITA PLC	102,099	7.475	763,190.020	
	AVIVA PLC	441,178	3.738	1,649,123.360	
	DIAGEO PLC	379,427	14.945	5,670,536.510	
	SCHRODERS PLC	22,293	15.720	350,445.960	
	NATIONAL GRID PLC	559,198	6.455	3,609,623.090	
	LONMIN	24,209	10.850	262,667.650	
	GKN PLC	203,239	2.355	478,627.840	
	KINGFISHER PLC	332,300	2.811	934,095.300	
	BAE SYSTEMS PLC	506,678	3.169	1,605,662.580	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	302,807	31.270	9,468,774.890	

MAN GROUP PLC	309,687	1.344	416,219.320
COBHAM PLC	215,276	1.881	404,934.150
NEXT PLC	28,133	27.600	776,470.800
REXAM PLC	138,079	4.170	575,789.430
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	153,745	25.080	3,855,924.600
JOHNSON MATTHEY PLC	30,474	23.360	711,872.640
SABMILLER PLC	142,461	25.730	3,665,521.530
ANGLO AMERICAN PLC	206,278	26.935	5,556,097.930
COMPASS GROUP PLC	297,929	6.360	1,894,828.440
HSBC HOLDINGS PLC	2,744,523	5.749	15,778,262.720
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	911,820	1.221	1,113,332.220
ARM HOLDINGS PLC	215,348	5.740	1,236,097.520
CENTRICA PLC	793,221	2.986	2,368,557.900
UNILEVER PLC	198,778	20.500	4,074,949.000
MEGGITT PLC	151,642	3.881	588,522.600
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	359,061	2.894	1,039,122.530
INTL POWER PLC	244,870	3.455	846,025.850
UNITED UTILITIES GROUP PLC	105,557	6.030	636,508.710
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	442,155	1.088	481,064.640
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	56,767	12.190	691,989.730
PEARSON PLC	125,455	12.510	1,569,442.050
PRUDENTIAL PLC	406,510	7.220	2,935,002.200
RIO TINTO PLC	207,181	36.705	7,604,578.600
VODAFONE GROUP PLC	7,756,164	1.717	13,317,333.580
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,980	34.210	3,351,895.800
REED ELSEVIER PLC	180,949	5.560	1,006,076.440
OLD MUTUAL PLC	836,251	1.606	1,343,019.100
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	293,028	8.105	2,374,991.940
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,068,711	0.285	874,582.630
SSE PLC	153,744	12.780	1,964,848.320
SERCO GROUP PLC	72,250	5.620	406,045.000
BP PLC	2,921,870	4.962	14,498,318.940
SAGE GROUP PLC(THE)	220,158	3.083	678,747.110
INVENSYS PLC	163,653	2.120	346,944.360
SMITHS GROUP PLC	59,731	10.810	645,692.110
STANDARD CHARTERED PLC	371,798	16.380	6,090,051.240
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,572,100	0.357	2,346,239.700
TATE & LYLE PLC	60,088	6.970	418,813.360
BG GROUP PLC	531,856	15.430	8,206,538.080
TESCO PLC	1,217,056	3.182	3,872,672.190
3I GROUP PLC	187,027	1.960	366,572.920
SMITH & NEPHEW PLC	123,146	6.285	773,972.610
GLAXOSMITHKLINE PLC	775,953	14.035	10,890,500.350
WEIR GROUP	34,823	22.360	778,642.280
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	29,945	9.385	281,033.820
BABCOCK INT'L GROUP	60,664	7.450	451,946.800
ASTRAZENECA PLC	199,327	28.560	5,692,779.120
WHITBREAD PLC	22,710	17.030	386,751.300



	CARNIVAL PLC	30,375	18.720	568,620.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	228,941	3.534	809,077.490	
	INTERTEK GROUP PLC	28,006	22.860	640,217.160	
	BURBERRY GROUP PLC	65,105	14.210	925,142.050	
	INVESTEC PLC	74,705	4.027	300,837.030	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	49,316	14.050	692,889.800	
	VEDANTA RESOURCES PLC	24,021	15.000	360,315.000	
	ICAP PLC	87,128	3.950	344,155.600	
	ITV PLC	657,334	0.801	526,524.530	
	SAINSBURY (J) PLC	190,870	3.015	575,473.050	
	G4S PLC	231,452	2.869	664,035.780	
	ADMIRAL GROUP PLC	22,361	10.470	234,119.670	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	569,445	23.220	13,222,512.900	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	404,493	23.530	9,517,720.290	
	INMARSAT PLC	80,402	4.800	385,929.600	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	11.630	396,978.420	
	STANDARD LIFE PLC	325,057	2.354	765,184.170	
	EXPERIAN PLC	162,080	9.455	1,532,466.400	
	TUI TRAVEL PLC	100,036	2.009	200,972.320	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	46,617	7.390	344,499.630	
	FRESNILLO PLC NPR	23,779	18.640	443,240.560	
	RESOLUTION LTD	183,507	2.650	486,293.550	
	SHIRE PLC	89,740	22.220	1,994,022.800	
	WPP PLC	189,654	8.015	1,520,076.810	
	WOLSELEY PLC	43,144	24.440	1,054,439.360	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	14,969	73.350	1,097,976.150	
	PETROFAC LTD	43,902	15.940	699,797.880	
	GLENCORE INTERNATIONAL PLC	181,558	4.363	792,137.550	
英ポンド小計	銘柄数 : 98	45,876,621		230,679,423.510	
	組入時価比率 : 10.30%			(29,771,486,398)	
	合計時価比率 : 10.57%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	27,787	36.900	1,025,340.300	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	15,943	30.010	478,449.430	
	BARRICK GOLD CORP	153,053	48.850	7,476,639.050	
	TMX GROUP INC	14,916	42.600	635,421.600	
	TALISMAN ENERGY INC	167,312	14.240	2,382,522.880	
	BANK OF MONTREAL	102,997	58.100	5,984,125.700	
	BANK OF NOVA SCOTIA	168,048	53.510	8,992,248.480	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,510	76.590	1,953,810.900	
	BCE INC	38,612	40.070	1,547,182.840	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	83,934	31.510	2,644,760.340	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	43,944	48.010	2,109,751.440	
	BOMBARDIER INC 'B'	240,632	4.810	1,157,439.920	
	SAPUTO INC	23,636	40.510	957,494.360	
	RESEARCH IN MOTION LTD	79,152	14.730	1,165,908.960	
	CGI GROUP INC	29,163	20.940	610,673.220	

	CAE INC	53,145	10.760	571,840.200	
	CAMECO CORP	57,534	25.200	1,449,856.800	
	ROGERS COMM-CL B	58,021	38.170	2,214,661.570	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	62,175	76.510	4,757,009.250	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	170,957	38.000	6,496,366.000	
	NEXEN INC	86,198	21.180	1,825,673.640	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	12,753	63.960	815,681.880	
	CANADIAN UTILITIES LTD	13,725	63.560	872,361.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	68,593	76.870	5,272,743.910	
	AGRIUM INC	22,588	83.660	1,889,712.080	
	YAMANA GOLD INC	115,290	17.720	2,042,938.800	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	23,729	25.030	593,936.870	
	OPEN TEXT CORP	9,281	61.790	573,472.990	
	ELDORADO GOLD CORP	89,925	15.050	1,353,371.250	
	OSISKO MINING CORP	52,038	12.540	652,556.520	
	EMPIRE CO LTD	6,539	55.320	361,737.480	
	KINROSS GOLD CORP	173,556	11.180	1,940,356.080	
	FINNING INTERNATIONAL INC	30,080	28.950	870,816.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	17,487	25.820	451,514.340	
	FORTIS INC	29,702	32.040	951,652.080	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,329	22.940	1,613,347.260	
	TELUS CORP-NON VOTE	29,802	56.710	1,690,071.420	
	GREAT WEST LIFECO INC	50,480	23.310	1,176,688.800	
	IAMGOLD CORP	65,070	15.900	1,034,613.000	
	IMPERIAL OIL LTD	44,159	48.800	2,154,959.200	
	ENBRIDGE INC	118,128	38.410	4,537,296.480	
	IGM FINANCIAL INC	19,774	45.140	892,598.360	
	IVANHOE MINES LTD/CA	49,079	17.520	859,864.080	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	268,208	12.500	3,352,600.000	
	LOBLAW CO LTD	17,526	34.650	607,275.900	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,573	29.660	1,262,715.180	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	18,285	26.830	490,586.550	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	30,081	47.360	1,424,636.160	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	83,291	21.280	1,772,432.480	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,579	393.490	1,408,300.710	
	INMET MINING CORPORATION	10,004	68.500	685,274.000	
	METRO INC	13,859	50.220	695,998.980	
	HUSKY ENERGY INC	57,774	26.730	1,544,299.020	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,756	46.210	2,021,964.760	
	NIKO RESOURCES LTD	9,961	47.380	471,952.180	
	ONEX CORP	17,569	36.870	647,769.030	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	21,311	25.560	544,709.160	
	GOLDCORP INC	122,852	48.640	5,975,521.280	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	129,253	46.580	6,020,604.740	
	POWER CORP OF CANADA	48,941	25.140	1,230,376.740	
	POWER FINANCIAL CORP	43,517	27.440	1,194,106.480	
	ROYAL BANK OF CANADA	226,407	54.660	12,375,406.620	

	SNC-LAVALIN GROUP INC	20,986	48.250	1,012,574.500	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,563	75.230	1,847,874.490	
	SHAW COMM INC-B	56,820	20.240	1,150,036.800	
	SINO-FOREST CORP	38,862	4.810	186,926.220	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	34,176	40.520	1,384,811.520	
	NEW GOLD INC	62,801	11.810	741,679.810	
	SUNCOR ENERGY INC	236,350	36.970	8,737,859.500	
	ENCANA CORP	112,909	19.700	2,224,307.300	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	91,181	40.660	3,707,419.460	
	THOMSON REUTERS CORP	62,106	28.530	1,771,884.180	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	140,328	79.300	11,128,010.400	
	TRANSCANADA CORP	107,227	42.000	4,503,534.000	
	TRANSALTA CORP	34,014	21.040	715,654.560	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,627	63.520	484,467.040	
	CENTERRA GOLD INC	22,699	21.430	486,439.570	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	34,783	11.300	393,047.900	
	INTACT FINANCIAL CORP	20,440	59.330	1,212,705.200	
	SILVER WHEATON CORP	50,604	38.760	1,961,411.040	
	VITERRA INC NPR	46,498	10.320	479,859.360	
	PRECISION DRILLING CORP	49,510	12.170	602,536.700	
	BELL ALIANT INC	14,926	27.220	406,285.720	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,093	44.210	844,101.530	
	CI FINANCIAL CORP	26,281	22.040	579,233.240	
	TOURMALINE OIL CORP	15,696	25.320	397,422.720	
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,082	28.360	597,885.520	
	TIM HORTONS INC	22,995	52.810	1,214,365.950	
	BAYTEX ENERGY CORP	18,200	58.130	1,057,966.000	
	MEG ENERGY CORP	17,794	43.980	782,580.120	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	37,765	12.300	464,509.500	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	118,611	39.110	4,638,876.210	
	ENERPLUS CORP	28,113	24.010	674,993.130	
	VERMILION ENERGY INC	10,515	48.610	511,134.150	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	74,986	21.560	1,616,698.160	
	ARC RESOURCES LTD	42,391	25.420	1,077,579.220	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	76,612	23.660	1,812,639.920	
	BONAVISTA ENERGY CORP	22,644	23.180	524,887.920	
	PENGROWTH ENERGY CORP	55,901	9.910	553,978.910	
カナダドル小計	銘柄数 : 99	5,901,612		195,254,174.200	
	組入時価比率 : 5.49%			(15,862,449,112)	
	合計時価比率 : 5.63%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	38,728	12.200	472,481.600	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	181,466	24.920	4,522,132.720	
	SYNGENTA AG	14,963	299.200	4,476,929.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	512,110	55.450	28,396,499.500	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	83,325	54.450	4,537,046.250	

	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	108,456	159.300	17,277,040.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,515	111.300	947,719.500	
	SIKA INHABER	363	1,990.000	722,370.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	861	1,719.000	1,480,059.000	
	SULZER AG-REG	4,948	125.500	620,974.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	361,655	51.500	18,625,232.500	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,984	71.350	641,008.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	390	904.000	352,560.000	
	SWISSCOM AG-REG	3,426	362.100	1,240,554.600	
	ABB LTD	328,240	18.790	6,167,629.600	
	ADECCO SA-REG	19,348	46.820	905,873.360	
	GEBERIT AG	4,882	194.800	951,013.600	
	LONZA GROUP AG-REG	9,112	49.530	451,317.360	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	2,758.000	250,978.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	32,770.000	655,400.000	
	UBS AG-REGISTERED	549,901	12.880	7,082,724.880	
	GIVAUDAN-REG	1,382	876.000	1,210,632.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	23,106	226.500	5,233,509.000	
	HOLCIM LTD-REG	37,527	58.650	2,200,958.550	
	ACTELION	19,725	34.810	686,627.250	
	SONOVA HOLDING AG	8,743	102.500	896,157.500	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,380	123.200	786,016.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	2,017	143.700	289,842.900	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,262	404.300	1,723,126.600	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,915	70.500	558,007.500	
	SCHINDLER NAMEN	1,824	109.800	200,275.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	101.800	361,695.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,737	169.600	464,195.200	
	ARYZTA AG	13,689	44.700	611,898.300	
	JULIUS BAER GROUP LTD	30,873	36.240	1,118,837.520	
	SWISS RE LTD	56,205	53.850	3,026,639.250	
	TRANSOCEAN LTD	54,450	45.880	2,498,166.000	
	SYNTHESE INC	9,702	157.000	1,523,214.000	
スイスフラン 小計	銘柄数 : 38	2,523,874		124,167,343.440	
	組入時価比率 : 3.90%			(11,279,361,478)	
	合計時価比率 : 4.01%				
スウェーデン クローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	9,909	731.000	7,243,479.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	103,057	172.900	17,818,555.300	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	64,097	154.100	9,877,347.700	
	ERICSSON LM-B SHS	465,092	67.700	31,486,728.400	
	GETINGE AB-B SHS	31,964	187.000	5,977,268.000	
	SKF AB-B SHS	55,959	170.500	9,541,009.500	
	SANDVIK AB	161,874	103.800	16,802,521.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	214,074	48.940	10,476,781.560	
	SKANSKA AB-B SHS	58,507	120.400	7,044,242.800	
	SWEDBANK AB	125,939	112.100	14,117,761.900	

	SSAB AB-A	32,561	71.250	2,319,971.250	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	79,580	114.500	9,111,910.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,081	218.900	16,435,230.900	
	VOLVO AB-B SHS	214,370	94.600	20,279,402.000	
	HOLMEN AB-B SHS	881	194.000	170,914.000	
	SCANIA AB	49,676	129.000	6,408,204.000	
	SWEDISH MATCH AB	30,526	248.700	7,591,816.200	

[前](#) [次](#)

平成24年2月27日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	TELE2 AB-B SHS	49,717	133.300	6,627,276.100	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	9,101	327.200	2,977,847.200	
	NORDEA AB	407,758	63.200	25,770,305.600	
	INDUSTRIVARDEN C	26,391	100.200	2,644,378.200	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	140.400	5,417,193.600	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	64.350	3,414,089.250	
	INVESTOR AB-B SHS	81,125	147.700	11,982,162.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	162,271	239.700	38,896,358.700	
	ASSA ABLOY AB-B	43,425	197.500	8,576,437.500	
	TELIASONERA AB	311,185	48.100	14,967,998.500	
	LUNDIN PETROLEUM AB	40,808	153.500	6,264,028.000	
	BOLIDEN AB	44,557	117.200	5,222,080.400	
	ALFA LAVAL AB	45,040	135.300	6,093,912.000	
	KINNEVIK INVESTMENT B	33,473	148.300	4,964,045.900	
	HUSQVARNA AB-B SHS	91,308	40.020	3,654,146.160	
	RATOS AB	34,246	87.650	3,001,661.900	
	HEXAGON AB	45,953	133.800	6,148,511.400	
スウェーデン クローネ小計	銘柄数 : 34	3,291,144		349,325,576.620	
	組入時価比率 : 1.50%			(4,338,623,662)	
	合計時価比率 : 1.54%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	59,022	8.800	519,393.600	
	OMV AG	24,898	28.850	718,307.300	
	VOEST-ALPINE AG	17,613	27.010	475,727.130	
	ERSTE GROUP BANK AG	33,508	18.500	619,898.000	
	IMMOFINANZ AG	152,609	2.634	401,972.100	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	26.470	240,850.530	
	UMICORE	18,212	39.420	717,917.040	
	DELHAIZE GROUP	12,505	40.915	511,642.070	
	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	27,003	17.210	464,721.630	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	123,829	49.230	6,096,101.670	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
	SOLVAY SA	8,874	91.000	807,534.000	
	MOBISTAR SA	5,958	36.080	214,964.640	
	AGEAS	411,212	1.626	668,630.710	
	UCB SA	13,154	30.630	402,907.020	
	COLRUYT NV	14,070	28.805	405,286.350	
	BEKAERT NV	7,702	24.720	190,393.440	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,830	55.370	710,397.100	
	GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.004	2.060	
	BELGACOM SA	23,896	23.670	565,618.320	
	ADIDAS AG	31,341	58.750	1,841,283.750	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	52,537	70.320	3,694,401.840	

	COMMERZBANK AG	605,908	1.941	1,176,067.420	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	16,709	77.960	1,302,633.640	
	UNITED INTERNET	18,350	14.775	271,121.250	
	MAN SE	10,044	85.610	859,866.840	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	12,421	42.595	529,072.490	
	GEA GROUP AG	28,135	25.550	718,849.250	
	CONTINENTAL AG	13,432	68.640	921,972.480	
	DEUTSCHE POST AG-REG	123,484	13.160	1,625,049.440	
	AXEL SPRINGER AG	6,021	35.990	216,695.790	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	25,205	48.550	1,223,702.750	
	MERCK KGAA	9,951	79.480	790,905.480	
	RWE AG	77,047	33.240	2,561,042.280	
	SAP AG	143,292	50.290	7,206,154.680	
	E.ON AG	270,819	16.960	4,593,090.240	
	HENKEL AG & CO KGAA	20,540	40.020	822,010.800	
	METRO AG	22,519	29.380	661,608.220	
	SIEMENS AG-REG	125,129	75.020	9,387,177.580	
	BAYER AG	125,309	55.900	7,004,773.100	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	25,233	47.550	1,199,829.150	
	DAIMLER AG	136,544	47.445	6,478,330.080	
	BASF SE	143,476	64.700	9,282,897.200	
	CELESIO AG	16,256	14.295	232,379.520	
	BEIERSDORF AG	17,671	46.835	827,621.280	
	HOCHTIEF AG	7,587	55.360	420,016.320	
	HEIDELBERGCEMENT AG	21,539	39.735	855,852.160	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	31,792	53.770	1,709,455.840	
	ALLIANZ SE	68,590	91.170	6,253,350.300	
	PROSIEBEN MEDIA N/V VORZUG REG	13,630	18.835	256,721.050	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	39,971	10.420	416,497.820	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	27,588	109.600	3,023,644.800	
	SALZGITTER	7,018	45.925	322,301.650	
	VOLKSWAGEN AG	5,402	126.600	683,893.200	
	VOLKSWAGEN AG PFD	23,174	139.250	3,226,979.500	
	THYSSENKRUPP AG	55,869	20.535	1,147,269.910	
	LINDE AG	25,895	126.350	3,271,833.250	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	139,921	34.855	4,876,946.450	
	BMW VORZUG	11,145	44.985	501,357.820	
	K & S	24,444	38.625	944,149.500	
	SUEDZUCKER AG	11,866	21.665	257,076.890	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	419,766	8.793	3,691,002.430	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	156,734	7.586	1,188,984.120	
	DEUTSCHE BOERSE AG	32,038	50.320	1,612,152.160	
	FRAPORT AG	6,165	47.790	294,625.350	
	LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	14,055	57.240	804,508.200	
	WACKER-CHEMIE GMBH	3,025	76.350	230,958.750	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	15,026	43.000	646,118.000	

	BRENNTAG AG	4,077	84.150	343,079.550	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	63,071	12.705	801,317.050	
	IBERDROLA SA	589,349	4.508	2,656,785.290	
	INDRA SISTEMAS SA	16,340	10.600	173,204.000	
	REPSOL YPF SA	118,170	20.630	2,437,847.100	
	TELEFONICA S.A	641,156	12.860	8,245,266.160	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,133	22.755	526,391.410	
	BANKINTER S.A.	34,675	4.970	172,334.750	
	ACERINOX SA	16,481	10.685	176,099.480	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	728,423	6.774	4,934,337.400	
	ACCIONA S.A.	1,908	59.650	113,812.200	
	GAS NATURAL SDG SA	57,849	12.635	730,922.110	
	BANCO SANTANDER SA	1,309,562	6.283	8,227,978.040	
	RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	14,371	36.100	518,793.100	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	8,715	19.550	170,378.250	
	BANCO POPULAR ESPANOL	146,617	3.048	446,888.610	
	BANCO SABADELL	179,119	2.413	432,214.140	
	INDITEX	33,620	69.030	2,320,788.600	
	MAPFRE SA	135,413	2.541	344,084.430	
	ENAGAS	25,191	15.135	381,265.780	
	GRIFOLS SA	24,523	15.200	372,749.600	
	FERROVIAL SA	63,117	9.550	602,767.350	
	CAIXABANK	149,185	3.597	536,618.440	
	AMADEUS IT HOLDING SA	52,881	13.965	738,483.160	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	151,868	1.893	287,486.120	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	111,285	3.549	394,950.460	
	BANKIA SAU	140,798	3.050	429,433.900	
	KESKO OYJ-B	13,297	25.320	336,680.040	
	WARTSILA OYJ	26,436	26.600	703,197.600	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	15,126	33.800	511,258.800	
	UPM-KYMMENE OYJ	78,102	10.600	827,881.200	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	108,663	5.730	622,638.990	
	SAMPO OYJ-A SHS	59,871	21.300	1,275,252.300	
	FORTUM OYJ	65,765	18.500	1,216,652.500	
	NOKIA OYJ	597,512	4.328	2,586,031.930	
	ELISA CORP	25,398	17.180	436,337.640	
	METSO OYJ	21,261	35.810	761,356.410	
	NESTE OIL OYJ	23,509	9.685	227,684.660	
	KONE OYJ	22,765	45.550	1,036,945.750	
	ORION OYJ	17,482	16.350	285,830.700	
	AIR LIQUIDE	45,890	97.490	4,473,816.100	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	66,253	27.060	1,792,806.180	
	AXA	266,452	12.125	3,230,730.500	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	68,396	9.060	619,667.760	
	DANONE	88,704	50.700	4,497,292.800	



SAFRAN SA	25,102	24.220	607,970.440
ACCOR SA	26,806	26.130	700,440.780
BOUYGUES	30,754	24.715	760,085.110
BNP PARIBAS	144,925	36.920	5,350,631.000
THALES SA	19,494	27.530	536,669.820
CAP GEMINI SA	24,414	32.885	802,854.390
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	71.980	472,692.660
CHRISTIAN DIOR	7,771	116.300	903,767.300
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	23,542	23.290	548,293.180
ALCATEL-LUCENT	384,592	1.953	751,108.170
NATIXIS	164,630	2.629	432,812.270
EIFFAGE	8,253	29.510	243,546.030
PUBLICIS GROUPE	19,919	40.815	812,993.980
IMERYS SA	7,765	45.150	350,589.750
LAFARGE SA	28,285	35.395	1,001,147.570
L'OREAL	35,517	85.000	3,018,945.000
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	38,546	126.350	4,870,287.100
LAGARDERE S.C.A.	21,125	22.385	472,883.120
MICHELIN(CGDE)-B	27,685	53.030	1,468,135.550
PERNOD-RICARD	30,026	76.790	2,305,696.540
PEUGEOT SA	30,300	15.855	480,406.500
RENAULT SA	27,030	39.940	1,079,578.200
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	61,891	36.055	2,231,480.000
SOCIETE GENERALE-A	101,057	24.430	2,468,822.510
VINCI S.A.	67,944	38.625	2,624,337.000
SODEXO	12,740	57.700	735,098.000
SCHNEIDER ELECTRIC SA	77,535	51.050	3,958,161.750
VIVENDI SA	197,714	16.490	3,260,303.860
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,942	81.320	1,296,403.440
TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	24,183	9.109	220,282.940
TOTAL SA	334,286	42.065	14,061,740.590
VALLOUREC	16,668	53.610	893,571.480
FRANCE TELECOM SA	295,145	11.730	3,462,050.850
BIC	6,136	75.170	461,243.120
DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	62.860	619,925.320
PPR	11,855	127.800	1,515,069.000
NEOPOST SA	6,482	52.010	337,128.820
CARREFOUR SA	85,148	18.320	1,559,911.360
ATOS	9,475	43.220	409,509.500
SANOFI	175,425	56.300	9,876,427.500
STMICROELECTRONICS NV	97,120	5.453	529,595.360
ESSILOR INTL	31,399	59.700	1,874,520.300
CREDIT AGRICOLE SA	172,905	4.898	846,888.690
WENDEL	6,630	63.890	423,590.700
ILIAD SA	1,861	96.250	179,121.250
GDF SUEZ	198,651	19.675	3,908,458.420
ALSTOM	33,600	32.350	1,086,960.000

	EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	28.420	495,929.000	
	ELECTRICITE DE FRANCE	44,581	18.590	828,760.790	
	ARKEMA SA	9,569	69.190	662,079.110	
	LEGRAND SA	32,977	27.595	910,000.310	
	ADP	6,435	61.060	392,921.100	
	SCOR SE	22,917	20.045	459,371.260	
	BUREAU VERITAS SA	7,690	62.540	480,932.600	
	GROUPE EUROTUNNEL SA	89,249	6.435	574,317.310	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	35,172	10.540	370,712.880	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	EDENRED	27,224	20.290	552,374.960	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	32,274	14.040	453,126.960	
	NATIONAL BANK OF GREECE	170,555	2.400	409,332.000	
	OPAP SA	41,034	6.770	277,800.180	
	CRH PLC	106,593	16.220	1,728,938.460	
	KERRY GROUP PLC-A	24,173	31.550	762,658.150	
	ELAN CORPORATION PLC	89,094	9.350	833,028.900	
	IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.132	12,053.710	
	ASSICURAZIONI GENERALI	177,127	12.220	2,164,491.940	
	INTESA SANPAOLO	1,617,052	1.490	2,409,407.480	
	UNICREDIT SPA	614,261	3.894	2,391,932.330	
	ENI SPA	366,914	17.570	6,446,678.980	
	MEDIOBANCA SPA	81,452	4.968	404,653.530	
	PIRELLI & C	48,668	7.925	385,693.900	
	SAIPEM	41,590	37.870	1,575,013.300	
	LUXOTTICA GROUP SPA	22,387	25.580	572,659.460	
	MEDIASET SPA	117,464	2.354	276,510.250	
	AUTOGRILL SPA	20,544	7.675	157,675.200	
	A2A SPA	273,914	0.756	207,078.980	
	FIAT SPA	119,079	4.564	543,476.550	
	ENEL SPA	1,035,843	3.050	3,159,321.150	
	FINMECCANICA SPA	70,788	4.152	293,911.770	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	804,540	0.392	315,379.680	
	SNAM SPA	225,511	3.610	814,094.710	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	137,041	3.586	491,429.020	
	TELECOM ITALIA SPA	1,374,164	0.867	1,191,400.180	
	TELECOM ITALIA-RNC	1,110,927	0.704	782,092.600	
	ATLANTIA SPA	54,105	12.760	690,379.800	
	TERNA SPA	147,965	2.792	413,118.280	
	EXOR SPA	9,585	19.070	182,785.950	
	PRYSMIAN SPA	37,609	13.000	488,917.000	
	BANCO POPOLARE SPA	305,979	1.425	436,020.070	
	ENEL GREEN POWER SPA	221,755	1.494	331,301.970	
	FIAT INDUSTRIAL SPA	119,079	7.985	950,845.810	
	ARCELOR MITTAL (NL)	128,605	16.095	2,069,897.470	
	TENARIS SA	71,428	15.220	1,087,134.160	
	SES FDR	46,853	17.855	836,560.310	

	BOSKALIS WESTMINSTER CT	13,745	28.040	385,409.800	
	REED ELSEVIER NV	112,391	9.353	1,051,193.020	
	KONINKLIJKE DSM NV	19,732	42.245	833,578.340	
	SBM OFFSHORE NV	23,374	13.300	310,874.200	
	ING GROEP NV-CVA	592,391	6.633	3,929,329.500	
	RANDSTAD HOLDINGS	21,850	28.240	617,044.000	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	179,713	10.310	1,852,841.030	
	HEINEKEN NV	35,432	39.420	1,396,729.440	
	AKZO NOBEL	35,469	43.480	1,542,192.120	
	ASML HOLDING NV	68,040	34.550	2,350,782.000	
	AEGON NV	277,959	3.926	1,091,267.030	
	UNILEVER NV-CVA	254,791	24.910	6,346,843.810	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	158,542	15.855	2,513,683.410	
	WOLTERS KLUWER-CVA	49,896	14.295	713,263.320	
	QIAGEN N.V.	39,540	11.985	473,886.900	
	VOPAK (KON.)	11,504	41.625	478,854.000	
	KONINKLIJKE KPN NV	222,305	8.106	1,802,004.330	
	HEINEKEN HOLDING NV-A	12,515	33.390	417,875.850	
	FUGRO CERT	10,228	54.390	556,300.920	
	TNT EXPRESS NV W/I	61,074	9.390	573,484.860	
	DELTA LLOYD NV	19,898	14.310	284,740.380	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	112,619	1.649	185,708.730	
	JERONIMO MARTINS	40,183	13.210	530,817.430	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	120,094	3.980	477,974.120	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	314,886	2.178	685,821.700	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	43,777	13.255	580,264.130	
ユーロ小計	銘柄数 : 233	26,997,810		340,823,977.880	
	組入時価比率 : 12.90%			(37,289,551,420)	
	合計時価比率 : 13.24%				
デンマーク ローネ	CARLSBERG AS-B	17,266	448.000	7,735,168.000	
	A P MOLLER A/S	168	45,520.000	7,647,360.000	
	AP MOLLER MAERSK A	100	43,560.000	4,356,000.000	
	DANSKE BANK A/S	108,499	95.950	10,410,479.050	
	NOVOZYMES-B SHS	40,415	168.300	6,801,844.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	64,956	794.000	51,575,064.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	35,696	58.350	2,082,861.600	
	TDC A/S	58,423	43.490	2,540,816.270	
	COLOPLAST-B	4,175	905.000	3,778,375.000	
	DSV A/S	29,112	128.000	3,726,336.000	
	WILLIAM DEMANT	4,646	498.900	2,317,889.400	
	TRYG A/S	4,793	299.900	1,437,420.700	
デンマーク ローネ小計	銘柄数 : 12	368,249		104,409,614.520	
	組入時価比率 : 0.53%			(1,535,865,430)	
	合計時価比率 : 0.55%				
ノルウェー ローネ	SEADRILL LTD	46,984	227.600	10,693,558.400	

	ACERGY SA	37,286	132.600	4,944,123.600	
	DNB ASA	136,403	70.100	9,561,850.300	
	NORSK HYDRO ASA	138,196	34.240	4,731,831.040	
	TELENOR ASA	123,877	103.000	12,759,331.000	
	ORKLA ASA	129,845	46.680	6,061,164.600	
	STATOIL ASA	181,422	157.100	28,501,396.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,891	279.000	8,060,589.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	97.500	1,846,260.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	43,012	64.800	2,787,177.600	
ノルウェーク ローネ小計	銘柄数 : 10	884,852		89,947,281.740	
	組入時価比率 : 0.45%			(1,313,230,313)	
	合計時価比率 : 0.47%				
香港ドル	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	136,000	25.650	3,488,400.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	43,000	53.150	2,285,450.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	408,000	5.520	2,252,160.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	358,000	28.750	10,292,500.000	
	BANK OF EAST ASIA	193,260	30.250	5,846,115.000	
	CLP HOLDINGS LTD	311,500	66.450	20,699,175.000	
	PCCW LTD	734,000	3.000	2,202,000.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	211,000	14.720	3,105,920.000	
	LI & FUNG LTD	812,400	18.000	14,623,200.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	223,000	111.000	24,753,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	95,000	44.550	4,232,250.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	156,400	144.500	22,599,800.000	
	MTR CORP	245,000	26.900	6,590,500.000	
	FIRST PACIFIC CO	380,000	8.380	3,184,400.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	53.650	7,242,750.000	
	HANG SENG BANK LTD	106,000	103.100	10,928,600.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	173,000	48.050	8,312,650.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	206,500	56.100	11,584,650.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	211,750	46.250	9,793,437.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	698,050	19.180	13,388,599.000	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	343,000	76.800	26,342,400.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	60,000	33.900	2,034,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	237,000	19.020	4,507,740.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	137,000	35.750	4,897,750.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	535,000	21.750	11,636,250.000	
	NWS HOLDINGS LTD	148,000	12.980	1,921,040.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	668,700	10.460	6,994,602.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	18.520	4,259,600.000	
	SINO LAND CO	389,400	13.920	5,420,448.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	224,000	119.400	26,745,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	98,000	86.500	8,477,000.000	
	WHEELOCK & CO LTD	162,000	25.800	4,179,600.000	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	28,500	19.920	567,720.000	

	SJM HOLDINGS LTD	290,000	15.580	4,518,200.000	
	AIA GROUP LTD	1,348,600	28.300	38,165,380.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	15,956	5.430	86,641.080	
	ASM PACIFIC TECH	37,600	109.400	4,113,440.000	
	WYNN MACAU LTD	273,200	19.900	5,436,680.000	
	SANDS CHINA LTD	361,200	28.650	10,348,380.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 39	11,424,016		358,058,027.580	
	組入時価比率 : 1.30%			(3,752,448,129)	
	合計時価比率 : 1.33%				
シンガポール ・ドル	GENTING SINGAPORE PLC	887,400	1.635	1,450,899.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.750	616,230.000	
	SINGAPORE TECH ENG	261,000	3.130	816,930.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	182,000	5.170	940,940.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.740	976,140.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	272,000	14.160	3,851,520.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	88,000	11.230	988,240.000	
	SEMBCORP MARINE	166,000	5.260	873,160.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	45.280	815,040.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	141,000	7.160	1,009,560.000	
	CAPITALAND LTD	297,000	3.100	920,700.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	105,500	6.600	696,300.000	
	KEPPEL CORP LTD	208,500	10.930	2,278,905.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	332,000	1.510	501,320.000	
	NEPTUNE ORIENT	215,750	1.340	289,105.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	646,763	1.395	902,234.380	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	389,200	8.990	3,498,908.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,264,867	3.120	3,946,385.040	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	91,400	10.700	977,980.000	
	KEPPEL LAND LTD	164,000	3.470	569,080.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	202,000	18.110	3,658,220.000	
	STARHUB LTD	110,000	2.920	321,200.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	140,800	2.320	326,656.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	262,000	5.120	1,341,440.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	390,000	1.335	520,650.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	288,000	1.565	450,720.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	253,000	2.150	543,950.000	
シンガポール ・ドル小計	銘柄数 : 27	8,458,820		34,082,412.420	
	組入時価比率 : 0.76%			(2,202,746,315)	
	合計時価比率 : 0.78%				
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	207,413	12.030	2,495,178.390	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	236,029	11.120	2,624,642.480	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	335,378	6.150	2,062,574.700	

	ISRAEL CHEMICALS LTD	81,827	40.980	3,353,270.460	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	148,953	166.300	24,770,883.900	
	ISRAEL CORP LTD/THE	489	2,300.000	1,124,700.000	
イスラエル・シュケル小計	銘柄数 : 6	1,010,089		36,431,249.930	
	組入時価比率 : 0.27%			(781,814,623)	
	合計時価比率 : 0.28%				
オーストラリアドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	18.160	232,357.200	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	394,554	22.200	8,759,098.800	
	AMCOR LTD	210,271	7.100	1,492,924.100	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	472,185	20.780	9,812,004.300	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	212,072	5.390	1,143,068.080	
	TELSTRA CORP LTD	677,536	3.260	2,208,767.360	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,181	7.890	443,268.090	
	AMP LTD	449,927	4.190	1,885,194.130	
	LYNAS CORP LTD	315,096	1.290	406,473.840	
	ASX LTD	30,082	32.100	965,632.200	
	BHP BILLITON LTD	491,216	36.540	17,949,032.640	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	24,948	12.980	323,825.040	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	12,052	59.000	711,068.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	2.150	218,760.350	
	COMPUTERSHARE LT	75,518	7.740	584,509.320	
	CSL LIMITED	77,107	32.900	2,536,820.300	
	TRANSURBAN GROUP	174,256	5.640	982,803.840	
	COCA-COLA AMATIL LTD	93,286	12.150	1,133,424.900	
	COCHLEAR LTD	10,605	60.440	640,966.200	
	ORIGIN ENERGY LTD	153,096	14.030	2,147,936.880	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	243,696	49.700	12,111,691.200	
	BORAL LIMITED	107,619	4.470	481,056.930	
	RIO TINTO LIMITED	65,844	68.090	4,483,317.960	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	266,750	3.250	866,937.500	
	OZ MINERALS LTD	55,513	10.920	606,201.960	
	ORICA LTD	50,048	26.620	1,332,277.760	
	FAIRFAX MEDIA LTD	373,327	0.795	296,794.960	
	LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	25.660	558,284.620	
	SYDNEY AIRPORT	66,175	2.620	173,378.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	58,487	27.010	1,579,733.870	
	WORLEYPARSONS LTD	28,202	29.600	834,779.200	
	SUNCORP GROUP LTD	211,551	8.260	1,747,411.260	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	354,370	23.520	8,334,782.400	
	NEWCREST MINING LTD	121,376	34.550	4,193,540.800	
	INCITEC PIVOT LTD	270,689	3.330	901,394.370	
	TOLL HOLDINGS LTD	118,338	5.680	672,159.840	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	186,960	1.680	314,092.800	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	169,191	11.610	1,964,307.510	

	SANTOS LTD	140,142	14.070	1,971,797.940	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	28,753	15.020	431,870.060	
	SONIC HEALTHCARE	64,654	11.850	766,149.900	
	TABCORP HOLDINGS LTD	129,182	2.800	361,709.600	
	WESFARMERS LTD	156,607	29.230	4,577,622.610	
	ALUMINA LIMITED	397,286	1.240	492,634.640	
	ILUKA RESOURCES LIM1	71,975	16.650	1,198,383.750	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	96,836	37.860	3,666,210.960	
	WOOLWORTHS LTD	192,530	25.160	4,844,054.800	
	METCASH LTD	79,084	4.200	332,152.800	
	TATTS GROUP LTD	225,953	2.550	576,180.150	
	AGL ENERGY LTD	65,010	13.670	888,686.700	
	BRAMBLES LTD	217,633	7.260	1,580,015.580	
	ASCIANO LTD	161,903	4.900	793,324.700	
	CROWN LTD	36,383	8.300	301,978.900	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	116,369	4.300	500,386.700	
	QR NATIONAL LTD	278,184	3.930	1,093,263.120	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	83,754	7.590	635,692.860	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 56	9,356,663		121,042,194.780	
	組入時価比率 : 3.63%			(10,501,620,819)	
	合計時価比率 : 3.73%				
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	152,611	6.400	976,710.400	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	407,280	2.160	879,724.800	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 2	559,891		1,856,435.200	
	組入時価比率 : 0.04%			(125,903,435)	
	合計時価比率 : 0.04%				
合計				276,129,010,449	
				(276,129,010,449)	

(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24年2月27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	518,848.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.00	594,771.060	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	590,706.00	1,113,619.060	
	組入時価比率 : 0.02%		(71,973,200)	
	合計時価比率 : 0.03%			
	MIRVAC GROUP	612,711.00	729,126.090	
	CFS RETAIL PROPERTY	338,821.00	606,489.590	
	GPT GROUP	292,236.00	908,853.960	
	LEND LEASE GROUP	97,048.00	735,623.840	

	STOCKLAND	357,887.00	1,116,607.440	
	WESTFIELD GROUP	354,089.00	3,098,278.750	
	DEXUS PROPERTY GROUP	873,123.00	790,176.310	
	GOODMAN GROUP	1,183,581.00	792,999.270	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	418,064.00	1,028,437.440	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 9	4,527,560.00	9,806,592.690	
	組入時価比率 : 0.29%		(850,819,982)	
	合計時価比率 : 0.30%			
投資信託受益証券計			922,793,182	
			(922,793,182)	
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	20,951.00	2,149,991.620	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	165,880.00	2,758,584.400	
	PROLOGIS INC	75,195.00	2,547,606.600	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,805.00	1,836,065.000	
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	532,113.320	
	EQUITY RESIDENTIAL	44,402.00	2,577,980.120	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,146.00	984,872.220	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	72,923.00	1,220,001.790	
	HCP INC	66,067.00	2,581,898.360	
	HEALTH CARE REIT INC	30,480.00	1,655,064.000	
	RAYONIER INC	16,734.00	746,001.720	
	KIMCO REALTY	65,111.00	1,217,575.700	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.00	551,687.500	
	THE MACERICH COMPANY	19,817.00	1,076,855.780	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	107,557.00	1,718,760.860	
	PLUM CREEK TIMBER CO	19,827.00	774,244.350	
	REGENCY	15,096.00	648,826.080	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,531.00	6,358,926.460	
	PUBLIC STORAGE	22,432.00	3,075,875.840	
	VENTAS INC	42,850.00	2,399,600.000	
	VORNADO REALTY TRUST	24,478.00	2,074,020.940	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	16,583.00	1,173,910.570	
	AMERICAN TOWER CORP	60,102.00	3,856,144.320	
米ドル小計	銘柄数 : 23	1,011,334.00	44,516,607.550	
	組入時価比率 : 1.25%		(3,618,755,028)	
	合計時価比率 : 1.29%			
	BRITISH LAND CO PLC	99,446.00	476,147.440	
	HAMMERSON PLC	101,418.00	405,773.410	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,202.00	740,642.690	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	115,270.00	390,534.760	
	SEGRO PLC	153,729.00	362,185.520	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	578,065.00	2,375,283.820	
	組入時価比率 : 0.11%		(306,554,130)	
	合計時価比率 : 0.11%			
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	30,249.00	529,962.480	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	6,464.00	152,550.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.00	421,529.360	



カナダドル小計	銘柄数：3	52,477.00	1,104,042.240	
	組入時価比率：0.03%		(89,692,392)	
	合計時価比率：0.03%			
	GECINA SA	4,806.00	352,712.340	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	14,804.00	2,152,501.600	
	KLEPIERRE	11,955.00	283,213.950	
	FONCIERE DES REGIONS	5,785.00	319,794.800	
	CORIO NV	12,621.00	454,419.100	
ユーロ小計	銘柄数：5	49,971.00	3,562,641.790	
	組入時価比率：0.13%		(389,788,638)	
	合計時価比率：0.14%			
	LINK REIT/THE	407,000.00	11,701,250.000	
香港ドル小計	銘柄数：1	407,000.00	11,701,250.000	
	組入時価比率：0.04%		(122,629,100)	
	合計時価比率：0.04%			
投資証券計			4,527,419,288	
			(4,527,419,288)	
合計			5,450,212,470	
			(5,450,212,470)	

(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 563銘柄	54.44%	55.89%
米ドル	投資証券 23銘柄	1.25%	1.29%
英ポンド	株式 98銘柄	10.30%	10.57%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.11%	0.11%
カナダドル	株式 99銘柄	5.49%	5.63%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.03%	0.03%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.90%	4.01%
スウェーデンクローネ	株式 34銘柄	1.50%	1.54%
ユーロ	株式 233銘柄	12.90%	13.24%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.13%	0.14%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	0.53%	0.55%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.45%	0.47%
香港ドル	株式 39銘柄	1.30%	1.33%
香港ドル	投資証券 1銘柄	0.04%	0.04%
シンガポール・ドル	株式 27銘柄	0.76%	0.78%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.02%	0.03%
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.27%	0.28%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	3.63%	3.73%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 9銘柄	0.29%	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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		537,983,640	1,197,816,695
国債証券		326,745,866,100	313,595,649,900
地方債証券		29,078,501,587	27,696,332,011
特殊債券		40,027,224,178	34,939,426,144
社債券		33,890,146,290	28,416,632,080
未収利息		1,704,114,684	1,642,793,339
前払費用		68,119,969	54,719,672
流動資産合計		432,051,956,448	407,543,369,841
資産合計		432,051,956,448	407,543,369,841
負債の部			
流動負債			
未払金		3,013,767,000	-
未払解約金		21,542,000	13,129,000
流動負債合計		3,035,309,000	13,129,000
負債合計		3,035,309,000	13,129,000
純資産の部			
元本等			
元本		385,632,006,164	356,921,096,490
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		43,384,641,284	50,609,144,351
元本等合計		429,016,647,448	407,530,240,841
純資産合計		429,016,647,448	407,530,240,841
負債純資産合計		432,051,956,448	407,543,369,841

## 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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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。	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24年2月15日から平成25年2月14日までとなっております。
----------------------------	---	---

## (追加情報)

自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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23年2月25日現在	平成24年2月27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	392,786,689,803円	385,632,006,164円
同期中追加設定元本額	65,036,938,109円	44,494,667,996円
同期中解約元本額	72,191,621,748円	73,205,577,670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	3,209,564,465円	5,033,974,984円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	7,432,091,062円	8,966,183,926円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	2,562,878,656円	2,757,718,808円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	4,104,287,669円	4,242,134,327円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,686,301,944円	1,648,530,293円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,172,809,174円	1,167,016,274円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,169,078,848円	1,150,779,054円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	148,687,126円	143,628,591円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	218,593,777円	185,379,315円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,030,055,853円	2,064,965,231円

マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	292,774円	7,182,278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)	17,805,464,716円	19,104,444,887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)	111,008,492円	110,129,562円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	889,437,282円	763,698,419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)	13,048,880,654円	11,428,923,094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)	740,697,687円	629,467,053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)	500,164,300円	442,339,155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)	1,226,743,288円	1,088,692,088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)	568,055,346円	499,286,789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)	408,045,160円	353,805,886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)	30,634,046,472円	27,266,821,480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)	10,213,725,233円	9,005,152,488円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	14,121,576,912円	12,539,104,738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)	5,360,357,730円	4,592,419,664円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	8,413,141,766円	7,075,042,233円

D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A（適格機関投資 家限定）	1,902,588,560円	1,651,151,713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）	6,686,340,545円	5,970,831,488円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A（適格 機関投資家限定）	8,176,856,086円	7,307,557,323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）	14,637,990,302円	13,668,900,760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）	745,905,317円	642,937,364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）	622,553,631円	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）	15,005,351,997円	13,412,426,041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）	7,436,743,261円	6,699,998,806円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A（適格機関投資家限定）	1,559,111,528円	1,440,002,445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）	111,783,779,828円	101,681,065,714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）	2,831,884,536円	2,460,295,612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）	10,182,701,262円	9,401,173,962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）	33,845,447,022円	30,976,383,878円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	2,322,962,143円	2,150,041,204円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	245,550円	233,119円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	153,891円	143,218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）	36,916,578,873円	33,982,118,741円
D I A M世界バランス2 5 V A （適格機関投資家限定）	762,044,075円	902,438,434円
D I A M国内バランス3 0 V A （適格機関投資家限定）	188,677,518円	203,014,261円

D I A Mバランス 2 0 V A（適格機関投資家限定）	2,207,560,636円	2,063,045,236円
D I A Mバランス 4 0 V A（適格機関投資家限定）	321,225円	308,796円
D I A Mバランス 6 0 V A（適格機関投資家限定）	235,111円	220,877円
（合 計）	385,632,006,164円	356,921,096,490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	385,632,006,164口	356,921,096,490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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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。  (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。	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,355,777,400	127,175,800
地方債証券	54,706,495	3,164,829
特殊債券	76,573,589	2,952,568
社債券	37,809,340	6,853,840
合計	1,524,866,824	114,204,563

(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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.1125円	1.1418円
（1万口当たり純資産額）	（11,125円）	（11,418円）

[前](#) [次](#)

## 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24年2月27日現在

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	3 0 2 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,001,960,000	
	3 0 3 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,501,590,000	
	3 0 4 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,002,280,000	
	3 0 5 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,003,660,000	
	3 0 6 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,002,740,000	
	3 0 7 回 利付国庫債券（2年）	2,200,000,000	2,203,036,000	
	3 0 8 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,499,880,000	
	3 0 9 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,499,865,000	
	3 1 0 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,003,240,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5年）	4,900,000,000	4,935,770,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5年）	4,200,000,000	4,276,272,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5年）	4,600,000,000	4,671,070,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,550,120,000	
	8 1 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,564,035,000	
	8 3 回 利付国庫債券（5年）	3,400,000,000	3,461,710,000	
	8 5 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,551,730,000	
	8 7 回 利付国庫債券（5年）	3,800,000,000	3,839,292,000	
	8 8 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,537,205,000	
	8 9 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,533,255,000	
	9 1 回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,712,291,000	
	9 2 回 利付国庫債券（5年）	3,000,000,000	3,011,100,000	
	9 3 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,052,800,000	
	9 5 回 利付国庫債券（5年）	2,000,000,000	2,028,480,000	
	9 6 回 利付国庫債券（5年）	1,500,000,000	1,515,345,000	
	9 7 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,525,830,000	
	9 9 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,025,850,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券（5年）	2,000,000,000	2,009,460,000	
	2 回 利付国庫債券（40年）	600,000,000	616,350,000	
	3 回 利付国庫債券（40年）	1,000,000,000	1,021,150,000	
	4 回 利付国庫債券（40年）	700,000,000	711,200,000	
	2 4 7 回 利付国庫債券（10年）	700,000,000	705,110,000	
	2 5 0 回 利付国庫債券（10年）	2,060,000,000	2,070,712,000	
	2 5 4 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,754,297,000	
	2 5 6 回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,558,550,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,024,570,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券（10年）	2,100,000,000	2,172,156,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,801,817,000	

266回	利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,831,350,000
269回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,395,000
270回	利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,451,968,000
272回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,189,355,000
274回	利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,516,400,000
277回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,163,710,000
280回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,996,084,000
282回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,618,008,000
284回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,306,367,000
285回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,809,915,000
286回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,766,210,000
288回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,860,640,000
289回	利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,355,881,000
290回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,382,080,000
293回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,410,450,000
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,253,920,000
297回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,382,848,000
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,254,504,000
301回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	4,043,542,000
303回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,957,640,000
305回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,502,573,000
306回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,211,800,000
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,877,382,000
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,053,900,000
310回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,573,890,000
312回	利付国庫債券(10年)	4,700,000,000	4,844,666,000
313回	利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,740,175,000
315回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,128,750,000
317回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,563,090,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,205,784,000
319回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,036,270,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	117,008,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	110,781,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	218,210,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,286,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	214,640,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	221,168,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	326,838,000
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	501,510,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	393,536,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	315,939,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	310,365,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	553,030,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	224,964,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	449,972,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	221,190,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	891,881,200
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	217,488,000

20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	337,248,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	543,015,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	528,768,800	
23回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	450,000,000	
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	674,970,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	650,328,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,103,590,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,012,041,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	900,112,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,436,266,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,626,090,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,274,328,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,731,360,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,828,242,000	
34回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,116,260,000	
35回	利付国庫債券(30年)	2,300,000,000	2,328,106,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	689,736,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	451,596,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	802,267,200	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	912,568,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	1,003,336,200	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,018,557,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	557,360,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,059,506,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	570,175,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	849,591,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	658,086,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	608,091,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	780,584,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	887,646,600	
57回	利付国庫債券(20年)	830,000,000	900,616,400	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	650,934,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,022,630,400	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	791,720,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	965,470,000	
64回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	864,728,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,186,977,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,400,230,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,415,362,500	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,370,512,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,505,064,200	
75回	利付国庫債券(20年)	1,340,000,000	1,464,512,800	
78回	利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,654,532,000	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,509,466,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,741,664,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,902,775,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,887,952,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,752,656,000	

	9 2 回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,836,918,000	
	9 3 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,065,320,000	
	9 4 回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	863,176,000	
	9 5 回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,877,446,000	
	9 7 回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,634,490,000	
	9 9 回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,718,256,000	
	1 0 0 回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,955,412,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,781,632,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,925,352,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,136,680,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,074,820,000	
	1 1 1 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,377,254,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,341,130,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,125,320,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,798,900,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,253,748,000	
	1 1 9 回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,519,875,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,260,456,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,328,700,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,576,376,000	
	1 2 8 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,227,744,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,007,210,000	
	1 3 0 回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,516,375,000	
	1 3 2 回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	692,300,000	
国債証券計			313,595,649,900	
地方債証券	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	151,020,680	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	207,660,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	167,239,710	
	6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	206,650,000	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,408,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	206,760,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	208,052,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	206,958,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,479,260	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	207,088,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,476,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	104,972,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	515,953,360	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,171,531	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	106,707,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	213,136,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	214,110,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	160,255,500	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	106,979,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	217,175,200	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	315,909,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	319,377,000	

680回 東京都公募公債	200,000,000	209,484,000	
685回 東京都公募公債	500,000,000	512,450,000	
688回 東京都公募公債	200,000,000	201,434,000	
15年度2回 北海道公募公債	203,000,000	205,433,970	
16年度11回 北海道公募公債	250,000,000	257,532,500	
18年度4回 北海道公募公債	190,500,000	203,492,100	
18年度6回 北海道公募公債	100,000,000	107,477,000	
19年度4回 北海道公募公債	300,000,000	323,400,000	
21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	211,918,000	
125回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,558,000	
126回 神奈川県公募公債	178,870,000	183,991,048	
127回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,902,000	
128回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,376,000	
130回 神奈川県公募公債	156,200,000	161,613,892	
135回 神奈川県公募公債	200,000,000	209,654,000	
136回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,626,000	
166回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,331,000	
261回 大阪府公募公債	129,000,000	131,964,420	
278回 大阪府公募公債	200,000,000	206,434,000	
285回 大阪府公募公債	100,000,000	104,359,000	
286回 大阪府公募公債	200,000,000	208,814,000	
289回 大阪府公募公債	200,000,000	211,652,000	
293回 大阪府公募公債	200,000,000	215,040,000	
301回 大阪府公募公債	100,000,000	106,930,000	
310回 大阪府公募公債	240,000,000	254,844,000	
336回 大阪府公募公債	200,000,000	209,308,000	
1回 大阪府公募公債 7年	500,000,000	511,680,000	
15年度3回 京都府公募公債	219,300,000	224,596,095	
16年度2回 京都府公募公債	100,000,000	103,368,000	
18年度1回 京都府公募公債	100,000,000	106,368,000	
15年度1回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,547,000	
16年度4回 兵庫県公募公債	251,970,000	259,672,722	
16年度8回 兵庫県公募公債	111,500,000	116,082,650	
17年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	207,018,000	
17年度9回 兵庫県公募公債	306,000,000	320,415,660	
17年度13回 兵庫県公募公債	105,000,000	110,638,500	
18年度1回 兵庫県公募公債	120,000,000	127,042,800	
15年度3回 静岡県公募公債	116,130,000	118,502,535	
18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	138,758,796	
21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	206,134,890	
15年度1回 愛知県公募公債	303,600,000	309,802,548	
16年度2回 愛知県公募公債	200,000,000	207,474,000	
18年度2回 愛知県公募公債	160,300,000	171,759,847	
20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	106,561,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	205,396,000	
16年度2回 広島県公募公債	200,000,000	207,746,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	208,574,000	
15年度3回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,250,000	

	17年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	206,856,000	
	18年度1回 埼玉県公募公債	200,000,000	212,216,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	464,393,600	
	23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	203,988,000	
	16年度3回 福岡県公募公債	131,040,000	135,285,696	
	17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	103,964,000	
	17年度5回 福岡県公募公債	100,000,000	104,684,000	
	18年度1回 福岡県公募公債	104,000,000	112,143,200	
	21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	212,334,000	
	15年度4回 千葉県公募公債	100,000,000	102,328,000	
	16年度3回 千葉県公募公債	100,000,000	104,252,000	
	16年度8回 千葉県公募公債	200,000,000	206,486,000	
	17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	206,954,000	
	19年度5回 千葉県公募公債	300,000,000	323,256,000	
	21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	210,214,000	
	18年度2回 新潟県公募公債	169,000,000	180,882,390	
	2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,530,000	
	3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,435,000	
	8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,900,000	
	9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	215,058,900	
	11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,738,000	
	12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	133,299,400	
	13回 共同発行市場公募地方債	221,000,000	227,287,450	
	18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,628,000	
	19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,842,500	
	20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,560,000	
	21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,113,000	
	23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,243,000	
	25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	315,184,160	
	28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,084,000	
	29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,922,000	
	31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,896,000	
	32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,816,000	
	33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,985,000	
	35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,262,000	
	36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,187,000	
	37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	159,150,000	
	38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	181,930,600	
	39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	155,796,600	
	40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,527,500	
	47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	172,882,912	
	55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,504,000	
	57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,436,000	
	61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	318,624,000	
	65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,669,000	
	75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	534,415,000	
	80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	741,818,000	
	94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,719,000	

	17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	103,291,000	
	17年度7回 大阪市公募公債	200,000,000	207,510,000	
	17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	209,116,000	
	17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	104,814,000	
	18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	106,786,000	
	18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	161,016,000	
	19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	145,669,050	
	12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,534,000	
	12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	207,068,000	
	12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	373,984,255	
	17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,871,000	
	18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	109,176,984	
	16年度5回 神戸市公募公債	200,000,000	206,620,000	
	17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	108,170,600	
	15年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	204,492,000	
	16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	205,864,000	
	17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	309,885,000	
	22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	206,110,000	
	14年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	100,598,000	
	16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	103,888,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,305,000	
	19回 川崎市公募公債 5年	100,000,000	101,606,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	106,603,000	
	16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	103,310,000	
	16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	103,418,000	
地方債証券計			27,696,332,011	
特殊債券	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	106,145,280	
	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	130,026,600	
	16回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,191,000	
	9回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,076,000	
	13回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,753,000	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,010,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,120,000	
	34回 日本道路・機構承継債	200,000,000	206,962,000	
	319回 政保道路債	132,000,000	133,473,120	
	322回 政保道路債	106,000,000	108,498,420	
	323回 政保道路債	200,000,000	204,876,000	
	324回 政保道路債	200,000,000	204,752,000	
	328回 政保道路債	200,000,000	206,044,000	
	329回 政保道路債	100,000,000	103,352,000	
	333回 政保道路債	300,000,000	311,385,000	
	335回 政保道路債	237,000,000	245,152,800	
	338回 政保道路債	264,000,000	274,578,480	
	339回 政保道路債	301,000,000	312,356,730	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	429,276,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	321,252,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	425,300,000	



	4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	747,544,000	
	3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,376,000	
	5 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	219,947,420	
	8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,712,120	
	9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,525,000	
	1 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	323,216,810	
	1 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	131,163,420	
	1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,689,000	
	2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	400,811,250	
	2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,473,000	
	2 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,410,000	
	3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	320,049,000	
	3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	317,062,350	
	3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	371,210,400	
	4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	357,652,120	
	4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	211,984,000	
	5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,918,000	
	6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,831,780	
	6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	427,967,250	
	7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	632,298,000	

[前](#) [次](#)

平成24年2月27日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
	7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,780,000	
	8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,059,000	
	8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,422,000	
	2 6 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	205,174,000	
	4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	311,181,000	
	8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	304,171,580	
	8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	212,096,340	
	8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	443,180,160	
	8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	617,406,000	
	8 3 9 回 政保公営企業債券	260,000,000	267,836,400	
	8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,439,000	
	8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,076,000	
	8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,634,000	
	8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	271,393,020	
	8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	310,722,000	
	8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	210,715,680	
	8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	316,248,160	
	8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	209,064,000	
	8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	216,890,460	
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	253,789,320	
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,278,000	
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	213,314,000	
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,842,750	
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	109,009,440	
	8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	514,756,720	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	690,431,070	
	3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,074,140	
	5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,375,000	
	8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,765,000	
	1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,845,000	
	1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,848,000	
	2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,046,000	
	1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,056,000	
	1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,654,000	
	1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,371,000	
	1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,507,000	
	2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	214,342,000	
	2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	321,957,000	
	1 9 1 回 政保首都高速道路債	113,000,000	117,460,110	
	1 4 2 回 政保阪神高速道路債	100,000,000	103,417,000	
	1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	111,015,710	

5回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	103,162,000	
176回 政保中小企業債券	100,000,000	102,239,000	
180回 政保中小企業債券	142,000,000	147,560,720	
186回 政保中小企業債券	104,000,000	107,878,160	
26回 中小企業債券	400,000,000	409,188,000	
15回 国際協力銀行債券	200,000,000	206,888,000	
12回 国際協力銀行債券	200,000,000	205,590,000	
2回 都市再生債券	100,000,000	104,242,000	
19回 都市再生機構債券	200,000,000	216,648,000	
23回 都市再生機構債券	200,000,000	203,450,000	
2回 本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	102,875,000	
6回 政保中部国際空港債券	100,000,000	102,584,000	
11回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,618,000	
32回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,930,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,503,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	121,869,000	129,443,158	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	84,274,000	88,948,678	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	126,555,000	134,096,412	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	147,279,000	155,860,947	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	65,127,000	68,664,698	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	333,785,000	347,994,227	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	79,008,000	82,173,060	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,374,000	64,122,017	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	233,296,000	248,203,614	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	186,405,000	196,813,855	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	319,540,000	336,488,401	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	410,050,000	427,936,381	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	723,600,000	748,752,336	
14回 政保国民生活債券	132,000,000	136,481,400	
704号 利付商工債	200,000,000	204,290,000	
706号 利付商工債	300,000,000	306,975,000	
714号 利付商工債	300,000,000	305,325,000	
723号 利付商工債	300,000,000	301,917,000	
732号 利付商工債	200,000,000	201,826,000	
695号 利付農林債	200,000,000	202,068,000	
698号 利付農林債	300,000,000	305,259,000	
701号 利付農林債	200,000,000	203,926,000	
709号 利付農林債	400,000,000	408,188,000	
713号 利付農林債	300,000,000	304,167,000	

	717号 利附農林債	300,000,000	304,014,000	
	721号 利附農林債	120,000,000	121,065,600	
	222回 利附信金中金債	200,000,000	202,888,000	
	223回 利附信金中金債	300,000,000	305,025,000	
	226回 利附信金中金債	300,000,000	305,268,000	
	229回 利附信金中金債	400,000,000	408,488,000	
	233回 利附信金中金債	300,000,000	307,140,000	
	236回 利附信金中金債	300,000,000	304,698,000	
	241回 利附信金中金債	300,000,000	303,663,000	
	139号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,447,000	
	1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	106,035,860	
	2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,728,820	
	4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,955,600	
	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	182,581,700	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	321,840,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	215,160,000	
	1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	211,021,860	
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	277,189,570	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	125,304,660	
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	311,571,000	
特殊債券計			34,939,426,144	
社債券	345回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,475,000	
	9回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	101,482,000	
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	101,162,000	
	14回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	102,547,000	
	2回 JPモルガン・チェース劣後債	100,000,000	99,318,000	
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	100,357,000	
	16回 シティグループ円貨社債	100,000,000	98,927,000	
	22回 シティグループ円貨社債	200,000,000	201,902,000	
	7回 ウェストパック銀行円貨社債	100,000,000	100,020,000	
	1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	102,341,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	301,920,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,754,000	
	5回 日本たばこ産業社債	100,000,000	101,952,000	
	25回 住友化学工業社債	100,000,000	102,196,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	105,124,000	
	34回 三井化学社債	100,000,000	105,354,000	
	2回 花王社債	100,000,000	102,145,000	
	24回 新日本石油社債	100,000,000	103,630,000	
	8回 旭硝子社債	100,000,000	100,534,000	
	29回 新日本製鐵社債	100,000,000	113,928,000	
	52回 新日本製鐵社債	100,000,000	102,894,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	104,712,000	
	13回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	101,554,000	

15回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,774,000	
12回 日立製作所社債	100,000,000	100,563,000	
25回 富士通社債	100,000,000	103,602,000	
7回 パナソニック社債	200,000,000	204,532,000	
10回 パナソニック社債	200,000,000	201,796,000	
11回 パナソニック社債	100,000,000	101,854,000	
24回 シャープ社債	200,000,000	202,246,000	
17回 ソニー社債	100,000,000	103,716,000	
3回 パナソニック電工社債	100,000,000	104,042,000	
19回 三菱重工業社債	100,000,000	107,004,000	
49回 日産自動車社債	100,000,000	103,902,000	
51回 日産自動車社債	100,000,000	101,146,000	
7回 トヨタ自動車社債	300,000,000	305,922,000	
9回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,778,000	
49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	109,409,000	
58回 伊藤忠商事社債	100,000,000	100,596,000	
77回 丸紅社債	100,000,000	101,160,000	
45回 三井物産社債	100,000,000	100,610,000	
16回 三菱商事社債	100,000,000	105,209,000	
14回 クレディセゾン社債	100,000,000	100,716,000	
1回 みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	205,486,000	
7回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	107,697,000	
13回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,012,000	
14回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	102,153,000	
15回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,050,000	
18回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,632,000	
20回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,170,000	
24回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,258,000	
100回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,122,000	
106回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	304,689,000	
112回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,254,000	
114回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,360,000	
3回2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	200,000,000	202,172,000	
6回 東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,330,000	
8回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	206,924,000	
12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,670,000	
28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	203,174,000	
11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,720,000	
4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,866,000	
6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,751,000	
4回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,921,000	
7回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	104,873,000	
5回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	105,667,000	
45回 三井住友銀行社債	200,000,000	203,712,000	
47回 三井住友銀行社債	200,000,000	203,102,000	
50回 三井住友銀行社債	200,000,000	201,166,000	

5 1 回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,030,000
6 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	101,717,000
7 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,849,000
8 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,653,000
9 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,816,000
1 1 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,782,000
2 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	214,804,000
1 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,828,000
6 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,994,000
1 0 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,530,000
1 4 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,710,000
3 8 回	NTTファイナンス社債	200,000,000	201,236,000
1 7 回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,997,000
1 9 回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,560,000
2 3 回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	320,595,000
4 0 回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,795,000
1 1 8 回	オリックス社債	100,000,000	103,285,000
1 4 4 回	オリックス社債	100,000,000	100,968,000
1 4 8 回	オリックス社債	200,000,000	200,418,000
1 2 回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,509,000
8 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,035,000
1 5 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,869,000
1 7 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,576,000
2 0 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	100,369,000
2 2 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,298,000
2 4 回	三井不動産社債	100,000,000	104,722,000
3 1 回	三井不動産社債	100,000,000	103,426,000
6 6 回	三菱地所社債	100,000,000	100,665,000
7 9 回	三菱地所社債	200,000,000	213,070,000
9 0 回	三菱地所社債	100,000,000	106,194,000
7 3 回	住友不動産社債	100,000,000	100,897,000
4 1 回	小田急電鉄社債	100,000,000	107,749,000
2 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	227,406,000
7 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,991,000
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,345,000
3 1 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	205,394,000
4 1 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,268,000
3 回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,260,000
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,762,000
1 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,684,000
2 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	229,184,000
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,637,000
1 0 回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	199,188,400
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,241,000
3 回	東京地下鉄社債	100,000,000	106,647,000
4 8 回	日本電信電話社債	400,000,000	413,676,000
5 0 回	日本電信電話社債	100,000,000	104,375,000
5 1 回	日本電信電話社債	200,000,000	214,064,000

5 8 回	日本電信電話社債	100,000,000	101,721,000	
5 回	K D D I 社債	100,000,000	113,505,000	
1 6 回	N T T ドコモ社債	200,000,000	203,728,000	
4 5 5 回	東京電力社債	200,000,000	154,380,000	
5 1 1 回	東京電力社債	100,000,000	90,885,000	
5 1 6 回	東京電力社債	100,000,000	86,812,000	
5 1 9 回	東京電力社債	372,000,000	315,173,280	
5 4 2 回	東京電力社債	500,000,000	382,560,000	
4 0 7 回	中部電力社債	100,000,000	109,191,000	
4 0 9 回	中部電力社債	300,000,000	339,900,000	
4 6 3 回	中部電力社債	200,000,000	200,838,000	
4 6 7 回	中部電力社債	100,000,000	102,725,000	
4 6 8 回	中部電力社債	100,000,000	102,517,000	
4 7 1 回	中部電力社債	300,000,000	306,690,000	
4 7 6 回	中部電力社債	100,000,000	106,979,000	
4 7 8 回	中部電力社債	100,000,000	104,990,000	
4 8 0 回	中部電力社債	200,000,000	209,500,000	
4 8 4 回	中部電力社債	200,000,000	204,370,000	
4 8 7 回	中部電力社債	140,000,000	141,653,400	
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	498,365,000	
4 1 0 回	関西電力社債	300,000,000	318,225,000	
4 2 7 回	関西電力社債	100,000,000	101,320,000	
4 3 3 回	関西電力社債	200,000,000	204,026,000	
4 4 1 回	関西電力社債	200,000,000	205,290,000	
4 4 6 回	関西電力社債	200,000,000	208,468,000	
2 9 8 回	中国電力社債	200,000,000	222,342,000	
3 1 0 回	中国電力社債	200,000,000	225,068,000	
3 4 1 回	中国電力社債	100,000,000	102,340,000	
3 5 0 回	中国電力社債	200,000,000	205,366,000	
2 4 5 回	北陸電力社債	200,000,000	220,888,000	
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	108,390,000	
2 8 1 回	北陸電力社債	200,000,000	212,052,000	
2 8 9 回	北陸電力社債	300,000,000	307,176,000	
3 6 8 回	東北電力社債	300,000,000	326,748,000	
3 7 5 回	東北電力社債	100,000,000	109,832,000	
3 8 0 回	東北電力社債	300,000,000	337,152,000	
4 2 0 回	東北電力社債	100,000,000	101,447,000	
4 2 7 回	東北電力社債	200,000,000	204,770,000	
4 3 2 回	東北電力社債	500,000,000	525,870,000	
2 3 7 回	四国電力社債	100,000,000	106,557,000	
2 5 7 回	四国電力社債	200,000,000	204,858,000	
3 7 4 回	九州電力社債	300,000,000	304,617,000	
3 8 2 回	九州電力社債	100,000,000	102,576,000	
3 8 3 回	九州電力社債	100,000,000	102,677,000	
3 8 7 回	九州電力社債	200,000,000	207,756,000	
2 5 7 回	北海道電力社債	200,000,000	225,324,000	
2 8 2 回	北海道電力社債	200,000,000	203,306,000	
2 8 4 回	北海道電力社債	500,000,000	514,950,000	

	286回 北海道電力社債	100,000,000	102,551,000	
	2回 電源開発社債	100,000,000	101,462,000	
	4回 電源開発社債	200,000,000	202,738,000	
	6回 電源開発社債	100,000,000	102,392,000	
	14回 電源開発社債	100,000,000	103,035,000	
	17回 電源開発社債	100,000,000	105,288,000	
	14回 東京ガス社債	100,000,000	111,583,000	
	24回 東京瓦斯社債	200,000,000	204,086,000	
	9回 大阪ガス社債	100,000,000	113,563,000	
	24回 大阪瓦斯社債	100,000,000	103,494,000	
	27回 大阪瓦斯社債	100,000,000	101,660,000	
	20回 NTTデータ社債	100,000,000	101,102,000	
社債券計			28,416,632,080	
合計			404,648,040,135	

## 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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		5,116,823,307	3,077,977,085
コール・ローン		191,885,361	170,818,958
国債証券		385,269,775,107	381,589,348,132
派生商品評価勘定		950,920	8,325
未収入金		-	3,178,093,238
未収利息		4,703,378,656	4,274,920,627
前払費用		244,705,957	222,700,925
流動資産合計		395,527,519,308	392,513,867,290
資産合計		395,527,519,308	392,513,867,290
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		348,000	44,922,458
未払解約金		222,431,000	2,339,559,000
流動負債合計		222,779,000	2,384,481,458
負債合計		222,779,000	2,384,481,458
純資産の部			
元本等			
元本		345,284,212,026	319,525,161,815
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		50,020,528,282	70,604,224,017
元本等合計		395,304,740,308	390,129,385,832
純資産合計		395,304,740,308	390,129,385,832
負債純資産合計		395,527,519,308	392,513,867,290

## 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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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。  (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。	(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24年2月22日から平成25年2月21日までとなっております。

## （追加情報）

自平成22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27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23年2月25日現在	平成24年2月27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	340,044,873,488円	345,284,212,026円
同期中追加設定元本額	47,591,167,052円	35,103,364,445円
同期中解約元本額	42,351,828,514円	60,862,414,656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	4,617,711,048円	1,953,141,110円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金>	3,569,552,218円	3,982,058,888円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	297,561,636円	336,794,400円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,083,613,768円	1,173,586,371円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,181,500,654円	1,199,564,903円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	323,613,584円	337,866,678円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	632,799,046円	657,766,156円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	424,763,594円	412,227,678円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	174,192,617円	159,116,667円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,611,183,169円	1,773,631,342円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	839,479円	8,527,564円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	8,675,277,313円	6,097,618,079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）	4,057,469,028円	8,286,867,956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）	7,820,305,763円	6,668,324,646円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	947,377,584円	945,973,519円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	264,971,288円	230,310,324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）	51,086,745,591円	46,194,708,815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）	2,902,426,874円	2,542,043,147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)	489,729,476円	443,302,387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)	800,269,682円	732,462,963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)	219,257,981円	199,161,902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)	99,827,730円	89,205,716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)	29,965,120,361円	27,504,228,485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)	6,666,128,697円	6,060,367,170円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	12,086,222,523円	10,941,303,721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)	5,681,457,193円	5,010,519,997円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	8,230,245,027円	7,144,069,005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)	3,108,153,931円	2,749,354,919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)	9,159,870,982円	8,322,878,783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)	10,661,402,167円	9,754,205,136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)	52,525,580,188円	50,514,998,824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)	270,088,311円	258,963,813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)	610,881,068円	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)	7,332,934,639円	6,640,123,954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)	16,388,291,644円	14,994,966,188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)	288,332,022円	288,419,031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）	27,298,720,049円	25,288,406,328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）	33,111,826,046円	30,916,176,543円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	851,719,069円	788,474,940円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	240,989円	234,507円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	150,746円	145,038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）	28,895,467,355円	27,049,038,677円
D I A M世界バランス2 5 V A （適格機関投資家限定）	226,705,158円	271,105,150円
D I A Mバランス2 0 V A（適 格機関投資家限定）	643,321,327円	602,563,991円
D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	225,302円	222,335円
D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	138,109円	134,069円
（合 計）	345,284,212,026円	319,525,161,815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	345,284,212,026口	319,525,161,815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22年2月26日 至平成23年2月25日	自平成23年2月26日 至平成24年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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。	(1)国債証券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,729,867,007	979,688,754
合計	1,729,867,007	979,688,754

(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)

(通貨関連)

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
-----	---------------	---	-------------	---------

平成24年2月27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	70,572,480	-	71,482,400	909,920
	ノルウェークローネ	16,203,225	-	16,194,900	8,325
	ユーロ	1,004,828,595	-	1,027,266,000	22,437,405
	英ポンド	210,461,917	-	215,513,500	5,051,583
	米ドル	1,051,495,650	-	1,068,019,200	16,523,550
合 計		2,353,561,867	-	2,398,476,000	44,914,133

（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23年2月25日現在	平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.1449円	1.2210円
（1万口当たり純資産額）	（11,449円）	（12,210円）

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



種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 0.625 01/31/13	15,000,000.00	15,061,500.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	33,137,280.000	
	US T N/B 1.375 03/15/13	28,000,000.00	28,343,280.000	
	US T N/B 1.75 04/15/13	25,000,000.00	25,432,500.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	30,202,920.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	32,000,000.00	33,326,080.000	
	US T N/B 1.0 07/15/13	40,000,000.00	40,415,600.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	37,050,650.000	
	US T N/B 0.125 08/31/13	35,000,000.00	34,927,200.000	
	US T N/B 0.5 10/15/13	30,000,000.00	30,105,300.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	42,706,000.000	
	US T N/B 0.75 12/15/13	25,000,000.00	25,195,250.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	42,890,400.000	
	US T N/B 1.75 03/31/14	25,000,000.00	25,739,250.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	38,406,900.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	31,588,800.000	
	US T N/B 0.75 06/15/14	10,000,000.00	10,089,400.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,653,280.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	29,421,840.000	
	US T N/B 0.25 09/15/14	20,000,000.00	19,925,600.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	33,110,100.000	
	US T N/B 2.125 11/30/14	25,000,000.00	26,157,000.000	
	US T N/B 2.625 12/31/14	16,000,000.00	16,984,320.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.00	22,089,000.000	
	US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.00	24,309,850.000	
	US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.00	21,264,800.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.00	20,079,720.000	
	US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.00	15,672,600.000	
	US T N/B 1.75 07/31/15	8,000,000.00	8,327,760.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.00	16,899,600.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	15,000,000.00	15,366,150.000	
	US T N/B 1.25 09/30/15	13,000,000.00	13,307,710.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.00	20,577,600.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	15,000,000.00	15,423,000.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.00	18,413,600.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	21,370,200.000	
	US T N/B 2.0 04/30/16	15,000,000.00	15,800,850.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.00	12,722,600.000	
	US T N/B 1.75 05/31/16	20,000,000.00	20,864,000.000	
	US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.00	27,669,750.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.00	20,063,910.000	
	US T N/B 1.0 08/31/16	20,000,000.00	20,195,200.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	21,985,800.000	
	US T N/B 1.0 10/31/16	15,000,000.00	15,127,650.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	18,337,760.000	

	US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.00	21,784,200.000	
	US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.00	22,268,600.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	14,182,440.000	
	US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.00	22,062,400.000	
	US T N/B 3.125 04/30/17	10,000,000.00	11,105,400.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,800,000.000	
	US T N/B 2.5 06/30/17	13,000,000.00	14,030,770.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.00	18,005,850.000	
	US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.00	8,363,120.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	8,000,000.00	8,354,960.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	14,000,000.00	16,478,420.000	
	US T N/B 2.25 11/30/17	14,000,000.00	14,918,680.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.00	15,913,940.000	
	US T N/B 2.875 03/31/18	5,000,000.00	5,507,400.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.00	9,298,720.000	
	US T N/B 2.375 06/30/18	18,000,000.00	19,267,020.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.00	14,088,720.000	
	US T N/B 1.375 09/30/18	12,000,000.00	12,049,680.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	20,000,000.00	23,164,000.000	
	US T N/B 1.375 11/30/18	15,000,000.00	15,032,700.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.00	6,026,560.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	11,000,000.00	12,013,100.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	15,000,000.00	16,756,500.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.00	5,911,240.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	9,000,000.00	10,370,340.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	14,000,000.00	15,897,560.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	20,000,000.00	23,101,400.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	16,000,000.00	18,331,200.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	4,000,000.00	6,270,920.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	17,000,000.00	18,260,380.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	22,000,000.00	23,582,900.000	
	US T N/B 3.625 02/15/21	24,000,000.00	27,710,400.000	
	US T N/B 3.125 05/15/21	25,000,000.00	27,759,750.000	
	US T N/B 2.125 08/15/21	20,000,000.00	20,401,400.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.00	9,310,260.000	
	US T N/B 2.0 11/15/21	19,000,000.00	19,096,330.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	4,507,710.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	3,000,000.00	4,502,100.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	7,000,000.00	9,938,320.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	2,000,000.00	3,156,400.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	2,000,000.00	3,194,520.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	3,500,000.00	5,318,600.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	4,000,000.00	5,681,840.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	4,477,260.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,512,650.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	2,000,000.00	2,976,560.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	6,000,000.00	8,752,920.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	4,151,460.000	

	US T N/B 5.25 11/15/28	3,000,000.00	4,052,550.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	3,000,000.00	4,059,600.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	2,000,000.00	2,967,500.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	4,000,000.00	6,054,680.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	5,000,000.00	6,964,050.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	8,000,000.00	10,154,960.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	4,000,000.00	5,267,160.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	4,000,000.00	5,453,400.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	5,000,000.00	6,261,300.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	6,000,000.00	7,661,700.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	8,000,000.00	8,693,120.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	9,500,000.00	11,684,240.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	10,000,000.00	12,780,400.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	13,000,000.00	16,308,890.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	12,000,000.00	15,647,760.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	13,000,000.00	16,325,140.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	13,000,000.00	15,052,570.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	14,000,000.00	17,236,380.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	12,000,000.00	15,973,080.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	14,000,000.00	17,603,880.000	
	US T N/B 3.75 08/15/41	13,000,000.00	14,712,230.000	
	US T N/B 3.125 11/15/41	11,000,000.00	11,069,520.000	
米ドル小計	銘柄数 : 115	1,746,000,000.00	1,933,371,270.000	
	組入時価比率 : 40.29%		(157,163,750,538)	
	合計時価比率 : 41.19%			
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	6,000,000.00	6,250,800.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,358,500.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	10,378,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	9,000,000.00	10,042,200.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	9,000,000.00	9,586,800.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	9,170,400.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	3,000,000.00	3,830,100.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	10,500,000.00	11,020,800.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	9,000,000.00	10,269,000.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/17	6,000,000.00	6,227,400.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,247,100.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,500,000.00	6,718,250.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	6,000,000.00	7,222,200.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	8,000,000.00	9,218,400.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.00	7,969,000.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	9,000,000.00	10,341,900.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	4,000,000.00	6,056,800.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	8,500,000.00	9,717,965.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	4,500,000.00	5,247,900.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	6,000,000.00	7,683,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	5,500,000.00	6,555,450.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,000,000.00	5,750,800.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,000,000.00	7,541,400.000	

	UK TREASURY 4.25 06/07/32	6,000,000.00	7,090,800.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	5,000,000.00	6,109,000.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	7,000,000.00	8,283,100.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	6,000,000.00	7,674,000.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	5,000,000.00	5,927,500.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	7,000,000.00	8,308,300.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	6,000,000.00	7,462,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	6,000,000.00	7,235,400.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	5,300,000.00	6,432,080.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,000,000.00	2,209,400.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,000,000.00	7,396,800.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	4,500,000.00	5,346,000.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 35	215,800,000.00	253,879,345.000	
	組入時価比率 : 8.40%		(32,765,668,266)	
	合計時価比率 : 8.59%			
	CANADA 5.25 06/01/13	7,000,000.00	7,366,590.000	
	CANADA 2.5 09/01/13	13,000,000.00	13,279,500.000	
	CANADA 1.5 11/01/13	7,000,000.00	7,049,700.000	
	CANADA 2.0 03/01/14	3,000,000.00	3,054,270.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	10,865,800.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,500,000.00	7,668,300.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.00	8,834,320.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	4,000,000.00	4,254,520.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	7,500,000.00	8,324,475.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	4,000,000.00	4,239,240.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	2,500,000.00	2,508,750.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	3,500,000.00	3,947,650.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	3,500,000.00	4,053,980.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	6,500,000.00	7,385,105.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,500,000.00	5,047,335.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,000,000.00	4,412,200.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,500,000.00	1,585,485.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	1,200,000.00	1,896,192.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,200,000.00	2,119,800.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	1,700,000.00	2,911,641.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	4,500,000.00	6,523,155.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	4,500,000.00	6,774,255.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	5,200,000.00	7,412,028.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	5,500,000.00	7,020,750.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,000,000.00	1,188,140.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 25	121,800,000.00	139,723,181.000	
	組入時価比率 : 2.91%		(11,351,111,224)	
	合計時価比率 : 2.97%			
	SWEDEN 6.75 05/05/14	26,000,000.00	29,186,300.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	23,000,000.00	25,584,280.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	19,294,920.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	19,000,000.00	21,190,320.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	25,000,000.00	29,290,750.000	

	SWEDEN 5.0 12/01/20	27,000,000.00	33,850,440.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	11,000,000.00	12,587,190.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	19,400,000.000	
スウェーデンクローネ 小計	銘柄数 : 8	165,000,000.00	190,384,200.000	
	組入時価比率 : 0.61%		(2,364,571,764)	
	合計時価比率 : 0.62%			
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,500,000.00	2,625,000.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	6,000,000.00	6,490,800.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,196,500.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	5,000,000.00	5,362,500.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	4,500,000.00	4,945,500.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,000,000.00	1,062,900.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	4,000,000.00	4,454,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	4,000,000.00	4,524,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	4,000,000.00	4,477,800.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	5,000,000.00	5,422,500.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,500,000.00	4,731,750.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	2,500,000.00	2,650,000.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,000,000.00	1,037,400.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,800,000.00	3,301,060.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	2,500,000.00	3,370,500.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	4,300,000.00	4,809,550.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	4,000,000.00	4,134,200.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	5,000,000.00	5,220,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	5,000,000.00	5,247,500.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	5,000,000.00	5,315,000.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	5,237,500.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,298,800.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.00	3,063,600.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	5,182,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	5,500,000.00	5,866,300.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	3,500,000.00	3,981,250.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	4,245,880.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	3,500,000.00	3,694,040.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	6,500,000.00	6,683,690.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	4,500,000.00	4,712,355.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	5,000,000.00	5,143,700.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/22	1,500,000.00	1,558,545.000	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.00	1,584,600.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	5,500,000.00	6,439,950.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,500,000.00	6,157,140.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	3,500,000.00	3,540,845.000	
	BUNDESSCHAT 1.5 03/15/13	5,000,000.00	5,069,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	14,500,000.00	15,185,705.000	
	BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13	8,000,000.00	8,064,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	20,000,000.00	21,486,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	17,000,000.00	18,570,800.000	

	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	17,000,000.00	18,621,800.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	18,000,000.00	19,674,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	14,000,000.00	15,551,200.000	
	BUNDESABL 2.75 04/08/16	13,000,000.00	14,099,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	10,000,000.00	11,403,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	10,000,000.00	11,384,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	7,000,000.00	8,198,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	7,000,000.00	8,155,700.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	8,000,000.00	9,494,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	8,000,000.00	9,282,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	8,000,000.00	9,160,800.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	8,000,000.00	9,022,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	7,000,000.00	7,750,400.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	6,000,000.00	6,284,400.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	7,000,000.00	7,447,300.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	6,500,000.00	7,306,650.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	6,000,000.00	6,214,200.000	
	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	4,000,000.00	4,039,600.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	3,500,000.00	5,012,350.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	4,000,000.00	6,074,400.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	5,000,000.00	7,041,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	4,000,000.00	5,199,600.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	3,500,000.00	5,346,250.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	6,100,000.00	8,760,820.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	7,000,000.00	9,583,700.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	8,000,000.00	10,182,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	5,000,000.00	6,714,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	5,500,000.00	7,992,600.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,300,000.00	5,008,210.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	5,000,000.00	5,241,000.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	10,000,000.00	10,300,600.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	12,000,000.00	12,407,400.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	8,000,000.00	8,360,800.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	5,500,000.00	5,588,825.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	7,203,000.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.00	6,019,800.000	
	SPAIN 4.0 07/30/15	1,500,000.00	1,550,055.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	6,000,000.00	5,971,800.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	6,000,000.00	5,959,020.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	4,000,000.00	4,111,920.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	6,000,000.00	5,931,000.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	5,500,000.00	5,904,635.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	5,994,600.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	6,000,000.00	6,088,200.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,500,000.00	5,453,800.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	7,000,000.00	6,755,000.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	6,000,000.00	6,065,400.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	7,500,000.00	7,806,000.000	

	SPAIN 5.85 01/31/22	2,000,000.00	2,118,000.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	5,500,000.00	5,262,400.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,000,000.00	4,610,000.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.00	2,577,000.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	6,500,000.00	6,746,350.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,000,000.00	5,057,250.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,500,000.00	4,428,435.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,500,000.00	3,924,000.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,800,000.00	3,243,300.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	2,500,000.00	2,668,500.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,599,825.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	2,500,000.00	2,775,375.000	
	FINLAND 1.75 04/15/16	3,000,000.00	3,086,100.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	2,000,000.00	2,239,000.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,319,000.000	
	FINLAND 3.375 04/15/20	2,000,000.00	2,176,300.000	
	FINLAND 3.5 04/15/21	1,500,000.00	1,643,850.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	2,800,000.00	3,199,700.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	9,000,000.00	9,353,700.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	19,000,000.00	20,024,100.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,323,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	14,000,000.00	14,961,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	14,000,000.00	15,092,000.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	16,000,000.00	17,128,000.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	17,000,000.00	17,974,780.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	17,000,000.00	18,177,420.000	
	FR TREASURY 2.5 07/25/16	8,000,000.00	8,286,800.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,448,400.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	10,000,000.00	10,915,500.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,930,880.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.00	9,950,670.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.00	8,946,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	9,500,000.00	10,602,285.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.00	4,223,700.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	9,000,000.00	9,719,910.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/20	11,000,000.00	11,627,440.000	
	FRANCE OAT 2.5 10/25/20	10,000,000.00	9,759,500.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	11,000,000.00	11,724,240.000	
	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	10,000,000.00	10,258,700.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	5,980,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,000,000.00	12,151,040.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.00	7,728,840.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/26	8,000,000.00	8,062,400.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	9,000,000.00	11,206,980.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,000,000.00	10,508,480.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	7,000,000.00	8,218,280.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	8,300,000.00	8,807,130.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	7,000,000.00	8,068,900.000	

	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	5,500,000.00	5,884,450.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,800,000.00	3,006,192.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	2,000,000.00	1,997,740.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	2,986,950.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	2,934,810.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,712,690.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,624,790.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	2,000,000.00	1,896,700.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,606,640.000	
	IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.00	1,749,700.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	2,647,170.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	10,000,000.00	10,251,100.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	16,000,000.00	16,353,280.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	18,000,000.00	18,248,940.000	
	ITALY BTPS 3.5 06/01/14	4,000,000.00	4,031,200.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	19,000,000.00	19,435,100.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	11,000,000.00	11,269,500.000	
	ITALY BTPS 3.0 04/15/15	10,000,000.00	9,892,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.00	15,073,500.000	
	ITALY BTPS 3.75 04/15/16	10,000,000.00	9,930,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.00	13,867,000.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	9,000,000.00	8,922,600.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,000,000.00	8,299,200.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	9,000,000.00	8,999,100.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	9,000,000.00	8,937,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,000,000.00	7,799,200.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	8,500,000.00	8,363,150.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	8,000,000.00	7,684,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	7,500,000.00	7,272,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	9,000,000.00	8,572,500.000	
	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	8,000,000.00	7,411,200.000	
	ITALY BTPS 3.75 03/01/21	8,000,000.00	7,250,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	10,000,000.00	8,956,000.000	
	ITALY BTPS 4.75 09/01/21	9,000,000.00	8,664,300.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/22	5,500,000.00	5,337,200.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	8,000,000.00	7,492,000.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.00	5,016,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	7,500,000.00	7,102,950.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/26	5,500,000.00	4,897,200.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	3,500,000.00	3,988,600.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	9,000,000.00	9,486,000.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	10,000,000.00	9,393,000.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	10,500,000.00	10,577,700.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	5,000,000.00	4,894,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,000,000.00	7,164,800.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	9,000,000.00	7,045,200.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	6,500,000.00	5,756,400.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	7,000,000.00	6,173,300.000	



	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	5,000,000.00	5,269,500.000	
	NETHERLANDS 1.0 01/15/14	4,000,000.00	4,044,600.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,534,800.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	5,000,000.00	5,294,000.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,478,200.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,609,500.000	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/17	3,000,000.00	3,169,710.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.00	5,783,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	6,000,000.00	6,832,200.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	4,500,000.00	5,143,500.000	
	NETHERLANDS 3.5 07/15/20	6,000,000.00	6,649,200.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,000,000.00	5,428,000.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,700,500.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	6,113,700.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,500,000.00	5,585,400.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	4,000,000.00	4,924,000.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 201	1,358,200,000.00	1,447,114,417.000	
	組入時価比率 : 40.58%		(158,328,788,364)	
	合計時価比率 : 41.49%			
	DENMARK 5.0 11/15/13	30,000,000.00	32,412,000.000	
	DENMARK 2.0 11/15/14	6,000,000.00	6,260,400.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	35,000,000.00	39,263,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	21,000,000.00	24,439,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	33,000,000.00	38,893,800.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	19,000,000.00	20,907,600.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	9,000,000.00	13,788,000.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	36,500,000.00	51,948,625.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 8	189,500,000.00	227,913,225.000	
	組入時価比率 : 0.86%		(3,352,603,540)	
	合計時価比率 : 0.88%			
	NORWAY 6.5 05/15/13	22,000,000.00	23,260,600.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	20,000,000.00	22,084,000.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	15,000,000.00	16,706,250.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	10,000,000.00	11,535,000.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	10,500,000.00	11,686,500.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 5	77,500,000.00	85,272,350.000	
	組入時価比率 : 0.32%		(1,244,976,310)	
	合計時価比率 : 0.33%			
	POLAND 5.25 04/25/13	11,000,000.00	11,083,930.000	
	POLAND 5.0 10/24/13	15,000,000.00	15,097,500.000	
	POLAND 5.75 04/25/14	13,000,000.00	13,284,310.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	4,500,000.00	4,592,475.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	17,000,000.00	17,765,000.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	4,000,000.00	4,009,600.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	12,060,000.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.00	9,071,280.000	

	POLAND 5.25 10/25/20	11,000,000.00	10,835,550.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,500,000.00	2,542,500.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	9,000,000.00	9,135,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.00	3,006,900.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数 : 12	111,000,000.00	112,484,045.000	
	組入時価比率 : 0.76%		(2,949,331,660)	
	合計時価比率 : 0.77%			
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	1,500,000.00	1,540,065.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,308,280.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	3,000,000.00	3,243,360.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	3,000,000.00	3,421,830.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,986,225.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	3,202,080.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,200,000.00	2,505,426.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,000,000.00	2,303,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	800,000.00	865,920.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 9	21,800,000.00	24,376,586.000	
	組入時価比率 : 0.40%		(1,575,458,753)	
	合計時価比率 : 0.41%			
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,588,250.000	
	MALAYSIA 3.835 08/12/15	6,000,000.00	6,145,980.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,310,800.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	7,178,010.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,343,560.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	8,000,000.00	8,538,640.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.00	4,229,080.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,849,600.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,350,100.000	
マレーシアリングット小計	銘柄数 : 9	59,000,000.00	61,534,020.000	
	組入時価比率 : 0.42%		(1,656,495,818)	
	合計時価比率 : 0.43%			
	AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	6,500,000.00	6,700,785.000	
	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	8,500,000.00	8,970,985.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	8,000,000.00	8,595,680.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	4,500,000.00	4,675,050.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	6,500,000.00	7,150,585.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,500,000.00	3,801,140.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	6,000,000.00	6,483,240.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	5,500,000.00	5,677,320.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,000,000.00	5,630,600.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.00	3,390,180.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,000,000.00	2,213,060.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,000,000.00	1,027,320.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 12	60,000,000.00	64,315,945.000	
	組入時価比率 : 1.43%		(5,580,051,388)	

	合計時価比率： 1.46%			
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	145,000,000.00	162,304,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.00	77,763,700.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	70,000,000.00	78,408,400.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	25,000,000.00	25,307,250.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.00	71,403,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	50,000,000.00	56,465,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	42,000,000.00	46,081,140.000	
メキシコ ペソ小計	銘柄数： 7	457,000,000.00	517,732,990.000	
	組入時価比率： 0.83%		(3,256,540,507)	
	合計時価比率： 0.85%			
合計			381,589,348,132	
			(381,589,348,132)	

(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 115銘柄	40.29%	41.19%
英ポンド	国債証券 35銘柄	8.40%	8.59%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.91%	2.97%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	0.61%	0.62%
ユーロ	国債証券 201銘柄	40.58%	41.49%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	0.86%	0.88%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	0.32%	0.33%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	0.76%	0.77%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.40%	0.41%
マレーシアリングット	国債証券 9銘柄	0.42%	0.43%
オーストラリアドル	国債証券 12銘柄	1.43%	1.46%
メキシコ ペソ	国債証券 7銘柄	0.83%	0.85%

(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&lt; D C年金&gt; 1 安定型

平成24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	5,031,784,830円
負債総額	7,396,660円
純資産総額（ - ）	5,024,388,170円
発行済数量	4,286,088,153口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1723円

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 2 安定・成長型

平成24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	11,988,304,189円
負債総額	30,842,489円
純資産総額（ - ）	11,957,461,700円
発行済数量	9,981,089,804口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1980円

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 3 成長型

平成24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	9,287,527,456円
負債総額	3,780,186円
純資産総額（ - ）	9,283,747,270円
発行済数量	7,637,120,164口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2156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24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	267,521,714,297円
負債総額	582,151,732円
純資産総額（ - ）	266,939,562,565円
発行済数量	239,268,492,047口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1156円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	288,169,743,306円
負債総額	161,176,176円
純資産総額（ - ）	288,008,567,130円
発行済数量	214,667,480,275口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3416円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	446,540,971,249円
負債総額	23,430,326,000円
純資産総額（ - ）	423,110,645,249円
発行済数量	370,208,517,283口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1429円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	390,107,070,600円
負債総額	384,442,000円
純資産総額（ - ）	389,722,628,600円
発行済数量	320,203,343,370口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2171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えない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### (5) 受益権の再分割

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

#### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

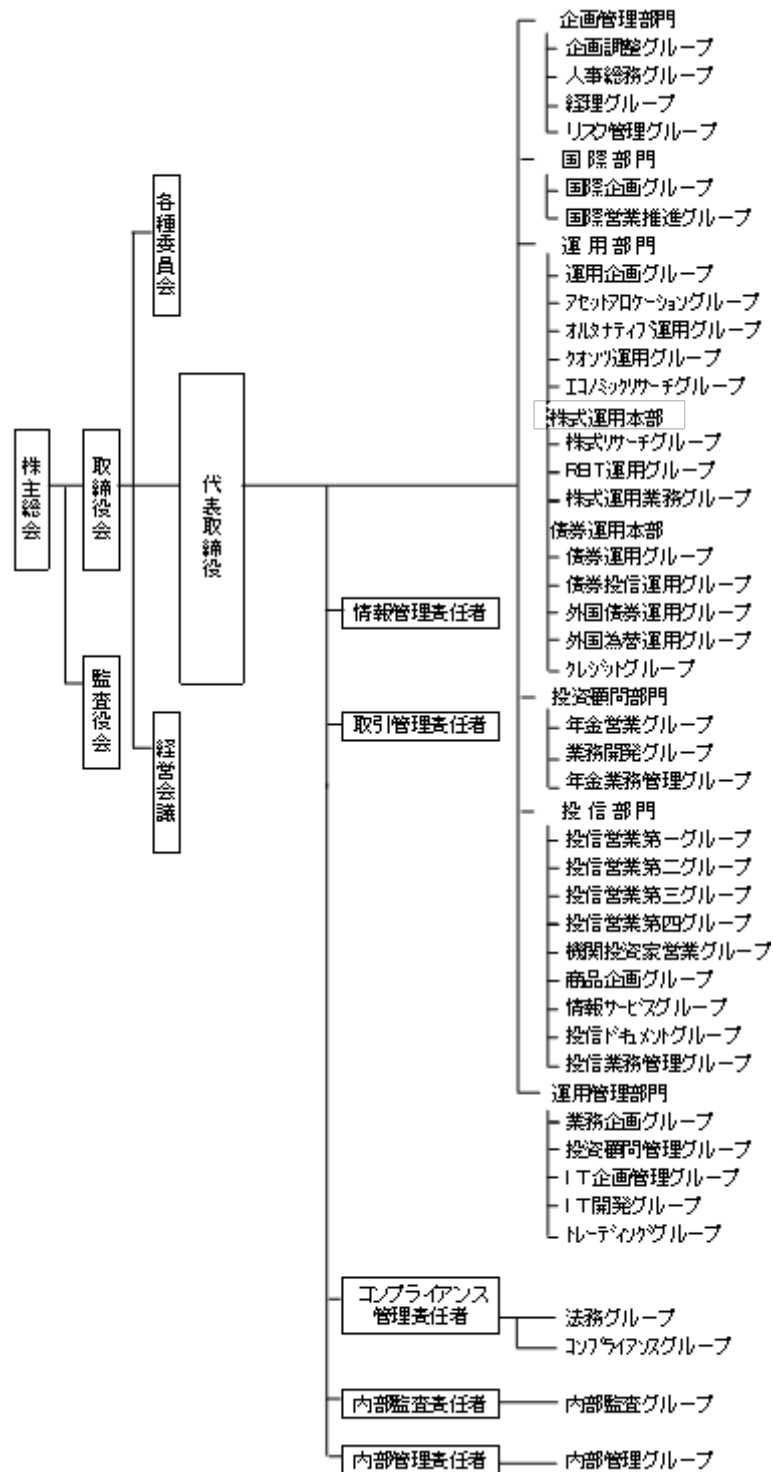
##### (1) 資本金の額

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

##### 直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構  
会社の組織図



上記組織は、平成24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。

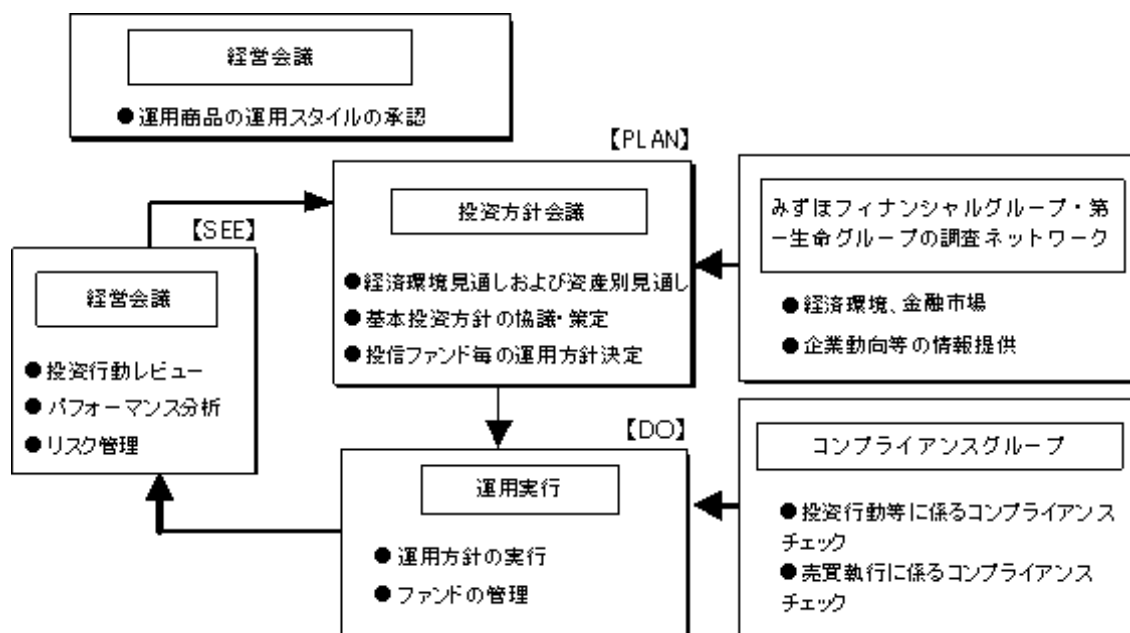
## 投資運用の意思決定機構

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24年2月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は275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	13	25,098,443,613
追加型株式投資信託	252	4,185,613,693,844
単位型公社債投資信託	9	75,758,017,008
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	407,439,406
合計	275	4,286,877,593,871

### 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、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23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．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23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27期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23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25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	13,820,588	12,220,759
金銭の信託	399,833	5,967,344
前払費用	33,221	27,593
未収委託者報酬	3,169,323	2,942,180
未収運用受託報酬	1,000,785	1,061,935
未収投資助言報酬	2 271,577	2 267,240
未収収益	247,552	186,483
繰延税金資産	383,608	403,201
その他	21,009	102,404
流動資産計	19,347,501	23,179,143
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 237,642	1 183,704
器具備品	1 351,237	1 206,306
建設仮勘定	10,541	10,956
無形固定資産		
商標権	1 804	1 510
ソフトウェア	1 557,870	1 780,190
ソフトウェア仮勘定	397,829	478,971
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 531	1 451
投資その他の資産		
投資有価証券	1,194,081	604,498
関係会社株式	2,161,144	2,457,319
繰延税金資産	403,908	402,191
長期差入保証金	1,187,070	702,696
その他	328,612	85,690
貸倒引当金	26,925	-
固定資産計	6,811,497	5,920,638
資産合計	26,158,999	29,099,782

（単位：千円）

	第25期 （平成22年3月31日現在）	第26期 （平成23年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	119,466	120,910
未払金	1,526,031	1,479,756
未払収益分配金	7,837	3,223
未払償還金	96,340	98,362
未払手数料	1,206,815	1,134,992
その他未払金	215,038	243,178
未払費用	2 1,522,325	2 1,226,658
未払法人税等	1,283,275	1,706,391
未払消費税等	113,923	143,728
賞与引当金	572,614	575,326
その他	38,231	10,000
流動負債計	5,175,867	5,262,771
固定負債		
退職給付引当金	488,790	579,063
役員退職慰労引当金	96,342	100,260
固定負債計	585,133	679,324
負債合計	5,761,000	5,942,095
（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	15,737,995	18,512,674
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	11,650,000	13,430,000
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	3,464,702	4,459,380
株主資本計	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	231,525	216,534
評価・換算差額等計	231,525	216,534
純資産合計	20,397,999	23,157,686
負債・純資産合計	26,158,999	29,099,782

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	26,734,588		24,367,005	
運用受託報酬	4,297,349		4,458,894	
投資助言報酬	1,027,153		1,019,727	
その他営業収益	723,055		789,867	
営業収益計		32,782,146		30,635,495
営業費用				
支払手数料	13,000,141		10,405,593	
広告宣伝費	218,782		272,928	
公告費	1,767		2,297	
調査費	5,056,427		4,755,890	
調査費	2,555,070		2,611,173	
委託調査費	2,501,356		2,144,716	
委託計算費	351,370		338,206	
営業雑経費	679,608		671,721	
通信費	32,088		30,286	
印刷費	613,198		585,041	
協会費	21,225		23,561	
諸会費	41		38	
支払販売手数料	13,054		32,794	
営業費用計		19,308,097		16,446,637
一般管理費				
給料	4,678,614		4,576,265	
役員報酬	1 244,725		1 235,289	
給料・手当	3,840,052		3,768,114	
賞与	593,836		572,860	
交際費	45,342		38,997	
寄付金	3,450		13,335	
旅費交通費	269,516		255,190	
租税公課	85,030		89,571	
不動産賃借料	791,980		718,929	
退職給付費用	132,513		139,773	
固定資産減価償却費	397,252		486,987	
福利厚生費	22,233		20,476	
修繕費	5,615		20,842	
賞与引当金繰入	572,614		575,326	
役員退職慰労引当金繰入	45,086		42,036	
役員退職金	18,129		13,140	
機器リース料	2,191		1,951	
事務委託費	285,449		331,935	
消耗品費	78,753		70,952	
器具備品費	2,046		575	
諸経費	88,728		124,218	
一般管理費計		7,524,549		7,520,506
営業利益		5,949,500		6,668,351

（単位：千円）

	第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）		第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	5,287		4	341,775
受取利息	18,745			9,168
時効成立分配金	157			2,574
投資信託解約益	559,971			157,213
先物利益	-			9,816
金銭の信託運用益	-			69,014
雑収入	3,431			8,602
営業外収益計		587,592		598,165
営業外費用				
為替差損	17,771			755
時効成立後支払分配金	444			-
先物損失	719,577			-
金銭の信託運用損	1,116			-
雑損失	-			6,089
営業外費用計		738,911		6,844
経常利益		5,798,181		7,259,672
特別利益				
貸倒引当金戻入益	-			4,288
過年度損益修正益	-		3,4	105,241
特別利益計		-		109,530
特別損失				
固定資産除却損	2	21,626	2	31,419
固定資産売却損		2,464		1,440
関係会社株式評価損		-		3,825
特別損失計		24,090		36,684
税引前当期純利益		5,774,091		7,332,518
法人税、住民税及び事業税		2,508,095		2,885,426
法人税等調整額		135,267		7,586
法人税等合計		2,372,828		2,877,839
当期純利益		3,401,263		4,454,678

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23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	10,040,000	11,650,000
当期変動額	1,610,000	1,780,000
当期末残高	11,650,000	13,430,000
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	3,299,438	3,464,702
当期変動額		
剰余金の配当	1,626,000	1,680,000
別途積立金の積立	1,610,000	1,780,000
当期純利益	3,401,263	4,454,678
当期末残高	3,464,702	4,459,380
利益剰余金合計		
前期末残高	13,962,732	15,737,995
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	15,737,995	18,512,674
株主資本合計		
前期末残高	18,391,210	20,166,473
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	1,547	231,525
当期変動額(純額)	233,073	14,991
当期末残高	231,525	216,534
純資産合計		
前期末残高	18,389,662	20,397,999
当期変動額	2,008,336	2,759,687
当期末残高	20,397,999	23,157,686

[次へ](#)





## 重要な会計方針

<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 style="text-align: center;">第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）</p>
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法</p> <p>（2）その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>（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>5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>6. 引当金の計上基準</p> <p>（1）貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>（2）賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式 同左</p> <p>（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及び評価方法 同左</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 同左</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>（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. 外貨建の資産及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</p> <p>（1）同左</p> <p>（2）同左</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>(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、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。</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>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。</p> <p>8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</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> <hr/> <p>(4) 同左</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>
--	--

## 追加情報

第25期（平成22年3月31日現在）	第26期（平成23年3月31日現在）
<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）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。</p>	<hr/>

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第25期（平成22年3月31日現在）			第26期（平成23年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物		471,484千円	建物		484,832千円
器具備品		356,326千円	器具備品		499,620千円
商標権		6,882千円	商標権		2,428千円
ソフトウェア		684,370千円	ソフトウェア		809,403千円
電話施設利用権		1,065千円	電話施設利用権		1,145千円
2. 関係会社項目			2. 関係会社項目		
関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円
流動負債	未払費用	400,075千円	流動負債	未払費用	291,628千円

## （損益計算書関係）

第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
1. 役員報酬の限度額	1. 役員報酬の限度額
取締役 年額250,000千円	同左
監査役 年額 50,000千円	
2. 固定資産除却損の内訳	2. 固定資産除却損の内訳
建物 1,199千円	建物 15,317千円
器具備品 15,159千円	器具備品 3,597千円
ソフトウェア 5,267千円	ソフトウェア 12,503千円
	3. 過年度損益修正益の内訳
	特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。
	4. 関係会社項目
	各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。
	受取配当金 331,240千円
	過年度損益修正益 105,241千円

## （株主資本等変動計算書関係）

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

第26期（自平成22年4月1日 至平成23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

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成23年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

(リース取引関係)

第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)				第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23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及び期末残高相当額				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及び期末残高相当額			
	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	46,681千円	-	46,681千円
減価償却累計額 相当額	75,063千円	-	75,063千円	減価償却累計額 相当額	46,138千円	-	46,138千円
期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円	期末残高相当額	543千円	-	543千円
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	15,764千円	586千円	16,350千円	未経過リース料 期末残高相当額	586千円	-	586千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額			
支払リース料		24,096千円		支払リース料		15,998千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		14,995千円	
支払利息相当額		845千円		支払利息相当額		234千円	
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 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				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		1,475千円	-	1,475千円

（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

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券及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、為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。

デリバティブ取引は、投資有価証券及び金銭の信託に係る為替及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及び株価指数先物取引等であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 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、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	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 その他有価証券	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 その他有価証券」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) 金銭債権及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 その他有価証券のうち 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、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。  
デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。  
取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。  
金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。  
長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。  
金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,220,759	12,220,759	-
(2) 金銭の信託	5,967,344	5,967,344	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	524,252	524,252	-
資産計	18,712,356	18,712,356	-
(1) 未払法人税等	1,706,391	1,706,391	-
負債計	1,706,391	1,706,391	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）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2,457,319千円）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（貸借対照表計上額702,696千円）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。

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,220,413	-	-	-
合計	12,220,413	-	-	-

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額  
該当事項はありません。

## (有価証券関係)

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. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 第26期（平成23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. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）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	513,129	146,101	367,027
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,400	3,000	400
小計	516,529	149,101	367,427
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）	7,723	10,000	2,277
小計	7,723	10,000	2,277
合計	524,252	159,101	365,150

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
719,016	162,043	4,830

（金銭の信託関係）

## 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。

## 第26期（平成23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	5,967,344	119,701

## 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。

第26期（平成23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

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。



（退職給付関係）

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

## 第26期（平成23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26期 (平成23年3月31日現在) (千円)	
(1) 退職給付債務	636,624	
(2) 未認識数理計算上の差異	57,560	
	<hr/>	
退職給付引当金	579,063	

## 3. 退職給付費用に関する事項

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) (千円)	
(1) 勤務費用	85,216	
(2) 利息費用	7,954	
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	9,383	
(4) 確定拠出年金 拠出額	37,218	
	<hr/>	
退職給付費用	139,773	

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第26期 (平成23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. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第25期	第26期
	(平成22年3月31日現在)	(平成23年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	108,541	128,299
未払事業所税	6,290	6,141
賞与引当金	233,054	234,157
未払法定福利費	26,912	28,823
未払確定拠出年金掛金	2,712	2,739
減価償却超過額	17,598	36,256
減価償却超過額（一括償却資産）	6,098	3,039
繰延資産償却超過額（税法上）	89,657	139,027
退職給付引当金	198,937	235,678
役員退職慰労引当金	39,211	40,806
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	66,421	763
関係会社株式評価損	-	1,556
貸倒引当金繰入額	14,840	-
繰延税金資産合計	815,851	862,867
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	28,334	57,474
繰延税金負債合計	28,334	57,474
差引繰延税金資産の純額	787,517	805,393

## 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。

第26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。

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （追加情報）

当事業年度より、「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。

( 関連当事者との取引 )

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

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 用及び助 言、当社 設定投信 の販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	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		

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

## (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			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産運用の顧問料は、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。

## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

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 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産運 用の助 言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,392	未収投資 助言報酬	190,149

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

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	646,432	未払 費用	172,736
	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	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

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	1,538,792	未払手 数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	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	536,163	未払手 数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	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	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	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)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
信託報酬の 支払								3,163			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産運用の顧問料は、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25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
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、新株引受権付社債及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 964,903円60銭 1株当たり当期純利益金額 185,611円60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、新株引受権付社債及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25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

## （重要な後発事象）

第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
_____	_____

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,268,020
金銭の信託		5,629,150
前払費用		59,568
未収委託者報酬		2,810,956
未収運用受託報酬		1,659,443
未収投資助言報酬		313,603
未収収益		243,409
繰延税金資産		375,975
その他		20,513
	流動資産計	22,380,642
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	168,959
器具備品	1	173,255
建設仮勘定		39,682
無形固定資産		
商標権	1	430
ソフトウェア	1	1,082,772
ソフトウェア仮勘定		189,016
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	411
投資その他の資産		4,173,376
投資有価証券		388,843
関係会社株式		2,457,319
繰延税金資産		542,108
長期差入保証金		702,696
その他		82,408
	固定資産計	5,835,053
資産合計		28,215,695

	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	45,556
未払金	1,335,271
未払収益分配金	3,223
未払償還金	95,222
未払手数料	1,089,997
その他未払金	146,827
未払費用	1,253,226
未払法人税等	1,383,356
未払消費税等	121,733
前受収益	4,659
賞与引当金	566,648
流動負債計	4,710,452
固定負債	
退職給付引当金	616,545
役員退職慰労引当金	118,905
固定負債計	735,451
負債合計	5,445,903
(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	18,252,663
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	15,630,000
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	1,999,370
株主資本計	22,681,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	88,650
評価・換算差額等計	88,650
純資産合計	22,769,792
負債・純資産合計	28,215,695

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,186,600	
運用受託報酬	2,427,618	
投資助言報酬	487,590	
その他営業収益	367,965	
営業収益計		15,469,773
営業費用		
支払手数料	5,317,217	
広告宣伝費	77,160	
調査費	2,399,769	
調査費	1,478,893	
委託調査費	920,876	
委託計算費	170,060	
営業雑経費	274,550	
通信費	13,894	
印刷費	212,477	
協会費	12,507	
諸会費	19	
支払販売手数料	35,652	
営業費用計		8,238,758
一般管理費		
給料	2,023,999	
役員報酬	123,681	
給料・手当	1,900,318	
交際費	15,479	
寄付金	3,156	
旅費交通費	98,767	
租税公課	46,092	
不動産賃借料	322,850	
退職給付費用	73,794	
固定資産減価償却費	1 228,152	
福利厚生費	15,312	
修繕費	3,575	
賞与引当金繰入	566,648	
役員退職慰労引当金繰入	26,763	
役員退職金	528	
機器リース料	828	
事務委託費	174,574	
消耗品費	28,721	
器具備品費	671	
諸経費	52,322	
一般管理費計		3,682,240
営業利益		3,548,774

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日至平成23年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	57,123	
受取利息	2,091	
雑収入	3,855	
営業外収益計		63,070
営業外費用		
為替差損	1,209	
時効成立後支払分配金	36	
金銭の信託運用損	337,781	
雑損失	997	
営業外費用計		340,025
経常利益		3,271,819
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	1,959	
特別利益計		1,959
特別損失		
固定資産除却損	5,729	
固定資産売却損	381	
特別損失計		6,111
税引前中間純利益		3,267,666
法人税、住民税及び事業税		1,344,597
法人税等調整額		24,919
法人税等合計		1,319,677
中間純利益		1,947,989

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	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	
	当期首残高	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	
	当期首残高	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	
	当期首残高	13,430,000
	当中間期変動額	2,200,000
	当中間期末残高	15,630,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	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	
	当期首残高	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	
	当期首残高	4,459,380
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	2,208,000
	別途積立金の積立	2,200,000
	中間純利益	1,947,989
	当中間期末残高	1,999,370
	利益剰余金合計	
	当期首残高	18,512,674
	当中間期変動額	260,010
	当中間期末残高	18,252,663
	株主資本合計	
	当期首残高	22,941,152
	当中間期変動額	260,010
	当中間期末残高	22,681,141
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	216,534
	当中間期変動額（純額）	127,883
	当中間期末残高	88,650
純資産合計		

当期首残高	23,157,686
当中間期変動額	387,894
当中間期末残高	22,769,792

[前](#) [次](#)

## 重要な会計方針

項目	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法  (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（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 ... 6～18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、それぞれ発生の日次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. 外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。



7. 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：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 追加情報

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第27期中間会計期間末 （平成23年9月30日現在）
1．固定資産の減価償却累計額	建物 ... 499,974千円 器具備品 ... 531,842千円 商標権 ... 2,508千円 ソフトウェア ... 798,730千円 電話施設利用権 ... 1,185千円

## （中間損益計算書関係）

項目	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
1．減価償却実施額	有形固定資産 ... 64,964千円 無形固定資産 ... 163,188千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

## (リース取引関係)

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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

重要な会計方針「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及び中間期末残高相当額

該当事項はありません。

未経過リース料中間期末残高相当額

該当事項はありません。

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料 588千円

減価償却費相当額 543千円

支払利息相当額 1千円

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
670千円	-	670千円

## （金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,268,020	11,268,020	-
(2) 金銭の信託	5,629,150	5,629,150	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	308,597	308,597	-
資産計	17,205,769	17,205,769	-
(1) 未払法人税等	1,383,356	1,383,356	-
負債計	1,383,356	1,383,356	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## 負 債

## (1) 未払法人税等

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

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）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2,457,319千円）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等（中間貸借対照表計上額702,696千円）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27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券  
該当事項はありません。
2. 子会社株式及び関連会社株式  
関係会社株式(中間貸借対照表計上額2,457,319千円)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	298,359	146,101	152,257
債券	-	-	-
その他(投資信託)	3,118	3,000	118
小計	301,478	149,101	152,376
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)	7,119	10,000	2,881
小計	7,119	10,000	2,881
合計	308,597	159,101	149,495

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

(金銭の信託関係)

第27期中間会計期間末(平成23年9月30日現在)

1. 満期保有目的の金銭の信託  
該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託  
該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	12,186,600	2,915,208	367,965	15,469,773

（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。

## （持分法損益等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）	
該当事項はありません。	

## （1株当たり情報）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）	
1株当たり純資産額	948,741円 34銭
1株当たり中間純利益金額	81,166円 22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いません。	

（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27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
中間純利益	1,947,989千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,947,989千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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23年3月31日現在 247,303百万円

- 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23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	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【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24年4月11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>1安定型の平成23年2月26日から平成24年2月27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<DC年金>1安定型の平成24年2月27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24年4月11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23年2月26日から平成24年2月27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> 2安定・成長型の平成24年2月27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24年4月11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23年2月26日から平成24年2月27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24年2月27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23年6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アセットマネジメント株式会社の平成23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23年12月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23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23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

（注）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>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<DC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> 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< D C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\(前期\)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](#)