

【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27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 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	D I A M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、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である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27年5月26日から平成28年5月25日まで

お申込みの取扱いは、販売会社の毎営業日に行われます。

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、下記の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

コールセンター：0120-506-860（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、各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】**お申込みの方法**

お申込みに際しては、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。

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。

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

<ファンドの特色>

1 ●ライフサイクルにあわせた分散投資

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

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

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

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

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

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

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

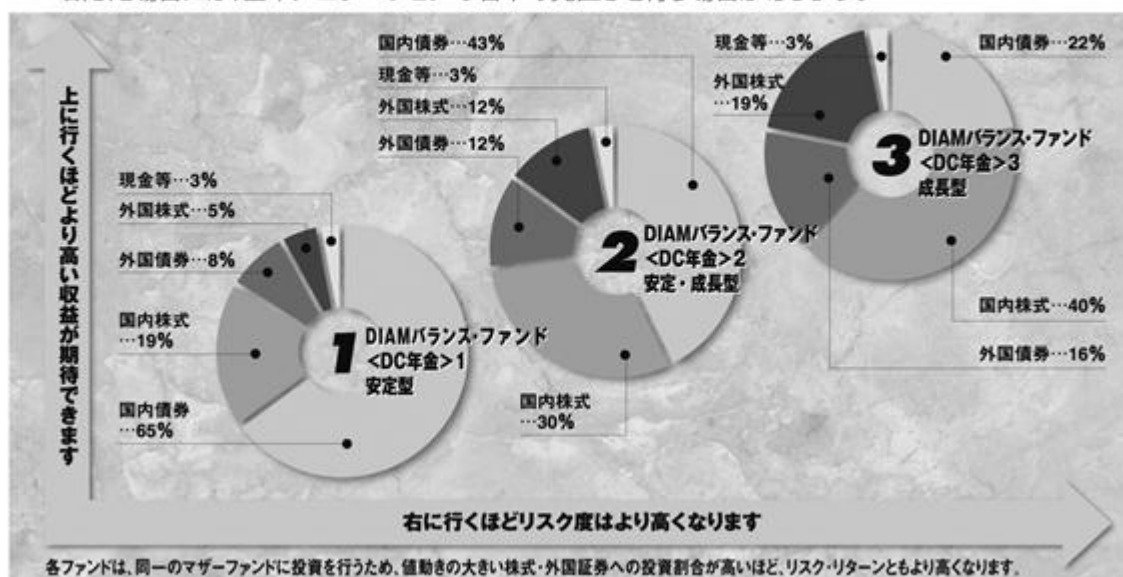
(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

2 ●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

3ファンドの基本アロケーション

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



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

分配方針

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

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

商品分類表

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型」

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

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

対象インデックス

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

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

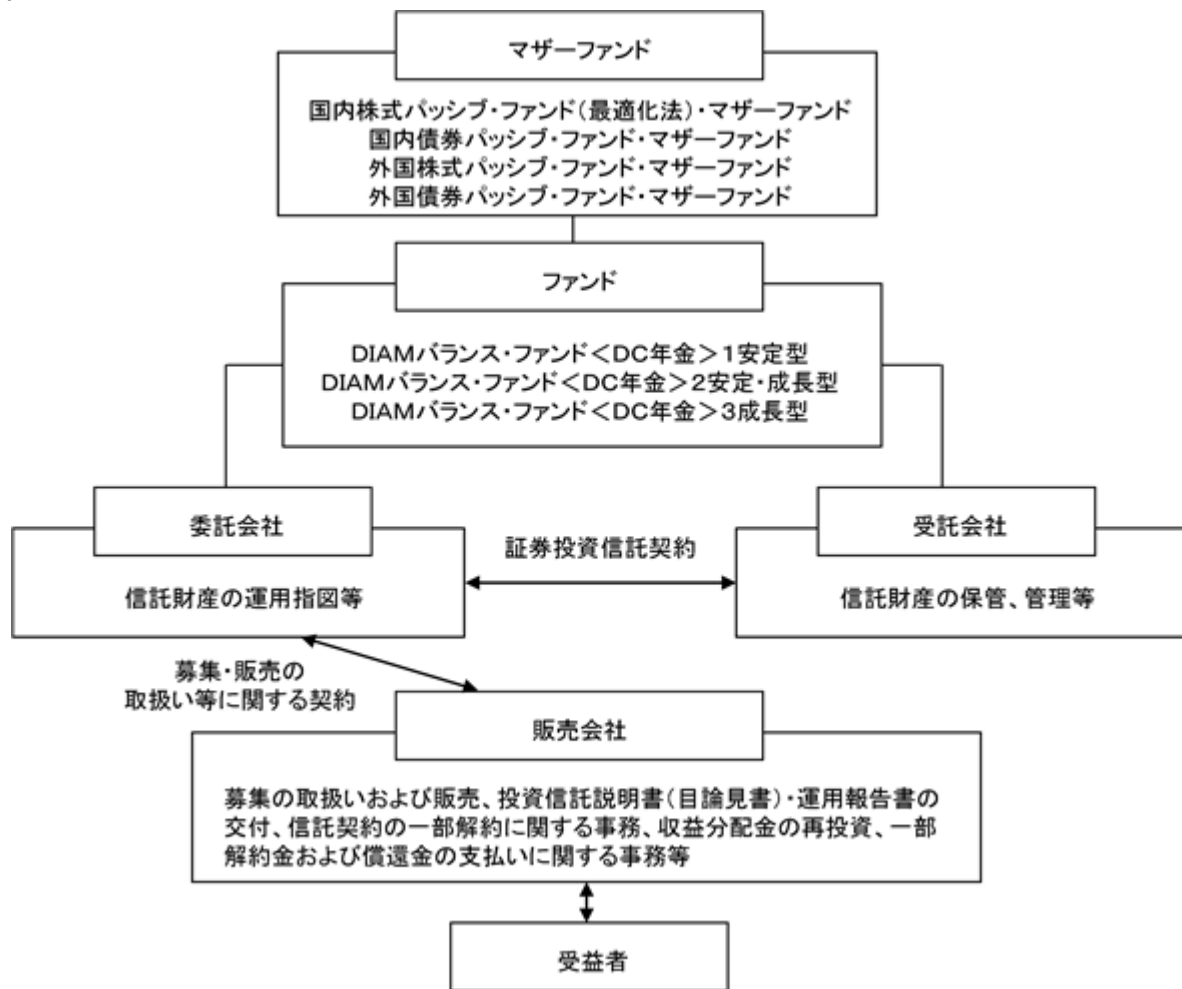
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2)【ファンドの沿革】

平成14年12月13日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

平成17年10月1日 信託報酬率の変更

(3) 【ファンドの仕組み】



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。

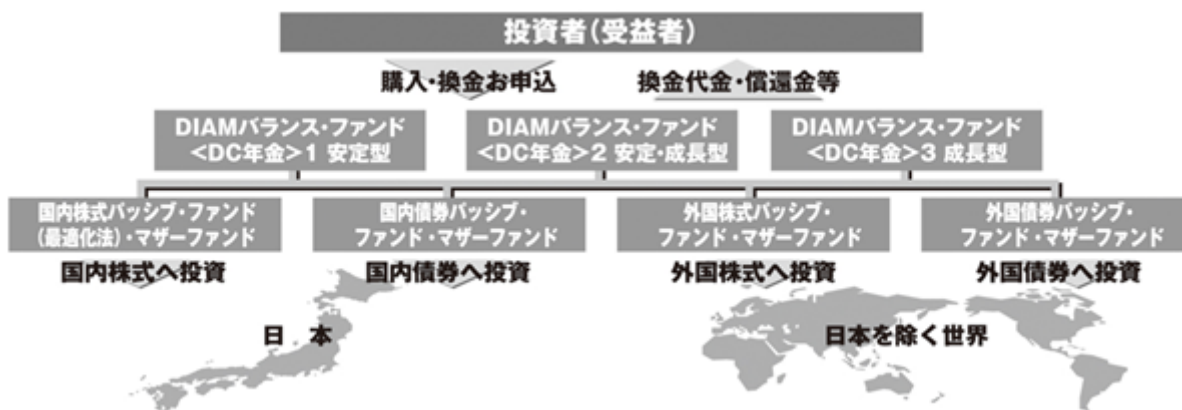
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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27年2月27日現在）

委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日	会社設立
平成10年 3月 31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月 1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月 1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルユ・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27年2月27日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

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

<投資態度>

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

2) 「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型」

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

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」

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

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型」

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

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

(注1) TOPIXの指数値及びTOPIX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TOPIXに関するすべての権利及びTOPIX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、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIX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、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIX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、TOPIX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、TOPIX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TOPIX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TOPIX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、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

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

(注3) M S C I コクサイ・インデックスは、M S C I Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I Inc. に属しており、また、M S C I Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成インデックスに連動させるため、以下の対応を行います。

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

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

(2) 【投資対象】

1. 投資の対象とする資産 (約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲 (約款第16条第1項)

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(4)までの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せん。)
- (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せん。)
- (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）

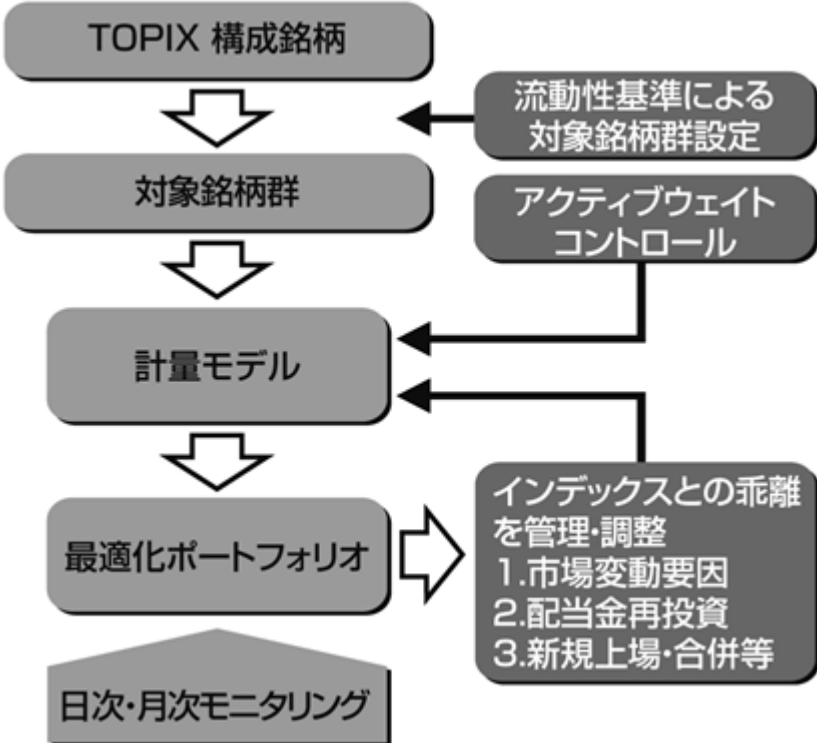
委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- (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）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"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

運用プロセス	<p>1)流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>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。</p>

運用プロセス

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。

2) 最適化法によるポートフォリオの構築

債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

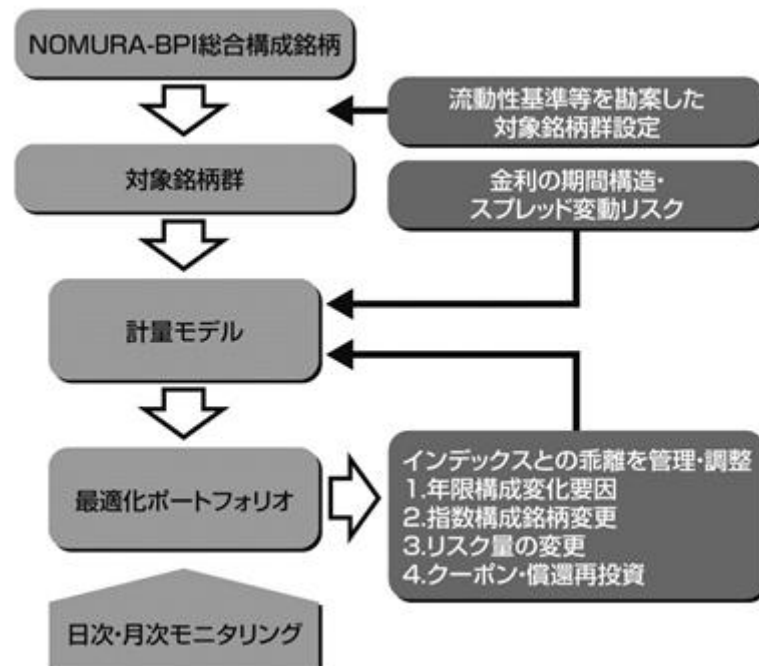
金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因、
が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3) インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン、償還再投資

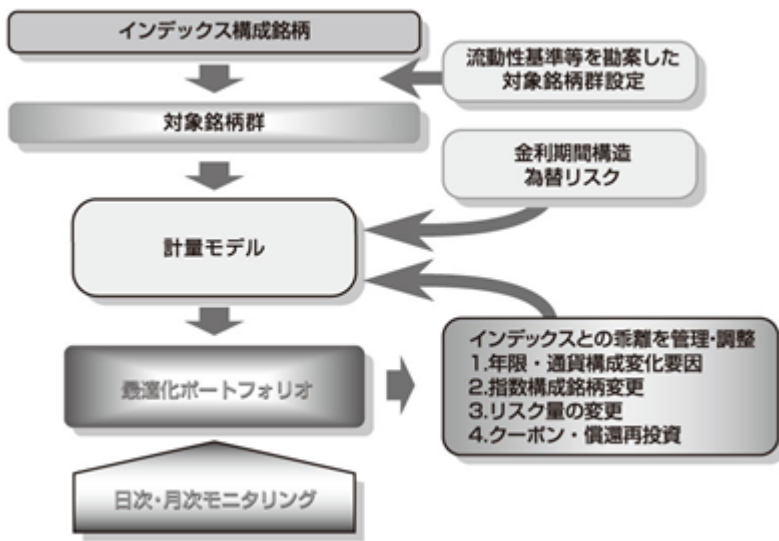


主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定め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	<ol style="list-style-type: none">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。2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

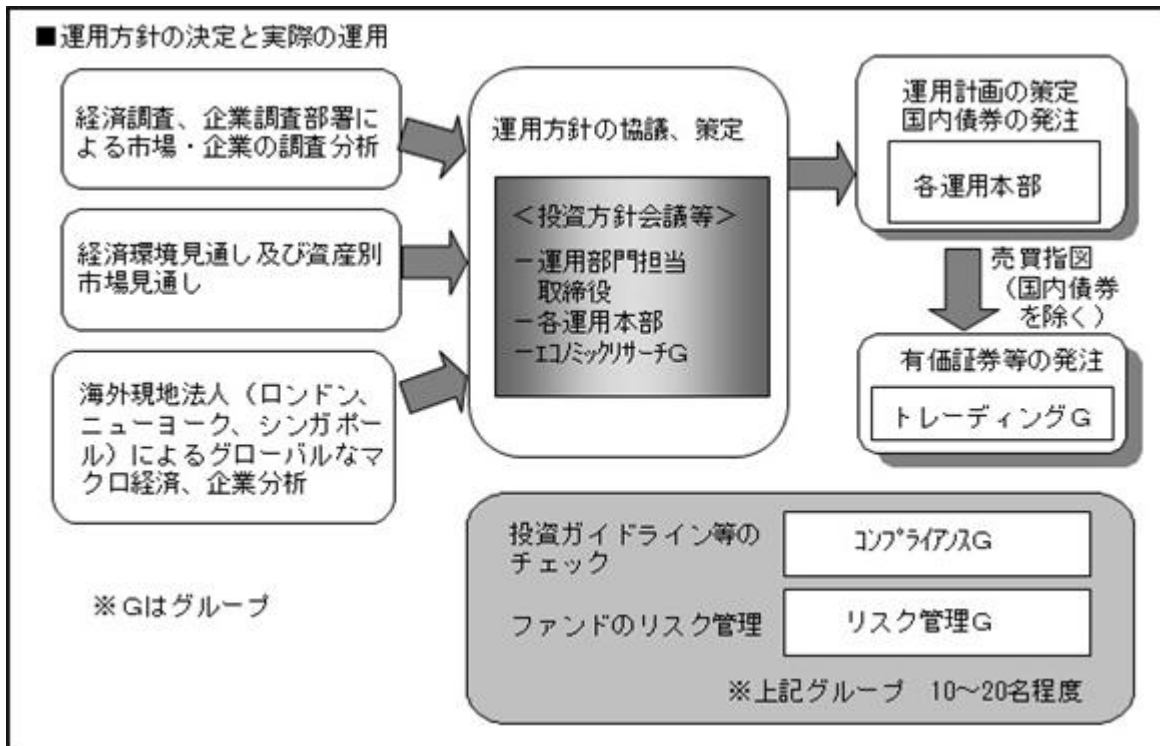
運用プロセス	<p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに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、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 
主な投資制限	<p>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】



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

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

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

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

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年4月13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てします。）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

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

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

(6)同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資制限（約款第19条）

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

(7)同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第20条）

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

(8)信用取引の指図範囲（約款第21条）

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

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

- 1)信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2)株式分割により取得する株券
- 3)有償増資により取得する株券

- 4) 売出しにより取得する株券
 - 5) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 - 6) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券
- (9) 先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第22条）

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

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

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

- いて同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供を要求され委託会社が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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(12) デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

(13) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

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

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

2) 公社債の貸付けは、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たときは、担保の受入の指図を行うものとします。

(14) 公社債の空売りの指図範囲（約款第26条）

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

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

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

(15) 公社債の借入れ（約款第27条）

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

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

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

(d) 上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(16) 特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第29条）

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

(17) 外国為替予約の指図（約款第30条）

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

(b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

(c) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(d) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(18) 資金の借入れ（約款第37条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(b) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

(c) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(1) 株式投資リスク

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

1) 価格変動リスク

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

2) 信用リスク

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

(2) 債券投資リスク

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

1) 金利リスク

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

2) 信用リスク

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

(3) 為替リスク

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

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる

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

(4)資産配分リスク

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

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

(5)カントリーリスク

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

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合に、

資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

資金動向、市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。

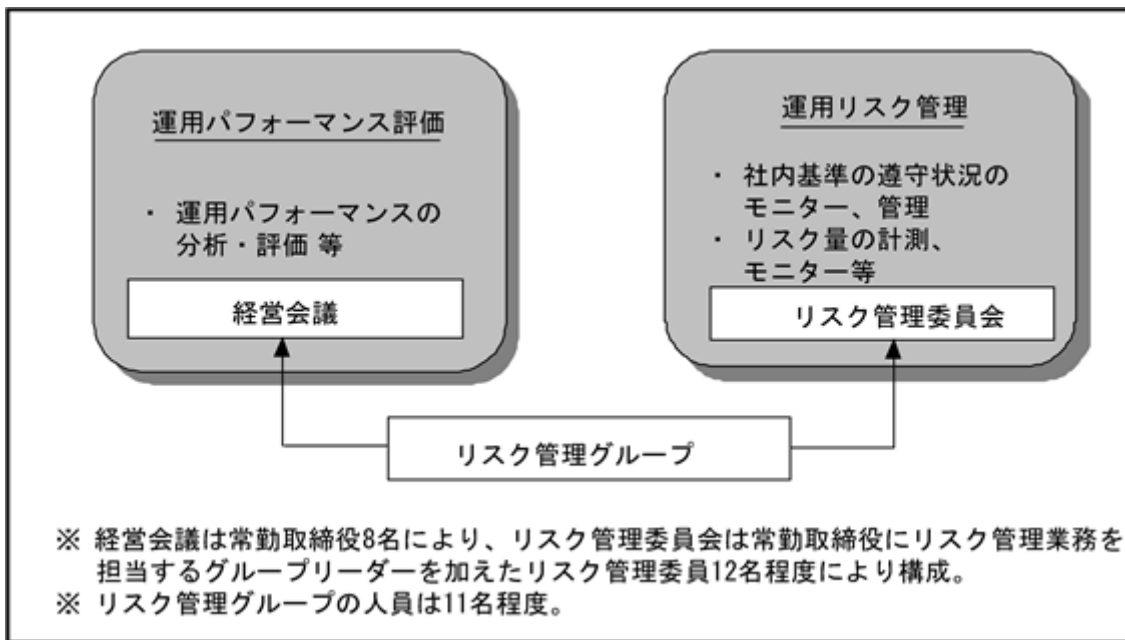
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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

注意事項

- イ.当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ.投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ.投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<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。

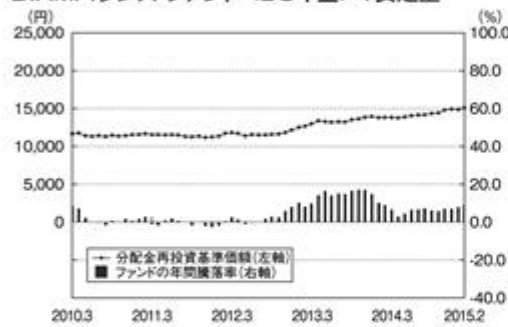
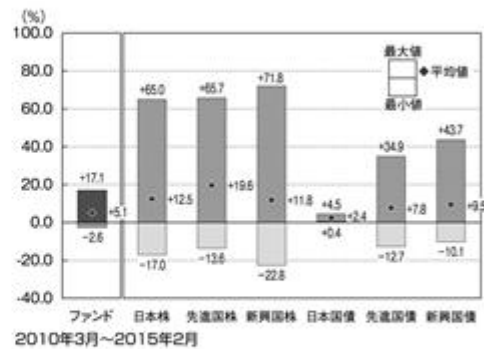
運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

上記体制は平成27年2月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

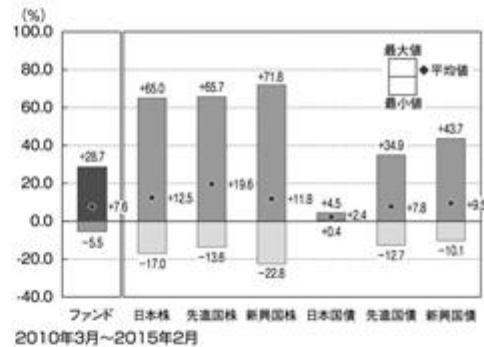
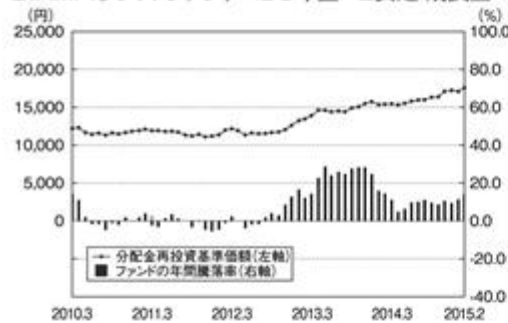
(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

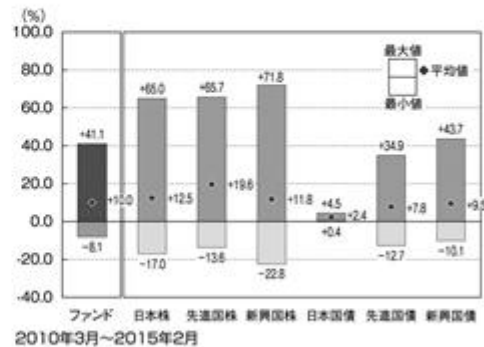
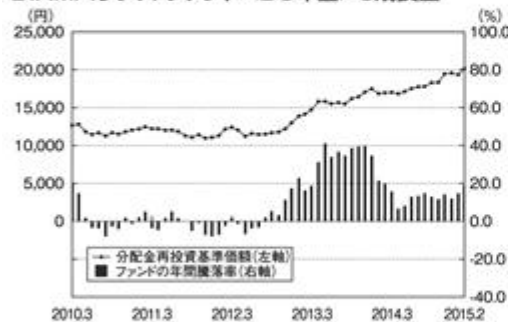
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型



DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



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

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

* 各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

ファンド名 ----- 信託報酬 税込（税抜）	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 1 安定型 ----- 年率0.2808%（税抜0.26%）	0.100%	0.130%	0.030%
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 2 安定・成長型 ----- 年率0.3132%（税抜0.29%）	0.115%	0.145%	0.030%
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 3 成長型 ----- 年率0.3456%（税抜0.32%）	0.130%	0.160%	0.030%
主な役務	委託した資金の運用 の対価	購入後の情報提供、 交付運用報告書等各 種書類の送付、口座 内でのファンドの管 理等の対価	運用財産の保管・管 理、委託会社からの 運用指図の実行等の 対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等がファンドから支払われます。

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。

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

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。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、平成27年2月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	7,964,218,997	97.01
内 日本	7,964,218,997	97.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	245,681,668	2.99
純資産総額	8,209,900,665	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	19,030,020,201	97.06
内 日本	19,030,020,201	97.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	575,657,901	2.94
純資産総額	19,605,678,102	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	15,503,009,114	97.02
内 日本	15,503,009,114	97.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	476,737,620	2.98
純資産総額	15,979,746,734	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	327,265,422,840	97.22
内 日本	327,265,422,840	97.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,359,214,639	2.78
純資産総額	336,624,637,479	100.00

その他資産の投資状況

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	8,542,800,000	2.54
内 日本	8,542,800,000	2.54

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	345,794,492,900	80.84
内 日本	345,794,492,900	80.84
地方債証券	28,988,411,541	6.78
内 日本	28,988,411,541	6.78
特殊債券	27,552,895,227	6.44
内 日本	27,552,895,227	6.44
社債券	23,449,381,500	5.48
内 日本	23,140,610,500	5.41
内 アメリカ	308,771,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,984,280,151	0.46
純資産総額	427,769,461,319	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	305,257,249,998	95.62
内 アメリカ	182,157,193,934	57.06
内 イギリス	25,741,106,711	8.06
内 スイス	12,845,824,480	4.02
内 カナダ	12,647,737,532	3.96
内 ドイツ	12,162,043,031	3.81
内 フランス	11,660,779,608	3.65
内 オーストラリア	8,908,029,437	2.79
内 オランダ	4,896,846,620	1.53
内 アイルランド	4,882,291,435	1.53
内 スペイン	4,484,186,795	1.40
内 スウェーデン	4,076,812,000	1.28
内 香港	3,673,749,025	1.15
内 イタリア	2,719,794,315	0.85
内 デンマーク	2,053,921,105	0.64
内 シンガポール	2,039,202,770	0.64
内 ジャージー	1,957,385,148	0.61
内 ベルギー	1,760,063,914	0.55

内	フィンランド	1,152,819,931	0.36
内	オランダ領キュラソー	1,065,722,244	0.33
内	パミュダ	1,019,077,277	0.32
内	ノルウェー	776,292,957	0.24
内	イスラエル	720,636,616	0.23
内	ルクセンブルグ	441,812,988	0.14
内	オーストリア	261,361,531	0.08
内	ポルトガル	200,988,771	0.06
内	ケイマン諸島	191,418,658	0.06
内	ニュージーランド	172,965,713	0.05
内	パナマ	169,518,384	0.05
内	イギリス領バージン諸島	134,171,271	0.04
内	リベリア	122,101,946	0.04
内	ガーンジィ	94,021,300	0.03
内	マン島	50,312,749	0.02
内	モーリシャス	17,059,802	0.01
投資信託受益証券		925,500,442	0.29
内	オーストラリア	789,462,802	0.25
内	シンガポール	136,037,640	0.04
投資証券		6,549,763,125	2.05
内	アメリカ	5,410,275,593	1.69
内	フランス	475,005,881	0.15
内	イギリス	448,415,256	0.14
内	香港	149,899,632	0.05
内	カナダ	66,166,763	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,508,431,742	2.04
純資産総額		319,240,945,307	100.00

その他資産の投資状況

平成27年2月27日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）		637,510,000	0.20
	-	637,510,000	0.20
株価指数先物取引（買建）		5,993,748,273	1.88
内	アメリカ	3,837,628,538	1.20
内	ドイツ	1,136,206,764	0.36
内	イギリス	521,563,552	0.16
内	オーストラリア	260,135,298	0.08
内	カナダ	238,214,121	0.07

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（注4）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	337,821,148,822	97.22
内 アメリカ	140,273,467,074	40.37
内 イタリア	33,751,241,730	9.71
内 フランス	33,627,245,303	9.68
内 イギリス	28,419,904,886	8.18
内 ドイツ	26,996,972,399	7.77
内 スペイン	18,593,483,684	5.35
内 ベルギー	9,005,137,317	2.59
内 オランダ	8,854,610,479	2.55
内 カナダ	7,670,919,038	2.21
内 オーストラリア	5,659,971,512	1.63
内 オーストリア	5,416,954,219	1.56
内 メキシコ	3,547,148,927	1.02
内 アイルランド	2,753,661,927	0.79
内 デンマーク	2,409,127,025	0.69
内 フィンランド	2,037,001,612	0.59
内 ポーランド	1,884,913,354	0.54
内 南アフリカ	1,787,601,404	0.51
内 マレーシア	1,645,658,552	0.47
内 スウェーデン	1,513,214,442	0.44
内 シンガポール	1,163,475,652	0.33
内 ノルウェー	809,438,286	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,651,130,771	2.78
純資産総額	347,472,279,593	100.00

その他資産の投資状況

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	859,834,050	0.25
-	859,834,050	0.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	4,276,476,753	1.2272 5,248,512,788	1.2266 5,245,526,385	- -	63.89%
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	760,827,655	2.1420 1,629,768,919	2.1650 1,647,191,873	- -	20.06%
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	341,847,976	1.8849 644,383,434	1.8867 644,964,576	- -	7.86%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	145,630,156	2.9216 425,487,626	2.9289 426,536,163	- -	5.20%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.01%
合計	97.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	6,629,308,611	1.2272 8,136,150,458	1.2266 8,131,509,942	- -	41.48%
2	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	2,855,064,553	2.1421 6,115,833,784	2.1650 6,181,214,757	- -	31.53%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	828,101,362	2.9216 2,419,463,749	2.9289 2,425,426,079	- -	12.37%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,214,750,317	1.8849 2,289,804,347	1.8867 2,291,869,423	- -	11.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.06%
合計	97.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	3,046,248,134	2.1420 6,525,368,127	2.1650 6,595,127,210	- -	41.27%
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,737,600,424	1.2272 3,359,850,022	1.2266 3,357,940,680	- -	21.01%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,051,813,641	2.9216 3,073,083,914	2.9289 3,080,656,973	- -	19.28%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,308,784,784	1.8849 2,467,059,317	1.8867 2,469,284,251	- -	15.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.02%
合計	97.02%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,027,300	7,700.00 15,610,210,000	8,063.00 16,346,119,900	- -	4.86%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	11,635,900	679.90 7,911,248,410	777.70 9,049,239,430	- -	2.69%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	766,900	7,136.00 5,472,598,400	7,367.00 5,649,752,300	- -	1.68%
4	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,322,200	3,820.50 5,051,465,100	3,949.50 5,222,028,900	- -	1.55%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,096,700	4,177.00 4,580,915,900	4,759.50 5,219,743,650	- -	1.55%
6	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	20,077,700	199.90 4,013,532,230	220.50 4,427,132,850	- -	1.32%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	567,500	7,212.00 4,092,810,000	7,420.00 4,210,850,000	- -	1.25%
8	KDDI 日本	株式 情報・通信業	491,100	7,786.00 3,823,704,600	8,290.00 4,071,219,000	- -	1.21%
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	576,600	5,922.00 3,414,625,200	6,123.00 3,530,521,800	- -	1.05%
10	ファナック 日本	株式 電気機器	153,000	20,035.00 3,065,355,000	22,945.00 3,510,585,000	- -	1.04%
11	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	912,600	3,443.50 3,142,538,100	3,772.00 3,442,327,200	- -	1.02%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,752,900	1,830.00 3,207,807,000	1,901.00 3,332,262,900	- -	0.99%
13	キヤノン 日本	株式 電気機器	851,900	3,732.50 3,179,716,750	3,889.00 3,313,039,100	- -	0.98%
14	ソニー 日本	株式 電気機器	960,300	3,066.79 2,945,042,950	3,414.50 3,278,944,350	- -	0.97%
15	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,078,000	2,514.00 2,710,092,000	2,793.50 3,011,393,000	- -	0.89%

16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	131,600	19,475.00 2,562,910,000	22,250.00 2,928,100,000	- -	0.87%
17	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,528,000	798.70 2,817,813,600	818.00 2,885,904,000	- -	0.86%
18	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	606,600	4,386.00 2,660,547,600	4,573.50 2,774,285,100	- -	0.82%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	269,300	9,140.00 2,461,402,000	10,035.00 2,702,425,500	- -	0.80%
20	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,790,700	1,318.50 2,361,037,950	1,495.00 2,677,096,500	- -	0.80%
21	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,111,500	2,223.00 2,470,864,500	2,390.50 2,657,040,750	- -	0.79%
22	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,062,400	1,064.00 2,194,393,600	1,264.00 2,606,873,600	- -	0.77%
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	596,900	4,076.50 2,433,262,850	4,350.50 2,596,813,450	- -	0.77%
24	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,195,000	1,996.50 2,385,817,500	2,124.50 2,538,777,500	- -	0.75%
25	三井不動産 日本	株式 不動産業	769,000	3,126.00 2,403,894,000	3,286.50 2,527,318,500	- -	0.75%
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	154,200	12,780.00 1,970,676,000	14,745.00 2,273,679,000	- -	0.68%
27	信越化学工業 日本	株式 化学	276,000	7,955.00 2,195,580,000	8,203.00 2,264,028,000	- -	0.67%
28	花王 日本	株式 化学	413,900	5,014.00 2,075,294,600	5,350.00 2,214,365,000	- -	0.66%
29	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	482,300	4,559.00 2,198,805,700	4,584.00 2,210,863,200	- -	0.66%
30	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	2,964,000	643.40 1,907,037,600	735.00 2,178,540,000	- -	0.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
株式	97.22%
合計	97.22%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年2月27日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.44%
輸送用機器		11.46%
銀行業		9.08%
情報・通信業		6.65%
化学		5.98%
機械		4.85%
医薬品		4.65%
陸運業		4.16%
小売業		4.12%
卸売業		3.98%
食料品		3.96%
サービス業		2.98%
不動産業		2.88%
建設業		2.49%
保険業		2.40%
電気・ガス業		1.92%
鉄鋼		1.55%
精密機器		1.42%
証券、商品先物取引業		1.35%
その他製品		1.28%
その他金融業		1.22%
ゴム製品		0.90%
ガラス・土石製品		0.90%
非鉄金属		0.89%
繊維製品		0.74%
金属製品		0.65%
空運業		0.59%
石油・石炭製品		0.46%
鉱業		0.42%
海運業		0.32%
パルプ・紙	0.23%	
倉庫・運輸関連業	0.22%	
水産・農林業	0.08%	
合計		97.22%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	101.75 5,596,415,000	102.76 5,651,800,000	0.600000 2024/6/20	1.32%
2	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.73 5,036,850,000	101.71 5,085,750,000	0.500000 2024/9/20	1.19%

3	117回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	5,000,000,000	100.38 5,019,300,000	100.62 5,031,300,000	0.200000 2019/3/20	1.18%
4	118回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	5,000,000,000	100.34 5,017,200,000	100.62 5,031,050,000	0.200000 2019/6/20	1.18%
5	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	4,500,000,000	101.84 4,582,890,000	102.86 4,629,060,000	0.600000 2024/3/20	1.08%
6	114回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.78 4,535,370,000	100.97 4,543,875,000	0.300000 2018/9/20	1.06%
7	116回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.42 4,518,900,000	100.62 4,528,170,000	0.200000 2018/12/20	1.06%
8	103回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,523,850,000	100.60 4,527,135,000	0.300000 2017/3/20	1.06%
9	106回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.37 4,516,830,000	100.48 4,521,780,000	0.200000 2017/9/20	1.06%
10	105回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.33 4,515,210,000	100.43 4,519,620,000	0.200000 2017/6/20	1.06%
11	122回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,500,000,000	99.98 4,499,535,000	100.14 4,506,435,000	0.100000 2019/12/20	1.05%
12	107回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,300,000,000	100.39 4,317,028,000	100.53 4,322,833,000	0.200000 2017/12/20	1.01%
13	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	4,000,000,000	105.57 4,222,840,000	105.88 4,235,360,000	1.300000 2019/12/20	0.99%
14	325回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	4,000,000,000	103.94 4,157,600,000	104.73 4,189,400,000	0.800000 2022/9/20	0.98%
15	332回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	4,000,000,000	101.96 4,078,680,000	102.96 4,118,760,000	0.600000 2023/12/20	0.96%
16	313回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,800,000,000	106.99 4,065,810,000	107.40 4,081,390,000	1.300000 2021/3/20	0.95%
17	97回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.50 4,020,000,000	100.50 4,020,240,000	0.400000 2016/6/20	0.94%
18	296回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,500,000,000	105.05 3,677,065,000	105.23 3,683,120,000	1.500000 2018/9/20	0.86%
19	301回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,400,000,000	105.97 3,603,082,000	106.19 3,610,664,000	1.500000 2019/6/20	0.84%

20	113回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.76 3,526,775,000	100.92 3,532,305,000	0.300000 2018/6/20	0.83%
21	102回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.48 3,517,010,000	100.52 3,518,235,000	0.300000 2016/12/20	0.82%
22	282回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,400,000,000	102.64 3,489,998,000	102.62 3,489,080,000	1.700000 2016/9/20	0.82%
23	297回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,300,000,000	104.98 3,464,571,000	105.20 3,471,600,000	1.400000 2018/12/20	0.81%
24	330回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	103.89 3,324,627,000	104.73 3,351,520,000	0.800000 2023/9/20	0.78%
25	289回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	104.09 3,330,912,000	104.17 3,333,440,000	1.500000 2017/12/20	0.78%
26	306回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	106.38 3,191,550,000	106.71 3,201,450,000	1.400000 2020/3/20	0.75%
27	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.40 3,162,060,000	106.18 3,185,580,000	1.000000 2022/3/20	0.74%
28	150回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	3,000,000,000	102.11 3,063,570,000	104.57 3,137,220,000	1.400000 2034/9/20	0.73%
29	326回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	103.14 3,094,230,000	103.95 3,118,770,000	0.700000 2022/12/20	0.73%
30	328回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	102.28 3,068,580,000	103.12 3,093,780,000	0.600000 2023/3/20	0.72%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
国債証券	80.84%
地方債証券	6.78%
特殊債券	6.44%
社債券	5.48%
合計	99.54%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	498,180	15,156.83 7,550,830,366	15,554.59 7,748,989,158	- -	2.43%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	352,875	11,136.23 3,929,700,654	10,573.28 3,731,048,120	- -	1.17%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	649,006	5,232.37 3,395,842,704	5,254.43 3,410,162,989	- -	1.07%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	232,262	11,881.67 2,759,662,156	12,260.95 2,847,754,162	- -	0.89%
5	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	410,944	6,599.20 2,711,905,384	6,577.74 2,703,082,992	- -	0.85%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	828,561	2,999.64 2,485,385,132	3,087.90 2,558,513,760	- -	0.80%
7	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	265,687	8,794.52 2,336,592,292	9,332.45 2,479,513,300	- -	0.78%
8	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	189,407	11,846.96 2,243,899,046	12,278.56 2,325,646,160	- -	0.73%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	312,049	7,116.84 2,220,803,086	7,344.64 2,291,889,626	- -	0.72%
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	222,546	10,245.29 2,280,048,975	10,158.22 2,260,672,541	- -	0.71%
11	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	521,082	4,131.51 2,152,856,952	4,125.54 2,149,749,480	- -	0.67%
12	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	156,699	13,451.27 2,107,800,651	12,769.04 2,000,896,770	- -	0.63%
13	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	339,429	5,881.20 1,996,251,090	5,888.35 1,998,680,112	- -	0.63%
14	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	57,784	30,474.35 1,760,930,418	32,400.89 1,872,253,605	- -	0.59%
15	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	423,769	4,133.89 1,751,817,906	4,114.81 1,743,731,037	- -	0.55%
16	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	138,490	12,424.35 1,720,649,048	12,470.87 1,727,090,952	- -	0.54%
17	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	245,293	7,014.26 1,720,551,012	7,032.15 1,724,939,426	- -	0.54%
18	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,586,419	1,100.38 1,745,677,856	1,069.85 1,697,235,442	- -	0.53%
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	872,577	1,981.07 1,728,640,218	1,913.09 1,669,319,030	- -	0.52%
20	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	93,995	17,692.51 1,663,007,646	17,692.51 1,663,007,646	- -	0.52%

21	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	411,248	4,098.11 1,685,342,502	4,013.43 1,650,517,322	- -	0.52%
22	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	322,437	5,008.14 1,614,811,990	5,064.20 1,632,886,809	- -	0.51%
23	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェア・サービス	24,123	65,480.42 1,579,584,236	66,252.09 1,598,199,398	- -	0.50%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	252,192	6,106.62 1,540,041,719	6,250.94 1,576,437,237	- -	0.49%
25	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェア・サービス	163,770	9,033.50 1,479,417,899	9,590.50 1,570,636,299	- -	0.49%
26	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	114,093	13,345.12 1,522,584,810	13,761.37 1,570,076,284	- -	0.49%
27	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	124,949	12,153.61 1,518,581,790	12,426.74 1,552,708,898	- -	0.49%
28	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェア・サービス	23,260	65,736.85 1,529,039,205	66,706.51 1,551,593,615	- -	0.49%
29	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	294,835	5,239.53 1,544,797,151	5,234.76 1,543,390,553	- -	0.48%
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	128,485	11,823.23 1,519,108,361	11,816.07 1,518,188,897	- -	0.48%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
株式	95.62%
投資信託受益証券	0.29%
投資証券	2.05%
合計	97.96%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年2月27日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.04%
医薬品		7.38%
石油・ガス・消耗燃料		7.11%
保険		4.11%
メディア		3.07%
コンピュータ・周辺機器		3.06%
化学		2.83%
各種電気通信サービス		2.69%
ソフトウェア		2.68%

食品	2.49%
情報技術サービス	2.20%
飲料	2.20%
食品・生活必需品小売り	2.19%
資本市場	2.13%
バイオテクノロジー	2.11%
航空宇宙・防衛	2.10%
インターネットソフトウェア・サービス	2.07%
専門小売り	1.91%
コングロマリット	1.87%
半導体・半導体製造装置	1.81%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.76%
金属・鉱業	1.63%
ホテル・レストラン・レジャー	1.62%
ヘルスケア機器・用品	1.61%
電力	1.59%
家庭用品	1.48%
機械	1.46%
タバコ	1.41%
各種金融サービス	1.27%
通信機器	1.26%
総合公益事業	1.25%
繊維・アパレル・贅沢品	1.23%
自動車	1.19%
陸運・鉄道	1.00%
エネルギー設備・サービス	0.94%
インターネット販売・カタログ販売	0.85%
電気設備	0.76%
不動産管理・開発	0.67%
複合小売り	0.59%
航空貨物・物流サービス	0.59%
自動車部品	0.57%
消費者金融	0.53%
専門サービス	0.48%
無線通信サービス	0.44%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.41%
商業サービス・用品	0.40%
電子装置・機器・部品	0.38%
家庭用耐久財	0.34%
建設資材	0.31%
建設・土木	0.31%
商社・流通業	0.31%
パーソナル用品	0.25%
容器・包装	0.23%
建設関連製品	0.20%
旅客航空輸送業	0.18%
運送インフラ	0.18%
ガス	0.16%
紙製品・林産品	0.12%
海運業	0.10%

水道	0.09%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08%
販売	0.08%
レジャー用品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.05%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.62%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16 アメリカ	国債証券	4,532,260,000	100.25 4,543,726,617	100.27 4,544,814,360	0.625000 2016/7/15	1.31%
2	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	3,041,385,000	103.18 3,138,313,939	104.21 3,169,670,619	2.500000 2024/5/15	0.91%
3	US T N/B 3.25 06/30/16 アメリカ	国債証券	2,981,750,000	103.83 3,096,219,382	103.80 3,095,056,500	3.250000 2016/6/30	0.89%
4	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	2,623,940,000	100.73 2,643,304,677	101.37 2,660,019,175	2.000000 2021/5/31	0.77%
5	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	2,385,400,000	104.79 2,499,708,368	104.83 2,500,829,506	3.250000 2016/12/31	0.72%
6	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	2,385,400,000	104.58 2,494,699,028	104.67 2,496,917,450	3.000000 2017/2/28	0.72%
7	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	2,445,035,000	101.78 2,488,581,073	101.69 2,486,380,541	1.750000 2016/5/31	0.72%
8	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	2,385,400,000	103.92 2,479,026,950	103.96 2,480,052,672	3.000000 2016/9/30	0.71%
9	US T N/B 2.375 03/31/16 アメリカ	国債証券	2,385,400,000	102.27 2,439,620,142	102.24 2,438,976,084	2.375000 2016/3/31	0.70%
10	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	2,146,860,000	109.71 2,355,320,106	110.15 2,364,895,101	3.625000 2020/2/15	0.68%
11	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	2,146,860,000	105.11 2,256,714,826	105.15 2,257,552,101	3.125000 2017/4/30	0.65%
12	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	2,266,130,000	99.17 2,247,434,427	99.30 2,250,267,090	0.750000 2017/12/31	0.65%
13	US T N/B 2.0 04/30/16 アメリカ	国債証券	2,146,860,000	101.95 2,188,788,175	101.92 2,188,101,180	2.000000 2016/4/30	0.63%
14	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	2,027,590,000	106.44 2,158,349,279	106.44 2,158,187,071	4.875000 2016/8/15	0.62%
15	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	2,146,860,000	99.59 2,138,208,154	99.68 2,140,054,453	0.625000 2017/5/31	0.62%
16	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	2,146,860,000	99.10 2,127,559,728	99.17 2,129,234,279	0.500000 2017/7/31	0.61%
17	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 イタリア	国債証券	1,978,020,000	107.12 2,118,934,144	107.24 2,121,367,109	4.000000 2017/2/1	0.61%
18	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	2,146,860,000	98.42 2,112,961,080	98.77 2,120,518,027	1.125000 2019/5/31	0.61%

19	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,967,955,000	104.72 2,060,960,553	105.23 2,071,036,482	2.625000 2020/8/15	0.60%
20	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,908,320,000	105.21 2,007,896,137	105.50 2,013,334,849	2.750000 2019/2/15	0.58%
21	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,789,050,000	109.41 1,957,524,838	109.48 1,958,795,064	4.750000 2017/8/15	0.56%
22	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	1,724,085,000	108.35 1,868,184,024	108.37 1,868,459,877	3.750000 2017/4/25	0.54%
23	US T N/B 0.875 07/31/19 アメリカ	国債証券	1,908,320,000	97.18 1,854,638,958	97.47 1,860,154,003	0.875000 2019/7/31	0.54%
24	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,657,260,000	111.93 1,854,971,118	112.23 1,859,942,898	4.500000 2018/2/1	0.54%
25	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,669,780,000	109.25 1,824,234,650	109.67 1,831,331,215	3.500000 2020/5/15	0.53%
26	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,848,685,000	97.27 1,798,271,360	97.67 1,805,629,126	1.000000 2019/11/30	0.52%
27	US T N/B 4.625 02/15/17 アメリカ	国債証券	1,669,780,000	107.78 1,799,839,164	107.73 1,798,987,576	4.625000 2017/2/15	0.52%
28	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,669,780,000	107.08 1,788,033,819	107.19 1,789,920,671	3.500000 2018/2/15	0.52%
29	US T N/B 1.0 05/31/18 アメリカ	国債証券	1,789,050,000	99.39 1,778,136,795	99.53 1,780,659,355	1.000000 2018/5/31	0.51%
30	US T N/B 2.75 11/30/16 アメリカ	国債証券	1,669,780,000	103.77 1,732,780,799	103.82 1,733,565,596	2.750000 2016/11/30	0.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
国債証券	97.22%
合計	97.22%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2703月	買建	560	8,277,509,440	8,542,800,000	2.54%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2015年03月	売建	3,400,000	405,177,580	405,484,000	0.13%
		ユーロ売/円買2015年03月	売建	900,000	120,931,600	120,285,000	0.04%
		イギリス・ポンド売/円買2015年03月	売建	300,000	55,364,100	55,179,000	0.02%
		カナダ・ドル売/円買2015年03月	売建	300,000	28,622,760	28,620,000	0.01%
		オーストラリア・ドル売/円買2015年03月	売建	300,000	27,943,200	27,942,000	0.01%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S & P 5 0 0 F U T U R E Mar 1 5	買建	61	3,807,799,111	3,837,628,538	1.20%
	EUREX取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 Mar 1 5	買建	238	1,097,718,237	1,136,206,764	0.36%
	ICE-EU	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E Mar 1 5	買建	41	515,567,702	521,563,552	0.16%
	シドニー先物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S Mar 1 5	買建	19	257,656,976	260,135,298	0.08%
	モントリオール取引所	S & P / T S E 6 0 I X F U T M ar 1 5	買建	14	237,946,945	238,214,121	0.07%

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2015年03月	買建	3,930,000	467,907,822	468,691,800	0.13%
		シンガポール・ドル 買/円売2015年0 3月	買建	1,300,000	114,214,880	114,192,000	0.03%
		オーストラリア・ドル 買/円売2015年0 3月	買建	1,220,000	114,105,624	113,643,000	0.03%
		ポーランド・ズロチ 買/円売2015年0 3月	買建	3,525,000	114,648,510	113,540,250	0.03%
		メキシコ・ペソ買/円 売2015年03月	買建	6,260,000	49,817,080	49,767,000	0.01%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成27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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第3計算期間末 (平成18年2月27日)	2,058	2,058	1.1990	1.1990
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	2,669	2,669	1.2585	1.2585
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	3,305	3,305	1.2076	1.2076
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	3,259	3,259	1.0599	1.0599
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	3,884	3,884	1.1365	1.1365
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	4,419	4,419	1.1651	1.1651
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	4,993	4,993	1.1720	1.1720
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	5,846	5,846	1.2689	1.2689
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	6,797	6,797	1.3874	1.3874
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	8,185	8,185	1.5056	1.5056
平成26年2月末日	6,966	-	1.3825	-
3月末日	6,999	-	1.3833	-
4月末日	6,980	-	1.3767	-
5月末日	7,136	-	1.3884	-
6月末日	7,212	-	1.4056	-
7月末日	7,499	-	1.4146	-
8月末日	7,558	-	1.4177	-
9月末日	7,666	-	1.4354	-
10月末日	7,740	-	1.4414	-
11月末日	7,955	-	1.4810	-
12月末日	7,975	-	1.4926	-
平成27年1月末日	8,068	-	1.4875	-
2月末日	8,209	-	1.5085	-

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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第3計算期間末 (平成18年2月27日)	5,022	5,022	1.3523	1.3523
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	6,979	6,979	1.4627	1.4627
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	8,199	8,199	1.3419	1.3419
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	7,395	7,395	1.0433	1.0433
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	9,529	9,529	1.1659	1.1659
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	10,826	10,826	1.2065	1.2065
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	11,905	11,905	1.1984	1.1984
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	14,251	14,251	1.3506	1.3506
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	16,454	16,454	1.5495	1.5495
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	19,545	19,545	1.7503	1.7503
平成26年2月末日	16,700	-	1.5403	-
3月末日	16,783	-	1.5443	-
4月末日	16,617	-	1.5326	-
5月末日	16,981	-	1.5512	-
6月末日	17,311	-	1.5799	-
7月末日	17,711	-	1.5953	-
8月末日	17,777	-	1.5989	-
9月末日	18,174	-	1.6315	-
10月末日	18,272	-	1.6370	-
11月末日	19,000	-	1.7097	-
12月末日	19,011	-	1.7212	-
平成27年1月末日	19,123	-	1.7085	-
2月末日	19,605	-	1.7564	-

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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第3計算期間末 (平成18年2月27日)	4,156	4,156	1.5136	1.5136
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	6,033	6,033	1.6848	1.6848
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	7,103	7,103	1.4810	1.4810
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	5,656	5,656	1.0219	1.0219
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	7,667	7,667	1.1890	1.1890
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	8,673	8,673	1.2395	1.2395
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	9,234	9,234	1.2166	1.2166
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	11,326	11,326	1.4236	1.4236
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	13,230	13,230	1.7075	1.7075
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	15,889	15,889	2.0030	2.0030
平成26年2月末日	13,310	-	1.6936	-
3月末日	13,340	-	1.7014	-
4月末日	13,189	-	1.6841	-
5月末日	13,536	-	1.7104	-
6月末日	13,861	-	1.7514	-
7月末日	14,148	-	1.7742	-
8月末日	14,163	-	1.7784	-
9月末日	14,589	-	1.8280	-
10月末日	14,687	-	1.8331	-
11月末日	15,371	-	1.9441	-
12月末日	15,390	-	1.9554	-
平成27年1月末日	15,386	-	1.9339	-
2月末日	15,979	-	2.0128	-

【分配の推移】

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

	1 口当たりの分配金(円)
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

	1 口当たりの分配金(円)
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

	1 口当たりの分配金(円)
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

【収益率の推移】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

	収益率(%)
第3計算期間	8.8
第4計算期間	5.0
第5計算期間	4.0
第6計算期間	12.2
第7計算期間	7.2
第8計算期間	2.5
第9計算期間	0.6
第10計算期間	8.3
第11計算期間	9.3
第12計算期間	8.5

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

	収益率(%)
第3計算期間	15.4
第4計算期間	8.2
第5計算期間	8.3
第6計算期間	22.3
第7計算期間	11.8
第8計算期間	3.5
第9計算期間	0.7
第10計算期間	12.7
第11計算期間	14.7
第12計算期間	13.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3成長型

	収益率(%)
第3計算期間	21.9
第4計算期間	11.3
第5計算期間	12.1
第6計算期間	31.0
第7計算期間	16.4
第8計算期間	4.2
第9計算期間	1.8
第10計算期間	17.0
第11計算期間	19.9
第12計算期間	17.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

	設定口数	解約口数
第3計算期間	1,071,241,518	234,014,125
第4計算期間	746,595,858	341,955,723
第5計算期間	1,023,536,793	407,728,822
第6計算期間	808,835,748	470,954,147
第7計算期間	717,089,255	374,538,190
第8計算期間	717,088,658	341,609,549
第9計算期間	891,096,153	423,802,872
第10計算期間	792,020,789	445,175,024
第11計算期間	1,211,792,457	920,086,264
第12計算期間	1,286,101,728	748,268,806

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

	設定口数	解約口数
第3計算期間	2,610,265,343	320,692,996
第4計算期間	1,520,234,750	462,264,605
第5計算期間	1,986,010,161	647,207,655
第6計算期間	1,694,085,942	716,280,777
第7計算期間	1,585,255,449	499,713,782
第8計算期間	1,458,689,281	659,115,611
第9計算期間	1,799,986,538	838,294,174
第10計算期間	1,442,236,754	824,908,601
第11計算期間	1,713,460,271	1,646,999,165
第12計算期間	1,739,079,770	1,190,841,426

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

	設定口数	解約口数
第3計算期間	2,153,330,055	371,349,072
第4計算期間	1,327,156,219	491,810,911
第5計算期間	1,854,832,281	639,682,536
第6計算期間	1,377,219,073	638,023,646
第7計算期間	1,360,590,692	447,612,668
第8計算期間	1,167,657,064	618,314,729
第9計算期間	1,241,120,741	648,446,247
第10計算期間	1,210,113,248	844,741,332
第11計算期間	1,548,578,623	1,756,263,299
第12計算期間	1,448,206,115	1,263,916,173

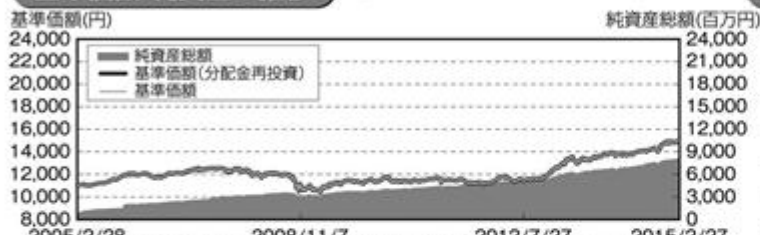
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2015年2月27日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

基準価額・純資産の推移 (2005年2月28日～2015年2月27日)



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

分配の推移(税引前)

期	日	金額
第8期	(2011.02.25)	0円
第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	63.89%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.06%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.86%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.20%

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

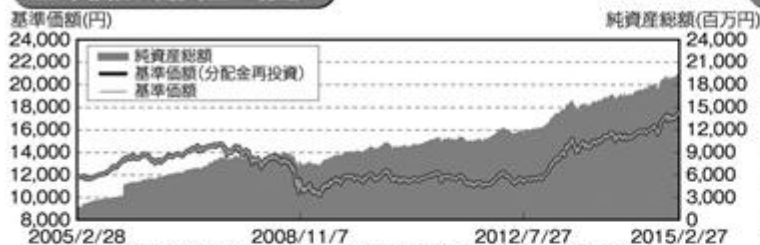
年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

基準価額・純資産の推移 (2005年2月28日～2015年2月27日)



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

分配の推移(税引前)

期	日	金額
第8期	(2011.02.25)	0円
第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

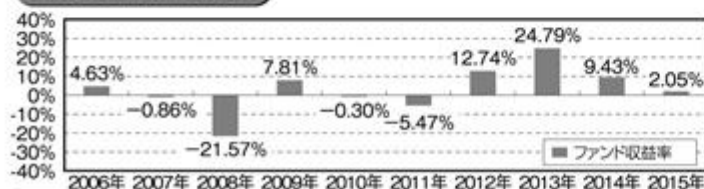
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	41.48%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	31.53%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.37%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.69%

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015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。

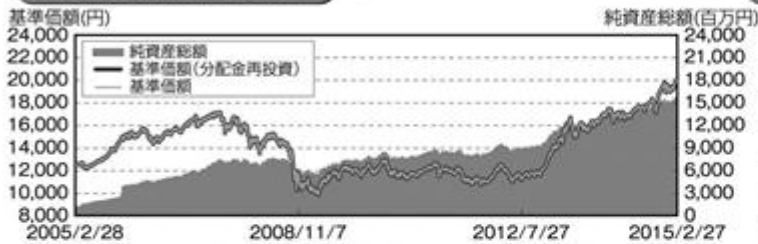
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○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:2015年2月27日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

基準価額・純資産の推移 (2005年2月28日～2015年2月27日)



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

分配の推移(税引前)

期	日	金額
第8期	(2011.02.25)	0円
第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

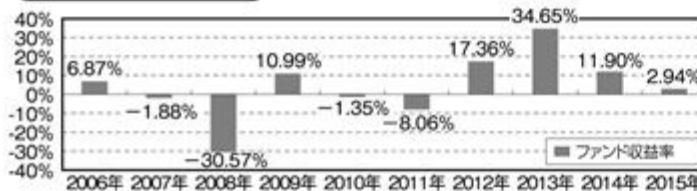
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	41.27%
2	国内債券パッシブ・ファンドマザーファンド	21.01%
3	外国株式パッシブ・ファンドマザーファンド	19.28%
4	外国債券パッシブ・ファンドマザーファンド	15.45%

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと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、2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

各マザーファンドの主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.22
内 日本	97.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.78
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.54

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.44%
2	輸送用機器	11.46%
3	銀行業	9.08%
4	情報・通信業	6.65%
5	化学	5.98%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.86%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.69%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.68%
4	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.55%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.55%
6	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.32%
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.25%
8	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.21%
9	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.05%
10	ファナック	株式	日本	電気機器	1.04%

○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:2015年2月27日

■外国株式バッシュ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.62
内 アメリカ	57.06
内 イギリス	8.06
内 スイス	4.02
内 カナダ	3.96
内 ドイツ	3.81
内 その他	18.71
投資信託受益証券	0.29
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.05
内 アメリカ	1.69
内 フランス	0.15
内 イギリス	0.14
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.04
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	2.43%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.17%
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.07%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.89%
5	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.85%
6	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.80%
7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.78%
8	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	0.73%
9	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.72%
10	PROCTER & GAMBLE CO	株式	アメリカ	家庭用品	0.71%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	9.04%
2	医薬品	7.38%
3	石油・ガス・消耗燃料	7.11%
4	保険	4.11%
5	メディア	3.07%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.20
株価指数先物取引(買建)	1.88

■国内債券バッシュ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	80.84
内 日本	80.84
地方債証券	6.78
内 日本	6.78
特殊債券	6.44
内 日本	6.44
社債券	5.48
内 日本	5.41
内 アメリカ	0.07
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.46
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	334回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/6/20	1.32%
2	335回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.500000	2024/9/20	1.19%
3	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.18%
4	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.18%
5	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/3/20	1.08%
6	114回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2018/9/20	1.06%
7	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.06%
8	103回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2017/3/20	1.06%
9	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.06%
10	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.06%

■外国債券バッシュ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.22
内 アメリカ	40.37
内 イタリア	9.71
内 フランス	9.68
内 イギリス	8.18
内 ドイツ	7.77
内 その他	21.51
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.78
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16	国債証券	アメリカ	0.625000	2016/7/15	1.31%
2	US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	アメリカ	2.500000	2024/5/15	0.91%
3	US T N/B 3.25 06/30/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/6/30	0.89%
4	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/5/31	0.77%
5	US T N/B 3.25 12/31/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/12/31	0.72%
6	US T N/B 3.0 02/28/17	国債証券	アメリカ	3.000000	2017/2/28	0.72%
7	US T N/B 1.75 05/31/16	国債証券	アメリカ	1.750000	2016/5/31	0.72%
8	US T N/B 3.0 09/30/16	国債証券	アメリカ	3.000000	2016/9/30	0.71%
9	US T N/B 2.375 03/31/16	国債証券	アメリカ	2.375000	2016/3/31	0.70%
10	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.68%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.25

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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、各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

・解約価額の照会方法等

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.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。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

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

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

信託期間は平成14年12月13日から無期限です。

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】**イ．償還規定**

- a. 委託会社は各ファンドについて受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 委託会社は上記a. b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記a. b. につき、上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えると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、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ができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a. ~ e. の規定に従います。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

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

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年2月25日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

(URL <http://www.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、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとし
ます。

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】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間（平成26年2月26日から平成27年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	214,037,426	283,025,420
親投資信託受益証券	6,594,058,670	7,941,428,767
未収入金	-	5,422,000
流動資産合計	6,808,096,096	8,229,876,187
資産合計	6,808,096,096	8,229,876,187
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,610,348	32,813,069
未払受託者報酬	1,057,327	1,278,423
未払委託者報酬	8,106,473	9,801,573
その他未払費用	167,325	202,325
流動負債合計	10,941,473	44,095,390
負債合計	10,941,473	44,095,390
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,899,083,576	1 5,436,916,498
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	1,898,071,047	2,748,864,299
(分配準備積立金)	914,008,345	1,385,304,521
元本等合計	6,797,154,623	8,185,780,797
純資産合計	6,797,154,623	8,185,780,797
負債純資産合計	6,808,096,096	8,229,876,187

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第11期		第12期	
	自 至	平成25年2月26日 平成26年2月25日	自 至	平成26年2月26日 平成27年2月25日
営業収益				
受取利息		125,104		132,132
有価証券売買等損益		585,028,655		649,687,097
営業収益合計		585,153,759		649,819,229
営業費用				
受託者報酬		2,037,534		2,416,721
委託者報酬		15,621,773		18,528,812
その他費用		322,446		382,481
営業費用合計		17,981,753		21,328,014
営業利益又は営業損失（ ）		567,172,006		628,491,215
経常利益又は経常損失（ ）		567,172,006		628,491,215
当期純利益又は当期純損失（ ）		567,172,006		628,491,215
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（ ）		63,459,911		36,145,874
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,238,793,444		1,898,071,047
剰余金増加額又は欠損金減少額		409,225,691		550,280,270
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		409,225,691		550,280,270
剰余金減少額又は欠損金増加額		253,660,183		291,832,359
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		253,660,183		291,832,359
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,898,071,047		2,748,864,299

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	4,607,377,383円	4,899,083,576円
期中追加設定元本額	1,211,792,457円	1,286,101,728円
期中一部解約元本額	920,086,264円	748,268,806円
2 . 受益権の総数	4,899,083,576口	5,436,916,498口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（112,731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（503,599,364円）、信託約款に規定される収益調整金（984,062,702円）及び分配準備積立金（410,296,250円）より分配対象収益は1,898,071,047円（1万口当たり3,874.34円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（125,935円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（592,219,406円）、信託約款に規定される収益調整金（1,363,559,778円）及び分配準備積立金（792,959,180円）より分配対象収益は2,748,864,299円（1万口当たり5,055.93円）ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第11期 自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	493,478,795	612,554,436
合計	493,478,795	612,554,436

（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11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.3874円	1.5056円
（1万口当たり純資産額）	(13,874円)	(15,056円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化 法）・マザーファンド	760,827,655	1,629,768,919	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	4,270,992,250	5,241,788,788	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	145,630,156	425,487,626	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	341,847,976	644,383,434	
親投資信託受益証券 合計		5,519,298,037	7,941,428,767	
合計		5,519,298,037	7,941,428,767	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間（平成26年2月26日から平成27年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

【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11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	517,763,133	633,971,932
親投資信託受益証券	15,963,557,852	18,969,348,001
未収入金	6,600,000	14,204,000
流動資産合計	16,487,920,985	19,617,523,933
資産合計	16,487,920,985	19,617,523,933
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,556,369	42,393,268
未払受託者報酬	2,541,316	3,028,503
未払委託者報酬	22,025,127	26,247,343
その他未払費用	402,291	479,421
流動負債合計	33,525,103	72,148,535
負債合計	33,525,103	72,148,535
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,618,915,107	1 11,167,153,451
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	5,835,480,775	8,378,221,947
(分配準備積立金)	2,994,547,640	4,828,001,454
元本等合計	16,454,395,882	19,545,375,398
純資産合計	16,454,395,882	19,545,375,398
負債純資産合計	16,487,920,985	19,617,523,933

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期		第12期	
	自 至	平成25年2月26日 平成26年2月25日	自 至	平成26年2月26日 平成27年2月25日
営業収益				
受取利息		298,268		311,111
有価証券売買等損益		2,158,349,645		2,283,498,149
営業収益合計		2,158,647,913		2,283,809,260
営業費用				
受託者報酬		4,920,951		5,743,392
委託者報酬		42,649,043		49,776,832
その他費用		778,981		909,198
営業費用合計		48,348,975		56,429,422
営業利益又は営業損失()		2,110,298,938		2,227,379,838
経常利益又は経常損失()		2,110,298,938		2,227,379,838
当期純利益又は当期純損失()		2,110,298,938		2,227,379,838
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()		192,815,455		87,381,935
期首剰余金又は期首欠損金()		3,699,220,038		5,835,480,775
剰余金増加額又は欠損金減少額		807,095,797		1,059,807,795
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		807,095,797		1,059,807,795
剰余金減少額又は欠損金増加額		588,318,543		657,064,526
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		588,318,543		657,064,526
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		5,835,480,775		8,378,221,947

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	10,552,454,001円	10,618,915,107円
期中追加設定元本額	1,713,460,271円	1,739,079,770円
期中一部解約元本額	1,646,999,165円	1,190,841,426円
2 . 受益権の総数	10,618,915,107口	11,167,153,451口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（276,885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（1,917,206,598円）、信託約款に規定される収益調整金（2,840,933,135円）及び分配準備積立金（1,077,064,157円）より分配対象収益は5,835,480,775円（1万口当たり5,495.36円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（303,852円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（2,139,694,051円）、信託約款に規定される収益調整金（3,550,220,493円）及び分配準備積立金（2,688,003,551円）より分配対象収益は8,378,221,947円（1万口当たり7,502.56円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第11期 自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,891,216,991	2,203,850,803
合計	1,891,216,991	2,203,850,803

（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11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.5495円	1.7503円
（1万口当たり純資産額）	(15,495円)	(17,503円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	2,858,843,867	6,123,929,447	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,629,308,611	8,136,150,458	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	828,101,362	2,419,463,749	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,214,750,317	2,289,804,347	
親投資信託受益証券 合計		11,531,004,157	18,969,348,001	
合計		11,531,004,157	18,969,348,001	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間（平成26年2月26日から平成27年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

【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11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	419,583,796	519,489,353
親投資信託受益証券	12,846,013,553	15,418,780,380
未収入金	2,100,000	11,433,000
流動資産合計	13,267,697,349	15,949,702,733
資産合計	13,267,697,349	15,949,702,733
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,300,999	34,171,561
未払受託者報酬	2,039,709	2,437,196
未払委託者報酬	19,717,647	23,560,006
その他未払費用	322,865	385,807
流動負債合計	37,381,220	60,554,570
負債合計	37,381,220	60,554,570
純資産の部		
元本等		
元本	1 7,748,322,084	1 7,932,612,026
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	5,481,994,045	7,956,536,137
(分配準備積立金)	2,669,382,052	4,480,901,966
元本等合計	13,230,316,129	15,889,148,163
純資産合計	13,230,316,129	15,889,148,163
負債純資産合計	13,267,697,349	15,949,702,733

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第11期		第12期	
	自 至	平成25年2月26日 平成26年2月25日	自 至	平成26年2月26日 平成27年2月25日
営業収益				
受取利息		244,757		253,206
有価証券売買等損益		2,277,271,704		2,400,303,827
営業収益合計		2,277,516,461		2,400,557,033
営業費用				
受託者報酬		3,951,694		4,600,154
委託者報酬		38,200,597		44,469,069
その他費用		625,519		728,195
営業費用合計		42,777,810		49,797,418
営業利益又は営業損失（ ）		2,234,738,651		2,350,759,615
経常利益又は経常損失（ ）		2,234,738,651		2,350,759,615
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,234,738,651		2,350,759,615
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（ ）		286,421,910		145,017,108
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,370,336,861		5,481,994,045
剰余金増加額又は欠損金減少額		928,137,839		1,168,729,899
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		928,137,839		1,168,729,899
剰余金減少額又は欠損金増加額		764,797,396		899,930,314
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		764,797,396		899,930,314
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,481,994,045		7,956,536,137

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	7,956,006,760円	7,748,322,084円
期中追加設定元本額	1,548,578,623円	1,448,206,115円
期中一部解約元本額	1,756,263,299円	1,263,916,173円
2 . 受益権の総数	7,748,322,084口	7,932,612,026口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(221,643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(1,948,095,098円)、信託約款に規定される収益調整金(3,028,699,791円)及び分配準備積立金(721,065,311円)より分配対象収益は5,698,081,843円(1万口当たり7,353.96円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(244,086円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(2,205,498,421円)、信託約款に規定される収益調整金(3,558,455,879円)及び分配準備積立金(2,275,159,459円)より分配対象収益は8,039,357,845円(1万口当たり10,134.57円)ですが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第11期 自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日	第12期 自 平成26年2月26日 至 平成27年2月25日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,054,993,489	2,309,302,254
合計	2,054,993,489	2,309,302,254

（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11期 平成26年2月25日現在	第12期 平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.7075円	2.0030円
（1万口当たり純資産額）	(17,075円)	(20,030円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	3,046,248,134	6,525,368,127	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,732,232,561	3,353,269,022	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,051,813,641	3,073,083,914	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,308,784,784	2,467,059,317	
親投資信託受益証券 合計		8,139,079,120	15,418,780,380	
合計		8,139,079,120	15,418,780,380	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		11,300,638,260	6,529,907,207
株式	2	312,658,405,390	323,712,344,980
派生商品評価勘定		280,076,705	230,359,500
未収入金		-	10,073,456,661
未収配当金		296,589,336	480,294,446
差入委託証拠金		222,510,905	-
流動資産合計		324,758,220,596	341,026,362,794
資産合計		324,758,220,596	341,026,362,794
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		154,187,644	-
前受金		276,030,905	238,906,000
未払金		1,908,676	-
未払解約金		90,566,000	7,100,316,000
流動負債合計		522,693,225	7,339,222,000
負債合計		522,693,225	7,339,222,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	188,809,272,100	155,777,350,252
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		135,426,255,271	177,909,790,542
元本等合計		324,235,527,371	333,687,140,794
純資産合計		324,235,527,371	333,687,140,794
負債純資産合計		324,758,220,596	341,026,362,794

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	228,600,317,852円	188,809,272,100円
同期中追加設定元本額	38,039,433,917円	22,731,111,433円
同期中一部解約元本額	77,830,479,669円	55,763,033,281円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	4,033,737,176円	3,916,623,435円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,372,061,781円	1,411,544,861円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	37,734,354,972円	35,645,328,124円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	757,481,705円	760,827,655円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,859,610,081円	2,858,843,867円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,039,958,422円	3,046,248,134円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	386,095,927円	384,627,133円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,267,213,606円	1,297,087,701円

D I A M D C バラン ス70インデックスファ ンド	1,088,127,674円	1,129,670,818円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	111,502,908円	77,696,556円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	1,364,450,473円	1,241,110,316円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	20,448,323円	28,078,282円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国10)	8,307,168円	16,078,346円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	11,558,016円	32,233,265円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	27,609,029円	81,358,474円
投資のソムリエ	120,681,929円	207,006,506円
クルーズコントロール	21,759,643円	705,575,334円
投資のソムリエ<DC年 金>	545,733円	3,030,563円
D I A M 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	580,728円	34,666,087円
D I A M D C バラン ス・F(成長型)	- 円	6,788,927円
クルーズコントロール< DC年金>	- 円	212,653円
D I A Mワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	155,568,450円	127,247,686円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,890,060,568円	1,965,284,782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)	965,282,970円	586,008,304円
D I A M国際分散 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	123,456,284円	64,423,090円
D I A M国際分散 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	412,806,035円	281,728,600円
D I A M国内重視 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	109,050,843円	56,864,102円
D I A M国内重視 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	181,178,060円	109,097,529円
D I A M世界 balan スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	14,929,403,132円	9,684,470,541円

D I A M世界バランス ファンド5 0 V A (適格 機関投資家限定)	4,948,236,931円	3,420,390,133円
D I A Mバランスファン ド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	3,568,706,610円	2,783,902,029円
D I A Mバランスファン ド3 7 . 5 V A (適格機 関投資家限定)	2,412,090,211円	1,923,494,326円
D I A Mバランスファン ド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	5,811,787,943円	4,886,749,268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)	674,290,940円	415,360,894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)	1,720,122,396円	1,107,957,901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)	1,580,270,828円	1,206,730,476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)	8,198,833,798円	5,254,130,543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)	87,280,606円	92,409,818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)	3,029,796,482円	1,868,209,643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)	7,515,993,196円	6,273,150,235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)	291,570,512円	178,472,559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)	28,248,047,481円	23,203,221,664円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1,430,352,903円	967,970,136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)	3,349,426,242円	2,677,293,646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)	17,435,869,317円	14,599,521,643円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	14,639,429円	38,223円

	D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	84,011,222円	10,776,546円
	D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	85,761,418円	47,591,162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)	15,490,002,989円	13,030,501,833円
	D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	191,093,460円	123,934,533円
	D I A M国内バランス3 0VA(適格機関投資家 限定)	57,997,307円	43,783,675円
	D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	122,532,453円	1,718,173円
	D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	84,697円	103,705,160円
	D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	126,520円	120,223円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1212)(適格機関 投資家限定)	935,035,848円	818,354,088円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1303)(適格機関 投資家限定)	2,351,917,037円	2,114,709,804円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1306)(適格機関 投資家限定)	3,056,002,530円	2,751,007,520円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1309)(適格機関 投資家限定)	124,499,158円	112,382,727円
	計	188,809,272,100円	155,777,350,252円
2.	受益権の総数	188,809,272,100口	155,777,350,252口
3.	2 差入代用有価証券	株式 2,995,000,000円	株式 4,063,500,000円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	11,283,961,250	17,758,862,010
合計	11,283,961,250	17,758,862,010

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年2月8日から平成26年2月25日まで及び平成27年2月10日から平成27年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成27年2月25日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	11,384,830,000	-	11,511,045,000	126,215,000	9,219,438,000	-	9,450,000,000	230,562,000
合計	11,384,830,000	-	11,511,045,000	126,215,000	9,219,438,000	-	9,450,000,000	230,562,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.7173円	2.1421円
（1万口当たり純資産額）	（17,173円）	（21,421円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	71,000	296.00	21,016,000	
日本水産	203,000	391.00	79,373,000	
マルハニチロ	31,900	1,778.00	56,718,200	
ハウスイ	14,000	136.00	1,904,000	
サカタのタネ	25,600	1,945.00	49,792,000	
ホクト	18,500	2,444.00	45,214,000	
ショーボンドホールディングス	15,400	5,100.00	78,540,000	
ミライト・ホールディングス	50,800	1,237.00	62,839,600	
タマホーム	11,600	566.00	6,565,600	
サンヨーホームズ	1,800	664.00	1,195,200	
住石ホールディングス	46,000	118.00	5,428,000	
日鉄鉱業	45,000	454.00	20,430,000	
三井松島産業	108,000	136.00	14,688,000	
国際石油開発帝石	867,300	1,400.00	1,214,220,000	
日本海洋掘削	4,900	4,215.00	20,653,500	
石油資源開発	23,400	3,975.00	93,015,000	
K&Oエナジーグループ	11,100	1,537.00	17,060,700	
ダイセキ環境ソリューション	2,000	1,859.00	3,718,000	
安藤・間	110,100	707.00	77,840,700	
東急建設	58,700	756.00	44,377,200	
コムシスホールディングス	73,400	1,431.00	105,035,400	
ミサワホーム	19,500	1,042.00	20,319,000	
高松コンストラクショングループ	12,500	2,579.00	32,237,500	
東建コーポレーション	6,200	5,270.00	32,674,000	
ヤマウラ	8,400	410.00	3,444,000	
大成建設	833,000	721.00	600,593,000	
大林組	494,000	800.00	395,200,000	
清水建設	504,000	859.00	432,936,000	
飛鳥建設	107,700	271.00	29,186,700	
長谷工コーポレーション	205,900	1,117.00	229,990,300	
松井建設	2,000	735.00	1,470,000	
銭高組	24,000	399.00	9,576,000	
鹿島建設	724,000	549.00	397,476,000	
不動テトラ	124,900	256.00	31,974,400	
大末建設	6,500	941.00	6,116,500	
鉄建建設	100,000	463.00	46,300,000	
日鉄住金テックスエンジ	31,000	558.00	17,298,000	
西松建設	178,000	454.00	80,812,000	
三井住友建設	668,700	177.00	118,359,900	
大豊建設	45,000	686.00	30,870,000	
前田建設工業	110,000	948.00	104,280,000	
佐田建設	58,000	147.00	8,526,000	
ナカノフドー建設	13,300	409.00	5,439,700	

奥村組	157,000	589.00	92,473,000
大和小田急建設	9,200	929.00	8,546,800
東鉄工業	19,900	2,841.00	56,535,900
イチケン	19,000	337.00	6,403,000
浅沼組	54,000	159.00	8,586,000
戸田建設	206,000	475.00	97,850,000
熊谷組	207,000	396.00	81,972,000
青木あすなろ建設	10,200	831.00	8,476,200
北野建設	35,000	368.00	12,880,000
植木組	21,000	271.00	5,691,000
三井ホーム	22,000	517.00	11,374,000
矢作建設工業	20,500	805.00	16,502,500
ピーエス三菱	17,700	431.00	7,628,700
東日本ハウス	20,900	560.00	11,704,000
大東建託	62,500	13,330.00	833,125,000
新日本建設	20,000	455.00	9,100,000
N I P P O	38,000	1,771.00	67,298,000
東亜道路工業	31,000	422.00	13,082,000
前田道路	52,000	1,836.00	95,472,000
日本道路	49,000	609.00	29,841,000
東亜建設工業	124,000	221.00	27,404,000
若築建設	95,000	202.00	19,190,000
東洋建設	44,100	539.00	23,769,900
五洋建設	183,000	442.00	80,886,000
大林道路	19,000	685.00	13,015,000
世紀東急工業	24,100	546.00	13,158,600
福田組	25,000	812.00	20,300,000
日本ドライケミカル	2,200	2,276.00	5,007,200
住友林業	121,600	1,240.00	150,784,000
日本基礎技術	19,900	436.00	8,676,400
日成ビルド工業	46,000	295.00	13,570,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	76,000	95.00	7,220,000
巴コーポレーション	20,800	419.00	8,715,200
パナホーム	62,000	778.00	48,236,000
大和ハウス工業	482,200	2,368.00	1,141,849,600
ライト工業	26,500	1,033.00	27,374,500
積水ハウス	506,600	1,619.00	820,185,400
日特建設	22,200	552.00	12,254,400
北陸電気工事	9,000	803.00	7,227,000
ユアテック	26,000	835.00	21,710,000
西部電気工業	14,000	475.00	6,650,000
四電工	6,000	474.00	2,844,000
中電工	23,900	1,999.00	47,776,100
関電工	75,000	693.00	51,975,000
きんでん	110,000	1,469.00	161,590,000
東京エネシス	19,000	838.00	15,922,000
トーエネック	23,000	597.00	13,731,000
住友電設	13,100	1,282.00	16,794,200
日本電設工業	26,900	1,875.00	50,437,500
協和エクシオ	69,900	1,145.00	80,035,500

新日本空調	14,200	981.00	13,930,200	
日本工営	51,000	493.00	25,143,000	
N D S	28,000	305.00	8,540,000	
九電工	30,000	1,442.00	43,260,000	
三機工業	33,700	864.00	29,116,800	
日揮	165,000	2,484.50	409,942,500	
中外炉工業	50,000	288.00	14,400,000	
ヤマト	15,000	447.00	6,705,000	
太平電業	22,000	832.00	18,304,000	
高砂熱学工業	46,000	1,442.00	66,332,000	
三晃金属工業	17,000	270.00	4,590,000	
N E C ネットズエスアイ	18,200	2,369.00	43,115,800	
朝日工業社	19,000	442.00	8,398,000	
明星工業	29,200	683.00	19,943,600	
大気社	23,600	2,758.00	65,088,800	
ダイダン	22,000	728.00	16,016,000	
日比谷総合設備	21,300	1,722.00	36,678,600	
東芝プラントシステム	26,700	1,785.00	47,659,500	
日本製粉	102,000	589.00	60,078,000	
日清製粉グループ本社	180,800	1,426.00	257,820,800	
日東富士製粉	8,000	344.00	2,752,000	
昭和産業	69,000	505.00	34,845,000	
鳥越製粉	13,900	709.00	9,855,100	
中部飼料	16,600	684.00	11,354,400	
フィード・ワンホールディングス	103,000	119.00	12,257,000	
東洋精糖	29,000	105.00	3,045,000	
日本甜菜製糖	86,000	210.00	18,060,000	
三井製糖	65,000	429.00	27,885,000	
塩水港精糖	18,300	286.00	5,233,800	
ネクスト	18,100	936.00	16,941,600	
日本M & Aセンター	23,800	3,810.00	90,678,000	
ノバレーゼ	4,100	865.00	3,546,500	
アコーディア・ゴルフ	57,700	1,216.00	70,163,200	
タケエイ	15,000	988.00	14,820,000	
トラスト・テック	2,800	1,884.00	5,275,200	
パソナグループ	11,600	688.00	7,980,800	
C D S	3,700	994.00	3,677,800	
リンクアンドモチベーション	21,300	157.00	3,344,100	
G C A サヴィアン	12,100	1,369.00	16,564,900	
エス・エム・エス	17,300	1,345.00	23,268,500	
テンブホールディングス	30,200	4,000.00	120,800,000	
リニカル	4,100	979.00	4,013,900	
クックパッド	9,800	4,715.00	46,207,000	
エスクリ	5,400	1,291.00	6,971,400	
アイ・ケイ・ケイ	4,300	1,130.00	4,859,000	
森永製菓	149,000	375.00	55,875,000	
中村屋	39,000	513.00	20,007,000	
江崎グリコ	38,100	5,140.00	195,834,000	
名糖産業	7,700	1,177.00	9,062,900	
不二家	95,000	198.00	18,810,000	

山崎製パン	121,000	1,947.00	235,587,000
第一屋製パン	25,000	129.00	3,225,000
モロゾフ	27,000	375.00	10,125,000
亀田製菓	9,200	4,675.00	43,010,000
寿スピリッツ	4,000	2,591.00	10,364,000
カルビー	61,000	4,535.00	276,635,000
森永乳業	148,000	461.00	68,228,000
六甲バター	7,700	1,162.00	8,947,400
ヤクルト本社	88,300	7,300.00	644,590,000
明治ホールディングス	48,800	13,380.00	652,944,000
雪印メグミルク	38,900	1,571.00	61,111,900
プリマハム	93,000	279.00	25,947,000
日本ハム	121,000	2,747.00	332,387,000
伊藤ハム	91,000	652.00	59,332,000
林兼産業	55,000	108.00	5,940,000
丸大食品	86,000	406.00	34,916,000
米久	5,400	1,874.00	10,119,600
S Foods	10,400	2,068.00	21,507,200
学情	5,800	1,014.00	5,881,200
スタジオアリス	7,100	2,093.00	14,860,300
シミックホールディングス	6,100	1,953.00	11,913,300
システナ	14,500	883.00	12,803,500
デジタルアーツ	7,900	1,131.00	8,934,900
新日鉄住金ソリューションズ	12,100	3,385.00	40,958,500
総合警備保障	51,200	3,515.00	179,968,000
キューブシステム	6,700	649.00	4,348,300
日本駐車場開発	158,400	130.00	20,592,000
コア	6,300	932.00	5,871,600
カカクコム	102,100	1,874.00	191,335,400
アイロムホールディングス	3,800	1,654.00	6,285,200
ルネサンス	7,900	1,227.00	9,693,300
ディップ	3,400	5,320.00	18,088,000
SBSホールディングス	11,000	884.00	9,724,000
オプト	6,900	663.00	4,574,700
新日本科学	14,500	924.00	13,398,000
ツクイ	18,200	943.00	17,162,600
総合臨床ホールディングス	7,300	492.00	3,591,600
キャリアデザインセンター	4,600	962.00	4,425,200
エムスリー	132,800	2,585.00	343,288,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,300	794.00	8,972,200
アウトソーシング	5,900	1,858.00	10,962,200
ウェルネット	4,100	2,301.00	9,434,100
ディー・エヌ・エー	75,600	1,398.00	105,688,800
博報堂DYホールディングス	212,800	1,287.00	273,873,600
ぐるなび	17,800	1,860.00	33,108,000
エスアールジータカミヤ	12,500	849.00	10,612,500
一休	12,100	1,745.00	21,114,500
ジャパンベストレスキューシステム	12,600	261.00	3,288,600
ファンコミュニケーションズ	26,500	1,162.00	30,793,000
ジェイコムホールディングス	3,500	824.00	2,884,000

P G Mホールディングス	21,700	1,367.00	29,663,900
W D Bホールディングス	5,600	822.00	4,603,200
ティア	4,100	597.00	2,447,700
バリューコマース	12,700	531.00	6,743,700
サッポロホールディングス	270,000	467.00	126,090,000
アサヒグループホールディングス	331,100	3,719.50	1,231,526,450
麒麟ホールディングス	704,700	1,549.00	1,091,580,300
宝ホールディングス	129,500	823.00	106,578,500
オエノンホールディングス	44,000	222.00	9,768,000
養命酒製造	3,000	963.00	2,889,000
コカ・コーラウエスト	55,900	1,801.00	100,675,900
コカ・コーライーストジャパン	50,100	2,112.00	105,811,200
サントリー食品インターナショナル	98,700	4,345.00	428,851,500
ダイトードリンク	8,400	4,860.00	40,824,000
伊藤園	49,000	2,488.00	121,912,000
キーコーヒー	14,800	1,809.00	26,773,200
ユニカフェ	5,000	903.00	4,515,000
ジャパンフーズ	2,600	1,157.00	3,008,200
日清オイリオグループ	80,000	441.00	35,280,000
不二製油	44,100	1,635.00	72,103,500
J - オイルミルズ	70,000	423.00	29,610,000
ローソン	54,900	7,900.00	433,710,000
サンエー	11,000	4,155.00	45,705,000
ダイユーエイト	3,200	845.00	2,704,000
カワチ薬品	11,200	2,056.00	23,027,200
エービーシー・マート	20,600	6,210.00	127,926,000
ハードオフコーポレーション	7,200	1,160.00	8,352,000
高千穂交易	5,600	1,103.00	6,176,800
アスクル	15,100	2,290.00	34,579,000
ゲオホールディングス	27,400	1,305.00	35,757,000
アダストリアホールディングス	12,300	2,968.00	36,506,400
シー・ヴィ・エス・バイエリア	19,000	127.00	2,413,000
伊藤忠食品	3,700	4,115.00	15,225,500
くらコーポレーション	8,600	3,890.00	33,454,000
キャンドウ	7,000	1,581.00	11,067,000
エレマテック	6,800	2,777.00	18,883,600
パル	8,500	3,085.00	26,222,500
J A L U X	4,200	2,020.00	8,484,000
エディオン	66,500	941.00	62,576,500
あらた	32,000	337.00	10,784,000
サーラコーポレーション	12,700	599.00	7,607,300
ワッツ	5,900	895.00	5,280,500
トーメンデバイス	2,100	1,862.00	3,910,200
J Pホールディングス	38,300	363.00	13,902,900
あみやき亭	2,500	4,125.00	10,312,500
東京エレクトロン デバイス	2,800	1,590.00	4,452,000
ひらまつ	20,100	642.00	12,904,200
双日	971,800	181.00	175,895,800
ゲンキー	1,500	10,010.00	15,015,000
アルフレッサ ホールディングス	171,600	1,692.00	290,347,200

大黒天物産	3,500	4,075.00	14,262,500	
ハニーズ	12,100	988.00	11,954,800	
キッコーマン	135,000	3,410.00	460,350,000	
味の素	380,000	2,201.50	836,570,000	
キューピー	83,900	2,871.00	240,876,900	
ハウス食品グループ本社	61,100	2,451.00	149,756,100	
カゴメ	63,900	1,810.00	115,659,000	
焼津水産化学工業	8,600	1,029.00	8,849,400	
アリアケジャパン	15,100	3,135.00	47,338,500	
ニチレイ	176,000	609.00	107,184,000	
横浜冷凍	36,400	841.00	30,612,400	
東洋水産	86,100	4,230.00	364,203,000	
イトアンド	1,900	1,884.00	3,579,600	
日清食品ホールディングス	69,700	5,890.00	410,533,000	
永谷園	7,000	1,158.00	8,106,000	
フジッコ	16,000	1,862.00	29,792,000	
ロック・フィールド	8,900	2,256.00	20,078,400	
日本たばこ産業	912,600	3,724.00	3,398,522,400	
ケンコーマヨネーズ	5,600	1,615.00	9,044,000	
わらべや日洋	9,800	1,986.00	19,462,800	
なとり	7,900	1,595.00	12,600,500	
ユーグレナ	35,700	2,034.00	72,613,800	
片倉工業	19,300	1,189.00	22,947,700	
グンゼ	124,000	324.00	40,176,000	
ヒューリック	244,800	1,336.00	327,052,800	
神栄	23,000	206.00	4,738,000	
山下医科器械	1,300	1,705.00	2,216,500	
ラサ商事	8,100	613.00	4,965,300	
アルペン	12,900	1,892.00	24,406,800	
クオール	14,900	997.00	14,855,300	
アルコニックス	8,400	1,807.00	15,178,800	
神戸物産	4,900	4,165.00	20,408,500	
ジェイアイエヌ	9,900	3,520.00	34,848,000	
ビックカメラ	63,000	1,320.00	83,160,000	
D C Mホールディングス	70,200	867.00	60,863,400	
MonotaRO	28,300	3,855.00	109,096,500	
あいホールディングス	23,300	2,353.00	54,824,900	
ディーブイエックス	4,300	1,125.00	4,837,500	
きちり	3,000	700.00	2,100,000	
アーランドサービス	1,700	4,480.00	7,616,000	
J.フロントリテイリング	183,500	1,643.00	301,490,500	
ドトール・日レスホールディングス	25,400	1,802.00	45,770,800	
マツモトキヨシホールディングス	32,400	4,015.00	130,086,000	
broncoピラー	2,600	3,835.00	9,971,000	
スタートトゥデイ	45,200	2,785.00	125,882,000	
物語コーポレーション	3,700	3,500.00	12,950,000	
ココカラファイン	15,200	3,405.00	51,756,000	
三越伊勢丹ホールディングス	288,400	1,795.00	517,678,000	
東洋紡	608,000	166.00	100,928,000	
ユニチカ	448,000	55.00	24,640,000	

富士紡ホールディングス	75,000	308.00	23,100,000
日清紡ホールディングス	98,000	1,218.00	119,364,000
倉敷紡績	158,000	206.00	32,548,000
ダイワボウホールディングス	131,000	199.00	26,069,000
シキボウ	85,000	122.00	10,370,000
日東紡績	113,000	491.00	55,483,000
トヨタ紡織	51,400	1,513.00	77,768,200
ウエルシアホールディングス	13,100	4,520.00	59,212,000
クリエイトSDホールディングス	6,400	4,110.00	26,304,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,400	973.00	26,660,200
八洲電機	11,500	579.00	6,658,500
UKCホールディングス	9,300	2,000.00	18,600,000
丸善CHIホールディングス	17,100	374.00	6,395,400
TOKAIホールディングス	71,100	569.00	40,455,900
エー・ピーカンパニー	2,100	2,015.00	4,231,500
三洋貿易	8,900	1,427.00	12,700,300
チムニー	2,700	2,348.00	6,339,600
ウイン・パートナーズ	4,800	1,441.00	6,916,800
ネクステージ	1,500	687.00	1,030,500
ジョイフル本田	8,000	4,195.00	33,560,000
キリン堂ホールディングス	4,900	826.00	4,047,400
すかいらく	53,100	1,412.00	74,977,200
日本毛織	48,000	795.00	38,160,000
大東紡織	24,000	75.00	1,800,000
トーア紡コーポレーション	69,000	76.00	5,244,000
ガイドーリミテッド	17,200	560.00	9,632,000
東京建物不動産販売	7,800	552.00	4,305,600
三栄建築設計	5,900	901.00	5,315,900
野村不動産ホールディングス	87,000	2,134.00	185,658,000
日本商業開発	4,500	1,947.00	8,761,500
プレサンスコーポレーション	4,900	3,785.00	18,546,500
常和ホールディングス	6,000	3,970.00	23,820,000
日本管理センター	7,100	1,261.00	8,953,100
エストラスト	1,600	691.00	1,105,600
フージャースホールディングス	21,700	534.00	11,587,800
オープンハウス	9,200	2,734.00	25,152,800
東急不動産ホールディングス	380,000	827.00	314,260,000
飯田グループホールディングス	94,000	1,666.00	156,604,000
帝国繊維	16,200	1,801.00	29,176,200
ブックオフコーポレーション	8,400	923.00	7,753,200
日本コークス工業	137,600	120.00	16,512,000
ミタチ産業	3,600	746.00	2,685,600
あさひ	9,600	1,164.00	11,174,400
日本調剤	1,900	4,155.00	7,894,500
コスモス薬品	7,300	18,630.00	135,999,000
シップヘルスケアホールディングス	26,500	2,608.00	69,112,000
トーエル	8,000	708.00	5,664,000
一六堂	3,600	438.00	1,576,800
ソフトクリエイトホールディングス	4,900	944.00	4,625,600

セブン&アイ・ホールディングス	606,600	4,514.50	2,738,495,700	
薬王堂	2,100	2,773.00	5,823,300	
クリエイイト・レストランツ・ホールディング	10,200	1,516.00	15,463,200	
ツルハホールディングス	30,900	7,870.00	243,183,000	
スターティア	1,300	1,574.00	2,046,200	
サンマルクホールディングス	5,200	7,730.00	40,196,000	
フェリシモ	3,800	1,029.00	3,910,200	
トリドール	15,600	1,653.00	25,786,800	
クスリのアオキ	5,700	7,700.00	43,890,000	
帝人	629,000	395.00	248,455,000	
東レ	1,191,000	989.70	1,178,732,700	
クラレ	262,200	1,584.00	415,324,800	
旭化成	960,000	1,205.50	1,157,280,000	
サカイオーベックス	41,000	196.00	8,036,000	
稲葉製作所	6,600	1,324.00	8,738,400	
宮地エンジニアリンググループ	45,000	208.00	9,360,000	
トーカロ	10,100	2,299.00	23,219,900	
アルファ	5,300	1,298.00	6,879,400	
SUMCO	105,900	2,289.00	242,405,100	
川田テクノロジーズ	2,900	4,070.00	11,803,000	
住江織物	39,000	311.00	12,129,000	
日本フェルト	8,900	576.00	5,126,400	
イチカワ	10,000	278.00	2,780,000	
日本バイリーン	22,000	605.00	13,310,000	
エコナックホールディングス	53,000	54.00	2,862,000	
日東製網	18,000	167.00	3,006,000	
芦森工業	34,000	166.00	5,644,000	
アツギ	129,000	116.00	14,964,000	
ダイニック	30,000	182.00	5,460,000	
共和レザー	10,400	780.00	8,112,000	
セーレン	38,400	1,036.00	39,782,400	
東海染工	22,000	133.00	2,926,000	
小松精練	25,900	589.00	15,255,100	
ワコールホールディングス	91,000	1,263.00	114,933,000	
ホギメディカル	9,700	6,150.00	59,655,000	
レナウン	35,700	116.00	4,141,200	
クラウディア	4,000	684.00	2,736,000	
T S Iホールディングス	68,800	720.00	49,536,000	
I Tホールディングス	48,100	2,105.00	101,250,500	
ネオス	4,000	669.00	2,676,000	
電算システム	5,200	1,567.00	8,148,400	
グリー	87,500	707.00	61,862,500	
コーエーテクモホールディングス	32,900	1,678.00	55,206,200	
三菱総合研究所	5,700	2,747.00	15,657,900	
ボルテージ	2,700	1,043.00	2,816,100	
電算	1,600	2,275.00	3,640,000	
A G S	2,600	996.00	2,589,600	
ファインデックス	2,100	5,200.00	10,920,000	
ヒト・コミュニケーションズ	2,100	1,642.00	3,448,200	

ブレインパッド	1,600	1,225.00	1,960,000	
K L a b	15,400	1,075.00	16,555,000	
ポールトゥウィン・ピットクルー ホールディングス	9,600	835.00	8,016,000	
イーブックイニシアティブジャパン	3,400	1,060.00	3,604,000	
ネクソン	137,800	1,129.00	155,576,200	
アイスタイル	5,000	695.00	3,475,000	
エムアップ	4,000	761.00	3,044,000	
エイチーム	1,800	5,220.00	9,396,000	
e n i s h	3,800	1,416.00	5,380,800	
コロプラ	25,500	2,809.00	71,629,500	
モバイルクリエイト	6,500	740.00	4,810,000	
オルトプラス	2,700	1,141.00	3,080,700	
ブロードリーフ	12,000	1,927.00	23,124,000	
ハーツユナイテッドグループ	4,400	1,775.00	7,810,000	
特種東海製紙	90,000	279.00	25,110,000	
ベリサーブ	1,800	1,087.00	1,956,600	
ティーガイア	14,500	1,488.00	21,576,000	
豆蔵ホールディングス	11,500	636.00	7,314,000	
テクマトリックス	6,600	622.00	4,105,200	
GMOペイメントゲートウェイ	12,700	2,594.00	32,943,800	
ザッパラス	8,300	686.00	5,693,800	
インターネットイニシアティブ	23,500	2,350.00	55,225,000	
GMOクラウド	2,500	882.00	2,205,000	
ビットアイル	16,400	529.00	8,675,600	
S R Aホールディングス	7,800	1,614.00	12,589,200	
システムインテグレータ	1,800	508.00	914,400	
パイブドピッツ	1,400	1,936.00	2,710,400	
朝日ネット	14,900	535.00	7,971,500	
コムチュア	2,500	1,971.00	4,927,500	
王子ホールディングス	631,000	502.00	316,762,000	
日本製紙	74,200	2,057.00	152,629,400	
三菱製紙	229,000	88.00	20,152,000	
北越紀州製紙	95,700	592.00	56,654,400	
中越パルプ工業	59,000	277.00	16,343,000	
巴川製紙所	24,000	251.00	6,024,000	
大王製紙	68,000	1,053.00	71,604,000	
g u m i	10,900	2,530.00	27,577,000	
レンゴー	135,000	540.00	72,900,000	
トーモク	48,000	295.00	14,160,000	
ザ・バック	10,900	2,431.00	26,497,900	
コープケミカル	24,000	104.00	2,496,000	
昭和電工	1,024,000	159.00	162,816,000	
住友化学	1,133,000	554.00	627,682,000	
日本化成	29,000	151.00	4,379,000	
住友精化	32,000	865.00	27,680,000	
日産化学工業	103,000	2,265.00	233,295,000	
ラサ工業	58,000	140.00	8,120,000	
クレハ	108,000	563.00	60,804,000	
多木化学	8,000	743.00	5,944,000	

テイカ	26,000	456.00	11,856,000
石原産業	258,000	119.00	30,702,000
片倉チッカリン	11,000	310.00	3,410,000
日本曹達	99,000	727.00	71,973,000
東ソー	384,000	577.00	221,568,000
トクヤマ	240,000	266.00	63,840,000
セントラル硝子	157,000	525.00	82,425,000
東亜合成	193,000	542.00	104,606,000
ダイソー	62,000	440.00	27,280,000
関東電化工業	37,000	864.00	31,968,000
電気化学工業	319,000	459.00	146,421,000
イビデン	96,200	1,993.00	191,726,600
信越化学工業	276,000	8,159.00	2,251,884,000
日本カーバイド工業	52,000	239.00	12,428,000
堺化学工業	63,000	399.00	25,137,000
エア・ウォーター	136,000	2,068.00	281,248,000
大陽日酸	198,000	1,739.00	344,322,000
日本化学工業	58,000	298.00	17,284,000
日本パーカライズング	36,300	2,878.00	104,471,400
高压ガス工業	23,000	614.00	14,122,000
チタン工業	19,000	250.00	4,750,000
四国化成工業	22,000	991.00	21,802,000
戸田工業	31,000	539.00	16,709,000
ステラ ケミファ	7,900	1,353.00	10,688,700
保土谷化学工業	47,000	213.00	10,011,000
日本触媒	121,000	1,642.00	198,682,000
大日精化工業	64,000	646.00	41,344,000
カネカ	208,000	797.00	165,776,000
協和発酵キリン	184,000	1,468.00	270,112,000
三菱瓦斯化学	265,000	605.00	160,325,000
三井化学	700,000	362.00	253,400,000
J S R	152,000	2,169.00	329,688,000
東京応化工業	31,900	4,175.00	133,182,500
大阪有機化学工業	11,400	508.00	5,791,200
三菱ケミカルホールディングス	962,300	639.70	615,583,310
日本合成化学工業	36,000	732.00	26,352,000
ダイセル	216,500	1,542.00	333,843,000
住友ベークライト	144,000	514.00	74,016,000
積水化学工業	356,000	1,517.00	540,052,000
日本ゼオン	133,000	1,136.00	151,088,000
アイカ工業	46,300	2,699.00	124,963,700
宇部興産	774,000	192.00	148,608,000
積水樹脂	23,900	1,626.00	38,861,400
タキロン	33,000	530.00	17,490,000
旭有機材工業	55,000	281.00	15,455,000
日立化成	76,100	2,587.00	196,870,700
ニチバン	16,000	470.00	7,520,000
リケンテクノス	25,000	453.00	11,325,000
大倉工業	37,000	357.00	13,209,000
積水化成品工業	44,000	463.00	20,372,000

群栄化学工業	41,000	351.00	14,391,000
タイガースポリマー	7,800	876.00	6,832,800
ミライアル	5,600	1,525.00	8,540,000
ダイキョーニシカワ	3,700	3,855.00	14,263,500
日本化薬	100,000	1,547.00	154,700,000
カーリットホールディングス	12,500	657.00	8,212,500
E P Sホールディングス	19,100	1,432.00	27,351,200
パナソニック インフォメーション システムズ	3,300	3,585.00	11,830,500
プレステージ・インターナショナル	11,700	999.00	11,688,300
フェイス	4,400	1,315.00	5,786,000
アミューズ	4,700	2,958.00	13,902,600
野村総合研究所	82,100	4,115.00	337,841,500
ドリームインキュベータ	5,100	2,345.00	11,959,500
サイバネットシステム	12,300	481.00	5,916,300
クイック	5,400	782.00	4,222,800
T A C	7,600	215.00	1,634,000
ケネディクス	218,300	557.00	121,593,100
電通	171,100	5,030.00	860,633,000
インテージホールディングス	8,300	1,985.00	16,475,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,000	1,109.00	6,654,000
東邦システムサイエンス	4,500	645.00	2,902,500
ぴあ	4,600	2,378.00	10,938,800
イオンファンタジー	5,100	1,536.00	7,833,600
ソースネクスト	7,400	848.00	6,275,200
ネクシィーズ	5,600	620.00	3,472,000
メディカルシステムネットワーク	13,100	404.00	5,292,400
ティー・ワイ・オー	14,500	177.00	2,566,500
日本精化	13,000	861.00	11,193,000
A D E K A	71,000	1,511.00	107,281,000
日油	128,000	848.00	108,544,000
ミヨシ油脂	59,000	139.00	8,201,000
新日本理化	24,600	222.00	5,461,200
ハリマ化成グループ	13,400	485.00	6,499,000
花王	413,900	5,218.00	2,159,730,200
第一工業製薬	30,000	413.00	12,390,000
三洋化成工業	49,000	945.00	46,305,000
武田薬品工業	576,600	6,105.00	3,520,143,000
アステラス製薬	1,752,900	1,879.00	3,293,699,100
大日本住友製薬	109,000	1,276.00	139,084,000
塩野義製薬	240,400	3,460.00	831,784,000
田辺三菱製薬	179,300	2,013.00	360,930,900
わかもと製薬	7,000	300.00	2,100,000
あすか製薬	18,300	1,162.00	21,264,600
日本新薬	35,000	3,915.00	137,025,000
バイオフェルミン製薬	2,600	3,010.00	7,826,000
中外製薬	153,300	3,560.00	545,748,000
科研製薬	53,000	3,490.00	184,970,000
エーザイ	203,000	6,209.00	1,260,427,000
理研ビタミン	4,900	3,995.00	19,575,500

ロート製薬	70,000	1,495.00	104,650,000
小野薬品工業	69,900	11,740.00	820,626,000
久光製薬	43,400	4,380.00	190,092,000
有機合成薬品工業	11,000	282.00	3,102,000
持田製薬	11,000	7,410.00	81,510,000
参天製薬	56,600	7,780.00	440,348,000
扶桑薬品工業	52,000	325.00	16,900,000
日本ケミファ	20,000	567.00	11,340,000
ツムラ	48,400	2,980.00	144,232,000
日医工	36,000	2,401.00	86,436,000
テルモ	225,200	3,240.00	729,648,000
みらかホールディングス	40,400	5,760.00	232,704,000
キッセイ薬品工業	28,600	3,440.00	98,384,000
生化学工業	29,500	2,053.00	60,563,500
栄研化学	12,900	1,823.00	23,516,700
日水製薬	6,400	1,384.00	8,857,600
鳥居薬品	10,500	3,330.00	34,965,000
J C Rファーマ	11,900	2,222.00	26,441,800
東和薬品	7,900	6,330.00	50,007,000
富士製薬工業	4,400	2,269.00	9,983,600
沢井製薬	24,400	7,790.00	190,076,000
ゼリア新薬工業	31,500	1,921.00	60,511,500
第一三共	517,600	1,870.50	968,170,800
キョーリン製薬ホールディングス	41,100	2,694.00	110,723,400
大幸薬品	6,800	1,997.00	13,579,600
ダイト	6,100	2,728.00	16,640,800
大塚ホールディングス	305,400	3,669.00	1,120,512,600
大正製薬ホールディングス	37,000	8,120.00	300,440,000
大日本塗料	88,000	157.00	13,816,000
日本ペイントホールディングス	133,200	4,165.00	554,778,000
関西ペイント	187,000	2,144.00	400,928,000
神東塗料	11,000	223.00	2,453,000
中国塗料	44,000	992.00	43,648,000
日本特殊塗料	12,100	790.00	9,559,000
藤倉化成	21,200	558.00	11,829,600
太陽ホールディングス	12,600	4,225.00	53,235,000
D I C	616,000	333.00	205,128,000
サカタインクス	31,600	1,260.00	39,816,000
東洋インキS Cホールディングス	152,000	585.00	88,920,000
T & K T O K A	5,200	2,374.00	12,344,800
アルプス技研	6,300	1,909.00	12,026,700
サニックス	17,900	393.00	7,034,700
ダイオーズ	3,400	910.00	3,094,000
日本空調サービス	7,700	884.00	6,806,800
オリエンタルランド	41,500	31,450.00	1,305,175,000
ダスキン	43,400	1,983.00	86,062,200
パーク24	72,900	2,160.00	157,464,000
明光ネットワークジャパン	15,300	1,227.00	18,773,100
ファルコホールディングス	7,400	1,381.00	10,219,400
クレスコ	3,400	1,954.00	6,643,600

フジ・メディア・ホールディングス	150,800	1,649.00	248,669,200
秀英予備校	3,500	315.00	1,102,500
田谷	3,100	837.00	2,594,700
ラウンドワン	43,600	684.00	29,822,400
リゾートトラスト	56,600	2,800.00	158,480,000
オービック	50,000	4,410.00	220,500,000
ジャストシステム	19,900	709.00	14,109,100
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,500	1,090.00	3,815,000
ヤフー	1,039,000	461.00	478,979,000
ビー・エム・エル	9,000	3,345.00	30,105,000
ワタベウェディング	5,100	503.00	2,565,300
トレンドマイクロ	76,800	3,850.00	295,680,000
もしもしホットライン	28,600	1,329.00	38,009,400
インフォメーション・ディベロプメント	3,000	961.00	2,883,000
リソー教育	23,500	280.00	6,580,000
日本オラクル	23,200	5,190.00	120,408,000
早稲田アカデミー	2,700	841.00	2,270,700
アルファシステムズ	4,900	1,657.00	8,119,300
フューチャーアーキテクト	15,500	726.00	11,253,000
CAC Holdings	10,100	1,056.00	10,665,600
ソフトバンク・テクノロジー	4,000	1,186.00	4,744,000
トーセ	3,900	748.00	2,917,200
ユー・エス・エス	185,800	2,060.00	382,748,000
オービックビジネスコンサルタント	9,200	4,135.00	38,042,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,400	4,660.00	76,424,000
アイティフォー	17,900	466.00	8,341,400
東京個別指導学院	7,800	359.00	2,800,200
東計電算	2,800	1,752.00	4,905,600
サイバーエージェント	28,100	5,680.00	159,608,000
楽天	666,800	1,896.00	1,264,252,800
エクスネット	1,600	1,499.00	2,398,400
テー・オー・ダブリュー	4,900	840.00	4,116,000
大塚商会	39,000	4,790.00	186,810,000
総合メディカル	3,500	6,690.00	23,415,000
サイボウズ	19,600	336.00	6,585,600
ソフトブレーン	20,600	192.00	3,955,200
セントラルスポーツ	5,300	2,150.00	11,395,000
パラカ	5,500	1,224.00	6,732,000
電通国際情報サービス	9,100	1,141.00	10,383,100
イーエムシステムズ	1,800	1,770.00	3,186,000
ウェザーニューズ	4,400	3,115.00	13,706,000
C I J	13,200	469.00	6,190,800
東洋ビジネスエンジニアリング	1,600	1,364.00	2,182,400
日本エンタープライズ	9,700	401.00	3,889,700
WOWOW	3,500	6,060.00	21,210,000
フルキャストホールディングス	16,100	569.00	9,160,900
富士フイルムホールディングス	352,200	4,110.00	1,447,542,000
コニカミノルタ	350,200	1,229.00	430,395,800

資生堂	273,700	2,054.50	562,316,650	
ライオン	177,000	675.00	119,475,000	
高砂香料工業	51,000	566.00	28,866,000	
マンダム	15,400	4,005.00	61,677,000	
ミルボン	9,100	3,465.00	31,531,500	
ファンケル	35,800	1,771.00	63,401,800	
コーセー	24,900	5,960.00	148,404,000	
コタ	4,500	1,982.00	8,919,000	
ドクターシーラボ	10,500	4,150.00	43,575,000	
シーボン	1,600	2,860.00	4,576,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	18,300	5,560.00	101,748,000	
ノエビアホールディングス	9,700	2,284.00	22,154,800	
アジュバンコスメジャパン	3,000	1,016.00	3,048,000	
エステー	10,400	1,033.00	10,743,200	
アグロ カネショウ	4,400	951.00	4,184,400	
コニシ	12,100	2,007.00	24,284,700	
長谷川香料	19,600	1,719.00	33,692,400	
星光PMC	8,600	949.00	8,161,400	
小林製薬	25,200	8,030.00	202,356,000	
荒川化学工業	13,100	1,329.00	17,409,900	
メック	12,100	812.00	9,825,200	
日本高純度化学	4,500	2,531.00	11,389,500	
JCU	4,200	5,680.00	23,856,000	
新田ゼラチン	9,500	814.00	7,733,000	
アース製薬	11,000	4,005.00	44,055,000	
イハラケミカル工業	23,800	1,363.00	32,439,400	
北興化学工業	17,000	411.00	6,987,000	
大成ラミック	4,400	2,900.00	12,760,000	
クミアイ化学工業	32,000	889.00	28,448,000	
日本農薬	35,200	1,356.00	47,731,200	
昭和シェル石油	137,700	1,123.00	154,637,100	
コスモ石油	425,000	174.00	73,950,000	
富士興産	5,900	606.00	3,575,400	
ニチレキ	19,000	989.00	18,791,000	
東燃ゼネラル石油	232,000	1,111.00	257,752,000	
ユシロ化学工業	9,100	1,550.00	14,105,000	
ビービー・カストロール	6,500	1,262.00	8,203,000	
富士石油	35,800	387.00	13,854,600	
MORESCO	4,100	2,156.00	8,839,600	
出光興産	72,800	2,110.00	153,608,000	
JXホールディングス	1,707,500	483.00	824,722,500	
横浜ゴム	172,000	1,197.00	205,884,000	
東洋ゴム工業	69,700	2,661.00	185,471,700	
ブリヂストン	482,300	4,575.00	2,206,522,500	
住友ゴム工業	120,000	2,041.00	244,920,000	
藤倉ゴム工業	12,900	785.00	10,126,500	
オカモト	53,000	469.00	24,857,000	
アキレス	131,000	154.00	20,174,000	
フコク	6,600	1,191.00	7,860,600	
ニッタ	15,200	3,070.00	46,664,000	

クリエイトメディック	5,000	1,013.00	5,065,000
住友理工	28,400	1,033.00	29,337,200
三ツ星ベルト	39,000	971.00	37,869,000
バンドー化学	56,000	444.00	24,864,000
鬼怒川ゴム工業	34,000	522.00	17,748,000
旭硝子	758,000	742.00	562,436,000
日本板硝子	741,000	125.00	92,625,000
石塚硝子	20,000	235.00	4,700,000
有沢製作所	25,900	1,076.00	27,868,400
日本山村硝子	60,000	176.00	10,560,000
日本電気硝子	295,000	587.00	173,165,000
オハラ	5,700	587.00	3,345,900
住友大阪セメント	285,000	370.00	105,450,000
太平洋セメント	960,000	399.00	383,040,000
デイ・シイ	15,900	493.00	7,838,700
リゾートソリューション	16,000	260.00	4,160,000
日本ヒューム	16,200	882.00	14,288,400
日本コンクリート工業	26,600	481.00	12,794,600
三谷セキサン	7,800	1,978.00	15,428,400
ジャパンパイル	20,600	700.00	14,420,000
東海カーボン	134,000	357.00	47,838,000
日本カーボン	81,000	298.00	24,138,000
東洋炭素	8,500	2,158.00	18,343,000
ノリタケカンパニーリミテド	87,000	286.00	24,882,000
TOTO	226,000	1,642.00	371,092,000
日本碍子	194,000	2,296.00	445,424,000
日本特殊陶業	132,600	3,390.00	449,514,000
ダントーホールディングス	22,000	163.00	3,586,000
MARUWA	4,500	2,657.00	11,956,500
品川リフラクトリーズ	39,000	296.00	11,544,000
黒崎播磨	33,000	255.00	8,415,000
ヨータイ	9,000	383.00	3,447,000
イソライト工業	7,400	222.00	1,642,800
東京窯業	19,000	223.00	4,237,000
ニッカトー	5,900	410.00	2,419,000
フジインコーポレーテッド	15,000	1,878.00	28,170,000
エーアンドエーマテリアル	33,000	120.00	3,960,000
ニチアス	69,000	688.00	47,472,000
新日鐵住金	6,502,000	315.60	2,052,031,200
神戸製鋼所	2,660,000	229.00	609,140,000
中山製鋼所	114,000	90.00	10,260,000
合同製鐵	78,000	194.00	15,132,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	392,500	2,934.00	1,151,595,000
日新製鋼	65,200	1,665.00	108,558,000
東京製鐵	77,900	872.00	67,928,800
共英製鋼	16,400	2,105.00	34,522,000
大和工業	35,000	3,165.00	110,775,000
東京鐵鋼	30,000	548.00	16,440,000
大阪製鐵	9,700	2,135.00	20,709,500

淀川製鋼所	109,000	480.00	52,320,000	
東洋鋼鋳	37,000	580.00	21,460,000	
丸一鋼管	47,100	2,794.00	131,597,400	
モリ工業	25,000	431.00	10,775,000	
大同特殊鋼	257,000	531.00	136,467,000	
日本高周波鋼業	61,000	117.00	7,137,000	
日本冶金工業	120,100	246.00	29,544,600	
山陽特殊製鋼	91,000	480.00	43,680,000	
愛知製鋼	91,000	583.00	53,053,000	
日立金属	156,000	1,901.00	296,556,000	
日本金属	40,000	150.00	6,000,000	
大平洋金属	98,000	352.00	34,496,000	
新日本電工	93,700	316.00	29,609,200	
栗本鐵工所	80,000	228.00	18,240,000	
虹 技	22,000	227.00	4,994,000	
日本鑄鉄管	15,000	232.00	3,480,000	
日本製鋼所	220,000	488.00	107,360,000	
三菱製鋼	100,000	256.00	25,600,000	
日亜鋼業	22,000	341.00	7,502,000	
日本精線	12,000	691.00	8,292,000	
大紀アルミニウム工業所	26,000	346.00	8,996,000	
日本軽金属ホールディングス	373,300	179.00	66,820,700	
三井金属鉱業	418,000	274.00	114,532,000	
東邦亜鉛	87,000	386.00	33,582,000	
三菱マテリアル	960,000	401.00	384,960,000	
住友金属鉱山	425,000	1,853.50	787,737,500	
D O W Aホールディングス	184,000	960.00	176,640,000	
古河機械金属	240,000	208.00	49,920,000	
エス・サイエンス	76,400	50.00	3,820,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	2,420.00	36,542,000	
東邦チタニウム	26,100	781.00	20,384,100	
U A C J	176,000	330.00	58,080,000	
古河電気工業	450,000	212.00	95,400,000	
住友電気工業	579,400	1,553.00	899,808,200	
フジクラ	214,000	506.00	108,284,000	
昭和電線ホールディングス	169,000	101.00	17,069,000	
東京特殊電線	2,200	1,499.00	3,297,800	
タツタ電線	28,700	505.00	14,493,500	
沖電線	16,000	336.00	5,376,000	
カナレ電気	2,500	2,476.00	6,190,000	
平河ヒューテック	3,700	1,447.00	5,353,900	
リョービ	86,000	343.00	29,498,000	
アーレスティ	13,400	647.00	8,669,800	
アサヒホールディングス	23,200	2,052.00	47,606,400	
東洋製罐グループホールディングス	109,300	1,658.00	181,219,400	
ホッカンホールディングス	36,000	284.00	10,224,000	
コロナ	8,200	1,155.00	9,471,000	
横河ブリッジホールディングス	29,200	1,334.00	38,952,800	
O S J Bホールディングス	22,600	270.00	6,102,000	
駒井ハルテック	28,000	278.00	7,784,000	

高田機工	14,000	249.00	3,486,000
三和ホールディングス	148,700	851.00	126,543,700
文化シャッター	43,000	979.00	42,097,000
三協立山	19,700	1,955.00	38,513,500
アルインコ	6,600	1,104.00	7,286,400
東洋シャッター	4,100	867.00	3,554,700
L I X I Lグループ	228,600	2,801.00	640,308,600
日本ファイルコン	11,200	478.00	5,353,600
ノーリツ	30,200	1,999.00	60,369,800
長府製作所	16,500	3,035.00	50,077,500
リンナイ	28,600	8,520.00	243,672,000
ユニプレス	28,200	2,254.00	63,562,800
ダイニチ工業	8,100	799.00	6,471,900
日東精工	22,000	365.00	8,030,000
三洋工業	21,000	227.00	4,767,000
岡部	30,400	1,101.00	33,470,400
ジーテクト	10,600	1,062.00	11,257,200
中国工業	2,600	826.00	2,147,600
東プレ	29,600	1,736.00	51,385,600
高周波熱錬	26,700	883.00	23,576,100
東京製綱	104,000	204.00	21,216,000
モリテックスチール	8,200	321.00	2,632,200
パイオラックス	7,800	5,390.00	42,042,000
日本発条	133,500	1,227.00	163,804,500
中央発條	20,000	350.00	7,000,000
アドバネクス	29,000	187.00	5,423,000
三浦工業	68,700	1,400.00	96,180,000
タクマ	52,000	968.00	50,336,000
テクノプロ・ホールディング	16,300	2,695.00	43,928,500
リブセンス	9,000	651.00	5,859,000
ジャパンマテリアル	6,200	1,696.00	10,515,200
ウチヤマホールディングス	6,700	577.00	3,865,900
サクセスホールディングス	1,300	1,227.00	1,595,100
アサンテ	3,900	1,259.00	4,910,100
E R Iホールディングス	3,900	996.00	3,884,400
リクルートホールディングス	174,100	3,710.00	645,911,000
ツガミ	44,000	716.00	31,504,000
オークマ	100,000	1,150.00	115,000,000
東芝機械	84,000	473.00	39,732,000
アマダ	229,300	1,115.00	255,669,500
アイダエンジニアリング	33,600	1,342.00	45,091,200
滝澤鉄工所	49,000	228.00	11,172,000
富士機械製造	50,200	1,328.00	66,665,600
牧野フライス製作所	77,000	1,025.00	78,925,000
オーエスジー	70,100	2,234.00	156,603,400
ダイジェット工業	18,000	224.00	4,032,000
旭ダイヤモンド工業	42,100	1,322.00	55,656,200
D M G森精機	97,100	1,700.00	165,070,000
ディスコ	17,900	10,950.00	196,005,000
日東工器	8,900	2,170.00	19,313,000

パンチ工業	3,500	1,400.00	4,900,000	
豊田自動織機	133,800	6,780.00	907,164,000	
豊和工業	8,700	747.00	6,498,900	
大阪機工	60,000	162.00	9,720,000	
石川製作所	39,000	103.00	4,017,000	
東洋機械金属	10,500	469.00	4,924,500	
津田駒工業	38,000	153.00	5,814,000	
エンシュウ	38,000	112.00	4,256,000	
島精機製作所	21,700	2,110.00	45,787,000	
日阪製作所	19,500	999.00	19,480,500	
やまびこ	6,100	5,070.00	30,927,000	
ペガサスミシン製造	13,600	632.00	8,595,200	
ナプテスコ	93,600	3,180.00	297,648,000	
三井海洋開発	15,400	2,020.00	31,108,000	
レオン自動機	11,900	504.00	5,997,600	
S M C	46,100	32,785.00	1,511,388,500	
新川	12,900	718.00	9,262,200	
ホソカワミクロン	26,000	637.00	16,562,000	
ユニオンツール	7,600	3,355.00	25,498,000	
オイレス工業	19,200	2,109.00	40,492,800	
日精エー・エス・ビー機械	5,000	2,276.00	11,380,000	
サトーホールディングス	19,100	2,517.00	48,074,700	
日本エアテック	4,700	671.00	3,153,700	
日精樹脂工業	11,300	1,388.00	15,684,400	
ワイエイシイ	6,200	664.00	4,116,800	
小松製作所	762,500	2,459.00	1,874,987,500	
住友重機械工業	421,000	731.00	307,751,000	
日立建機	68,700	2,203.00	151,346,100	
日工	21,000	418.00	8,778,000	
巴工業	5,800	1,717.00	9,958,600	
井関農機	157,000	243.00	38,151,000	
T O W A	12,600	690.00	8,694,000	
丸山製作所	35,000	233.00	8,155,000	
北川鉄工所	71,000	262.00	18,602,000	
シンニッタン	16,100	554.00	8,919,400	
クボタ	742,000	1,905.50	1,413,881,000	
荏原実業	4,600	1,420.00	6,532,000	
東洋エンジニアリング	79,000	361.00	28,519,000	
三菱化工機	51,000	448.00	22,848,000	
月島機械	27,100	1,296.00	35,121,600	
帝国電機製作所	10,300	1,185.00	12,205,500	
東京機械製作所	59,000	75.00	4,425,000	
新東工業	36,100	840.00	30,324,000	
澁谷工業	12,900	2,205.00	28,444,500	
アイチコーポレーション	21,900	586.00	12,833,400	
小森コーポレーション	37,400	1,337.00	50,003,800	
鶴見製作所	11,500	1,971.00	22,666,500	
住友精密工業	24,000	479.00	11,496,000	
酒井重工業	29,000	295.00	8,555,000	
荏原製作所	318,000	496.00	157,728,000	

石井鐵工所	23,000	226.00	5,198,000
西島製作所	15,000	911.00	13,665,000
北越工業	11,500	994.00	11,431,000
千代田化工建設	119,000	974.00	115,906,000
ダイキン工業	214,000	7,821.00	1,673,694,000
オルガノ	29,000	484.00	14,036,000
トーヨーカネツ	89,000	235.00	20,915,000
栗田工業	86,900	2,979.00	258,875,100
椿本チエイン	79,000	968.00	76,472,000
大同工業	30,000	270.00	8,100,000
日本コンベヤ	48,000	242.00	11,616,000
日機装	47,500	1,005.00	47,737,500
木村化工機	14,100	502.00	7,078,200
新興プランテック	33,800	963.00	32,549,400
アネスト岩田	23,100	762.00	17,602,200
ダイフク	72,600	1,497.00	108,682,200
サムコ	1,900	1,099.00	2,088,100
加藤製作所	32,000	775.00	24,800,000
油研工業	29,000	256.00	7,424,000
タダノ	71,000	1,517.00	107,707,000
フジテック	42,800	1,189.00	50,889,200
C K D	41,200	1,078.00	44,413,600
キトー	16,100	1,117.00	17,983,700
平和	31,900	2,482.00	79,175,800
理想科学工業	17,900	2,072.00	37,088,800
S A N K Y O	44,500	4,505.00	200,472,500
日本金銭機械	13,600	1,753.00	23,840,800
マースエンジニアリング	8,300	2,211.00	18,351,300
福島工業	8,100	1,676.00	13,575,600
オーイズミ	5,200	944.00	4,908,800
ダイコク電機	6,100	1,765.00	10,766,500
アマノ	49,000	1,436.00	70,364,000
J U K I	109,000	416.00	45,344,000
サンデン	90,000	601.00	54,090,000
蛇の目ミシン工業	143,000	149.00	21,307,000
ブラザー工業	189,900	2,009.00	381,509,100
マックス	23,000	1,381.00	31,763,000
モリタホールディングス	25,800	1,243.00	32,069,400
グローリー	47,000	3,150.00	148,050,000
新晃工業	10,300	1,322.00	13,616,600
大和冷機工業	21,300	731.00	15,570,300
セガサミーホールディングス	157,800	1,788.00	282,146,400
日本ピストンリング	58,000	259.00	15,022,000
リケン	63,000	476.00	29,988,000
T P R	16,400	2,919.00	47,871,600
ホシザキ電機	32,200	7,020.00	226,044,000
大豊工業	12,000	1,416.00	16,992,000
日本精工	302,000	1,639.00	494,978,000
N T N	340,000	583.00	198,220,000
ジェイテクト	156,600	1,882.00	294,721,200

不二越	136,000	678.00	92,208,000
ミネベア	219,000	1,801.00	394,419,000
日本トムソン	50,000	616.00	30,800,000
T H K	97,700	2,819.00	275,416,300
ユーシン精機	6,500	2,191.00	14,241,500
前澤給装工業	5,900	1,450.00	8,555,000
イーグル工業	20,500	2,449.00	50,204,500
前澤工業	10,800	334.00	3,607,200
日本ピラー工業	16,100	931.00	14,989,100
キッツ	66,000	616.00	40,656,000
日立製作所	3,528,000	821.30	2,897,546,400
東芝	3,093,000	492.50	1,523,302,500
三菱電機	1,469,000	1,378.00	2,024,282,000
富士電機	409,000	558.00	228,222,000
東洋電機製造	29,000	428.00	12,412,000
安川電機	172,700	1,622.00	280,119,400
シンフォニア テクノロジー	102,000	215.00	21,930,000
明電舎	135,000	394.00	53,190,000
オリジン電気	22,000	550.00	12,100,000
山洋電気	33,000	809.00	26,697,000
デンヨー	13,400	1,929.00	25,848,600
日立工機	39,400	924.00	36,405,600
三櫻工業	18,900	779.00	14,723,100
マキタ	95,800	5,560.00	532,648,000
東芝テック	105,000	723.00	75,915,000
芝浦メカトロニクス	24,000	286.00	6,864,000
マブチモーター	44,900	6,110.00	274,339,000
日本電産	158,800	8,130.00	1,291,044,000
東光高岳	7,500	1,787.00	13,402,500
宮越ホールディングス	5,100	486.00	2,478,600
ダイヘン	80,000	614.00	49,120,000
ヤーマン	2,000	1,663.00	3,326,000
J V Cケンウッド	107,900	388.00	41,865,200
第一精工	5,400	2,427.00	13,105,800
日新電機	35,000	677.00	23,695,000
大崎電気工業	23,000	812.00	18,676,000
オムロン	158,700	5,110.00	810,957,000
日東工業	23,600	2,156.00	50,881,600
I D E C	17,500	1,040.00	18,200,000
不二電機工業	1,500	1,508.00	2,262,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	283,000	540.00	152,820,000
サクサホールディングス	38,000	220.00	8,360,000
メルコホールディングス	8,200	1,947.00	15,965,400
テクノメディカ	3,300	2,497.00	8,240,100
日本電気	1,901,000	366.00	695,766,000
富士通	1,417,000	722.70	1,024,065,900
沖電気工業	509,000	261.00	132,849,000
岩崎通信機	65,000	93.00	6,045,000
電気興業	42,000	528.00	22,176,000

サンケン電気	74,000	850.00	62,900,000
ナカヨ	15,000	387.00	5,805,000
アイホン	8,600	1,842.00	15,841,200
ルネサスエレクトロニクス	76,000	884.00	67,184,000
セイコーエプソン	100,300	4,385.00	439,815,500
ワコム	115,800	631.00	73,069,800
アルバック	24,800	1,861.00	46,152,800
アクセル	6,800	1,687.00	11,471,600
E I Z O	13,500	2,657.00	35,869,500
ジャパンディスプレイ	226,400	493.00	111,615,200
日本信号	40,600	1,198.00	48,638,800
京三製作所	34,000	374.00	12,716,000
能美防災	19,500	1,433.00	27,943,500
ホーチキ	11,000	892.00	9,812,000
エレコム	4,700	2,346.00	11,026,200
日本無線	32,000	359.00	11,488,000
パナソニック	1,790,700	1,447.00	2,591,142,900
シャープ	1,241,000	252.00	312,732,000
アンリツ	91,900	852.00	78,298,800
富士通ゼネラル	45,000	1,297.00	58,365,000
日立国際電気	38,000	1,660.00	63,080,000
ソニー	950,800	3,280.00	3,118,624,000
T D K	88,700	8,010.00	710,487,000
帝国通信工業	36,000	251.00	9,036,000
ミツミ電機	52,000	921.00	47,892,000
タムラ製作所	57,000	417.00	23,769,000
アルプス電気	116,000	2,627.00	304,732,000
池上通信機	50,000	185.00	9,250,000
パイオニア	220,800	240.00	52,992,000
日本電波工業	13,200	958.00	12,645,600
鈴木	1,900	949.00	1,803,100
日本トリム	3,600	3,295.00	11,862,000
ローランド ディー . ジー .	5,900	3,205.00	18,909,500
日本コロムビア	5,200	398.00	2,069,600
フォスター電機	15,000	2,796.00	41,940,000
クラリオン	78,000	390.00	30,420,000
S M K	43,000	506.00	21,758,000
ヨコオ	11,700	664.00	7,768,800
東光	35,000	341.00	11,935,000
ティアック	79,000	61.00	4,819,000
ホシデン	46,500	660.00	30,690,000
ヒロセ電機	23,700	15,220.00	360,714,000
日本航空電子工業	42,000	2,781.00	116,802,000
T O A	15,800	1,159.00	18,312,200
日立マクセル	21,900	2,065.00	45,223,500
古野電気	17,600	1,173.00	20,644,800
ユニデン	40,000	225.00	9,000,000
アルパイン	35,100	2,067.00	72,551,700
スミダコーポレーション	13,200	651.00	8,593,200
アイコム	8,200	2,783.00	22,820,600

リオン	4,200	1,539.00	6,463,800
船井電機	14,900	1,385.00	20,636,500
横河電機	147,000	1,300.00	191,100,000
新電元工業	57,000	632.00	36,024,000
アズビル	47,900	3,150.00	150,885,000
東亜ディーケーケー	6,300	670.00	4,221,000
日本光電工業	31,300	6,160.00	192,808,000
チノー	5,300	1,225.00	6,492,500
共和電業	18,100	474.00	8,579,400
日本電子材料	6,400	770.00	4,928,000
堀場製作所	27,100	4,345.00	117,749,500
アドバンテスト	100,200	1,573.00	157,614,600
小野測器	7,500	937.00	7,027,500
エスベック	16,300	1,208.00	19,690,400
パナソニック デバイスSUNX	13,000	903.00	11,739,000
キーエンス	33,300	60,050.00	1,999,665,000
日置電機	7,700	1,910.00	14,707,000
シスメックス	113,800	6,180.00	703,284,000
メガチップス	15,300	1,401.00	21,435,300
O B A R A G R O U P	9,500	6,270.00	59,565,000
イマジカ・ロボット ホールディング グス	7,800	720.00	5,616,000
澤藤電機	10,000	241.00	2,410,000
デンソー	363,000	5,609.00	2,036,067,000
コーセル	21,400	1,328.00	28,419,200
新日本無線	11,000	468.00	5,148,000
オブテックス	10,100	2,109.00	21,300,900
千代田インテグレ	6,500	2,269.00	14,748,500
レーザーテック	15,100	1,523.00	22,997,300
スタンレー電気	105,400	2,841.00	299,441,400
岩崎電気	50,000	233.00	11,650,000
ウシオ電機	89,100	1,508.00	134,362,800
岡谷電機産業	8,100	468.00	3,790,800
ヘリオス テクノ ホールディング	13,900	429.00	5,963,100
日本セラミック	8,400	1,612.00	13,540,800
遠藤照明	6,700	1,411.00	9,453,700
日本デジタル研究所	12,500	1,611.00	20,137,500
古河電池	11,000	965.00	10,615,000
双信電機	7,400	419.00	3,100,600
山一電機	17,100	919.00	15,714,900
図研	10,800	1,083.00	11,696,400
日本電子	62,000	568.00	35,216,000
カシオ計算機	147,300	2,078.00	306,089,400
ファナック	153,000	22,905.00	3,504,465,000
日本シイエムケイ	37,500	318.00	11,925,000
エンプラス	6,600	5,040.00	33,264,000
大真空	27,000	328.00	8,856,000
ローム	72,400	7,610.00	550,964,000
浜松ホトニクス	61,100	6,810.00	416,091,000
三井ハイテック	19,500	832.00	16,224,000

新光電気工業	55,500	904.00	50,172,000	
京セラ	241,200	5,907.00	1,424,768,400	
協栄産業	18,000	209.00	3,762,000	
太陽誘電	77,000	1,418.00	109,186,000	
村田製作所	154,200	13,805.00	2,128,731,000	
ユーシン	20,500	725.00	14,862,500	
双葉電子工業	25,200	1,943.00	48,963,600	
日東電工	118,900	7,465.00	887,588,500	
北陸電気工業	63,000	199.00	12,537,000	
東海理化電機製作所	38,700	2,526.00	97,756,200	
ニチコン	46,300	1,073.00	49,679,900	
日本ケミコン	119,000	385.00	45,815,000	
K O A	20,300	1,176.00	23,872,800	
三井造船	568,000	211.00	119,848,000	
日立造船	114,900	684.00	78,591,600	
三菱重工業	2,462,000	660.50	1,626,151,000	
川崎重工業	1,068,000	568.00	606,624,000	
I H I	1,059,000	555.00	587,745,000	
名村造船所	41,000	1,155.00	47,355,000	
サノヤホールディングス	18,200	286.00	5,205,200	
日本車輛製造	53,000	371.00	19,663,000	
ニチュ三菱フォークリフト	17,000	696.00	11,832,000	
近畿車輛	22,000	395.00	8,690,000	
F P G	12,500	2,777.00	34,712,500	
島根銀行	3,300	1,485.00	4,900,500	
じもとホールディングス	104,500	238.00	24,871,000	
全国保証	37,700	3,860.00	145,522,000	
足利ホールディングス	91,200	510.00	46,512,000	
東京T Yフィナンシャルグループ	18,700	3,600.00	67,320,000	
日産自動車	2,062,400	1,224.50	2,525,408,800	
いすゞ自動車	464,600	1,692.50	786,335,500	
トヨタ自動車	2,027,300	8,127.00	16,475,867,100	*
日野自動車	209,800	1,818.00	381,416,400	
三菱自動車工業	538,600	1,047.00	563,914,200	
エフテック	8,400	1,221.00	10,256,400	
レシップホールディングス	5,000	859.00	4,295,000	
G M B	2,300	1,317.00	3,029,100	
武蔵精密工業	15,700	2,519.00	39,548,300	
日産車体	64,600	1,590.00	102,714,000	
新明和工業	59,000	1,228.00	72,452,000	
極東開発工業	27,300	1,338.00	36,527,400	
日信工業	26,900	1,881.00	50,598,900	
トビー工業	121,000	287.00	34,727,000	
ティラド	58,000	251.00	14,558,000	
曙ブレーキ工業	62,000	442.00	27,404,000	
タチエス	23,400	1,628.00	38,095,200	
N O K	71,100	3,370.00	239,607,000	
フタバ産業	44,900	564.00	25,323,600	
カヤバ工業	165,000	454.00	74,910,000	
シロキ工業	33,000	326.00	10,758,000	

市光工業	36,000	233.00	8,388,000
大同メタル工業	20,600	1,220.00	25,132,000
プレス工業	73,000	469.00	34,237,000
カルソニックカンセイ	112,000	705.00	78,960,000
太平洋工業	30,100	1,000.00	30,100,000
ケーヒン	33,800	1,962.00	66,315,600
河西工業	18,200	1,006.00	18,309,200
アイシン精機	134,400	4,390.00	590,016,000
富士機工	17,200	515.00	8,858,000
マツダ	437,900	2,561.00	1,121,461,900
ダイハツ工業	175,300	1,734.00	303,970,200
今仙電機製作所	12,500	1,551.00	19,387,500
本田技研工業	1,322,200	3,942.00	5,212,112,400
スズキ	307,200	3,777.00	1,160,294,400
富士重工業	500,100	4,116.50	2,058,661,650
安永	5,200	655.00	3,406,000
ヤマハ発動機	223,500	2,802.00	626,247,000
ショーワ	34,800	1,256.00	43,708,800
小糸製作所	88,100	3,775.00	332,577,500
T B K	19,100	659.00	12,586,900
エクセディ	20,000	2,794.00	55,880,000
ミツバ	27,100	2,210.00	59,891,000
豊田合成	47,500	2,622.00	124,545,000
愛三工業	22,900	1,086.00	24,869,400
盟和産業	13,000	155.00	2,015,000
ヨロズ	13,800	2,396.00	33,064,800
エフ・シー・シー	21,700	2,016.00	43,747,200
新家工業	32,000	189.00	6,048,000
シマノ	63,500	17,080.00	1,084,580,000
タカタ	26,600	1,341.00	35,670,600
テイ・エス テック	31,000	3,330.00	103,230,000
小野建	12,600	1,067.00	13,444,200
はるやま商事	6,200	767.00	4,755,400
佐島電機	11,500	826.00	9,499,000
カッパ・クリエイトホールディングス	22,600	1,140.00	25,764,000
エコートレーディング	3,700	651.00	2,408,700
伯東	9,900	1,355.00	13,414,500
コンドーテック	11,100	789.00	8,757,900
中山福	8,700	888.00	7,725,600
ライトオン	10,900	819.00	8,927,100
ナガイレーベン	21,000	2,204.00	46,284,000
ジーンズメイト	5,000	271.00	1,355,000
三菱食品	16,100	2,503.00	40,298,300
良品計画	17,900	15,280.00	273,512,000
三城ホールディングス	18,300	480.00	8,784,000
松田産業	10,900	1,516.00	16,524,400
メディバルホールディングス	145,000	1,525.00	221,125,000
アドヴァン	7,600	1,494.00	11,354,400
S P K	3,300	2,149.00	7,091,700

萩原電気	4,000	1,877.00	7,508,000
アズワン	10,400	3,550.00	36,920,000
スズデン	5,100	727.00	3,707,700
尾家産業	5,500	876.00	4,818,000
シモジマ	8,900	1,103.00	9,816,700
ドウシシャ	19,000	1,987.00	37,753,000
小津産業	3,000	2,183.00	6,549,000
コナカ	17,100	707.00	12,089,700
高速	8,700	881.00	7,664,700
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,444.00	2,743,600
G - 7ホールディングス	3,300	1,080.00	3,564,000
たけびし	5,200	1,127.00	5,860,400
イオン北海道	9,200	676.00	6,219,200
コジマ	21,500	349.00	7,503,500
ヒマラヤ	3,400	988.00	3,359,200
コーナン商事	22,100	1,366.00	30,188,600
黒田電気	24,300	1,779.00	43,229,700
ネットワンシステムズ	59,000	800.00	47,200,000
エコス	5,200	968.00	5,033,600
ワタミ	17,000	1,183.00	20,111,000
マルシェ	3,800	914.00	3,473,200
ドンキホーテホールディングス	46,700	8,910.00	416,097,000
丸文	12,900	797.00	10,281,300
西松屋チェーン	28,700	977.00	28,039,900
ゼンショーホールディングス	74,400	1,095.00	81,468,000
ハビネット	8,900	1,410.00	12,549,000
幸楽苑	9,100	1,557.00	14,168,700
ハークスレイ	4,200	1,046.00	4,393,200
橋本総業	2,800	1,410.00	3,948,000
サイゼリヤ	21,500	2,053.00	44,139,500
エクセル	6,700	1,410.00	9,447,000
マルカキカイ	4,800	1,693.00	8,126,400
アルゴグラフィックス	6,100	1,758.00	10,723,800
ガリバーインターナショナル	44,000	950.00	41,800,000
日本エム・ディ・エム	12,300	592.00	7,281,600
ポブラ	4,100	536.00	2,197,600
ユナイテッドアローズ	19,000	3,620.00	68,780,000
進和	8,600	1,381.00	11,876,600
エスケイジャパン	3,900	230.00	897,000
ダイトエレクトロン	6,800	691.00	4,698,800
ハイデイ日高	11,040	3,165.00	34,941,600
シークス	9,200	2,775.00	25,530,000
京都きもの友禅	9,200	1,014.00	9,328,800
コロワイド	48,200	1,633.00	78,710,600
田中商事	5,000	696.00	3,480,000
オーハシテクニカ	9,100	1,605.00	14,605,500
壱番屋	6,100	5,250.00	32,025,000
マクニカ	7,400	3,705.00	27,417,000
白銅	4,800	1,216.00	5,836,800
トップカルチャー	6,200	497.00	3,081,400

PLANT	3,800	1,302.00	4,947,600
スギホールディングス	26,000	5,720.00	148,720,000
島津製作所	176,000	1,283.00	225,808,000
JMS	27,000	298.00	8,046,000
クボテック	3,300	309.00	1,019,700
ショットモリテックス	3,500	259.00	906,500
長野計器	9,300	708.00	6,584,400
ブイ・テクノロジー	2,800	2,425.00	6,790,000
スター精密	28,000	1,590.00	44,520,000
東京計器	51,000	269.00	13,719,000
愛知時計電機	20,000	325.00	6,500,000
オーバル	11,200	337.00	3,774,400
東京精密	26,400	2,657.00	70,144,800
マニー	4,100	7,410.00	30,381,000
ニコン	274,300	1,533.00	420,501,900
トプコン	44,400	2,505.00	111,222,000
オリンパス	218,900	4,460.00	976,294,000
理研計器	13,000	1,266.00	16,458,000
SCREENホールディングス	139,000	796.00	110,644,000
キヤノン電子	13,500	2,241.00	30,253,500
タムロン	11,300	2,340.00	26,442,000
HOYA	349,700	4,804.50	1,680,133,650
ノーリツ鋼機	13,300	670.00	8,911,000
エー・アンド・デイ	13,300	481.00	6,397,300
キヤノン	851,900	3,869.00	3,296,001,100
リコー	441,700	1,204.00	531,806,800
シチズンホールディングス	181,000	917.00	165,977,000
リズム時計工業	65,000	159.00	10,335,000
大研医器	10,300	1,148.00	11,824,400
パラマウントベッドホールディングス	15,500	3,160.00	48,980,000
SHOBI	5,300	407.00	2,157,100
前田工織	14,700	1,040.00	15,288,000
永大産業	22,000	456.00	10,032,000
アートネイチャー	10,700	1,095.00	11,716,500
ダンロップスポーツ	9,500	1,281.00	12,169,500
バンダイナムコホールディングス	162,100	2,177.00	352,891,700
共立印刷	27,000	301.00	8,127,000
フランスベッドホールディングス	103,000	181.00	18,643,000
マーベラス	24,500	1,689.00	41,380,500
パイロットコーポレーション	12,800	6,880.00	88,064,000
萩原工業	3,200	1,984.00	6,348,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	28,700	1,969.00	56,510,300
トッパン・フォームズ	26,300	1,248.00	32,822,400
フジシールインターナショナル	17,900	3,540.00	63,366,000
タカラトミー	52,900	711.00	37,611,900
廣済堂	13,700	531.00	7,274,700
アーク	46,500	136.00	6,324,000
レック	5,400	1,388.00	7,495,200

タカノ	6,700	617.00	4,133,900
プロネクサス	15,200	811.00	12,327,200
ホクシン	13,100	132.00	1,729,200
ウッドワン	26,000	272.00	7,072,000
大建工業	61,000	283.00	17,263,000
きもと	27,600	288.00	7,948,800
凸版印刷	415,000	844.00	350,260,000
大日本印刷	447,000	1,152.50	515,167,500
図書印刷	24,000	326.00	7,824,000
共同印刷	46,000	393.00	18,078,000
日本写真印刷	24,700	2,340.00	57,798,000
光村印刷	3,000	276.00	828,000
藤森工業	13,200	3,750.00	49,500,000
宝印刷	7,900	941.00	7,433,900
前澤化成工業	11,100	1,287.00	14,285,700
アシックス	146,000	3,015.00	440,190,000
ツツミ	7,400	2,736.00	20,246,400
J S P	11,500	2,399.00	27,588,500
ニチハ	20,600	1,319.00	27,171,400
エフピコ	13,600	4,155.00	56,508,000
小松ウオール工業	4,600	2,580.00	11,868,000
ヤマハ	108,100	2,035.00	219,983,500
河合楽器製作所	5,100	2,156.00	10,995,600
クリナップ	13,700	930.00	12,741,000
ピジョン	27,800	7,950.00	221,010,000
天馬	11,900	1,797.00	21,384,300
兼松日産農林	20,000	157.00	3,140,000
キングジム	12,300	797.00	9,803,100
リンテック	34,900	2,784.00	97,161,600
T A S A K I	2,800	1,938.00	5,426,400
信越ポリマー	30,400	579.00	17,601,600
東リ	41,000	265.00	10,865,000
イトーキ	31,100	675.00	20,992,500
任天堂	90,500	12,235.00	1,107,267,500
三菱鉛筆	12,100	4,130.00	49,973,000
松風	7,300	1,399.00	10,212,700
タカラスタANDARD	61,000	1,000.00	61,000,000
コクヨ	76,400	1,047.00	79,990,800
ナカバヤシ	31,000	228.00	7,068,000
ニフコ	34,300	4,055.00	139,086,500
グローブライド	72,000	173.00	12,456,000
岡村製作所	56,500	860.00	48,590,000
日本バルカー工業	64,000	318.00	20,352,000
M U T O Hホールディングス	20,000	450.00	9,000,000
伊藤忠商事	1,214,100	1,318.50	1,600,790,850
丸紅	1,268,800	728.40	924,193,920
スクロール	19,600	289.00	5,664,400
高島	28,000	260.00	7,280,000
ヨンドシーホールディングス	11,100	2,021.00	22,433,100
三陽商会	81,000	290.00	23,490,000

長瀬産業	88,400	1,528.00	135,075,200
ナイガイ	57,000	64.00	3,648,000
蝶理	9,300	1,904.00	17,707,200
豊田通商	161,700	3,260.00	527,142,000
オンワードホールディングス	110,000	777.00	85,470,000
三共生興	25,100	478.00	11,997,800
兼松	291,000	178.00	51,798,000
美津濃	79,000	592.00	46,768,000
ツカモトコーポレーション	26,000	138.00	3,588,000
ファミリーマート	49,000	5,440.00	266,560,000
ルック	26,000	224.00	5,824,000
三井物産	1,229,600	1,639.00	2,015,314,400
日本紙パルプ商事	75,000	340.00	25,500,000
東京エレクトロン	123,600	9,200.00	1,137,120,000
日立ハイテクノロジーズ	50,300	3,720.00	187,116,000
カメイ	19,000	874.00	16,606,000
東都水産	26,000	199.00	5,174,000
OUGホールディングス	25,000	232.00	5,800,000
スターゼン	57,000	423.00	24,111,000
セイコーホールディングス	104,000	651.00	67,704,000
山善	56,200	917.00	51,535,400
椿本興業	16,000	312.00	4,992,000
住友商事	856,000	1,301.50	1,114,084,000
日本ユニシス	40,100	1,150.00	46,115,000
内田洋行	36,000	368.00	13,248,000
三菱商事	1,111,500	2,358.50	2,621,472,750
第一実業	36,000	601.00	21,636,000
キヤノンマーケティングジャパン	41,400	2,251.00	93,191,400
西華産業	48,000	308.00	14,784,000
佐藤商事	13,000	801.00	10,413,000
菱洋エレクトロ	16,800	1,304.00	21,907,200
東京産業	14,700	490.00	7,203,000
ユアサ商事	12,900	2,485.00	32,056,500
神鋼商事	38,000	273.00	10,374,000
小林産業	10,800	258.00	2,786,400
阪和興業	145,000	463.00	67,135,000
カナデン	2,000	848.00	1,696,000
菱電商事	24,000	815.00	19,560,000
ニプロ	93,600	1,110.00	103,896,000
フルサト工業	8,100	1,712.00	13,867,200
岩谷産業	161,000	811.00	130,571,000
すてきナイスグループ	63,000	195.00	12,285,000
昭光通商	55,000	149.00	8,195,000
ニチモウ	25,000	209.00	5,225,000
極東貿易	18,000	228.00	4,104,000
イワキ	23,000	221.00	5,083,000
兼松エレクトロニクス	9,300	1,779.00	16,544,700
三愛石油	37,000	863.00	31,931,000
稲畑産業	35,100	1,160.00	40,716,000
G S Iクレオス	38,000	128.00	4,864,000

明和産業	12,100	453.00	5,481,300
キムラタン	695,000	9.00	6,255,000
ゴールドウイン	35,000	825.00	28,875,000
ユニ・チャーム	311,600	3,261.50	1,016,283,400
デサント	35,200	1,421.00	50,019,200
キング	8,200	433.00	3,550,600
ワキタ	30,900	1,152.00	35,596,800
ヤマトインターナショナル	10,700	415.00	4,440,500
東邦ホールディングス	50,000	2,061.00	103,050,000
サンゲツ	26,100	3,430.00	89,523,000
ミツウロコグループホールディングス	23,500	593.00	13,935,500
シナネン	32,000	494.00	15,808,000
伊藤忠エネクス	32,200	990.00	31,878,000
サンリオ	40,600	3,450.00	140,070,000
サンワ テクノス	9,300	1,211.00	11,262,300
リョーサン	24,400	2,791.00	68,100,400
新光商事	17,100	1,159.00	19,818,900
トーヨー	34,000	447.00	15,198,000
三信電気	20,100	1,002.00	20,140,200
東陽テクニカ	21,300	1,227.00	26,135,100
モスフードサービス	19,000	2,452.00	46,588,000
加賀電子	13,100	1,420.00	18,602,000
三益半導体工業	11,400	1,428.00	16,279,200
ソーダニッカ	2,000	558.00	1,116,000
立花エレテック	9,000	1,813.00	16,317,000
木曽路	17,700	2,132.00	37,736,400
サトレストランシステムズ	13,700	1,104.00	15,124,800
千趣会	26,100	843.00	22,002,300
タカキュー	10,700	213.00	2,279,100
ケーヨー	27,400	565.00	15,481,000
アデランス	17,000	1,117.00	18,989,000
上新電機	32,000	972.00	31,104,000
日本瓦斯	23,300	3,255.00	75,841,500
ベスト電器	47,000	145.00	6,815,000
マルエツ	36,000	502.00	18,072,000
ロイヤルホールディングス	24,200	1,819.00	44,019,800
東天紅	11,000	201.00	2,211,000
いなげや	16,200	1,463.00	23,700,600
島忠	35,200	3,065.00	107,888,000
チヨダ	17,200	2,686.00	46,199,200
ライフコーポレーション	9,200	1,770.00	16,284,000
カスミ	29,800	974.00	29,025,200
リンガーハット	14,200	2,138.00	30,359,600
さが美	13,000	96.00	1,248,000
MR MAX	14,600	285.00	4,161,000
テンアライド	12,700	385.00	4,889,500
AOKIホールディングス	33,300	1,490.00	49,617,000
オークワ	23,000	933.00	21,459,000
コメリ	24,800	2,834.00	70,283,200

青山商事	36,500	4,040.00	147,460,000
しまむら	16,800	11,080.00	186,144,000
C F S コーポレーション	9,800	875.00	8,575,000
はせがわ	5,100	540.00	2,754,000
高島屋	211,000	1,083.00	228,513,000
松屋	29,300	1,774.00	51,978,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,600	2,208.00	151,468,800
近鉄百貨店	55,000	337.00	18,535,000
丸栄	24,000	136.00	3,264,000
ニッセンホールディングス	30,700	287.00	8,810,900
パルコ	13,900	1,027.00	14,275,300
丸井グループ	174,600	1,374.00	239,900,400
クレディセゾン	118,500	2,293.00	271,720,500
アクシアル リテイリング	11,300	3,115.00	35,199,500
井筒屋	80,000	63.00	5,040,000
イオン	597,900	1,286.00	768,899,400
ユニーグループ・ホールディングス	139,100	688.00	95,700,800
イズミ	32,400	4,415.00	143,046,000
東武ストア	19,000	283.00	5,377,000
フォーバル	3,000	1,523.00	4,569,000
平和堂	29,400	2,578.00	75,793,200
フジ	16,100	2,133.00	34,341,300
ヤオコー	8,200	7,950.00	65,190,000
ゼビオ	19,700	2,238.00	44,088,600
ケーズホールディングス	33,400	3,515.00	117,401,000
P a l t a c	23,200	1,691.00	39,231,200
O l y m p i c グループ	8,700	810.00	7,047,000
日産東京販売ホールディングス	24,500	285.00	6,982,500
新生銀行	1,381,000	227.00	313,487,000
あおぞら銀行	980,000	430.00	421,400,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,635,900	762.70	8,874,700,930
りそなホールディングス	1,697,000	674.00	1,143,778,000
三井住友トラスト・ホールディングス	3,206,000	482.20	1,545,933,200
三井住友フィナンシャルグループ	1,096,700	4,615.50	5,061,818,850
第四銀行	183,000	450.00	82,350,000
北越銀行	157,000	247.00	38,779,000
西日本シティ銀行	509,000	383.00	194,947,000
千葉銀行	559,000	901.00	503,659,000
横浜銀行	1,002,000	738.00	739,476,000
常陽銀行	524,000	642.00	336,408,000
群馬銀行	344,000	853.00	293,432,000
武蔵野銀行	23,200	4,345.00	100,804,000
千葉興業銀行	30,100	853.00	25,675,300
筑波銀行	60,300	414.00	24,964,200
七十七銀行	245,000	722.00	176,890,000
青森銀行	114,000	387.00	44,118,000
秋田銀行	96,000	376.00	36,096,000
山形銀行	87,000	535.00	46,545,000

岩手銀行	10,100	5,320.00	53,732,000
東邦銀行	130,000	487.00	63,310,000
東北銀行	80,000	168.00	13,440,000
みちのく銀行	72,000	215.00	15,480,000
ふくおかフィナンシャルグループ	589,000	648.00	381,672,000
静岡銀行	425,000	1,220.00	518,500,000
十六銀行	182,000	461.00	83,902,000
スルガ銀行	153,100	2,507.00	383,821,700
八十二銀行	262,000	890.00	233,180,000
山梨中央銀行	92,000	529.00	48,668,000
大垣共立銀行	181,000	417.00	75,477,000
福井銀行	124,000	278.00	34,472,000
北國銀行	161,000	435.00	70,035,000
清水銀行	5,000	3,125.00	15,625,000
滋賀銀行	145,000	723.00	104,835,000
南都銀行	140,000	422.00	59,080,000
百五銀行	139,000	586.00	81,454,000
京都銀行	277,000	1,168.00	323,536,000
紀陽銀行	56,900	1,651.00	93,941,900
三重銀行	65,000	299.00	19,435,000
ほくほくフィナンシャルグループ	986,000	282.00	278,052,000
広島銀行	428,000	653.00	279,484,000
山陰合同銀行	89,000	1,032.00	91,848,000
中国銀行	104,200	1,853.00	193,082,600
鳥取銀行	47,000	273.00	12,831,000
伊予銀行	155,100	1,508.00	233,890,800
百十四銀行	159,000	429.00	68,211,000
四国銀行	112,000	263.00	29,456,000
阿波銀行	118,000	692.00	81,656,000
鹿児島銀行	101,000	829.00	83,729,000
大分銀行	89,000	450.00	40,050,000
宮崎銀行	97,000	472.00	45,784,000
肥後銀行	118,000	736.00	86,848,000
佐賀銀行	89,000	313.00	27,857,000
十八銀行	90,000	381.00	34,290,000
沖縄銀行	11,500	5,180.00	59,570,000
琉球銀行	29,900	1,829.00	54,687,100
セブン銀行	489,100	584.00	285,634,400
みずほフィナンシャルグループ	20,077,700	218.90	4,395,008,530
高知銀行	56,000	166.00	9,296,000
山口フィナンシャルグループ	145,000	1,401.00	203,145,000
アクリーティブ	10,400	267.00	2,776,800
芙蓉総合リース	15,200	4,280.00	65,056,000
興銀リース	27,200	2,417.00	65,742,400
東京センチュリーリース	34,000	3,065.00	104,210,000
SBIホールディングス	174,200	1,414.00	246,318,800
日本証券金融	68,400	652.00	44,596,800
アイフル	242,800	456.00	110,716,800
日本アジア投資	101,000	75.00	7,575,000
ポケットカード	11,100	535.00	5,938,500

長野銀行	48,000	210.00	10,080,000
名古屋銀行	131,000	467.00	61,177,000
北洋銀行	218,200	471.00	102,772,200
愛知銀行	5,300	6,550.00	34,715,000
第三銀行	83,000	210.00	17,430,000
中京銀行	60,000	218.00	13,080,000
東日本銀行	64,000	390.00	24,960,000
大光銀行	52,000	242.00	12,584,000
愛媛銀行	85,000	258.00	21,930,000
トマト銀行	56,000	191.00	10,696,000
みなと銀行	132,000	297.00	39,204,000
京葉銀行	120,000	703.00	84,360,000
関西アーバン銀行	20,000	1,328.00	26,560,000
栃木銀行	73,000	630.00	45,990,000
北日本銀行	4,600	3,085.00	14,191,000
東和銀行	199,000	107.00	21,293,000
福島銀行	179,000	95.00	17,005,000
大東銀行	94,000	156.00	14,664,000
リコーリース	11,400	3,520.00	40,128,000
イオンフィナンシャルサービス	95,100	2,721.00	258,767,100
アコム	291,600	387.00	112,849,200
ジャックス	80,000	588.00	47,040,000
オリエントコーポレーション	335,000	203.00	68,005,000
日立キャピタル	28,500	2,507.00	71,449,500
アプラスフィナンシャル	70,000	139.00	9,730,000
オリックス	1,026,400	1,607.00	1,649,424,800
三菱UFJリース	367,700	581.00	213,633,700
ジャフコ	19,800	4,630.00	91,674,000
トモニホールディングス	111,500	566.00	63,109,000
大和証券グループ本社	1,356,000	928.30	1,258,774,800
野村ホールディングス	2,964,000	720.50	2,135,562,000
岡三証券グループ	124,000	932.00	115,568,000
丸三証券	46,300	880.00	40,744,000
東洋証券	59,000	374.00	22,066,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	166,400	877.00	145,932,800
光世証券	36,000	233.00	8,388,000
水戸証券	45,300	444.00	20,113,200
いちよし証券	30,500	1,352.00	41,236,000
松井証券	73,800	1,112.00	82,065,600
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	322,200	3,631.50	1,170,069,300
だいこう証券ビジネス	7,400	820.00	6,068,000
日本取引所グループ	213,000	3,055.00	650,715,000
マネックスグループ	170,800	290.00	49,532,000
カブドットコム証券	64,400	738.00	47,527,200
極東証券	19,500	1,896.00	36,972,000
岩井コスモホールディングス	14,900	1,492.00	22,230,800
フィデアホールディングス	83,700	235.00	19,669,500
池田泉州ホールディングス	119,300	557.00	66,450,100

アニコム ホールディングス	6,200	1,723.00	10,682,600	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	462,300	3,170.00	1,465,491,000	
マネースクウェアHD	4,600	1,357.00	6,242,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	138,900	1,790.00	248,631,000	
マネーパートナーズグループ	15,200	414.00	6,292,800	
小林洋行	5,000	340.00	1,700,000	
第一生命保険	929,200	1,742.50	1,619,131,000	
東京海上ホールディングス	596,900	4,241.00	2,531,452,900	
イー・ギャランティ	4,300	1,845.00	7,933,500	
アサックス	2,700	1,661.00	4,484,700	
N E Cキャピタルソリューション	5,900	1,958.00	11,552,200	
T & Dホールディングス	528,500	1,521.50	804,112,750	
三井不動産	769,000	3,333.50	2,563,461,500	
三菱地所	1,078,000	2,749.50	2,963,961,000	
平和不動産	27,500	1,680.00	46,200,000	
東京建物	316,000	910.00	287,560,000	
ダイビル	37,300	1,137.00	42,410,100	
京阪神ビルディング	24,200	730.00	17,666,000	
住友不動産	347,000	4,125.50	1,431,548,500	
太平洋興発	58,000	100.00	5,800,000	
大京	230,000	176.00	40,480,000	
テオーシー	50,000	782.00	39,100,000	
東京楽天地	24,000	500.00	12,000,000	
レオパレス21	158,700	696.00	110,455,200	
スターツコーポレーション	16,700	1,696.00	28,323,200	
フジ住宅	18,500	680.00	12,580,000	
空港施設	17,600	706.00	12,425,600	
明和地所	8,500	502.00	4,267,000	
住友不動産販売	10,400	3,250.00	33,800,000	
ゴールドクレスト	13,100	2,121.00	27,785,100	
リロ・ホールディング	5,300	9,720.00	51,516,000	
日本エスリード	5,800	1,230.00	7,134,000	
日神不動産	19,600	472.00	9,251,200	
タカラレーベン	64,500	675.00	43,537,500	
サンヨーハウジング名古屋	8,300	1,267.00	10,516,100	
イオンモール	93,500	2,295.00	214,582,500	
ファースト住建	5,500	1,362.00	7,491,000	
ランド	59,000	24.00	1,416,000	
東祥	3,300	2,693.00	8,886,900	
トーセイ	19,900	765.00	15,223,500	
穴吹興産	13,000	248.00	3,224,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	90,000	1,222.00	109,980,000	
サンフロンティア不動産	15,700	1,045.00	16,406,500	
エフ・ジェー・ネクスト	11,300	545.00	6,158,500	
ランドビジネス	7,600	404.00	3,070,400	
グランディハウス	13,000	306.00	3,978,000	
東武鉄道	785,000	591.00	463,935,000	
相鉄ホールディングス	252,000	592.00	149,184,000	

東京急行電鉄	798,000	815.00	650,370,000
京浜急行電鉄	402,000	970.00	389,940,000
小田急電鉄	471,000	1,254.00	590,634,000
京王電鉄	411,000	993.00	408,123,000
京成電鉄	220,000	1,578.00	347,160,000
富士急行	40,000	1,237.00	49,480,000
新京成電鉄	19,000	425.00	8,075,000
東日本旅客鉄道	269,300	10,050.00	2,706,465,000
西日本旅客鉄道	141,400	6,786.00	959,540,400
東海旅客鉄道	131,600	22,195.00	2,920,862,000
西武ホールディングス	117,100	3,005.00	351,885,500
鴻池運輸	9,100	2,450.00	22,295,000
西日本鉄道	190,000	534.00	101,460,000
ハマキョウレックス	4,600	4,105.00	18,883,000
サカイ引越センター	2,500	3,745.00	9,362,500
近畿日本鉄道	1,478,000	464.00	685,792,000
阪急阪神ホールディングス	985,000	742.00	730,870,000
南海電気鉄道	329,000	514.00	169,106,000
京阪電気鉄道	329,000	730.00	240,170,000
神戸電鉄	36,000	386.00	13,896,000
名糖運輸	6,200	754.00	4,674,800
名古屋鉄道	533,000	500.00	266,500,000
山陽電気鉄道	54,000	482.00	26,028,000
トランコム	4,300	5,080.00	21,844,000
日本通運	582,000	665.00	387,030,000
ヤマトホールディングス	258,400	2,789.00	720,677,600
山九	178,000	489.00	87,042,000
日新	56,000	322.00	18,032,000
丸運	8,600	261.00	2,244,600
丸全昭和運輸	50,000	404.00	20,200,000
センコー	60,000	695.00	41,700,000
トナミホールディングス	30,000	512.00	15,360,000
日本梱包運輸倉庫	48,000	1,910.00	91,680,000
日本石油輸送	17,000	244.00	4,148,000
福山通運	89,000	649.00	57,761,000
セイノーホールディングス	114,000	1,300.00	148,200,000
神奈川中央交通	17,000	604.00	10,268,000
日立物流	30,500	1,727.00	52,673,500
日本郵船	1,241,000	352.00	436,832,000
商船三井	770,000	427.00	328,790,000
川崎汽船	643,000	343.00	220,549,000
NSユナイテッド海運	64,000	300.00	19,200,000
明治海運	13,400	407.00	5,453,800
飯野海運	76,100	642.00	48,856,200
共栄タンカー	13,000	245.00	3,185,000
第一中央汽船	113,000	46.00	5,198,000
日本航空	281,400	3,650.00	1,027,110,000
ANAホールディングス	2,888,000	321.70	929,069,600
パスコ	14,000	338.00	4,732,000
三菱倉庫	96,000	1,824.00	175,104,000

三井倉庫ホールディングス	85,000	410.00	34,850,000
住友倉庫	107,000	676.00	72,332,000
澁澤倉庫	38,000	368.00	13,984,000
ヤマタネ	73,000	186.00	13,578,000
東陽倉庫	26,000	315.00	8,190,000
乾汽船	10,000	983.00	9,830,000
日本トランスシティ	34,000	396.00	13,464,000
ケイヒン	28,000	202.00	5,656,000
中央倉庫	8,700	984.00	8,560,800
安田倉庫	11,500	1,033.00	11,879,500
東洋埠頭	47,000	205.00	9,635,000
宇徳	12,100	656.00	7,937,600
上組	175,000	1,170.00	204,750,000
サンリツ	1,700	567.00	963,900
キムラユニティ	3,700	1,018.00	3,766,600
キューソー流通システム	4,100	1,387.00	5,686,700
郵船ロジスティクス	13,600	1,526.00	20,753,600
近鉄エクスプレス	13,200	5,120.00	67,584,000
東海運	8,300	294.00	2,440,200
エーアイティー	6,900	1,215.00	8,383,500
東京放送ホールディングス	86,800	1,391.00	120,738,800
日本テレビホールディングス	132,400	1,910.00	252,884,000
朝日放送	14,400	960.00	13,824,000
テレビ朝日ホールディングス	39,500	1,833.00	72,403,500
スカパーJ S A Tホールディングス	110,200	746.00	82,209,200
テレビ東京ホールディングス	11,900	2,267.00	26,977,300
コネクシオ	10,500	1,083.00	11,371,500
クロップス	1,400	539.00	754,600
日本電信電話	567,500	7,381.00	4,188,717,500
K D D I	491,100	8,187.00	4,020,635,700
光通信	13,100	7,820.00	102,442,000
N T T ドコモ	1,195,000	2,134.50	2,550,727,500
G M Oインターネット	48,400	1,182.00	57,208,800
K A D O K A W A ・ D W A N G O	35,500	2,050.00	72,775,000
学研ホールディングス	48,000	265.00	12,720,000
ゼンリン	19,300	1,545.00	29,818,500
昭文社	8,800	1,001.00	8,808,800
インプレスホールディングス	10,700	128.00	1,369,600
東京電力	1,246,300	477.00	594,485,100
中部電力	449,600	1,448.50	651,245,600
関西電力	599,600	1,070.00	641,572,000
中国電力	203,100	1,593.00	323,538,300
北陸電力	144,000	1,606.00	231,264,000
東北電力	367,100	1,419.00	520,914,900
四国電力	132,300	1,591.00	210,489,300
九州電力	324,400	1,039.00	337,051,600
北海道電力	137,400	950.00	130,530,000
沖縄電力	9,600	4,070.00	39,072,000
電源開発	98,800	4,115.00	406,562,000
東京瓦斯	1,786,000	731.90	1,307,173,400

大阪瓦斯	1,521,000	494.30	751,830,300
東邦瓦斯	374,000	678.00	253,572,000
北海道瓦斯	29,000	286.00	8,294,000
西部瓦斯	165,000	273.00	45,045,000
静岡瓦斯	41,900	852.00	35,698,800
メタウォーター	6,800	2,435.00	16,558,000
アイネット	7,700	936.00	7,207,200
松竹	95,000	1,140.00	108,300,000
東宝	103,500	2,859.00	295,906,500
エイチ・アイ・エス	25,000	4,000.00	100,000,000
東映	54,000	772.00	41,688,000
AOI Pro.	6,900	828.00	5,713,200
エヌ・ティ・ティ・データ	89,600	4,870.00	436,352,000
共立メンテナンス	7,600	6,460.00	49,096,000
イチネンホールディングス	16,200	1,032.00	16,718,400
建設技術研究所	9,100	1,341.00	12,203,100
スペース	8,600	1,206.00	10,371,600
アインファーマシーズ	16,800	4,600.00	77,280,000
燦ホールディングス	3,200	1,764.00	5,644,800
スバル興業	3,000	450.00	1,350,000
東京テアトル	59,000	145.00	8,555,000
よみうりランド	31,000	478.00	14,818,000
東京都競馬	105,000	321.00	33,705,000
常磐興産	56,000	154.00	8,624,000
カナモト	21,400	3,270.00	69,978,000
東京ドーム	105,000	589.00	61,845,000
D T S	15,100	2,232.00	33,703,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,700	2,415.00	127,270,500
シーイーシー	9,700	1,012.00	9,816,400
カブコン	37,100	2,148.00	79,690,800
西尾レントオール	12,400	3,185.00	39,494,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	65,000	46.00	2,990,000
日本空港ビルデング	50,100	5,830.00	292,083,000
トランス・コスモス	20,100	2,424.00	48,722,400
乃村工藝社	30,200	1,161.00	35,062,200
ジャステック	8,700	945.00	8,221,500
S C S K	34,500	3,180.00	109,710,000
藤田観光	56,000	503.00	28,168,000
K N T - C Tホールディングス	74,000	162.00	11,988,000
日本管財	7,600	2,688.00	20,428,800
トーカイ	6,800	3,925.00	26,690,000
白洋舎	5,000	250.00	1,250,000
セコム	149,000	7,344.00	1,094,256,000
日本システムウエア	5,700	940.00	5,358,000
セントラル警備保障	6,900	1,289.00	8,894,100
アイネス	20,000	866.00	17,320,000
丹青社	17,900	812.00	14,534,800
メイテック	20,800	3,670.00	76,336,000

TKC	12,300	2,260.00	27,798,000
アサツー ディ・ケイ	28,900	3,240.00	93,636,000
富士ソフト	20,000	2,518.00	50,360,000
応用地質	16,100	1,684.00	27,112,400
船井総研ホールディングス	16,800	979.00	16,447,200
NSD	33,990	1,771.00	60,196,290
進学会	6,800	467.00	3,175,600
丸紅建材リース	13,000	274.00	3,562,000
コナミ	58,900	2,375.00	139,887,500
ベネッセホールディングス	56,000	3,815.00	213,640,000
イオンディライト	14,900	2,787.00	41,526,300
ナック	10,300	1,066.00	10,979,800
福井コンピュータホールディングス	4,200	802.00	3,368,400
ニチイ学館	30,100	1,133.00	34,103,300
ダイセキ	24,700	2,088.00	51,573,600
ステップ	5,300	846.00	4,483,800
日鉄住金物産	95,000	414.00	39,330,000
元気寿司	4,500	2,725.00	12,262,500
トラスコ中山	18,200	3,475.00	63,245,000
ヤマダ電機	573,200	496.00	284,307,200
オートバックスセブン	53,400	1,877.00	100,231,800
アークランドサカモト	10,400	2,479.00	25,781,600
ニトリホールディングス	62,700	7,690.00	482,163,000
グルメ杵屋	11,000	992.00	10,912,000
愛眼	12,000	248.00	2,976,000
ケーユーホールディングス	8,000	697.00	5,576,000
吉野家ホールディングス	40,700	1,311.00	53,357,700
加藤産業	21,100	2,400.00	50,640,000
イノテック	13,300	458.00	6,091,400
イエローハット	13,700	2,393.00	32,784,100
富士エレクトロニクス	7,400	1,468.00	10,863,200
松屋フーズ	7,000	2,504.00	17,528,000
JBCホールディングス	12,400	790.00	9,796,000
JKホールディングス	15,000	583.00	8,745,000
サガミチェーン	18,000	1,195.00	21,510,000
日伝	6,000	2,545.00	15,270,000
関西スーパーマーケット	10,900	802.00	8,741,800
ミロク情報サービス	9,800	670.00	6,566,000
北沢産業	11,000	181.00	1,991,000
杉本商事	7,900	1,300.00	10,270,000
因幡電機産業	21,400	4,110.00	87,954,000
王将フードサービス	10,700	4,475.00	47,882,500
プレナス	16,200	2,315.00	37,503,000
ミニストップ	10,800	1,613.00	17,420,400
アークス	25,300	2,462.00	62,288,600
パロー	31,300	2,406.00	75,307,800
バイテック	5,000	1,034.00	5,170,000
ミスミグループ本社	54,100	4,545.00	245,884,500
江守グループホールディングス	6,200	836.00	5,183,200
アルテック	11,000	210.00	2,310,000

ベルク	6,500	3,280.00	21,320,000	
大 庄	7,900	1,426.00	11,265,400	
タキヒヨー	24,000	454.00	10,896,000	
ファーストリテイリング	29,000	44,905.00	1,302,245,000	
ソフトバンク	766,900	7,315.00	5,609,873,500	
スズケン	60,000	3,815.00	228,900,000	
サンドラッグ	30,700	5,750.00	176,525,000	
サックスパー ホールディングス	11,000	1,866.00	20,526,000	
ジェコス	10,200	1,346.00	13,729,200	
ヤマザワ	3,100	1,745.00	5,409,500	
やまや	2,500	1,647.00	4,117,500	
ルネサスイーストン	6,700	732.00	4,904,400	
ベルーナ	36,200	541.00	19,584,200	
合計	244,198,630		323,712,344,980	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘 柄	株 式 数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,583,323,975	3,135,975,174
国債証券		351,275,841,100	342,470,616,400
地方債証券		28,762,321,767	27,404,729,235
特殊債券		29,885,012,244	27,546,834,748
社債券		27,524,696,780	23,039,056,100
未収利息		1,589,417,351	1,486,873,383
前払費用		35,039,973	29,240,078
流動資産合計		441,655,653,190	425,113,325,118
資産合計		441,655,653,190	425,113,325,118
負債の部			
流動負債			
未払金		-	712,949,000
未払解約金		114,210,000	63,275,000
流動負債合計		114,210,000	776,224,000
負債合計		114,210,000	776,224,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	369,629,287,107	345,746,995,990
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		71,912,156,083	78,590,105,128
元本等合計		441,541,443,190	424,337,101,118
純資産合計		441,541,443,190	424,337,101,118
負債純資産合計		441,655,653,190	425,113,325,118

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	379,645,534,947円	369,629,287,107円
同期中追加設定元本額	68,533,693,970円	45,327,581,060円
同期中一部解約元本額	78,549,941,810円	69,209,872,177円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	6,124,799,820円	8,503,262,466円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	9,964,889,255円	10,825,044,625円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	3,689,890,795円	4,270,992,250円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	5,899,835,145円	6,629,308,611円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,441,051,268円	2,732,232,561円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,445,723,290円	1,645,584,410円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,576,398,413円	1,795,769,252円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	223,891,406円	254,649,242円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	155,827,199円	119,643,701円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,914,949,486円	1,932,618,795円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,450,420円	10,557,102円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	65,611,552円	156,357,891円

D I A M D C 8 資産 バランスファンド(新興 国20)	32,831,575円	111,841,764円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド(新興 国30)	9,744,053円	34,671,990円
投資のソムリエ	572,926,042円	1,484,320,221円
クルーズコントロール	41,067,151円	1,388,385,757円
投資のソムリエ<DC年 金>	2,528,769円	21,949,338円
D I A M 8 資産 balan スファンドN<DC年金 >	4,868,709円	324,888,979円
D I A M D C バラン ス・F(成長型)	- 円	6,078,776円
クルーズコントロール< DC年金>	- 円	419,325円
みずほエマージングボン ドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファ ンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債 券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	12,480,682,698円	12,161,340,736円
D I A Mワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	729,182,367円	708,077,509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)	8,371,525,368円	4,083,456,644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)	550,031,413円	391,300,895円
D I A M国際分散 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	410,802,331円	252,489,640円
D I A M国際分散 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	883,135,350円	705,807,127円
D I A M国内重視 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	389,296,695円	248,091,708円
D I A M国内重視 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	344,472,009円	245,121,818円
D I A M世界 balan スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	31,933,620,345円	24,499,571,391円
D I A M世界 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	10,587,775,823円	8,605,785,394円

D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	13,576,802,100円	12,537,944,510円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	5,159,581,547円	4,852,002,295円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	8,286,523,508円	8,171,451,026円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	1,453,753,657円	1,026,521,106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)	6,149,349,161円	4,606,495,216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)	6,772,700,939円	6,060,818,780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)	11,688,869,273円	8,958,285,756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)	508,585,424円	495,049,617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)	13,047,452,258円	9,309,734,048円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	8,305,551,020円	8,496,097,087円
D I A Mグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	1,356,918,135円	1,038,550,408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)	107,438,352,199円	104,406,638,366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)	2,039,450,561円	1,620,368,453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)	9,556,849,896円	9,010,019,380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)	33,152,430,550円	32,807,793,993円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	167,899,806円	494,649円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	299,556,566円	43,932,447円

D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	122,282,533円	77,804,608円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	36,823,253,663円	36,564,549,550円
D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	896,638,916円	687,712,472円
D I A M国内バランス3 0VA(適格機関投資家 限定)	192,913,809円	171,833,083円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	1,752,178,041円	28,056,951円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	423,568円	595,035,375円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	300,391円	326,057円
計	369,629,287,107円	345,746,995,990円
2. 受益権の総数	369,629,287,107口	345,746,995,990口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	165,657,200	3,541,686,200
地方債証券	2,858,895	116,092,683
特殊債券	1,961,920	72,764,571
社債券	4,941,220	29,019,600
合計	159,819,005	3,759,563,054

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年2月15日から平成26年2月25日まで及び平成27年2月17日から平成27年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.1946円	1.2273円
（1万口当たり純資産額）	（11,946円）	（12,273円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	340回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,040,000	
	341回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,060,000	
	342回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,200,000	
	343回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,501,755,000	
	344回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,460,000	
	345回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,600,000	
	348回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,503,525,000	
	96回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,206,216,000	
	97回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,020,160,000	
	99回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,790,000	
	101回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,013,740,000	
	102回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,517,710,000	
	103回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,526,370,000	
	105回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,518,135,000	
	106回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,520,700,000	
	107回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,321,113,000	
	109回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,004,260,000	
	110回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,016,480,000	
	112回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,518,090,000	
	113回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,530,660,000	
	114回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,541,580,000	
	116回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,525,650,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,028,300,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,026,800,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,350,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,501,350,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,500,705,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	721,506,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,203,690,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,201,770,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	1,259,489,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,003,005,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	527,875,000	
	277回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,542,025,000	
	280回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,537,020,000	
	282回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,489,148,000	
	284回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,339,533,000	
	285回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,551,825,000	
	286回 利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,706,834,000	
	288回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,564,515,000	

289回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,332,576,000	
290回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,042,000,000	
293回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,857,518,000	
296回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,681,720,000	
297回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,469,455,000	
299回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,730,494,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,608,896,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,437,977,000	
305回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,231,840,000	
306回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,199,470,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,916,100,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,107,840,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,942,632,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,343,176,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	4,079,452,000	
315回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,889,837,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,598,820,000	
318回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,330,592,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,134,560,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,590,780,000	
321回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,184,740,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,618,425,000	
325回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,188,120,000	
326回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,117,750,000	
328回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,092,700,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,884,420,000	
330回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,825,658,000	
332回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,117,120,000	
333回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,627,170,000	
334回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,651,965,000	
335回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,085,850,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,016,150,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	129,029,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,384,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	244,026,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,786,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	240,900,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,848,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	365,082,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	566,220,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	444,364,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	353,043,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	347,496,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	613,030,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	248,352,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	496,540,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	244,680,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	988,182,000	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	240,840,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	372,300,000	

2 1回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	602,115,000	
2 2回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	583,495,600	
2 3回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	745,008,000	
2 4回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	372,546,000	
2 5回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	722,202,000	
2 6回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,222,080,000	
2 7回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,119,654,000	
2 8回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	996,824,000	
2 9回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,596,803,000	
3 0回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,572,818,000	
3 1回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,428,996,000	
3 2回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,940,928,000	
3 3回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,724,610,000	
3 4回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,792,410,000	
3 5回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,726,050,000	
3 6回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,955,799,000	
3 7回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,802,096,000	
3 8回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,103,920,000	
3 9回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	901,192,000	
4 0回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,101,840,000	
4 1回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,184,766,000	
4 2回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,076,410,000	
4 3回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,075,750,000	
4 4回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,612,620,000	
3 7回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	647,232,000	
3 9回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	431,336,000	
4 0回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	777,729,600	
4 2回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	882,064,000	
4 3回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	970,226,200	
4 5回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,005,678,000	
4 6回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	556,395,000	
4 7回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,062,157,000	
4 8回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	570,350,000	
5 0回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	866,431,800	
5 1回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	672,558,000	
5 2回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	622,341,500	
5 4回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	799,708,000	
5 5回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	916,928,100	
5 7回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,273,894,200	
5 8回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	677,490,000	
6 0回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,082,614,500	
6 1回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	850,408,000	
6 2回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,360,970,000	
6 4回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	683,556,000	
6 5回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,256,464,000	
6 7回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,173,809,000	
7 0回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,491,112,500	
7 2回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,460,487,500	
7 3回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,381,482,900	
7 5回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,642,018,000	

78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,675,301,000		
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,634,444,000		
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,651,762,000		
85回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,009,213,000		
88回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,809,345,000		
90回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,675,688,000		
92回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,780,560,000		
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	823,144,000		
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	950,424,000		
95回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,819,410,000		
97回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,922,608,000		
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,666,672,000		
100回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,046,698,000		
102回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,091,323,000		
105回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,145,330,000		
107回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,026,519,000		
109回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,214,469,000		
111回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,412,160,000		
113回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,264,971,000		
114回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,383,740,000		
116回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,653,112,000		
118回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,412,772,000		
119回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,148,130,000		
121回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,438,226,000		
123回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,262,558,000		
125回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,408,700,000		
128回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,157,860,000		
129回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,143,440,000		
130回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,168,337,000		
132回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,135,980,000		
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,024,317,000		
135回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,346,928,000		
137回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,465,430,000		
140回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,125,663,000		
141回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,455,090,000		
143回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,632,320,000		
145回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,334,717,000		
146回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,219,160,000		
147回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,397,582,000		
148回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,141,200,000		
149回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,669,875,000		
150回	利付国庫債券(20年)	3,000,000,000	3,144,870,000		
151回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	505,255,000		
国債証券 合計		317,120,000,000	342,470,616,400		
地方債証券	634回	東京都公募公債	200,000,000	204,744,000	
	638回	東京都公募公債	200,000,000	205,762,000	
	640回	東京都公募公債	150,000,000	154,693,500	
	641回	東京都公募公債	100,000,000	103,183,000	
	659回	東京都公募公債	203,500,000	213,933,445	
	664回	東京都公募公債	300,000,000	314,883,000	

6 6 7 回	東京都公募公債	300,000,000	317,841,000	
6 8 0 回	東京都公募公債	200,000,000	212,824,000	
6 8 5 回	東京都公募公債	500,000,000	526,785,000	
6 8 8 回	東京都公募公債	200,000,000	209,120,000	
6 9 7 回	東京都公募公債	500,000,000	531,070,000	
7 0 1 回	東京都公募公債	700,000,000	739,165,000	
7 0 8 回	東京都公募公債	500,000,000	525,435,000	
7 2 0 回	東京都公募公債	300,000,000	314,907,000	
7 2 6 回	東京都公募公債	400,000,000	414,768,000	
1 8 年度 4 回	北海道公募公債	190,500,000	195,312,030	
1 8 年度 6 回	北海道公募公債	100,000,000	102,996,000	
1 9 年度 4 回	北海道公募公債	300,000,000	313,053,000	
2 1 年度 6 回	北海道公募公債	200,000,000	212,736,000	
2 2 年度 1 2 回	北海道公募公債	200,000,000	213,134,000	
1 6 6 回	神奈川県公募公債	300,000,000	316,749,000	
1 9 4 回	神奈川県公募公債	300,000,000	312,792,000	
2 0 8 回	神奈川県公募公債	300,000,000	305,445,000	
2 8 9 回	大阪府公募公債	200,000,000	203,986,000	
2 9 3 回	大阪府公募公債	200,000,000	206,044,000	
3 0 1 回	大阪府公募公債	100,000,000	103,747,000	
3 0 7 回	大阪府公募公債	100,000,000	104,644,000	
3 1 0 回	大阪府公募公債	240,000,000	250,615,200	
3 1 9 回	大阪府公募公債	200,000,000	211,452,000	
3 3 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	213,178,000	
3 4 5 回	大阪府公募公債	300,000,000	319,146,000	
3 5 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	211,888,000	
3 6 4 回	大阪府公募公債	300,000,000	312,189,000	
3 7 4 回	大阪府公募公債	300,000,000	315,591,000	
8 3 回	大阪府公募公債 5 年	300,000,000	301,359,000	
1 8 年度 1 回	京都府公募公債	100,000,000	102,966,000	
1 8 年度 1 回	兵庫県公募公債	120,000,000	122,398,800	
1 9 年度 2 回	兵庫県公募公債	200,000,000	207,648,000	
1 8 年度 5 回	静岡県公募公債	129,800,000	133,643,378	
2 1 年度 5 回	静岡県公募公債	197,000,000	208,043,820	
2 2 年度 8 回	静岡県公募公債	200,000,000	210,196,000	
2 3 年度 9 回	静岡県公募公債	200,000,000	212,008,000	
1 8 年度 2 回	愛知県公募公債	160,300,000	164,434,137	
2 0 年度 4 回	愛知県公募公債	100,000,000	105,389,000	
2 2 年度 6 回	愛知県公募公債	200,000,000	211,346,000	
2 3 年度 2 0 回	愛知県公募公債	500,000,000	531,925,000	
2 5 年度 4 回	愛知県公募公債	300,000,000	314,208,000	
2 2 年度 1 回	広島県公募公債	200,000,000	212,870,000	
2 1 年度 4 回	埼玉県公募公債	440,000,000	465,836,800	
2 3 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	213,134,000	
2 6 年度 5 回	埼玉県公募公債	400,000,000	409,340,000	
1 8 年度 1 回	福岡県公募公債	104,000,000	107,191,760	
2 1 年度 3 回	福岡県公募公債	200,000,000	212,708,000	
1 9 年度 5 回	千葉県公募公債	300,000,000	314,190,000	
2 1 年度 6 回	千葉県公募公債	200,000,000	211,654,000	
2 4 年度 7 回	千葉県公募公債	300,000,000	311,508,000	

25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	209,206,000	
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	174,296,460	
37回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,028,500	
38回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	174,086,800	
39回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	149,549,260	
40回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,302,000	
47回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	167,170,352	
54回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	416,848,000	
55回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,460,000	
57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,894,000	
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,908,000	
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,345,000	
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	532,740,000	
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	746,214,000	
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	532,570,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	745,815,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,659,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	530,935,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	735,133,000	
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,545,000	
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,195,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	828,442,589	
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,040,000	
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,069,000	
18年度2回	大阪市公募公債	100,000,000	102,519,000	
18年度3回	大阪市公募公債	150,000,000	154,264,500	
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	141,127,650	
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	459,702,000	
18年度3回	京都市公募公債	101,700,000	105,424,254	
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	211,522,000	
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	213,106,000	
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	476,856,000	
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	420,096,000	
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	312,834,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	208,546,000	
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	107,951,000	
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	211,546,000	
18年度4回	福岡市公募公債	100,000,000	102,874,000	
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	215,100,000	
地方債証券 合計		26,162,300,000	27,404,729,235	
特殊債券	13回	政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	124,525,940
	27回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	205,834,000
	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	209,550,000
	15回	高速道路機構債	400,000,000	412,072,000
	25回	高速道路機構債	300,000,000	313,089,000
	35回	高速道路機構債	400,000,000	418,612,000
	48回	高速道路機構債	700,000,000	743,785,000
	96回	高速道路機構債	700,000,000	726,537,000
	116回	高速道路機構債	100,000,000	103,008,000

9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,778,000	
1 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	309,322,650	
1 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	125,594,120	
1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	340,281,000	
1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,775,000	
2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	386,478,750	
2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	309,036,000	
3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,308,000	
3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	307,579,140	
3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	358,712,880	
4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	346,361,710	
4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,152,000	
5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,540,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,388,000	
6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	747,878,740	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	170,231,220	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	423,355,750	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	629,994,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	737,842,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,025,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	316,170,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,039,180,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,665,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	525,410,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	347,575,800	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	204,868,000	

8 6 7 回	政保公営企業債券	200,000,000	205,474,000	
8 6 8 回	政保公営企業債券	101,000,000	103,908,800	
8 6 9 回	政保公営企業債券	102,000,000	105,088,560	
8 7 5 回	政保公営企業債券	482,000,000	499,699,040	
8 8 1 回	政保公営企業債券	500,000,000	520,985,000	
8 回	政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	689,356,920	
3 回	政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,222,610	
5 回	地方公共団体金融機構債券	500,000,000	528,010,000	
8 回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,193,000	
1 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	529,825,000	
1 5 回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,670,000	
2 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	319,074,000	
2 4 回	地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,882,000	
3 6 回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,660,000	
5 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	526,710,000	
6 4 回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,385,000	
2 0 回	公営企業金融公庫債券	200,000,000	205,080,000	
2 4 回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	309,894,000	
1 9 回	都市再生機構債券	200,000,000	211,686,000	
1 1 回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,644,000	
3 7 回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	316,575,000	
6 回	貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	74,883,000	81,306,463	
8 回	貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	52,268,000	56,590,040	
9 回	貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	77,502,000	84,023,793	
2 回	貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	84,249,000	91,752,215	
1 3 回	貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	38,961,000	41,305,672	
1 4 回	貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	199,025,000	209,209,109	
4 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,894,000	51,069,783	
4 3 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,428,000	37,651,493	
4 4 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	127,556,000	139,580,704	
5 1 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	101,673,000	110,819,503	
1 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,205,000	189,337,035	
2 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	280,470,000	301,878,275	
3 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	545,640,000	583,360,093	
7 3 2 号	利付商工債	400,000,000	402,316,000	
7 3 6 号	利付商工債	300,000,000	301,470,000	
7 4 0 号	利付商工債	300,000,000	301,791,000	
7 3 7 号	利附農林債	300,000,000	301,647,000	
7 4 3 号	利附農林債	300,000,000	301,845,000	
7 5 3 号	利附農林債	300,000,000	300,675,000	
7 6 0 号	利附農林債	300,000,000	302,082,000	
7 6 4 号	利附農林債	500,000,000	502,520,000	
2 6 1 回	利附信金中金債	300,000,000	301,458,000	
2 7 5 回	利附信金中金債	400,000,000	401,804,000	
2 8 2 回	利附信金中金債	300,000,000	301,455,000	
1 7 1 号	利附商工債(3年)	200,000,000	200,258,000	
8 回	政保中日本高速道路債券	170,000,000	174,836,500	

	10回 政保中日本高速道路債券	215,000,000	221,460,750	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	315,825,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	212,132,000	
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	267,629,880	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	121,086,810	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	521,120,000	
特殊債券 合計		26,429,754,000	27,546,834,748	
社債券	9回 JPモルガン・チェース円貨債	200,000,000	204,252,000	
	12回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	104,537,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	313,713,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	106,393,000	
	3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	105,852,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	105,942,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	106,281,000	
	12回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,596,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,398,000	
	29回 新日本製鐵社債	100,000,000	106,379,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	106,111,000	
	1回 日本電産社債	100,000,000	100,546,000	
	11回 パナソニック社債	100,000,000	102,679,000	
	19回 三菱重工業社債	100,000,000	102,911,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	101,248,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	210,020,000	
	49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	106,780,000	
	58回 伊藤忠商事社債	100,000,000	100,563,000	
	66回 伊藤忠商事社債	200,000,000	200,908,000	
	91回 丸紅社債	100,000,000	100,746,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	102,326,000	
	69回 三菱商事社債	300,000,000	317,466,000	
	7回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	313,692,000	
	25回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,989,000	
	27回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,629,000	
	29回 みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	502,960,000	
	31回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,134,000	
	32回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,456,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	108,944,000	
	126回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,695,000	
	134回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,764,000	
	140回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,825,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	216,926,000	
	11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,876,000	
	12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,334,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,988,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	214,238,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	323,760,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	110,123,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,238,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	213,000,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	108,115,000	

5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,296,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	103,648,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,550,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	103,403,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,960,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	301,011,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	207,356,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,640,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	216,516,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	212,008,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	429,072,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,271,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	104,980,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	215,814,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,644,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,745,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,599,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,327,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	217,240,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	308,802,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	103,598,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	204,160,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,686,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,606,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,958,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,889,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,926,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	199,352,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,550,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	212,900,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	206,786,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	104,714,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	212,486,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,499,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,781,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	105,667,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	103,067,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,926,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	339,855,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,653,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,818,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,400,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	212,070,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	342,267,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,600,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,838,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	196,344,100	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	216,080,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,278,000	
3回	東京地下鉄社債	100,000,000	102,792,000	

5回	KDDI社債	100,000,000	106,565,000	
51回	日本電信電話社債	200,000,000	205,106,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	210,216,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	319,029,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	211,768,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	203,038,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	500,335,000	
409回	中部電力社債	300,000,000	314,802,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	106,191,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	102,702,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	206,192,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	524,105,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	317,331,000	
310回	中国電力社債	200,000,000	214,566,000	
377回	中国電力社債	200,000,000	209,784,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	110,334,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	210,626,000	
380回	東北電力社債	300,000,000	317,475,000	
432回	東北電力社債	500,000,000	511,690,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	106,569,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	204,936,000	
426回	九州電力社債	300,000,000	308,472,000	
257回	北海道電力社債	200,000,000	208,314,000	
17回	電源開発社債	100,000,000	102,452,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	108,104,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	108,049,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	109,010,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	104,534,000	
社債券 合計		22,090,000,000	23,039,056,100	
合計		391,802,054,000	420,461,236,483	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		7,238,506,876	7,463,794,011
コール・ローン		95,423,713	317,762,461
株式		301,789,773,803	304,556,404,131
投資信託受益証券		872,653,837	931,236,031
投資証券		5,370,362,315	6,568,436,671
派生商品評価勘定		187,898,027	274,115,200
未収入金		-	18,440
未収配当金		823,647,139	540,263,891
差入委託証拠金		1,697,116,653	1,942,072,454
流動資産合計		318,075,382,363	322,594,103,290
資産合計		318,075,382,363	322,594,103,290
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		262,500	1,515,280
未払解約金		501,256,000	3,205,197,000
流動負債合計		501,518,500	3,206,712,280
負債合計		501,518,500	3,206,712,280
純資産の部			
元本等			
元本	1	137,116,704,251	109,314,267,788
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		180,457,159,612	210,073,123,222
元本等合計		317,573,863,863	319,387,391,010
純資産合計		317,573,863,863	319,387,391,010
負債純資産合計		318,075,382,363	322,594,103,290

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	182,478,399,692円	137,116,704,251円
同期中追加設定元本額	14,598,144,822円	10,177,480,079円
同期中一部解約元本額	59,959,840,263円	37,979,916,542円
元本の内訳 ファンド名		

D I A M外国株式パッシ ブ・ファンド	1,157,227,895円	973,546,154円
D I A M外国株式イン デックスファンド< D C 年金>	33,333,122,557円	34,317,265,356円
D I A Mバランス・ファ ンド< D C年金> 1 安定 型	146,968,029円	145,630,156円
D I A Mバランス・ファ ンド< D C年金> 2 安 定・成長型	869,514,428円	828,101,362円
D I A Mバランス・ファ ンド< D C年金> 3 成長 型	1,108,459,293円	1,051,813,641円
D I A M D C バラン ス30インデックスファ ンド	147,409,276円	140,375,493円
D I A M D C バラン ス50インデックスファ ンド	416,887,340円	403,472,656円
D I A M D C バラン ス70インデックスファ ンド	335,873,826円	323,794,483円
マネックス資産設計ファ ンド< 隔月分配型>	77,685,053円	50,098,652円
マネックス資産設計ファ ンド< 育成型>	952,637,609円	795,335,714円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	176,632,962円	217,561,695円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド(新興 国10)	6,128,891円	11,771,139円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド(新興 国20)	8,519,657円	23,300,325円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド(新興 国30)	20,501,667円	58,619,745円
投資のソムリエ	89,302,448円	150,434,088円
クルーズコントロール	8,482,513円	251,262,691円
投資のソムリエ< D C年 金>	398,539円	2,221,645円
D I A M 8 資産バラン スファンドN< D C年金 >	454,098円	25,247,512円
D I A M D C バラン ス・F(成長型)	- 円	2,351,445円
クルーズコントロール< D C年金>	- 円	75,719円
D I A M外国株式イン デックスファンドV A (適格機関投資家専用)	445,997,136円	347,241,830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)	4,220,261,501円	3,392,710,883円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	50,901,162円	40,541,962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)	3,735,475,008円	1,438,591,599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)	737,284,160円	429,031,677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)	94,323,154円	47,163,743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)	467,749,117円	308,162,419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)	41,625,205円	20,801,176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)	92,263,536円	53,437,377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)	11,371,122,917円	7,090,256,484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)	5,671,731,149円	3,741,316,822円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	1,813,277,510円	1,369,439,114円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	1,607,532,960円	1,234,248,157円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	4,422,388,362円	3,577,642,164円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	2,618,996,253円	1,516,695,305円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	3,998,591,953円	2,435,074,033円
D I A M アクサ グ ローバル バランスファ ンド30VA(適格機関 投資家限定)	2,375,814,024円	1,746,188,035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)	2,069,110,615円	1,321,413,471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)	27,678,338円	25,693,500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)	10,587,917,377円	6,142,740,733円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	2,237,421,615円	1,850,290,073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)	72,249,171円	43,493,404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)	14,346,736,140円	11,518,510,481円
D I A M世界アセットバ ランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,085,199,207円	708,666,227円
D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,555,117,327円	1,960,021,605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)	8,859,175,681円	7,251,366,521円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	56,611,889円	138,291円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	257,732,938円	31,289,480円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	240,880,538円	127,053,691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)	11,814,829,536円	9,539,533,825円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	284,017,847円	3,743,916円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	194,209円	229,228,270円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	290,635円	261,849円
計	137,116,704,251円	109,314,267,788円
2. 受益権の総数	137,116,704,251口	109,314,267,788口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,845,156,038	3,978,069,952
投資信託受益証券	14,535,066	10,111,126
投資証券	40,878,558	106,355,730
合計	2,900,569,662	3,861,603,096

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年2月18日から平成26年2月25日まで及び平成27年2月17日から平成27年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成27年2月25日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	5,236,927,180	-	5,236,634,000	293,180	3,587,754,960	-	3,586,528,000	1,226,960
アメリカ・ドル	3,138,079,860	-	3,137,724,000	355,860	2,282,482,980	-	2,280,192,000	2,290,980
イギリス・ポンド	546,447,450	-	546,496,000	48,550	312,358,160	-	312,273,000	85,160
オーストラリア・ドル	222,176,400	-	222,290,000	113,600	157,903,700	-	158,607,000	703,300
カナダ・ドル	231,588,000	-	231,650,000	62,000	160,999,840	-	161,806,000	806,160
ユーロ	1,098,635,470	-	1,098,474,000	161,470	674,010,280	-	673,650,000	360,280
合計	5,236,927,180	-	5,236,634,000	293,180	3,587,754,960	-	3,586,528,000	1,226,960

（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。

株式関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成27年2月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	4,084,177,311	-	4,271,519,658	187,342,347	6,286,651,477	-	6,558,024,437	271,372,960
合計	4,084,177,311	-	4,271,519,658	187,342,347	6,286,651,477	-	6,558,024,437	271,372,960

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	2.3161円	2.9217円
(1万口当たり純資産額)	(23,161円)	(29,217円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年2月25日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	32,541	378.590	12,319,697.190	
	ABBOTT LABORATORIES	120,464	47.470	5,718,426.080	
	AES CORP	45,320	12.120	549,278.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,292	164.830	12,904,870.360	
	ADOBE SYSTEMS INC	39,348	77.680	3,056,552.640	
	ACE LTD	29,077	114.510	3,329,607.270	
	AGCO CORP	9,937	50.080	497,644.960	
	AIRGAS INC	6,292	117.080	736,667.360	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,935	156.980	2,658,456.300	
	ENERGEN CORP	7,454	68.310	509,182.740	
	ALLEGHANY CORP	1,575	477.510	752,078.250	
	ALLERGAN INC	25,734	231.880	5,967,199.920	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	77,004	77.900	5,998,611.600	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	138.090	730,496.100	
	ALLSTATE CORP	32,138	71.670	2,303,330.460	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	62,671	104.300	6,536,585.300	
	ALTERA CORPORATION	23,108	36.800	850,374.400	
	ALCOA INC	102,779	15.740	1,617,741.460	
	AMGEN INC	62,407	157.370	9,820,989.590	
	HESS CORP	22,783	76.490	1,742,671.670	
	AMERICAN EXPRESS CO	76,404	80.860	6,178,027.440	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	40,601	59.280	2,406,827.280	
	AFLAC INC	33,588	62.060	2,084,471.280	
	AMERICAN INTL GROUP	115,953	55.040	6,382,053.120	
	JARDEN CORP	14,140	53.660	758,752.400	
	ANALOG DEVICES	25,145	59.610	1,498,893.450	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	43,179	85.890	3,708,644.310	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,523	182.290	3,011,977.670	
	NABORS INDUSTRIES LTD	19,674	12.870	253,204.380	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	35,093	42.610	1,495,312.730	
	TIME WARNER	74,128	83.620	6,198,583.360	
	VALERO ENERGY CORP	44,783	61.600	2,758,632.800	
	APACHE CORP	32,414	66.910	2,168,820.740	
	ANSYS INC	9,305	85.620	796,694.100	
APPLE INC	498,180	132.170	65,844,450.600		
APPLIED MATERIALS INC	99,730	25.360	2,529,152.800		
ALBEMARLE CORP	7,690	56.080	431,255.200		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,879	48.650	2,669,863.350	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	66.060	618,321.600	
AMEREN CORP	19,716	42.990	847,590.840	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	62.930	488,777.310	
ASHLAND INC	6,333	126.950	803,974.350	
AUTOLIV INC	7,264	112.460	816,909.440	
AUTODESK INC	20,701	62.070	1,284,911.070	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	40,602	89.260	3,624,134.520	
AUTOZONE INC	3,006	637.790	1,917,196.740	
AVERY DENNISON CORP	8,865	54.640	484,383.600	
AVNET INC	10,288	46.370	477,054.560	
AVON PRODUCTS INC	41,317	8.630	356,565.710	
BAKER HUGHES INC	36,553	63.030	2,303,935.590	
BALL CORP	12,188	72.560	884,361.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	93,995	148.950	14,000,555.250	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	97,048	39.780	3,860,569.440	
CR BARD INC	6,949	174.480	1,212,461.520	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,911	69.060	3,308,733.660	
BED BATH & BEYOND INC	16,743	76.160	1,275,146.880	
BECTON DICKINSON & CO	16,624	148.700	2,471,988.800	
AMETEK INC	21,508	52.600	1,131,320.800	
BE AEROSPACE INC	7,540	64.210	484,143.400	
VERIZON COMM INC	339,429	49.220	16,706,695.380	
WR BERKLEY CORP	11,053	50.060	553,313.180	
BEST BUY CO INC	23,778	38.260	909,746.280	
YUM! BRANDS INC	37,350	77.860	2,908,071.000	
FIRSTENERGY CORP	38,598	36.070	1,392,229.860	
H&R BLOCK INC	26,590	34.510	917,620.900	
ENSCO PLC-CL A	16,993	26.970	458,301.210	
BOEING CO	55,977	154.380	8,641,729.260	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	63.000	683,298.000	
BORGWARNER INC	17,824	61.060	1,088,333.440	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,190	16.620	1,964,317.800	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,679	73.980	1,011,972.420	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	313.040	689,627.120	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	135,665	61.450	8,336,614.250	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	218.120	932,681.120	
ONEOK INC	20,139	45.100	908,268.900	
UNITED RENTALS INC	7,795	93.860	731,638.700	
SEMPRA ENERGY	21,423	110.270	2,362,314.210	
FEDEX CORP	22,088	177.800	3,927,246.400	

VERISIGN INC	12,278	64.060	786,528.680	
AMPHENOL CORP	28,176	56.820	1,600,960.320	
BROWN-FORMAN CORP	9,803	92.220	904,032.660	
QUANTA SERVICES INC	20,095	29.040	583,558.800	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,584	53.910	1,379,233.440	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	209,556	3.910	819,363.960	
CSX CORP	81,336	35.570	2,893,121.520	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	12,039	19.800	238,372.200	
CABOT OIL & GAS CORP	38,134	28.400	1,083,005.600	
CAMPBELL SOUP CO	18,846	47.220	889,908.120	
SEAGATE TECHNOLOGY	26,728	60.700	1,622,389.600	
WHITING PETROLEUM CORP	10,428	36.560	381,247.680	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,019	115.710	1,622,138.490	
CARDINAL HEALTH INC	27,919	89.250	2,491,770.750	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	43.590	1,415,454.480	
CATERPILLAR INC	48,649	84.500	4,110,840.500	
CELGENE CORP	65,797	123.180	8,104,874.460	
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	111.000	350,649.000	
CITRIX SYSTEMS INC	14,671	63.650	933,809.150	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	19.880	886,767.280	
CENTURYLINK INC	48,563	37.060	1,799,744.780	
CERNER CORP	24,936	72.780	1,814,842.080	
JPMORGAN CHASE & CO	312,049	60.820	18,978,820.180	
CHUBB CORP	20,125	100.370	2,019,946.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,581	86.140	1,083,727.340	
CIGNA CORP	22,520	120.760	2,719,515.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	53.015	627,273.480	
CINTAS CORP	8,876	83.170	738,216.920	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	103,027	8.020	826,276.540	
CISCO SYSTEMS INC	422,964	29.630	12,532,423.320	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	9,607	41.720	400,804.040	
CLOROX COMPANY	9,288	109.370	1,015,828.560	
COCA-COLA CO/THE	322,437	42.130	13,584,270.810	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	18,074	45.330	819,294.420	
COLGATE-PALMOLIVE CO	79,446	71.010	5,641,460.460	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	18,147	82.245	1,492,500.010	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	34,035	58.780	2,000,577.300	
COMERICA INC	13,912	45.990	639,812.880	
NRG ENERGY, INC.	23,703	25.880	613,433.640	
COMCAST CORP-CL A	177,601	59.170	10,508,651.170	

CA INC	30,767	32.700	1,006,080.900	
COMPUTER SCIENCES CORP	12,846	70.840	910,010.640	
CONAGRA FOODS INC	38,836	34.710	1,347,997.560	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,429	65.260	1,594,236.540	
CMS ENERGY CORP	20,017	36.060	721,813.020	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	18,288	47.710	872,520.480	
COOPER COS INC	3,794	164.430	623,847.420	
MOLSON COORS BREWING CO	12,219	76.570	935,608.830	
CORNING INC	109,097	24.780	2,703,423.660	
DIRECTV	41,243	87.460	3,607,112.780	
CREE INC	12,621	39.555	499,223.650	
SEALED AIR CORP	14,883	48.300	718,848.900	
BROADCOM CORP-CL A	45,367	45.310	2,055,578.770	
CUMMINS INC	14,022	141.790	1,988,179.380	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	132.440	876,620.360	
DR HORTON INC	30,691	27.630	847,992.330	
DANAHER CORP	53,997	87.040	4,699,898.880	
MOODY'S CORP	15,654	97.180	1,521,255.720	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,125	62.450	3,130,306.250	
TARGET CORP	50,249	76.950	3,866,660.550	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	30.790	205,307.720	
DEERE & CO	28,677	91.500	2,623,945.500	
MORGAN STANLEY	120,873	36.740	4,440,874.020	
REPUBLIC SERVICES INC	23,767	40.660	966,366.220	
THE WALT DISNEY CO	138,490	104.670	14,495,748.300	
DOLLAR TREE INC	18,189	77.470	1,409,101.830	
DOVER CORP	13,192	74.060	976,999.520	
DOW CHEMICAL	97,954	49.810	4,879,088.740	
OMNICOM GROUP	21,059	78.130	1,645,339.670	
DTE ENERGY CO	16,432	84.200	1,383,574.400	
XL GROUP PLC	19,925	35.690	711,123.250	
DUKE ENERGY CORP	61,631	79.850	4,921,235.350	
FLOWSERVE CORP	12,469	62.570	780,185.330	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,714	63.530	426,540.420	
EBAY INC	91,630	58.400	5,351,192.000	
EMC CORP/MASS	174,011	29.020	5,049,799.220	
BANK OF AMERICA CORP	872,577	16.380	14,292,811.260	
CITIGROUP INC	252,192	51.900	13,088,764.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,209	75.840	1,001,770.560	
EATON CORP PLC	39,957	71.720	2,865,716.040	
EATON VANCE CORP	12,917	44.000	568,348.000	
DISH NETWORK CORP	16,800	77.770	1,306,536.000	
ECOLAB INC	22,668	113.000	2,561,484.000	
ELECTRONIC ARTS INC	25,957	57.625	1,495,772.120	
SALESFORCE.COM INC	48,957	61.930	3,031,907.010	

EMERSON ELECTRIC CO	55,561	58.550	3,253,096.550	
WEATHERFORD INTL PLC	73,546	12.400	911,970.400	
ENERGY CORP	16,359	80.460	1,316,245.140	
EOG RESOURCES INC	45,477	91.610	4,166,147.970	
EQUIFAX INC	11,487	93.070	1,069,095.090	
EQT CORP	12,314	81.760	1,006,792.640	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	21,214	81.770	1,734,668.780	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	47.875	683,607.120	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	64,253	87.620	5,629,847.860	
EXXON MOBIL CORP	352,875	89.420	31,554,082.500	
FMC CORP	9,724	63.840	620,780.160	
NEXTERA ENERGY INC	37,916	106.080	4,022,129.280	
FAMILY DOLLAR STORES	10,460	78.190	817,867.400	
ASSURANT INC	6,227	60.750	378,290.250	
FASTENAL CO	24,749	42.100	1,041,932.900	
FIFTH THIRD BANCORP	64,871	19.390	1,257,848.690	
M&T BANK CORP	9,572	121.580	1,163,763.760	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	8,764	104.350	914,523.400	
FISERV INC	23,093	79.040	1,825,270.720	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	32.150	463,667.300	
MACY'S INC	27,089	62.100	1,682,226.900	
FORD MOTOR CO	297,897	16.360	4,873,594.920	
FOSSIL GROUP INC	3,149	85.360	268,798.640	
FRANKLIN RESOURCES INC	34,352	53.840	1,849,511.680	
FREEMPORT-MCMORAN INC	85,535	21.220	1,815,052.700	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	12.400	550,101.200	
GAP INC/THE	16,693	39.950	666,885.350	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,729	52.570	564,023.530	
GENERAL DYNAMICS CORP	24,091	141.680	3,413,212.880	
GENERAL MILLS INC	51,206	53.420	2,735,424.520	
GENUINE PARTS CO	12,396	96.380	1,194,726.480	
GILEAD SCIENCES INC	124,949	104.700	13,082,160.300	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	14,991	79.810	1,196,431.710	
MCKESSON CORP	19,523	230.200	4,494,194.600	
NVIDIA CORP	43,024	22.310	959,865.440	
GENERAL ELECTRIC CO	828,561	25.390	21,037,163.790	
WW GRAINGER INC	4,603	237.510	1,093,258.530	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	11,113	125.390	1,393,459.070	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	14.020	311,748.720	
HALLIBURTON CO	68,949	43.120	2,973,080.880	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,900	124.805	1,609,984.500	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,262	192.220	6,201,401.640	
HARLEY-DAVIDSON INC	17,507	62.280	1,090,335.960	
HARRIS CORP	7,832	78.550	615,203.600	

CONSOL ENERGY INC	22,051	34.340	757,231.340	
HASBRO INC	11,176	62.050	693,470.800	
HENRY SCHEIN INC	7,142	141.390	1,009,807.380	
DENBURY RESOURCES INC	28,517	8.780	250,379.260	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	67.300	668,221.700	
HERSHEY FOODS CORP	13,846	105.740	1,464,076.040	
HEWLETT-PACKARD CO	154,487	38.490	5,946,204.630	
F5 NETWORKS INC	5,817	119.595	695,684.110	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	52.120	673,338.280	
REYNOLDS AMERICAN INC	29,054	75.650	2,197,935.100	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	117.810	1,221,571.890	
JUNIPER NETWORKS INC	37,815	24.450	924,576.750	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	40.820	566,908.160	
HOLOGIC INC	12,273	31.850	390,895.050	
UNUM GROUP	24,833	34.080	846,308.640	
HOME DEPOT INC	114,093	116.750	13,320,357.750	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,549	106.030	1,224,540.470	
HORMEL FOODS CORP	14,878	57.770	859,502.060	
HUDSON CITY BANCORP INC	43,137	9.750	420,585.750	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	22.040	704,222.080	
HUMANA INC	14,243	164.440	2,342,118.920	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	86.300	572,773.100	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	10.960	658,257.600	
RED HAT INC	14,283	68.890	983,955.870	
BIOGEN IDEC INC	20,368	404.890	8,246,799.520	
ILLINOIS TOOL WORKS	31,641	99.480	3,147,646.680	
INTUIT INC	22,782	97.375	2,218,397.250	
INGERSOLL-RAND PLC	24,217	68.750	1,664,918.750	
INTEL CORP	411,248	34.410	14,151,043.680	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,632	122.630	690,652.160	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,978	56.760	1,985,351.280	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	22.470	828,513.840	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	44.510	413,809.470	
INCYTE CORP	12,683	81.170	1,029,479.110	
JOHNSON & JOHNSON	232,262	100.700	23,388,783.400	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,070	41.320	1,449,092.400	
JOHNSON CONTROLS INC	54,401	50.790	2,763,026.790	
KLA-TENCOR CORP	12,621	66.280	836,519.880	
DEVON ENERGY CORP	32,345	64.840	2,097,249.800	
KELLOGG CO	22,425	64.030	1,435,872.750	
KEYCORP	66,833	14.080	941,008.640	

KIMBERLY-CLARK CORP	32,564	110.390	3,594,739.960	
BLACKROCK INC/NEW YORK	11,407	378.110	4,313,100.770	
KOHL'S CORP	18,627	69.970	1,303,331.190	
KROGER CO	36,321	72.920	2,648,527.320	
LAM RESEARCH CORP	14,133	84.230	1,190,422.590	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	70.120	1,007,414.040	
LEGG MASON INC	9,375	58.490	548,343.750	
LEGGETT & PLATT INC	8,522	45.300	386,046.600	
LENNAR CORP	12,932	51.210	662,247.720	
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,186	24.170	729,595.620	
ELI LILLY & CO	80,805	70.900	5,729,074.500	
L BRANDS INC	20,969	91.530	1,919,292.570	
LINCOLN NATIONAL CORP	21,084	58.460	1,232,570.640	
LINEAR TECH CORP	18,324	48.575	890,088.300	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,830	102.320	6,224,125.600	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	30,573	42.060	1,285,900.380	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,541	206.620	4,450,801.420	
LOEWS CORP	33,738	42.420	1,431,165.960	
RANGE RESOURCES CORP	12,431	51.240	636,964.440	
LOWE'S COS INC	84,815	74.650	6,331,439.750	
DOMINION RESOURCES INC/VA	49,181	74.060	3,642,344.860	
SCANA CORP	9,574	59.290	567,642.460	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,355	23.260	194,337.300	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	21.880	737,990.520	
MCCORMICK & CO INC	9,163	75.410	690,981.830	
MCDONALD'S CORPORATION	84,886	94.980	8,062,472.280	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	22,594	104.010	2,350,001.940	
EVEREST RE GROUP LTD	2,661	179.650	478,048.650	
MANPOWERGROUP INC	7,953	80.690	641,727.570	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	8,263	133.990	1,107,159.370	
MARSH & MCLENNAN COS	47,833	57.470	2,748,962.510	
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,542	135.450	750,663.900	
MASCO CORP	30,441	26.840	817,036.440	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	143.290	731,065.580	
MATTEL INC	25,152	25.315	636,722.880	
METLIFE INC	80,053	51.390	4,113,923.670	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,714	34.765	859,182.210	
MEDTRONIC PLC	120,663	79.020	9,534,790.260	
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,499	23.540	953,346.460	
CVS HEALTH CORP	93,997	103.360	9,715,529.920	
MERCK & CO. INC.	245,293	58.360	14,315,299.480	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,509	122.210	795,464.890	
MICROSOFT CORP	649,006	44.090	28,614,674.540	
MICRON TECH INC	89,717	30.770	2,760,592.090	
RACKSPACE HOSTING INC	10,000	49.320	493,200.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,985	51.530	978,297.050	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	16.180	499,767.840	
3M CO	50,172	169.120	8,485,088.640	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,675	183.510	857,909.250	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,814	68.530	1,426,383.420	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	119.500	1,039,530.500	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	51.000	634,593.000	
ENDO INTERNATIONAL PLC	12,378	85.250	1,055,224.500	
MYLAN LABORATORIES	33,530	57.215	1,918,418.950	
ILLUMINA INC	11,266	199.700	2,249,820.200	
XCEL ENERGY INC	41,914	36.350	1,523,573.900	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	35,727	54.680	1,953,552.360	
NETAPP INC	29,487	38.570	1,137,313.590	
NEWELL RUBBERMAID INC	24,567	39.840	978,749.280	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	134.580	494,850.660	
NEWMONT MINING CORP	37,881	25.810	977,708.610	
NIKE INC-CL B	56,049	95.420	5,348,195.580	
NOBLE ENERGY INC	28,642	49.670	1,422,648.140	
NORDSTROM INC	13,411	80.560	1,080,390.160	
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,247	110.870	2,910,004.890	
EVERSOURCE ENERGY	29,591	53.340	1,578,383.940	
NISOURCE INC	28,988	43.840	1,270,833.920	
COACH INC	21,436	42.950	920,676.200	
TOWERS WATSON & COMPANY	6,639	132.320	878,472.480	
NORTHERN TRUST CORP	17,989	71.090	1,278,838.010	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,654	170.190	2,834,344.260	
WELLS FARGO & CO	410,944	55.370	22,753,969.280	
NUCOR CORP	24,612	48.650	1,197,373.800	
MONSANTO CO	44,026	124.940	5,500,608.440	
CHENIERE ENERGY INC	19,714	76.210	1,502,403.940	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,823	80.500	3,769,251.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	63,476	79.750	5,062,211.000	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	53.730	487,922.130	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.080	546,234.240	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,409	207.540	1,745,203.860	
OMNICARE INC	8,889	76.670	681,519.630	
ORACLE CORP	294,835	43.880	12,937,359.800	
OWENS-ILLINOIS INC	9,767	26.250	256,383.750	
PACCAR INC	27,939	63.790	1,782,228.810	

PALL CORP	10,048	103.450	1,039,465.600	
EXELON CORP	72,135	34.790	2,509,576.650	
PARKER HANNIFIN CORP	13,401	123.530	1,655,425.530	
PARTNERRE LTD	3,890	115.350	448,711.500	
PATTERSON COS INC	4,032	49.570	199,866.240	
PAYCHEX INC	25,896	49.965	1,293,893.640	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	52.060	443,499.140	
PPL CORPORATION	58,534	35.250	2,063,323.500	
PEPSICO INC	128,485	99.580	12,794,536.300	
PENTAIR PLC	15,841	67.630	1,071,326.830	
PFIZER INC	521,082	34.340	17,893,955.880	
CONOCOPHILLIPS	100,443	67.090	6,738,720.870	
PVH CORP	7,894	111.680	881,601.920	
PETSMART INC	8,567	82.990	710,975.330	
PG&E CORP	40,294	55.150	2,222,214.100	
PHARMACYCLICS INC	5,559	188.450	1,047,593.550	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,237	157.370	1,925,736.690	
ALTRIA GROUP INC	160,112	55.720	8,921,440.640	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	45,489	92.340	4,200,454.260	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	155.120	772,497.600	
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	4,923	157.100	773,403.300	
GARMIN LTD	9,959	49.600	493,966.400	
AETNA INC	30,133	100.170	3,018,422.610	
FLUOR CORP (NEW)	14,048	59.250	832,344.000	
PPG INDUSTRIES INC	11,246	236.770	2,662,715.420	
PRAXAIR INC	24,869	128.380	3,192,682.220	
PRECISION CASTPARTS CORP	12,001	215.130	2,581,775.130	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,539	148.210	5,563,655.190	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,241	84.020	1,952,708.820	
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	70.620	780,774.720	
PROCTER & GAMBLE CO	222,546	85.500	19,027,683.000	
PROGRESSIVE CORP	45,883	26.620	1,221,405.460	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,038	43.160	1,814,360.080	
PULTE GROUP INC	25,477	23.240	592,085.480	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	37,710	16.530	623,346.300	
QUALCOMM INC	138,305	71.370	9,870,827.850	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	57.680	598,372.320	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	102.980	364,034.300	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,463	420.640	2,718,596.320	
AUTONATION INC	3,445	62.030	213,693.350	

RESMED INC	11,376	65.380	743,762.880	
US BANCORP	146,773	44.720	6,563,688.560	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,613	59.425	868,377.520	
ROSS STORES INC	18,937	98.070	1,857,151.590	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,795	70.000	755,650.000	
ROPER INDUSTRIES INC	9,399	167.870	1,577,810.130	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,943	118.420	1,295,870.060	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,330	76.900	1,025,077.000	
RAYTHEON COMPANY	24,336	110.190	2,681,583.840	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	276.190	1,264,950.200	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	41.250	772,983.750	
ACCENTURE PLC-CL A	52,942	90.850	4,809,780.700	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	136,094	37.005	5,036,158.470	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	13,685	47.730	653,185.050	
SANDISK CORP	18,229	79.970	1,457,773.130	
ROCKWELL COLLINS INC	11,510	91.420	1,052,244.200	
ST JUDE MEDICAL INC	21,273	66.910	1,423,376.430	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	25,685	107.550	2,762,421.750	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,091	68.160	1,778,362.560	
PRICELINE GROUP INC	4,305	1,219.790	5,251,195.950	
SCHLUMBERGER LTD	106,513	85.310	9,086,624.030	
SCHWAB (CHARLES) CORP	99,789	29.820	2,975,707.980	
JOY GLOBAL INC	7,485	44.980	336,675.300	
ZIMMER HOLDINGS INC	14,008	121.760	1,705,614.080	
SPX CORP	3,361	88.900	298,792.900	
BUNGE LTD	10,172	82.570	839,902.040	
SEI INVESTMENTS CO	10,402	43.040	447,702.080	
ANTHEM INC	22,872	147.280	3,368,588.160	
AMERISOURCEBERGEN CORP	20,248	102.970	2,084,936.560	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	51.920	1,212,383.920	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,870	290.620	1,996,559.400	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	21.190	352,114.230	
SIGMA-ALDRICH	9,766	138.310	1,350,735.460	
SNAP-ON INC	4,354	146.790	639,123.660	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	38,713	81.530	3,156,270.890	
ADVANCE AUTO PARTS	6,001	156.400	938,556.400	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	27.740	785,818.720	
EDISON INTERNATIONAL	26,497	65.640	1,739,263.080	
SOUTHERN CO	77,354	46.890	3,627,129.060	
BB&T CORP	59,553	38.220	2,276,115.660	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	45.350	623,381.100	

AT&T INC	423,769	34.050	14,429,334.450	
CHEVRON CORP	156,699	107.960	16,917,224.040	
MEADWESTVACO CORP	16,496	54.320	896,062.720	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,011	100.170	1,203,141.870	
STAPLES INC	50,301	16.820	846,062.820	
STATE STREET CORP	35,980	78.210	2,813,995.800	
STARBUCKS CORP	64,100	93.450	5,990,145.000	
STRYKER CORP	29,747	94.880	2,822,395.360	
NETFLIX INC	4,820	474.880	2,288,921.600	
STERICYCLE INC	7,859	134.570	1,057,585.630	
SUNTRUST BANKS INC	42,848	41.450	1,776,049.600	
SYMANTEC CORP	62,503	25.210	1,575,700.630	
SYNOPSIS INC	14,312	47.060	673,522.720	
SYSCO CORP	47,889	39.540	1,893,531.060	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,314	511.870	1,696,337.180	
TESORO CORP	10,250	90.210	924,652.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	88,001	58.960	5,188,538.960	
TEXTRON INC	25,116	45.330	1,138,508.280	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,397	131.850	4,535,244.450	
TIFFANY & CO	12,040	89.520	1,077,820.800	
TOLL BROTHERS INC	12,654	38.530	487,558.620	
TORCHMARK CORP	13,665	53.860	735,996.900	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	38.040	518,751.480	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	72.930	1,017,081.780	
TRACTOR SUPPLY CO	11,181	89.060	995,779.860	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	26.320	615,572.160	
TYSON FOODS INC	25,091	41.500	1,041,276.500	
MARATHON OIL CORP	60,801	28.830	1,752,892.830	
UNION PACIFIC CORP	74,051	122.690	9,085,317.190	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,953	123.790	8,783,271.870	
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,492	115.430	9,060,331.560	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,035	108.520	980,478.200	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	93.540	776,007.840	
VF CORP	31,132	76.320	2,375,994.240	
CBS CORP	40,761	59.400	2,421,203.400	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,936	116.920	2,330,917.120	
VULCAN MATERIALS CO	10,233	80.730	826,110.090	
URBAN OUTFITTERS INC	8,777	38.300	336,159.100	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	78,365	80.390	6,299,762.350	
WAL-MART STORES INC	137,490	84.570	11,627,529.300	
WASTE MANAGEMENT INC	37,795	54.470	2,058,693.650	

WATERS CORP	8,002	120.560	964,721.120	
ACTAVIS PLC	22,848	289.110	6,605,585.280	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,059	113.470	914,454.730	
WESTERN DIGITAL CORP	18,200	108.970	1,983,254.000	
WABTEC CORP	7,250	96.770	701,582.500	
WHIRLPOOL CORP	6,288	214.300	1,347,518.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,330	88.180	1,351,799.400	
WYNN RESORTS LTD	6,279	147.000	923,013.000	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	56.680	1,646,837.400	
NASDAQ OMX GROUP	6,550	50.650	331,757.500	
CME GROUP INC	26,453	96.170	2,543,985.010	
WILLIAMS COS INC	57,448	49.300	2,832,186.400	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	54.780	477,462.480	
LKQ CORP	22,850	27.360	625,176.000	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	27.260	495,995.700	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	65.510	694,995.590	
WISCONSIN ENERGY CORP	20,446	52.560	1,074,641.760	
FOOT LOCKER INC	11,034	55.810	615,807.540	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	77.780	608,550.720	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	36.720	912,492.000	
CARMAX INC	17,598	67.280	1,183,993.440	
XEROX CORP	88,088	13.980	1,231,470.240	
XILINX INC	22,098	42.480	938,723.040	
YAHOO! INC	77,695	43.380	3,370,409.100	
CIMAREX ENERGY CO	6,901	114.630	791,061.630	
TJX COMPANIES INC	59,133	67.160	3,971,372.280	
HOSPIRA INC	15,624	87.480	1,366,787.520	
GENWORTH FINANCIAL INC	36,757	8.000	294,056.000	
CBRE GROUP INC	20,788	34.670	720,719.960	
LIBERTY GLOBAL PLC	20,004	53.350	1,067,213.400	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,419	9.670	1,038,741.730	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,276	70.710	90,225.960	
GOOGLE INC-CL A	23,260	538.650	12,528,999.000	
T-MOBILE US INC	19,411	31.590	613,193.490	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,776	56.150	1,896,522.400	
MEDIVATION INC	6,237	111.920	698,045.040	
MOSAIC CO/THE	25,355	53.190	1,348,632.450	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	42,294	34.060	1,440,533.640	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	115,375	35.240	4,065,815.000	
HERBALIFE LTD	7,528	32.860	247,370.080	
CELANESE CORP	11,777	57.890	681,770.530	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	53,093	7.860	417,310.980	
IHS INC-CLASS A	5,758	118.260	680,941.080	

DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	13,414	33.000	442,662.000	
EXPEDIA INC	8,139	94.175	766,490.320	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,691	311.880	1,463,029.080	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,496	135.480	2,099,398.080	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	55,860	51.380	2,870,086.800	
GAMESTOP CORP. - CL. A	11,417	37.140	424,027.380	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,715	235.530	2,288,173.950	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,436	75.550	1,166,189.800	
VIACOM INC-CLASS B	29,086	70.930	2,063,069.980	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,613	667.910	1,745,248.830	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	70.890	493,465.290	
TRANSDIGM GROUP INC	4,774	225.270	1,075,438.980	
MASTERCARD INC	82,552	91.320	7,538,648.640	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	35,147	29.070	1,021,723.290	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	12,025	91.440	1,099,566.000	
HANESBRANDS INC	8,241	122.330	1,008,121.530	
WESTERN UNION CO	48,136	19.330	930,468.880	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	35,460	22.760	807,069.600	
SPECTRA ENERGY CORP	56,039	36.130	2,024,689.070	
TIME WARNER CABLE INC	23,556	152.240	3,586,165.440	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,191	15.100	289,784.100	
DELTA AIR LINES INC	17,405	48.030	835,962.150	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,164	45.640	235,684.960	
DISCOVER FINANCIAL	39,467	60.760	2,398,014.920	
TE CONNECTIVITY LTD	33,444	71.880	2,403,954.720	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	113.350	1,142,227.950	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	66.100	507,648.000	
VMWARE INC	8,753	83.400	730,000.200	
TERADATA CORP	12,117	44.730	541,993.410	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	138.390	679,079.730	
INVESCO LTD	39,506	40.200	1,588,141.200	
NETSUITE INC	3,281	97.770	320,783.370	
CALPINE CORP NPR	26,738	22.130	591,711.940	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	132,841	83.510	11,093,551.910	
VISA INC	40,853	272.470	11,131,216.910	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,483	78.910	1,221,763.530	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	54.200	882,863.800	
LORILLARD INC	30,497	69.360	2,115,271.920	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	74.400	540,069.600	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	119.620	729,083.900	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,028	30.710	645,769.880	
MARATHON PETROLEUM CORP	24,146	105.180	2,539,676.280	
CAREFUSION CORP	16,819	60.220	1,012,840.180	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	155,188	42.170	6,544,277.960	
XYLEM INC	11,028	35.960	396,566.880	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	36,179	91.320	3,303,866.280	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	20,996	113.180	2,376,327.280	
LINKEDIN CORP	8,789	264.260	2,322,581.140	
ZILLOW GROUP INC	4,067	117.680	478,604.560	
HCA HOLDINGS INC	23,874	70.410	1,680,968.340	
NIELSEN NV	26,310	46.140	1,213,943.400	
VERISK ANALYTICS INC	13,285	67.910	902,184.350	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	176.130	858,457.620	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	156.960	1,124,147.520	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	16,743	104.880	1,756,005.840	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	56.210	443,609.320	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	30,557	9.240	282,346.680	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,012	177.770	1,068,753.240	
CIT GROUP INC	13,340	46.290	617,508.600	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	330,000	0.700	231,000.000	
DOLLAR GENERAL CORP	24,796	71.930	1,783,576.280	
AON PLC	23,296	100.590	2,343,344.640	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	47.840	548,437.760	
QEP RESOURCES INC	18,552	22.420	415,935.840	
TESLA MOTORS INC	7,149	204.110	1,459,182.390	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	55.300	851,232.900	
GENERAL MOTORS CO	106,094	37.750	4,005,048.500	
VANTIV INC	12,141	37.100	450,431.100	
TRIPADVISOR INC	9,263	88.500	819,775.500	
ALLY FINANCIAL INC	29,357	21.220	622,955.540	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,570	68.390	1,133,222.300	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	43.600	725,242.400	

DELPHI AUTOMOTIVE PLC	24,272	78.840	1,913,604.480	
PHILLIPS 66	46,816	80.000	3,745,280.000	
LIBERTY MEDIA CORP	9,165	38.810	355,693.650	
FACEBOOK INC	163,770	78.450	12,847,756.500	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	5,356	64.490	345,408.440	
ADT CORP	15,211	39.420	599,617.620	
SERVICENOW INC	10,829	78.750	852,783.750	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,339	138.610	740,038.790	
WORKDAY INC	7,948	93.030	739,402.440	
KRAFT FOODS GROUP INC	49,163	64.080	3,150,365.040	
ABBVIE INC	131,385	60.870	7,997,404.950	
ZOETIS INC	41,066	45.400	1,864,396.400	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	6,507	48.080	312,856.560	
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	17.285	572,237.210	
MALLINCKRODT PLC	10,923	117.820	1,286,947.860	
SPRINT CORP	84,196	4.630	389,827.480	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,766	51.520	760,744.320	
FIREEYE INC	5,217	43.970	229,391.490	
ANTERO RESOURCES CORP	1,568	39.410	61,794.880	
NOBLE CORP PLC	24,088	17.830	429,489.040	
TWITTER INC	28,920	48.690	1,408,114.800	
PERRIGO CO PLC	11,364	153.480	1,744,146.720	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,195	27.790	727,959.050	
GOOGLE INC-CL C	24,123	536.090	12,932,099.070	
NAVIENT CORP	28,699	21.680	622,194.320	
FNF GROUP	21,690	36.770	797,541.300	
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	38.800	711,204.000	
SYNCHRONY FINANCIAL	14,261	32.360	461,485.960	
QORVO INC	12,235	69.340	848,374.900	
アメリカ・ドル 小計	26,193,718		1,611,195,261.870 (191,361,661,252)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	4.678	433,636.560	
AMEC FOSTER WHEELER PLC	28,599	8.715	249,240.280	
ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.545	195,453.220	
ASHTREAD GROUP	38,160	11.510	439,221.600	
SEVERN TRENT PLC	23,162	20.780	481,306.360	
BHP BILLITON PLC	180,741	16.435	2,970,478.330	
BARCLAYS PLC	1,410,749	2.640	3,724,377.360	
BT GROUP PLC	657,931	4.470	2,940,951.570	
SKY PLC	92,843	9.740	904,290.820	
AGGREKO PLC	18,550	17.000	315,350.000	
TULLOW OIL PLC	92,627	4.003	370,785.880	
BUNZL PLC	26,929	19.280	519,191.120	
EASYJET PLC	13,628	17.980	245,031.440	
CAPITA PLC	50,523	11.870	599,708.010	

AVIVA PLC	239,823	5.490	1,316,628.270	
CRODA INTERNATIONAL	9,774	27.730	271,033.020	
DIAGEO PLC	210,873	19.355	4,081,446.910	
SCHRODERS PLC	12,609	30.670	386,718.030	
NATIONAL GRID PLC	325,001	9.067	2,946,784.060	
GKN PLC	134,097	3.736	500,986.390	
KINGFISHER PLC	189,315	3.417	646,889.350	
BAE SYSTEMS PLC	257,944	5.360	1,382,579.840	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	151,954	37.370	5,678,520.980	
COBHAM PLC	88,449	3.430	303,380.070	
NEXT PLC	12,582	74.150	932,955.300	
REXAM PLC	54,770	5.500	301,235.000	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	83,655	31.540	2,638,478.700	
IMI PLC	22,272	14.360	319,825.920	
JOHNSON MATTHEY PLC	18,203	34.740	632,372.220	
SABMILLER PLC	79,110	36.955	2,923,510.050	
ANGLO AMERICAN PLC	120,088	12.370	1,485,488.560	
COMPASS GROUP PLC	148,870	11.500	1,712,005.000	
HSBC HOLDINGS PLC	1,586,419	5.816	9,226,612.900	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.771	1,282,150.010	
ARM HOLDINGS PLC	117,450	11.330	1,330,708.500	
CENTRICA PLC	406,663	2.517	1,023,570.770	
UNILEVER PLC	109,550	28.610	3,134,225.500	
MEGGITT PLC	71,707	5.370	385,066.590	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	128,338	1.918	246,152.280	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,266	9.620	512,418.920	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	4.499	329,268.310	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,107	30.090	905,919.630	
PEARSON PLC	73,025	14.110	1,030,382.750	
PERSIMMON PLC	23,150	16.500	381,975.000	
PRUDENTIAL PLC	210,454	16.165	3,401,988.910	
RIO TINTO PLC	104,384	31.935	3,333,503.040	
VODAFONE GROUP PLC	2,285,158	2.265	5,175,882.870	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,210	57.750	3,246,127.500	
REED ELSEVIER PLC	91,200	11.870	1,082,544.000	
OLD MUTUAL PLC	422,993	2.215	936,929.490	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	154,737	9.365	1,449,112.000	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	210,422	4.039	849,894.450	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	19.980	397,502.100	
SSE PLC	83,923	15.800	1,325,983.400	

BP PLC	1,516,898	4.483	6,800,253.730	
SHIRE PLC	48,674	51.500	2,506,711.000	
SAGE GROUP PLC(THE)	98,062	4.835	474,129.770	
SMITHS GROUP PLC	27,324	11.630	317,778.120	
STANDARD CHARTERED PLC	212,238	9.506	2,017,534.420	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,802,206	0.792	3,803,347.150	
TATE & LYLE PLC	20,845	5.930	123,610.850	
BG GROUP PLC	281,725	9.810	2,763,722.250	
TESCO PLC	658,849	2.384	1,570,696.010	
3I GROUP PLC	88,649	4.924	436,507.670	
SMITH & NEPHEW PLC	80,528	11.840	953,451.520	
GLAXOSMITHKLINE PLC	409,687	15.465	6,335,809.450	
WEIR GROUP	18,336	18.630	341,599.680	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	15,672	25.140	393,994.080	
BABCOCK INT'L GROUP	24,605	10.120	249,002.600	
WPP PLC	105,982	15.340	1,625,763.880	
WOLSELEY PLC	20,425	39.900	814,957.500	
ASTRAZENECA PLC	103,616	45.070	4,669,973.120	
WHITBREAD PLC	13,806	51.050	704,796.300	
CARNIVAL PLC	14,275	28.960	413,404.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	131,038	5.040	660,431.520	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	24.700	332,116.200	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.949	237,315.150	
BURBERRY GROUP PLC	41,539	19.030	790,487.170	
INVESTEC PLC	50,655	5.830	295,318.650	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	25.660	458,852.120	
ICAP PLC	52,823	5.305	280,226.010	
ITV PLC	345,353	2.299	793,966.540	
SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.700	240,769.800	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	49.770	431,655.210	
G4S PLC	124,374	2.972	369,639.520	
ADMIRAL GROUP PLC	22,361	14.790	330,719.190	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	322,829	21.295	6,874,643.550	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	204,595	22.150	4,531,779.250	
INMARSAT PLC	46,334	8.665	401,484.110	
PETROFAC LTD	28,374	8.150	231,248.100	
TUI AG-DI	19,394	11.910	230,982.540	
STANDARD LIFE PLC	187,787	4.245	797,155.810	
EXPERIAN PLC	77,318	11.960	924,723.280	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	17,067	6.895	117,676.960	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	11.080	287,271.160	
MELROSE INDUSTRIES PLC	84,043	3.073	258,264.130	
FRESNILLO PLC NPR	10,457	8.270	86,479.390	

	FRIENDS LIFE GROUP LTD	122,660	4.190	513,945.400	
	GLENCORE PLC	915,457	2.954	2,704,259.970	
	DIXONS CARPHONE PLC	72,841	4.491	327,128.930	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	107,350	3.309	355,221.150	
	COCA-COLA HBC AG	18,432	11.260	207,544.320	
	ROYAL MAIL PLC	64,647	4.339	280,503.330	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	39,861	4.230	168,612.030	
イギリス・ポンド	小計	23,572,562		145,675,242.730 (26,760,542,091)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	133,450	17.780	2,372,741.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	13.540	1,682,615.800	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	6.456	1,215,212.880	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	59,178	27.670	1,637,455.260	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	75,781	223.800	16,959,787.800	
イスラエル・シュケル	小計	580,909		23,867,812.740 (716,989,095)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	63.800	816,321.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	225,661	35.290	7,963,576.690	
	AMCOR LTD	84,976	13.950	1,185,415.200	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	254,695	37.970	9,670,769.150	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	14.220	479,242.440	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	2.460	367,046.760	
	TELSTRA CORP LTD	346,377	6.590	2,282,624.430	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	12.970	413,405.780	
	AMP LTD	240,810	6.750	1,625,467.500	
	ASX LTD	18,724	43.320	811,123.680	
	BHP BILLITON LTD	275,670	33.060	9,113,650.200	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	36.220	512,476.780	
	ALS LTD	34,895	5.890	205,531.550	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	47,699	4.340	207,013.660	
	COMPUTERSHARE LT	50,472	12.280	619,796.160	
	CSL LIMITED	40,309	91.230	3,677,390.070	
	REA GROUP LTD	5,318	48.820	259,624.760	
	TRANSURBAN GROUP	159,479	9.180	1,464,017.220	
	COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	10.320	624,360.000	
	COCHLEAR LTD	5,226	91.130	476,245.380	
	ORIGIN ENERGY LTD	84,610	11.880	1,005,166.800	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	132,986	91.040	12,107,045.440	
	BORAL LIMITED	43,430	6.010	261,014.300	
	RIO TINTO LIMITED	34,809	63.140	2,197,840.260	
	APA GROUP	114,969	8.770	1,008,278.130	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	174,456	5.970	1,041,502.320	
	TPG TELECOM LTD	12,142	7.350	89,243.700	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,423	39.500	174,708.500	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	14.350	513,586.500	
	ORICA LTD	34,301	19.830	680,188.830	
	LEIGHTON HLDGS LTD	11,538	21.760	251,066.880	
	SYDNEY AIRPORT	115,539	5.130	592,715.070	
	MACQUARIE GROUP LTD	25,913	71.470	1,852,002.110	
	WORLEYPARSONS LTD	23,411	11.230	262,905.530	
	SUNCORP GROUP LTD	114,181	13.860	1,582,548.660	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	201,492	37.580	7,572,069.360	
	NEWCREST MINING LTD	74,849	13.820	1,034,413.180	
	INCITEC PIVOT LTD	165,148	4.050	668,849.400	
	TOLL HOLDINGS LTD	72,011	8.960	645,218.560	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	43,622	2.720	118,651.840	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	12.450	1,321,405.650	
	SANTOS LTD	84,284	8.120	684,386.080	
	SONIC HEALTHCARE	33,734	19.550	659,499.700	
	TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.980	352,464.480	
	WESFARMERS LTD	101,292	45.460	4,604,734.320	
	ALUMINA LIMITED	184,613	1.840	339,687.920	
	ILUKA RESOURCES LIM I	45,912	7.520	345,258.240	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	36.450	2,111,293.350	
	WOOLWORTHS LTD	105,245	34.320	3,612,008.400	
	METCASH LTD	79,084	1.570	124,161.880	
	SEEK LTD	29,830	17.370	518,147.100	
	TATTS GROUP LTD	141,350	4.140	585,189.000	
	AGL ENERGY LTD	48,662	15.320	745,501.840	
	BRAMBLES LTD	123,431	10.600	1,308,368.600	
	ASCIANO LTD	74,924	6.500	487,006.000	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	15.660	514,603.260	
	AURIZON HOLDINGS LTD	142,831	4.950	707,013.450	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	5.380	303,442.760	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.420	568,334.580	
オーストラリア・ドル	小計	5,366,297		96,326,620.390 (8,988,236,948)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,334	38.180	661,812.120	

ALIMENTATION COUCHE TARD INC	38,448	48.320	1,857,807.360	
BARRICK GOLD CORP	89,708	15.700	1,408,415.600	
ATCO LTD	7,193	47.500	341,667.500	
TALISMAN ENERGY INC	100,146	9.700	971,416.200	
BANK OF MONTREAL	49,807	75.830	3,776,864.810	
BANK OF NOVA SCOTIA	96,454	65.220	6,290,729.880	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,276	46.900	1,373,044.400	
BCE INC	21,413	55.210	1,182,211.730	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	46,731	68.670	3,209,017.770	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	27,472	251.530	6,910,032.160	
BOMBARDIER INC 'B'	97,503	2.500	243,757.500	
SAPUTO INC	25,590	36.270	928,149.300	
BLACKBERRY LTD	38,780	12.810	496,771.800	
CGI GROUP INC	17,094	54.050	923,930.700	
CAE INC	31,436	15.290	480,656.440	
CAMECO CORP	29,078	19.910	578,942.980	
ROGERS COMM-CL B	29,459	45.310	1,334,787.290	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,423	91.500	3,058,204.500	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,278	37.550	3,502,588.900	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,877	122.150	840,025.550	
CANADIAN UTILITIES LTD	8,537	41.450	353,858.650	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	65,516	86.590	5,673,030.440	
AGRIUM INC	11,307	142.080	1,606,498.560	
YAMANA GOLD INC	67,520	5.040	340,300.800	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	75.350	865,846.850	
OPEN TEXT CORP	12,014	72.640	872,696.960	
ELDORADO GOLD CORP	46,790	6.590	308,346.100	
EMPIRE CO LTD	5,031	94.760	476,737.560	
KINROSS GOLD CORP	125,461	3.400	426,567.400	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	24.900	427,284.000	
FORTIS INC	20,884	39.430	823,456.120	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	15.210	721,486.350	
TELUS CORP	18,945	44.100	835,474.500	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	35.790	888,916.230	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	49.220	1,126,301.260	
ENBRIDGE INC	73,421	60.370	4,432,425.770	
IGM FINANCIAL INC	3,211	44.680	143,467.480	
MANULIFE FINANCIAL CORP	155,082	22.010	3,413,354.820	
LOBLAW CO LTD	17,936	65.620	1,176,960.320	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	33,447	3.860	129,105.420	

INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	42.390	408,215.700	
MAGNA INTERNATIONAL INC	17,322	127.680	2,211,672.960	
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,112	39.020	1,916,350.240	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,940	650.500	1,261,970.000	
METRO INC	22,860	35.990	822,731.400	
HUSKY ENERGY INC	26,989	29.060	784,300.340	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	31.870	1,176,640.400	
METHANEX CORP	9,418	65.700	618,762.600	
ONEX CORP	10,676	70.830	756,181.080	
GOLDCORP INC	75,826	26.690	2,023,795.940	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	69,901	46.000	3,215,446.000	
POWER CORP OF CANADA	32,563	33.690	1,097,047.470	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	37.120	873,099.520	
ROYAL BANK OF CANADA	122,071	75.050	9,161,428.550	
SNC-LAVALIN GROUP INC	16,326	39.690	647,978.940	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,033	234.710	3,293,685.430	
SHAW COMM INC-B	30,249	29.480	891,740.520	
NEW GOLD INC	51,627	4.330	223,544.910	
SUNCOR ENERGY INC	120,968	38.340	4,637,913.120	
ENCANA CORP	59,596	16.280	970,222.880	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	19.210	839,150.430	
THOMSON REUTERS CORP	29,905	49.880	1,491,661.400	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	159,434	53.270	8,493,049.180	
TRANSCANADA CORP	58,122	54.950	3,193,803.900	
TRANSALTA CORP	34,014	12.060	410,208.840	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	106.490	505,082.070	
INTACT FINANCIAL CORP	12,288	88.650	1,089,331.200	
SILVER WHEATON CORP	28,408	26.390	749,687.120	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,344	409.250	550,032.000	
CATAMARAN CORP	16,398	66.200	1,085,547.600	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	11,057	64.180	709,638.260	
CI FINANCIAL CORP	16,122	35.100	565,882.200	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	39.410	621,850.390	
KEYERA CORP	8,738	82.930	724,642.340	
ALTAGAS LTD	12,358	44.520	550,178.160	
PEMBINA PIPELINE CORP	23,194	39.820	923,585.080	
DOLLARAMA INC	9,286	62.650	581,767.900	
BAYTEX ENERGY CORP	11,962	21.250	254,192.500	
MEG ENERGY CORP	14,673	21.460	314,882.580	
CENOVUS ENERGY INC W/I	61,276	22.080	1,352,974.080	
ENERPLUS CORP	20,814	12.600	262,256.400	

	VERMILION ENERGY INC	8,291	53.100	440,252.100	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	2.500	131,142.500	
	ARC RESOURCES LTD	20,372	23.720	483,223.840	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	11.500	543,110.500	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	35.000	390,880.000	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	33.680	1,000,868.560	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,330	30.800	287,364.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	52.760	869,009.960	
カナダ・ドル 小計		3,305,587		131,820,933.170 (12,548,034,629)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.550	443,750.000	
	SEBFCORP INDUSTRIES	92,000	4.260	391,920.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.120	696,280.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	473,640	0.410	194,192.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	147,000	19.770	2,906,190.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	10.300	381,100.000	
	SEBFCORP MARINE	108,000	3.010	325,080.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	42.850	557,050.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	8.220	715,140.000	
	CAPITALAND LTD	276,000	3.620	999,120.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	1.045	610,698.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	8.710	927,615.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	202,000	3.000	606,000.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	1.060	436,468.780	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	208,725	10.610	2,214,572.250	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	631,867	4.280	2,704,390.760	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	12.080	790,032.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,000	22.960	2,158,240.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.290	658,000.000	
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.265	292,215.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.560	729,600.000		
シンガポール・ドル 小計		4,548,295		19,737,654.190 (1,728,229,001)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	130,323	23.590	3,074,319.570	
	SYNGENTA AG	7,554	336.700	2,543,431.800	
	NESTLE SA-REGISTERED	265,687	73.400	19,501,425.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	44,464	85.200	3,788,332.800	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	57,784	257.200	14,862,044.800	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,842	157.200	761,162.400	
	SIKA INHABER	188	3,270.000	614,760.000	
	SGS SA-REG	458	1,911.000	875,238.000	
	SULZER AG-REG	1,118	117.500	131,365.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	189,407	97.750	18,514,534.250	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,687	123.400	454,975.800	
	SWISSCOM AG-REG	2,309	542.500	1,252,632.500	
	ABB LTD	188,239	20.400	3,840,075.600	
	ADECCO SA-REG	12,185	75.600	921,186.000	
	GEBERIT AG	3,062	334.900	1,025,463.800	
	LONZA GROUP AG-REG	3,997	116.500	465,650.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	5,215.000	474,565.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	61,315.000	551,835.000	
	GIVAUDAN-REG	758	1,842.000	1,396,236.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,931	306.100	3,652,079.100	
	HOLCIM LTD-REG	20,064	73.650	1,477,713.600	
	ACTELION	9,776	113.500	1,109,576.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	131.400	593,796.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	135.500	603,381.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,189	432.200	946,085.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	83.400	463,036.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,785	231.100	643,613.500	
	EMS-CHEMIE HOLDING	808	421.000	340,168.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,477	86.600	474,308.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	286.500	575,865.000	
	ARYZTA AG	8,596	74.800	642,980.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,352	44.120	897,930.240	
	SWISS RE LTD	31,693	86.750	2,749,367.750	
	TRANSOCEAN LTD	26,823	15.260	409,318.980	
	UBS GROUP AG	308,288	16.540	5,099,083.520	
スイス・フラン	小計	1,381,478		95,727,540.010 (11,980,301,632)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,851	271.200	14,333,191.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,459	250.600	10,640,225.400	
	ELEKTA AB	18,233	87.750	1,599,945.750	
	ERICSSON LM-B SHS	249,528	109.400	27,298,363.200	
	GETINGE AB-B SHS	14,684	217.700	3,196,706.800	
	SKF AB-B SHS	40,686	210.100	8,548,128.600	
	SANDVIK AB	77,917	94.700	7,378,739.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	125,807	104.000	13,083,928.000	
	SKANSKA AB-B SHS	25,753	207.500	5,343,747.500	
	SWEDBANK AB	80,565	214.600	17,289,249.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	43,424	200.700	8,715,196.800	

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	42,643	409.700	17,470,837.100	
	VOLVO AB-B SHS	118,487	99.400	11,777,607.800	
	SWEDISH MATCH AB	21,596	259.100	5,595,523.600	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	96.900	2,355,154.500	
	NORDEA AB	274,104	113.000	30,973,752.000	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	159.600	2,929,138.800	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	273.900	4,737,374.400	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	118.700	3,235,880.700	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	326.800	11,720,682.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,198	364.800	28,161,830.400	
	ASSA ABLOY AB-B	26,496	490.800	13,004,236.800	
	TELIASONERA AB	194,938	52.150	10,166,016.700	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	123.500	2,168,042.500	
	BOLIDEN AB	17,761	165.800	2,944,773.800	
	ALFA LAVAL AB	31,389	164.700	5,169,768.300	
	KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	283.300	6,577,659.400	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	582.500	2,996,962.500	
	ICA GRUPPEN AB	5,738	294.200	1,688,119.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	65.700	2,042,415.900	
	HEXAGON AB	21,871	302.100	6,607,229.100	
スウェーデン・クローナ 小計		1,804,213		289,750,428.050 (4,099,968,557)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,563	542.500	4,102,927.500	
	A P MOLLER A/S	620	13,940.000	8,642,800.000	
	AP MOLLER MAERSK A	310	13,480.000	4,178,800.000	
	DANSKE BANK A/S	56,971	176.800	10,072,472.800	
	NOVOZYMES-B SHS	19,620	327.500	6,425,550.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	169,532	311.600	52,826,171.200	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	22,090	278.400	6,149,856.000	
	TDC A/S	84,208	50.800	4,277,766.400	
	COLOPLAST-B	10,474	523.000	5,477,902.000	
	DSV A/S	15,918	214.200	3,409,635.600	
	WILLIAM DEMANT	2,595	498.300	1,293,088.500	
	PANDORA A/S	9,254	592.000	5,478,368.000	
デンマーク・クローネ 小計		399,155		112,335,338.000 (2,028,776,204)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	137,108	4.280	586,822.240	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	8.430	623,752.560	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	209,231	3.100	648,616.100	
ニュージーランド・ドル 小計		420,331		1,859,190.900 (165,914,196)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	88,892	125.800	11,182,613.600	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	43.850	4,694,668.700	
	TELENOR ASA	65,096	152.500	9,927,140.000	

	SUBSEA 7 SA	22,609	77.900	1,761,241.100	
	ORKLA ASA	43,472	60.050	2,610,493.600	
	STATOIL ASA	94,525	144.700	13,677,767.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,544	431.300	5,841,527.200	
	SEADRILL LTD	38,772	89.700	3,477,848.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,655	132.100	1,539,625.500	
	ノルウェー・クロネ 小計	485,627		54,712,925.600 (857,351,544)	
ユーロ	CRH PLC	62,226	24.920	1,550,671.920	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	64.610	918,431.150	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.327	792,269.330	
	UMICORE	10,008	37.005	370,346.040	
	AIR LIQUIDE	28,580	116.550	3,330,999.000	
	AIRBUS GROUP NV	49,675	51.850	2,575,648.750	
	AXA	156,101	21.435	3,346,024.930	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,430	17.070	485,300.100	
	ADIDAS AG	18,603	68.920	1,282,118.760	
	ASSICURAZIONI GENERALI	96,101	18.330	1,761,531.330	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	28,481	17.300	492,721.300	
	DANONE	45,362	60.490	2,743,947.380	
	SAFRAN SA	24,711	60.920	1,505,394.120	
	INTESA SANPAOLO	945,546	2.922	2,762,885.410	
	INTESA SANPAOLO-RNC	113,165	2.624	296,944.960	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,991	110.650	3,097,204.150	
	ACCOR SA	12,175	47.495	578,251.620	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	41.200	244,439.600	
	BOUYGUES	12,132	35.460	430,200.720	
	BNP PARIBAS	90,026	51.980	4,679,551.480	
	REED ELSEVIER NV	58,088	22.675	1,317,145.400	
	THALES SA	8,128	51.780	420,867.840	
	CAP GEMINI SA	12,883	70.490	908,122.670	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	81.740	335,869.660	
	CHRISTIAN DIOR	4,128	171.700	708,777.600	
	ALCATEL-LUCENT	250,589	3.460	867,037.940	
	UNICREDIT SPA	376,340	5.935	2,233,577.900	
	NATIXIS	70,166	6.405	449,413.230	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,718	49.680	681,510.240	
	DELHAIZE GROUP	10,182	79.300	807,432.600	
	COMMERZBANK AG	80,064	12.195	976,380.480	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	27,811	48.235	1,341,463.580	
	UNITED INTERNET	9,768	39.635	387,154.680	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	4,800	38.240	183,552.000	
	PUBLICIS GROUPE	14,367	72.290	1,038,590.430	
	MAN SE	3,396	96.000	326,016.000	
	IBERDROLA SA	433,586	6.100	2,644,874.600	

ENI SPA	216,606	16.650	3,606,489.900	
JERONIMO MARTINS	19,517	10.195	198,975.810	
KBC GROUPE	20,590	54.500	1,122,155.000	
LAFARGE SA	17,314	66.550	1,152,246.700	
HANNOVER RUECK SE	2,391	84.300	201,561.300	
WARTSILA OYJ	13,904	41.820	581,465.280	
L'OREAL	20,721	159.300	3,300,855.300	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	23,740	161.200	3,826,888.000	
LAGARDERE S.C.A.	7,114	25.400	180,695.600	
GEA GROUP AG	16,205	43.345	702,405.720	
BOLLORE	19,700	4.915	96,825.500	
MEDIOBANCA SPA	55,752	8.285	461,905.320	
MICHELIN(CGDE)-B	16,223	86.260	1,399,395.980	
CONTINENTAL AG	9,083	214.450	1,947,849.350	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,250	30.145	2,449,281.250	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	26.770	251,611.230	
AXEL SPRINGER SE	6,021	57.270	344,822.670	
OMV AG	15,010	24.965	374,724.650	
PERNOD-RICARD	17,525	104.400	1,829,610.000	
PEUGEOT SA	38,593	14.675	566,352.270	
PIRELLI & C	14,123	13.460	190,095.580	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	14,295	82.990	1,186,342.050	
RENAULT SA	15,554	84.940	1,321,156.760	
REPSOL SA	94,415	17.080	1,612,608.200	
REMY COINTREAU	905	65.380	59,168.900	
MERCK KGAA	9,627	89.550	862,097.850	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	66,077	111.050	7,337,850.850	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	40,143	41.615	1,670,550.940	
SAIPEM	28,190	9.310	262,448.900	
RWE AG	41,149	24.605	1,012,471.140	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	16,499	54.100	892,595.900	
SOCIETE GENERALE-A	60,206	40.810	2,457,006.860	
VINCI S.A.	39,349	53.160	2,091,792.840	
SODEXO	7,368	89.590	660,099.120	
SOLVAY SA	5,034	125.950	634,032.300	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,801	70.940	3,107,242.940	
VIVENDI SA	100,016	21.560	2,156,344.960	
SAP SE	76,018	61.780	4,696,392.040	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	59.160	567,521.880	
TELEFONICA S.A	354,795	13.570	4,814,568.150	
TOTAL SA	180,345	47.185	8,509,578.820	
VALLOUREC	11,847	22.945	271,829.410	
VALEO	6,764	133.650	904,008.600	
E.ON SE	157,708	13.895	2,191,352.660	

VOEST-ALPINE AG	9,875	35.100	346,612.500	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	32.005	489,100.410	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	91.620	789,214.680	
METRO AG	11,655	29.410	342,773.550	
SIEMENS AG-REG	67,294	98.310	6,615,673.140	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	17.040	789,088.320	
ING GROEP NV-CVA	322,508	13.120	4,231,304.960	
BAYER AG	68,336	128.000	8,747,008.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	8.805	392,799.850	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,659	102.700	1,505,479.300	
DAIMLER AG	81,250	85.220	6,924,125.000	
BASF SE	77,500	84.610	6,557,275.000	
BEIERSDORF AG	7,979	75.920	605,765.680	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,234	71.340	944,113.560	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,505	65.500	1,212,077.500	
ORANGE	156,256	16.130	2,520,409.280	
SAMPO OYJ-A SHS	36,337	44.700	1,624,263.900	
RANDSTAD HOLDINGS	8,678	52.160	452,644.480	
ALLIANZ SE	38,893	149.200	5,802,835.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.485	665,962.590	
KONINKLIJKE AHOLD NV	71,470	17.190	1,228,569.300	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	16,917	42.480	718,634.160	
HERMES INTL	1,446	283.450	409,868.700	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	13.455	367,308.040	
ERSTE GROUP BANK AG	22,063	23.650	521,789.950	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	14,486	181.750	2,632,830.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	89,645	9.692	868,839.340	
SOCIETE BIC SA	3,322	133.750	444,317.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,074	61.350	679,389.900	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,337	33.995	453,391.310	
HEINEKEN NV	21,379	68.280	1,459,758.120	
AKZO NOBEL	20,652	65.990	1,362,825.480	
ASML HOLDING NV	30,604	96.440	2,951,449.760	
AEGON NV	167,051	6.839	1,142,461.780	
BANKINTER S.A.	52,241	6.975	364,380.970	
VOLKSWAGEN AG	3,700	220.400	815,480.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	12,808	226.100	2,895,888.800	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	515,225	8.863	4,566,439.170	
KERING	6,033	180.300	1,087,749.900	
CNP ASSURANCES	22,463	14.715	330,543.040	
FORTUM OYJ	27,087	20.370	551,762.190	
AGEAS	19,877	31.880	633,678.760	
UCB SA	10,367	67.610	700,912.870	
THYSSENKRUPP AG	36,583	23.270	851,286.410	

UNILEVER NV-CVA	133,150	38.500	5,126,275.000	
CARREFOUR SA	50,201	29.480	1,479,925.480	
GAS NATURAL SDG SA	34,711	21.250	737,608.750	
ATOS	6,025	66.000	397,650.000	
NOKIA OYJ	317,729	7.080	2,249,521.320	
TUI AG	19,196	16.180	310,591.280	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	78,582	26.425	2,076,529.350	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	28.630	706,330.730	
SANOFI	98,091	88.750	8,705,576.250	
IMMOFINANZ AG	131,110	2.510	329,086.100	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	7.910	466,769.100	
ELISA OYJ	13,898	24.000	333,552.000	
BANCO SANTANDER SA	1,190,121	6.460	7,688,181.660	
METSO OYJ	10,879	28.730	312,553.670	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	6,801	75.570	513,951.570	
QIAGEN N.V.	19,737	21.880	431,845.560	
LINDE AG	15,570	180.500	2,810,385.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	116,699	29.255	3,414,029.240	
BMW VORZUG	4,116	84.740	348,789.840	
K & S	18,588	28.755	534,497.940	
ENEL SPA	523,816	4.062	2,127,740.590	
COLRUYT NV	4,076	41.795	170,356.420	
VOPAK (KON.)	5,364	48.925	262,433.700	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.083	281,015.830	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	269,083	16.095	4,330,890.880	
BANCO POPULAR ESPANOL	156,309	4.186	654,309.470	
FINMECCANICA SPA	34,431	10.870	374,264.970	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	103,908	10.375	1,078,045.500	
KONINKLIJKE KPN NV	257,686	2.990	770,481.140	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.548	234,395.610	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,063	73.140	1,247,987.820	
BANCO SABADELL	269,488	2.473	666,443.820	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,333	77.480	413,200.840	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.001	0.510	
FRAPORT AG	3,149	54.370	171,211.130	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	60.350	483,644.900	
INDITEX	93,857	28.145	2,641,605.260	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	269,372	0.610	164,316.920	
ANDRITZ AG	4,704	52.070	244,937.280	
MAPFRE SA	80,219	3.144	252,208.530	
ESSILOR INTL	18,032	102.650	1,850,984.800	
SNAM SPA	126,865	4.466	566,579.090	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	12.810	1,096,343.850	
ENAGAS	16,043	27.720	444,711.960	

WENDEL	1,994	108.000	215,352.000	
TENARIS SA	33,458	12.650	423,243.700	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	7.185	538,544.490	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	1.020	891,181.140	
TELECOM ITALIA-RNC	432,141	0.827	357,380.600	
ATLANTIA SPA	33,870	23.310	789,509.700	
ILIAD SA	2,821	234.500	661,524.500	
BELGACOM SA	13,498	35.330	476,884.340	
SES FDR	28,786	30.960	891,214.560	
TERNA SPA	138,625	4.010	555,886.250	
GRIFOLS SA	13,410	36.375	487,788.750	
FERROVIAL SA	33,893	18.675	632,951.770	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	45.785	313,901.960	
EXOR SPA	9,585	39.500	378,607.500	
NESTE OIL OYJ	10,692	23.650	252,865.800	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	13.525	123,063.970	
KONE OYJ	25,273	40.140	1,014,458.220	
GDF SUEZ	119,536	19.240	2,299,872.640	
ALSTOM	17,252	28.600	493,407.200	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	50.500	253,762.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	31.255	545,399.750	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,174	24.270	392,542.980	
DEUTSCHE WOHNEN AG	19,531	24.250	473,626.750	
ARKEMA SA	5,658	66.950	378,803.100	
LEGRAND SA	23,768	48.910	1,162,492.880	
ADP	1,609	106.750	171,760.750	
ORION OYJ	8,051	29.170	234,847.670	
RTL GROUP SA	1,270	88.200	112,014.000	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	10.595	360,420.710	
SYMRISE AG	9,463	56.280	532,577.640	
SCOR SE	14,425	29.020	418,613.500	
REXEL SA	20,799	17.190	357,534.810	
PRYSMIAN SPA	14,445	17.900	258,565.500	
BANCO POPOLARE SC	34,687	13.880	481,455.560	
CAIXABANK	163,859	4.060	665,267.540	
BUREAU VERITAS SA	23,255	19.900	462,774.500	
GROUPE EUROTUNNEL SE	46,533	12.165	566,073.940	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	16.940	384,080.620	
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	37,149	35.920	1,334,392.080	
TNT EXPRESS NV W/I	26,687	5.560	148,379.720	
ENEL GREEN POWER SPA	71,844	1.874	134,635.650	
BRENNTAG AG	15,483	51.930	804,032.190	

	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	91,411	7.680	702,036.480	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.501	381,004.100	
	DELTA LLOYD NV	19,898	16.670	331,699.660	
	EDENRED	18,682	24.160	451,357.120	
	BANKIA SA	431,169	1.247	537,667.740	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	63,554	4.800	305,059.200	
	HUGO BOSS AG -ORD	2,985	118.250	352,976.250	
	OSRAM LICHT AG	9,503	41.650	395,799.950	
	GEMALTO	5,952	69.410	413,128.320	
	DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN SE	23,344	34.000	793,696.000	
	OCI NV	6,901	34.285	236,600.780	
	CNH INDUSTRIAL NV	84,201	7.510	632,349.510	
	NUMERICABLE-SFR	9,058	52.360	474,276.880	
	ALTICE SA	5,487	84.110	461,511.570	
	NN GROUP NV	12,746	25.985	331,204.810	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	77,674	13.670	1,061,803.580	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV-RTS	13,317	0.465	6,192.400	
ユーロ 小計		21,720,946		292,337,887.780 (39,386,683,620)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	22.050	4,806,900.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	31.600	3,528,456.000	
	CLP HOLDINGS LTD	177,000	68.400	12,106,800.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	7.790	4,147,396.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	119,000	151.300	18,004,700.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	65.200	3,194,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	95,500	177.500	16,951,250.000	
	MTR CORP	133,500	35.850	4,785,975.000	
	HANG SENG BANK LTD	74,200	142.200	10,551,240.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	97,870	54.250	5,309,447.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	130,500	78.250	10,211,625.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	142,750	59.600	8,507,900.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	621,214	17.360	10,784,275.040	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	185,000	104.800	19,388,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	40.900	7,730,100.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	381,500	27.300	10,414,950.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	574,266	9.220	5,294,732.520	

SINO LAND CO	355,400	12.760	4,534,904.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	153,000	124.000	18,972,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	57,500	106.000	6,095,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	26.450	2,393,725.000	
WHEELLOCK & CO LTD	107,000	42.450	4,542,150.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	11.720	2,297,120.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	21.950	3,722,720.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	19.060	800,520.000	
AIA GROUP LTD	1,008,600	45.600	45,992,160.000	
HKT TRUST / HKT LTD	98,000	10.020	981,960.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	37.900	6,806,840.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	25.000	4,080,000.000	
香港・ドル 小計	6,452,760		256,937,646.060 (3,933,715,362)	
合計	96,231,878		304,556,404,131 (304,556,404,131)	

(2) 株式以外の有価証券

平成27年2月25日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	671,777.560	
		FEDERATION CENTRES	146,114.000	432,497.440	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	965,095.200	
		GPT GROUP	73,257.000	340,645.050	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	817,238.400	
		MIRVAC GROUP	235,066.000	481,885.300	
		NOVION PROPERTY GROUP	235,579.000	586,591.710	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,556,142.900	
		STOCKLAND	210,736.000	977,815.040	
		WESTFIELD CORP	166,693.000	1,690,267.020	
	オーストラリア・ドル 小計		1,770,164.000	8,519,955.620 (794,997,059)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	127,906.000	317,206.880	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	375,580.000	
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	636,768.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		117,000.000	226,395.000		
シンガポール・ドル 小計		750,706.000	1,555,949.880 (136,238,972)		
投資信託受益証券 合計			2,520,870	931,236,031 (931,236,031)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	26,719.000	581,939.820	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	65,404.000	618,721.840	
		AMERICAN TOWER CORP	33,235.000	3,145,692.750	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	88,038.000	937,604.700	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,610.000	1,960,929.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,785.000	1,767,654.100	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	460,690.500	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	27,842.000	2,416,964.020	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	724,504.500	
	DUKE REALTY TRUST	28,754.000	615,623.140	
	EQUINIX INC	4,580.000	1,063,338.600	
	EQUITY RESIDENTIAL	29,194.000	2,276,548.120	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	1,076,795.250	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	821,020.410	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	1,359,552.000	
	HCP INC	39,145.000	1,650,353.200	
	HEALTH CARE REIT INC	23,302.000	1,782,603.000	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	1,239,672.720	
	IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	508,681.480	
	KIMCO REALTY	32,980.000	872,321.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	387,757.350	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	576,005.280	
	PROLOGIS INC	40,935.000	1,747,515.150	
	PUBLIC STORAGE	13,351.000	2,650,173.500	
	RAYONIER INC	10,834.000	292,518.000	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	852,632.070	
	REGENCY CENTERS CORP	6,286.000	412,110.160	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	26,810.000	5,095,508.600	
	SL GREEN	8,526.000	1,081,778.880	
	THE MACERICH COMPANY	12,185.000	1,013,670.150	
	UDR INC	21,797.000	689,221.140	
	VENTAS INC	24,040.000	1,791,941.600	
	VORNADO REALTY TRUST	14,028.000	1,557,809.400	
	WEYERHAEUSER CO	47,879.000	1,682,468.060	
アメリカ・ドル 小計		837,148.000	45,712,319.490 (5,429,252,186)	
イギリス・債券	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	677,641.300	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	454,547.280	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	328,815.900	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	782,799.780	
	SEGRO PLC	42,345.000	178,357.140	
イギリス・債券 小計		345,120.000	2,422,161.400 (444,951,049)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	225,661.890	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	456,052.520	

カナダ・ドル 小計		25,495.000	681,714.410 (64,892,395)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	242,533.440	
	GECINA SA	1,083.000	126,602.700	
	ICADE	3,001.000	239,449.790	
	KLEPIERRE	15,834.000	722,663.760	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,582.000	2,233,465.500	
ユーロ 小計		31,092.000	3,564,715.190 (480,274,078)	
香港・ドル	LINK REIT/THE	196,500.000	9,736,575.000	
香港・ドル 小計		196,500.000	9,736,575.000 (149,066,963)	
投資証券 合計		1,435,355	6,568,436,671 (6,568,436,671)	
合計			7,499,672,702 (7,499,672,702)	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における () 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比 率
アメリカ・ドル	株式 598銘柄	59.92%	-%	-%	63.06%
	投資証券 34銘柄	-%	-%	1.70%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	8.38%	-%	-%	8.72%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
イスラエル・シケル	株式 5銘柄	0.22%	-%	-%	0.23%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.81%	-%	-%	3.14%
	投資信託 受益証券 10銘柄	-%	0.25%	-%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	3.93%	-%	-%	4.04%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.54%	-%	-%	0.60%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 35銘柄	3.75%	-%	-%	3.84%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.28%	-%	-%	1.31%
デンマーク・クローネ	株式 12銘柄	0.64%	-%	-%	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.05%	-%	-%	0.05%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.27%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 230銘柄	12.33%	-%	-%	12.78%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.15%	
香港・ドル	株式 29銘柄	1.23%	-%	-%	1.31%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,003,458,961	5,369,690,970
コール・ローン		225,302,330	374,837,019
国債証券		375,243,989,904	337,543,101,755
派生商品評価勘定		13,817	1,800
未収利息		4,017,527,019	3,230,185,165
前払費用		141,576,037	95,848,149
流動資産合計		384,631,868,068	346,613,664,858
資産合計		384,631,868,068	346,613,664,858
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	60,400
未払解約金		62,372,000	53,890,000
流動負債合計		62,372,000	53,950,400
負債合計		62,372,000	53,950,400
純資産の部			
元本等			
元本	1	234,028,916,867	183,852,928,058
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		150,540,579,201	162,706,786,400
元本等合計		384,569,496,068	346,559,714,458
純資産合計		384,569,496,068	346,559,714,458
負債純資産合計		384,631,868,068	346,613,664,858

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	280,556,875,822円 17,179,528,256円 63,707,487,211円	234,028,916,867円 13,814,661,751円 63,990,650,560円
元本の内訳 ファンド名 D I A M外国債券パッシブ・ファンド D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金> 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 D I A M D C バランス30インデックスファンド D I A M D C バランス50インデックスファンド	3,042,808,840円 4,215,730,642円 331,588,356円 1,211,540,212円 1,303,541,985円 305,504,835円 656,719,484円	3,781,500,974円 4,544,032,431円 341,847,976円 1,214,750,317円 1,308,784,784円 313,217,589円 671,428,982円

D I A M D C バラン ス70インデックスファ ンド	461,916,251円	481,588,849円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	45,079,861円	31,376,785円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	545,649,215円	501,462,033円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	8,202,426円	21,995,765円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国10)	2,492,699円	5,344,612円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	3,064,251円	9,302,206円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	7,073,170円	22,535,569円
クルーズコントロール D I A M 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	30,350,803円 186,505円	909,075,064円 11,234,137円
D I A M D C バラン ス・F(成長型)	- 円	2,903,738円
クルーズコントロール< DC年金>	- 円	274,315円
D I A Mパッシブ資産分 散ファンド	3,440,686,045円	2,195,692,298円
D I A M為替フルヘッジ 型外国債券パッシブ私募 ファンド(適格機関投資 家向け)	6,268,094,899円	7,027,645,265円
D I A M外国債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	4,910,796,362円	4,732,221,877円
外国債券パッシブファン ド(適格機関投資家限 定)	1,256,699,172円	1,250,447,896円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	162,201,386円	141,069,091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)	24,485,399,797円	10,685,215,824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)	1,609,853,495円	1,025,897,488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)	300,395,823円	165,286,091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)	430,402,346円	307,586,013円

D I A M国内重視バ ランスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	113,653,304円	64,479,077円
D I A M国内重視バ ランスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	62,920,414円	40,066,465円
D I A M世界バラン スファンド4 0 V A (適格 機関投資家限定)	23,349,328,976円	16,046,248,001円
D I A M世界バラン スファンド5 0 V A (適格 機関投資家限定)	5,158,609,726円	3,756,953,586円
D I A Mバランスマ ンド2 5 V A (適格機関 投資家限定)	8,685,291,057円	7,184,715,005円
D I A Mバランスマ ンド3 7 . 5 V A (適格機 関投資家限定)	4,087,051,309円	3,442,592,042円
D I A Mバランスマ ンド5 0 V A (適格機関 投資家限定)	6,058,907,931円	5,346,965,944円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスマ ンド(適格機関投資家 限定)	1,772,289,243円	1,119,757,516円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスマ ンド2(適格機関投資家 限定)	6,291,716,856円	4,223,200,090円
D I A M アクサ グ ローバル バランスマ ンド3 0 V A (適格機関 投資家限定)	6,633,814,428円	5,299,806,889円
D I A M世界アセッ トバランスマン ドV A (適格機関投資 家向け)	31,608,060,489円	21,653,398,611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)	104,311,492円	100,927,303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)	4,753,049,113円	3,042,648,599円
D I A Mアイエヌジ ー世界バランスマ ンド3 5 V A (適格機関 投資家限定)	13,764,142,018円	12,468,255,935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)	202,690,780円	134,886,348円
D I A M世界アセッ トバランスマン ド2 V A (適格機関投資 家限定)	19,631,763,420円	17,084,379,724円
D I A M世界アセッ トバランスマン ド3 V A (適格機関投資 家限定)	24,240,319,192円	21,483,751,875円

D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	45,970,194円	120,615円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	219,032,482円	28,789,731円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	89,231,077円	50,952,485円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限 定)	21,537,285,269円	19,153,914,577円
D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	199,262,536円	137,085,607円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	383,883,760円	5,513,095円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	221,510円	279,673,418円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	131,431円	127,551円
計	234,028,916,867円	183,852,928,058円
2. 受益権の総数	234,028,916,867口	183,852,928,058口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	282,734,109	1,491,332,744
合計	282,734,109	1,491,332,744

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年2月22日から平成26年2月25日まで及び平成27年2月24日から平成27年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成27年2月25日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	237,312,367	-	237,298,550	13,817	165,322,800	-	165,321,000	1,800
イギリス・ボンド	-	-	-	-	165,322,800	-	165,321,000	1,800
ユーロ	237,312,367	-	237,298,550	13,817	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	183,750,400	-	183,690,000	60,400
イギリス・ボンド	-	-	-	-	183,750,400	-	183,690,000	60,400
合計	237,312,367	-	237,298,550	13,817	349,073,200	-	349,011,000	58,600

（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26年2月25日現在	平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.6433円	1.8850円
（1万口当たり純資産額）	（16,433円）	（18,850円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.375 03/15/16	10,000,000.000	10,011,300.000	
		US T N/B 0.5 07/31/17	18,000,000.000	17,880,300.000	
		US T N/B 0.625 04/30/18	10,500,000.000	10,362,135.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	18,000,000.000	17,965,440.000	
		US T N/B 0.625 07/15/16	38,000,000.000	38,128,820.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	11,500,000.000	11,416,395.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	19,000,000.000	18,900,440.000	
		US T N/B 0.875 01/31/17	8,400,000.000	8,449,476.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	16,000,000.000	15,648,640.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	15,000,000.000	14,958,900.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	10,000,000.000	10,087,800.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	7,000,000.000	6,876,100.000	
		US T N/B 1.0 09/30/16	6,000,000.000	6,054,120.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	4,906,250.000	
		US T N/B 1.0 10/31/16	8,000,000.000	8,068,400.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	15,500,000.000	15,182,095.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	18,000,000.000	17,825,580.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	6,946,660.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	10,000,000.000	10,032,800.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	13,500,000.000	13,390,245.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	9,800,000.000	9,865,758.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	12,000,000.000	12,138,720.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	10,000,000.000	10,089,800.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	8,000,000.000	8,098,720.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,000,000.000	2,960,850.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	10,500,000.000	10,339,560.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	5,000,000.000	4,983,750.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	13,000,000.000	12,853,750.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	20,500,000.000	20,863,465.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,043,560.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	3,500,000.000	3,561,250.000	
		US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.000	8,212,800.000	
		US T N/B 1.875 09/30/17	10,000,000.000	10,263,200.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	5,500,000.000	5,582,885.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	14,142,100.000	
		US T N/B 2.0 02/28/21	3,000,000.000	3,054,360.000	
US T N/B 2.0 04/30/16	18,000,000.000	18,355,680.000			
US T N/B 2.0 05/31/21	22,000,000.000	22,367,620.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,128,880.000			
US T N/B 2.0 11/15/21	9,000,000.000	9,138,150.000			

US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,261,250.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,085,530.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	12,000,000.000	12,386,160.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	10,000,000.000	10,366,700.000	
US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.000	20,453,800.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	6,000,000.000	6,246,540.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,198,239.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	7,000,000.000	7,284,340.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	25,500,000.000	26,639,340.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	8,000,000.000	8,328,080.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,411,295.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,325,500.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	16,000,000.000	16,927,360.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,000,000.000	11,734,690.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,890,000.000	4,007,905.900	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,666,400.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	5,400,000.000	5,559,462.000	
US T N/B 2.75 11/30/16	14,000,000.000	14,546,840.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,561,700.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,070,000.000	3,238,113.200	
US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.000	20,957,000.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,270,000.000	3,536,178.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.000	20,805,400.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	4,500,000.000	4,879,305.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	4,290,000.000	4,749,802.200	
US T N/B 3.125 02/15/43	8,390,000.000	9,274,222.100	
US T N/B 3.125 04/30/17	18,000,000.000	18,952,020.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,949,000.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	11,000,000.000	11,923,340.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	8,700,000.000	9,650,127.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,700,000.000	4,103,818.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,800,000.000	8,225,022.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.000	25,965,750.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.000	20,991,400.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	8,590,000.000	9,963,712.800	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,356,840.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	15,037,400.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	3,000,000.000	3,521,250.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	15,403,220.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	19,883,520.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	10,500,000.000	11,671,380.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	9,820,000.000	11,894,475.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	9,000,000.000	9,878,490.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	9,000,000.000	10,897,020.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,480,000.000	4,292,614.800	
US T N/B 3.75 11/15/43	7,300,000.000	9,036,597.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,718,080.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	3,070,000.000	3,830,776.700	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	13,183,080.000	

	US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,138,608.900	
	US T N/B 4.25 11/15/17	9,000,000.000	9,814,500.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	3,200,000.000	4,232,000.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	1,450,000.000	1,928,036.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	4,290,000.000	5,749,929.900	
	US T N/B 4.375 05/15/41	2,450,000.000	3,318,402.500	
	US T N/B 4.375 11/15/39	2,860,000.000	3,826,565.600	
	US T N/B 4.5 02/15/36	3,480,000.000	4,706,700.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,933,617.400	
	US T N/B 4.5 08/15/39	2,200,000.000	2,991,472.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	14,000,000.000	15,110,060.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	5,127,941.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	4,275,930.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.000	16,453,050.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.000	18,109,590.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	2,065,449.100	
	US T N/B 5.25 02/15/29	1,700,000.000	2,304,027.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	2,029,215.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,633,398.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,481,174.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,000,000.000	2,776,560.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,800,000.000	2,584,962.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,800,000.000	2,705,616.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	5,000,000.000	6,719,900.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.000	10,846,800.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	4,000,000.000	4,477,320.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	8,390,580.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	5,178,400.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.000	8,248,240.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	5,196,560.000	
	アメリカ・ドル 小計	1,109,890,000.000 (131,821,635,300)	1,178,251,444.100 (139,940,924,016)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.0 09/07/17	4,000,000.000	4,030,800.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/18	8,200,000.000	8,282,000.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/17	3,400,000.000	3,479,220.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/19	5,000,000.000	5,125,700.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	4,300,000.000	4,355,470.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	4,600,000.000	4,812,244.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	4,100,000.000	4,453,912.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	4,800,000.000	5,583,360.000	

UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,200,000.000	2,679,820.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,460,000.000	3,239,820.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,170,000.000	4,186,619.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	3,800,000.000	4,236,240.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	4,200,000.000	4,748,100.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,500,000.000	4,007,290.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,840,000.000	4,070,004.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	3,500,000.000	4,092,550.000	
UK TREASURY 4.0 09/07/16	2,000,000.000	2,109,000.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,800,000.000	5,000,420.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,750,000.000	4,849,125.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,450,000.000	3,289,370.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,660,000.000	3,351,600.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,300,000.000	4,454,010.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,000,000.000	4,202,400.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,370,000.000	3,386,493.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,690,000.000	3,977,703.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	5,500,000.000	6,252,400.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	4,200,000.000	5,654,040.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,600,000.000	5,111,640.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	4,000,000.000	4,685,200.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	3,300,000.000	4,467,210.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,350,000.000	4,795,525.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/18	1,800,000.000	2,025,900.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	3,680,000.000	4,777,744.000	

	UK TREASURY 6.0 12/07/28	2,050,000.000	3,049,170.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	3,000,000.000	4,195,500.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	2,500,000.000	3,009,750.000	
イギリス・ボンド 小計		127,070,000.000 (23,342,759,000)	154,027,349.000 (28,294,824,011)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,926,020.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,000,000.000	4,518,000.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,800,000.000	4,588,006.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	3,987,165.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,000,000.000	1,034,160.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,700,000.000	2,869,020.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	1,998,990.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,350,000.000	1,501,969.500	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,100,000.000	2,431,107.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,100,000.000	1,161,523.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,194,758.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,500,000.000	3,035,600.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	1,500,000.000	1,554,975.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	6,600,000.000	7,275,378.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	4,400,000.000	5,404,872.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	4,316,375.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	7,000,000.000	7,557,760.000	
オーストラリア・ドル 小計		53,550,000.000 (4,996,750,500)	60,355,678.500 (5,631,788,361)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,741,450.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	2,200,000.000	2,252,404.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,050,000.000	2,104,161.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	2,000,000.000	2,042,900.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,600,000.000	2,685,150.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	4,400,000.000	4,515,720.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,300,000.000	1,415,765.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	3,100,000.000	3,451,602.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,400,000.000	2,702,976.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	7,200,000.000	7,445,952.000	

	CANADA 2.75 12/01/64	600,000.000	753,222.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,200,000.000	2,523,026.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	3,200,000.000	3,652,672.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,750,000.000	5,077,875.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	7,200,000.000	8,157,888.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	8,500,000.000	8,876,550.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	2,400,000.000	2,592,792.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	3,000,000.000	4,260,540.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	2,500,000.000	2,805,100.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	2,600,000.000	4,068,350.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	2,200,000.000	3,359,510.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,500,000.000	4,045,025.000	
カナダ・ドル 小計		68,900,000.000 (6,558,591,000)	80,530,630.000 (7,665,710,670)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	1,430,000.000	1,399,255.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	510,000.000	496,801.200	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	411,100.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	469,627.800	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	710,000.000	753,480.400	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,708,480.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,040,000.000	2,182,290.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	522,945.600	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,100,220.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	1,700,000.000	1,771,451.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,150,000.000	2,347,886.000	
シンガポール・ドル 小計		12,480,000.000 (1,092,748,800)	13,163,537.000 (1,152,599,300)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,700,000.000	13,726,160.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	8,800,000.000	10,409,256.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	9,500,000.000	9,919,140.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	7,600,000.000	11,146,464.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	16,370,000.000	20,073,712.500	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	12,280,000.000	13,504,193.200	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	13,300,000.000	15,642,263.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	9,410,000.000	12,043,106.200	
スウェーデン・クローナ 小計		89,960,000.000 (1,272,934,000)	106,464,294.900 (1,506,469,773)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	12,300,000.000	13,696,050.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	7,570,000.000	8,732,903.400	
	DENMARK 2.5 11/15/16	4,700,000.000	4,956,902.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	17,800,000.000	21,270,110.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	12,280,000.000	13,802,720.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	18,800,000.000	22,625,800.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	22,000,000.000	39,523,880.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	5,810,000.000	9,629,784.500	

デンマーク・クローネ 小計		101,260,000.000 (1,828,755,600)	134,238,149.900 (2,424,340,987)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	8,040,876.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,300,000.000	8,325,285.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	11,100,000.000	12,917,070.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	9,000,000.000	9,690,300.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	11,260,000.000	12,980,528.000	
ノルウェー・クローネ 小計		46,260,000.000 (724,894,200)	51,954,059.000 (814,120,105)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,249,902.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,610,000.000	1,760,535.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	6,000,000.000	6,366,900.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	5,000,000.000	5,718,500.000	
	POLAND 4.75 04/25/17	3,680,000.000	3,923,800.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	9,000,000.000	9,463,500.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	660,000.000	685,443.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	5,000,000.000	5,458,250.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	3,890,000.000	4,571,722.500	
	POLAND 5.5 10/25/19	4,290,000.000	4,983,264.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,588,438.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	5,014,760.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,522,720.000	
ポーランド・ズロチ 小計		51,720,000.000 (1,675,728,000)	58,307,734.900 (1,889,170,611)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.172 07/15/16	3,700,000.000	3,691,083.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,187,352.800	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,174,040.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	3,270,000.000	3,096,526.500	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	4,700,000.000	4,691,587.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	5,520,000.000	5,558,419.200	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,144,067.100	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	2,450,000.000	2,405,067.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	7,180,000.000	7,348,514.600	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,463,690.800	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	3,500,000.000	3,565,975.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	8,180,000.000	8,409,367.200	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,176,989.500	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,753,056.000	
マレーシア・リングgit 小計		49,230,000.000 (1,613,759,400)	49,665,735.700 (1,628,042,816)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	17,000,000.000	24,891,910.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	47,000,000.000	62,754,870.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	7,000,000.000	7,039,410.000	
	MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	19,500,000.000	20,187,765.000	

	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	22,000,000.000	23,538,020.000	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/15/16	50,000,000.000	53,011,500.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,775,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	23,984,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.000	76,432,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	37,000,000.000	42,093,050.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	7,500,000.000	8,784,750.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	44,000,000.000	54,879,880.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	29,000,000.000	37,154,800.000	
	メキシコ・ペソ 小計	380,000,000.000 (3,024,800,000)	446,528,655.000 (3,554,368,094)	
ユーロ	AUSTRIA 1.65 10/21/24	950,000.000	1,057,540.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,566,600.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,100,000.000	1,196,360.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	800,000.000	1,001,456.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,070,000.000	1,609,290.700	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,700,000.000	1,812,200.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	2,000,000.000	2,485,020.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,600,000.000	3,174,600.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,600,000.000	1,994,400.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	680,000.000	1,308,986.400	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,500,000.000	3,021,250.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	1,900,000.000	2,021,600.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,300,000.000	3,723,700.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	2,100,000.000	2,336,250.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	3,700,000.000	4,363,040.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	2,300,000.000	2,616,250.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,900,000.000	2,774,570.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,350,000.000	2,258,280.000	
	BELGIUM 1.25 06/22/18	2,500,000.000	2,609,200.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	2,700,000.000	3,112,290.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	3,100,000.000	3,690,116.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	300,000.000	309,357.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	1,150,000.000	1,513,377.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	2,500,000.000	2,845,325.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	3,400,000.000	3,580,880.000	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	2,000,000.000	2,169,700.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,050,000.000	1,651,744.500	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	3,500,000.000	4,221,630.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	3,700,000.000	4,018,829.000	

BELGIUM 4.0 03/28/18	600,000.000	675,624.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	2,650,000.000	3,085,925.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,600,000.000	3,297,606.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,650,000.000	2,408,191.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,700,000.000	4,446,684.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,850,000.000	3,618,160.500	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,600,000.000	3,379,818.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,200,000.000	3,097,534.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,700,000.000	6,239,458.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,300,000.000	5,216,310.000	
BELGIUM 5.5 09/28/17	1,500,000.000	1,717,500.000	
BUNDESABL 0.5 02/23/18	2,600,000.000	2,655,302.000	
BUNDESABL 0.5 04/07/17	4,100,000.000	4,161,500.000	
BUNDESABL 0.5 04/12/19	2,800,000.000	2,876,580.000	
BUNDESABL 0.5 10/13/17	2,500,000.000	2,547,575.000	
BUNDESABL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,877,994.000	
BUNDESABL 2.75 04/08/16	8,500,000.000	8,777,865.000	
BUNDESSCHAT 0.25 06/10/16	1,600,000.000	1,609,040.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	600,000.000	637,440.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,000,000.000	1,107,340.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,213,212.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	6,100,000.000	6,767,767.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,100,000.000	3,423,857.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,698,105.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	5,100,000.000	5,724,852.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	3,500,000.000	3,967,950.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	6,300,000.000	7,255,710.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,000,000.000	4,511,600.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,000,000.000	3,436,500.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	4,200,000.000	4,820,760.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	3,000,000.000	4,117,800.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,430,000.000	1,978,419.300	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	4,500,000.000	5,240,250.000	

DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	4,500,000.000	5,238,900.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,800,000.000	4,582,040.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	3,070,000.000	4,719,204.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	5,900,000.000	6,841,640.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	9,100,000.000	9,771,125.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	6,000,000.000	6,911,400.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	7,200,000.000	8,068,320.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,300,000.000	6,914,658.000	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	7,000,000.000	7,398,720.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	7,000,000.000	7,736,400.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	6,000,000.000	6,897,600.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,700,000.000	4,614,030.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,450,000.000	3,754,870.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,700,000.000	6,262,250.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	3,200,000.000	5,900,480.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	3,300,000.000	5,652,900.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,860,000.000	4,658,654.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	2,400,000.000	3,675,120.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	2,040,000.000	3,656,496.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	2,450,000.000	4,205,425.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	1,100,000.000	1,148,059.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,020,000.000	1,117,002.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	900,000.000	992,970.000	
FINLAND 1.75 04/15/16	1,220,000.000	1,246,474.000	
FINLAND 1.875 04/15/17	1,020,000.000	1,063,911.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	800,000.000	915,480.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	710,000.000	976,924.500	
FINLAND 2.75 07/04/28	880,000.000	1,104,928.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,330,000.000	1,561,220.500	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,000,000.000	1,208,300.000	

FINLAND 3.875 09/15/17	1,000,000.000	1,100,500.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,310,000.000	1,770,334.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	810,000.000	966,613.500	
FR TREASURY 1.0 07/25/17	3,000,000.000	3,079,890.000	
FR TREASURY 2.5 07/25/16	6,700,000.000	6,948,436.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	3,000,000.000	4,969,380.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	3,500,000.000	3,621,590.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	3,500,000.000	3,649,275.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	500,000.000	519,570.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	5,000,000.000	5,550,750.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,960,000.000	5,505,947.200	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,600,000.000	4,160,556.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	5,384,414.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,700,000.000	3,260,115.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	6,800,000.000	7,721,400.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	6,440,000.000	7,883,976.800	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	6,300,000.000	7,529,445.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	8,000,000.000	8,314,400.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,250,000.000	3,226,995.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,300,000.000	8,773,213.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	7,400,000.000	8,711,280.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,340,000.000	8,205,228.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	12,900,000.000	13,977,279.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	7,000,000.000	8,554,420.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,747,872.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	7,000,000.000	7,904,260.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,000,000.000	5,192,100.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,040,000.000	3,618,144.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	5,010,000.000	7,707,634.500	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	9,500,000.000	11,190,050.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	6,800,000.000	7,587,576.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,986,750.000	

FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,800,000.000	7,682,506.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,910,000.000	8,281,451.500	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,100,000.000	6,673,734.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	9,000,000.000	9,766,530.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	6,030,000.000	9,680,742.900	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,200,000.000	9,078,368.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	4,090,000.000	6,341,217.800	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.000	4,185,750.000	
IRISH 2.4 05/15/30	800,000.000	904,304.000	
IRISH 3.4 03/18/24	1,430,000.000	1,739,881.000	
IRISH 3.9 03/20/23	1,120,000.000	1,394,747.200	
IRISH 4.4 06/18/19	1,430,000.000	1,687,400.000	
IRISH 4.5 04/18/20	2,250,000.000	2,725,740.000	
IRISH 4.5 10/18/18	2,040,000.000	2,363,748.000	
IRISH 4.6 04/18/16	500,000.000	526,330.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,800,000.000	2,258,730.000	
IRISH 5.4 03/13/25	2,250,000.000	3,186,810.000	
IRISH 5.5 10/18/17	1,820,000.000	2,082,353.000	
IRISH 5.9 10/18/19	1,300,000.000	1,637,870.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,100,000.000	2,339,778.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	7,000,000.000	8,163,050.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,685,710.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	6,000,000.000	6,301,740.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	6,000,000.000	7,029,000.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	3,400,000.000	4,096,218.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	14,800,000.000	15,865,600.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,900,000.000	6,242,110.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	5,400,000.000	6,334,740.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,471,350.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,700,000.000	6,698,640.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	7,300,000.000	8,489,170.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	12,400,000.000	13,905,360.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,336,100.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	10,500,000.000	12,180,000.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,674,358.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,900,000.000	5,034,120.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,500,000.000	4,374,930.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	7,000,000.000	7,975,800.000	

ITALY BTPS 4.75 08/01/23	3,000,000.000	3,823,200.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,800,000.000	4,696,420.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,480,000.000	4,654,917.600	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	3,860,000.000	5,676,477.400	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,500,000.000	5,692,500.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	5,930,000.000	7,867,924.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	4,700,000.000	6,716,300.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,890,000.000	5,719,467.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	4,000,000.000	5,901,200.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	11,200,000.000	12,542,880.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	5,500,000.000	7,779,200.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	6,000,000.000	7,863,900.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	4,400,000.000	5,775,220.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,170,000.000	4,846,930.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	6,550,000.000	10,090,275.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	5,500,000.000	8,410,050.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,250,000.000	3,579,750.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.000	6,502,000.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	600,000.000	608,064.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	3,500,000.000	3,639,580.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	2,660,000.000	2,797,389.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,400,000.000	2,681,112.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,550,000.000	2,920,974.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	3,370,000.000	3,873,309.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	4,090,000.000	4,294,009.200	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,040,000.000	2,592,289.200	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	960,000.000	1,382,659.200	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	3,680,000.000	4,406,064.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	3,270,000.000	3,883,942.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	3,100,000.000	3,935,140.000	

	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,770,000.000	4,575,236.700	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,800,000.000	4,482,800.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	4,700,000.000	4,967,900.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	3,030,804.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,613,390.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	4,090,000.000	4,540,309.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,300,000.000	3,666,200.000	
	SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,185,120.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,900,000.000	4,383,834.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	3,000,000.000	3,082,590.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	3,500,000.000	3,627,750.000	
	SPAIN 3.75 10/31/18	4,000,000.000	4,485,240.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	8,000,000.000	8,544,000.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	4,200,000.000	5,092,248.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	4,500,000.000	5,248,575.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,835,135.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	3,300,000.000	4,403,190.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	5,000,000.000	5,341,850.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	4,300,000.000	5,027,560.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,639,935.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	4,300,000.000	4,818,365.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	6,300,000.000	7,407,855.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,200,000.000	4,170,400.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	3,064,950.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,200,000.000	4,132,640.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	3,900,000.000	4,770,480.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,500,000.000	3,706,250.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	3,051,400.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,300,000.000	2,038,244.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	4,100,000.000	5,410,852.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	5,700,000.000	7,274,625.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	6,000,000.000	6,760,920.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,100,000.000	4,771,024.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,300,000.000	5,696,812.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	3,400,000.000	4,911,130.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	4,300,000.000	6,455,332.000	
	ユーロ 小計	846,350,000.000 (114,028,735,500)	1,048,513,042.600 (141,266,162,229)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	29,000,000.000	35,373,620.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	11,827,179.000	

	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	15,760,000.000	12,839,829.600	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	28,660,000.000	28,148,705.600	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,600,000.000	15,760,800.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	5,110,000.000	5,101,568.500	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	35,000,000.000	36,327,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	1,000,000.000	1,006,290.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	3,270,000.000	3,392,461.500	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	4,910,000.000	5,055,385.100	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	5,000,000.000	5,253,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	11,000,000.000	11,536,360.000	
	南アフリカ・ランド 小計	171,010,000.000 (1,768,243,400)	171,622,899.300 (1,774,580,779)	
国債証券	合計	293,750,334,700 (293,750,334,700)	337,543,101,755 (337,543,101,755)	
合計		293,750,334,700 (293,750,334,700)	337,543,101,755 (337,543,101,755)	

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 119銘柄	40.38%	41.46%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	8.16%	8.38%
オーストラリア・ドル	国債証券 17銘柄	1.63%	1.67%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	2.21%	2.27%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.33%	0.34%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.43%	0.45%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.70%	0.72%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.23%	0.24%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.55%	0.56%
マレーシア・リングギット	国債証券 14銘柄	0.47%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	1.03%	1.05%
ユーロ	国債証券 228銘柄	40.76%	41.85%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.51%	0.53%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

平成27年2月27日現在

資産総額	8,241,648,616円
負債総額	31,747,951円
純資産総額（ - ）	8,209,900,665円
発行済数量	5,442,341,624口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5085円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

平成27年2月27日現在

資産総額	19,641,993,220円
負債総額	36,315,118円
純資産総額（ - ）	19,605,678,102円
発行済数量	11,162,507,716口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7564円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型

平成27年2月27日現在

資産総額	16,000,306,902円
負債総額	20,560,168円
純資産総額（ - ）	15,979,746,734円
発行済数量	7,939,204,893口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0128円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	337,860,260,429円
負債総額	1,235,622,950円
純資産総額（ - ）	336,624,637,479円
発行済数量	155,484,453,261口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1650円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	437,986,684,819円
負債総額	10,217,223,500円
純資産総額（ - ）	427,769,461,319円
発行済数量	348,739,691,474口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2266円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	320,353,645,527円
負債総額	1,112,700,220円
純資産総額(-)	319,240,945,307円
発行済数量	108,998,463,393口
1口当たり純資産額(/)	2.9289円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	347,709,603,237円
負債総額	237,323,644円
純資産総額(-)	347,472,279,593円
発行済数量	184,168,667,288口
1口当たり純資産額(/)	1.8867円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に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ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

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

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

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

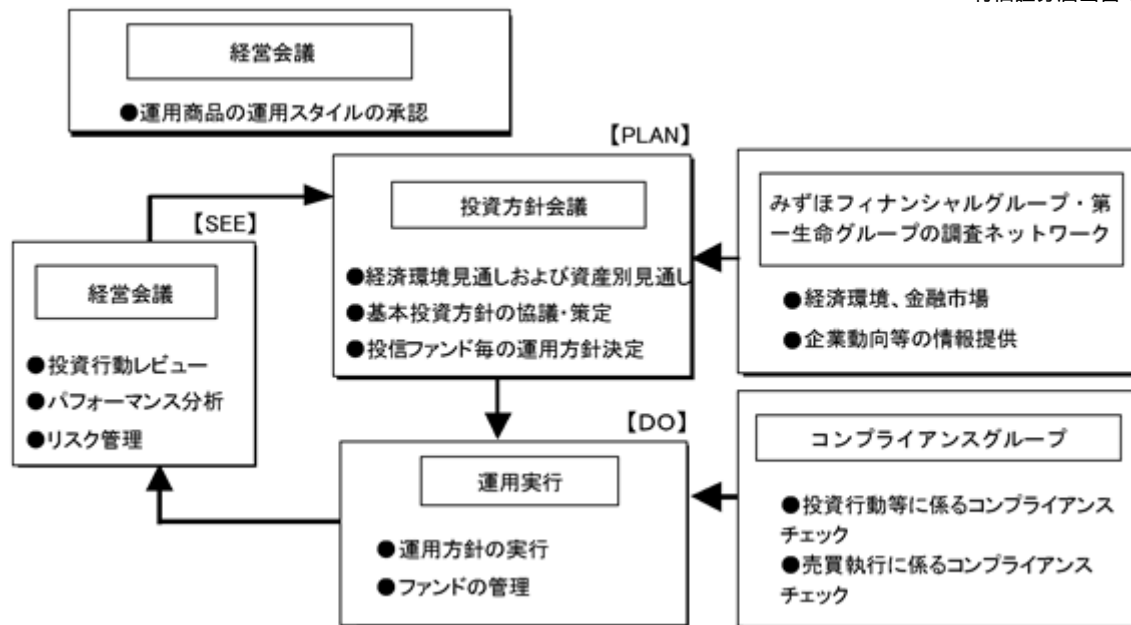
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年2月27日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成27年2月27日現在、委託会社の運用する投資信託は353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	7	20,669,998,430
追加型株式投資信託	323	5,754,565,009,705
単位型公社債投資信託	23	201,073,975,137
追加型公社債投資信託	0	0
合計	353	5,976,308,983,272

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

3．委託会社は、第29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26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30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	-
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	2 1,306,837	2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（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	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
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	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第28期 （ 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 ）		第29期 （ 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期		第29期	
	（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）		（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		-	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	-		213,744	
雑損失	-		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	1	1,752	1	22
固定資産売却損	2	115	2	1,448
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		134,463		13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の 配当							2,712,000	2,712,000	2,712,000
別途積立金 の積立				700,000			700,000	-	-
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	700,000	-	-	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の 配当		2,712,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	32,375	32,375
当期変動額 合計	32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の 配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金 の積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の 配当		3,096,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	139,391	139,391
当期変動額 合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

重要な会計方針

項目	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当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。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 2em;">数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理</p> <p style="padding-left: 2em;">過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

（1）概要

財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。

（2）適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、現在評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウェア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

2. 関係会社項目

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

(千円)

		第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	-	22
ソフトウェア	1,752	0

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	115	1,448

(株主資本等変動計算書関係)

第28期(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2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25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成26年6月30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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,806,745	10,806,745	-
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	320,332	320,332	-
資産計	21,341,518	21,341,518	-
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	-
負債計	1,299,068	1,299,068	-

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
差入保証金	731,564	731,197

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第28期(平成25年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	10,806,412	-	-	-
合計	10,806,412	-	-	-

第29期(平成26年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第28期及び第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	307,639	146,101	161,537
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
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）	8,688	10,000	1,312
小計	8,688	10,000	1,312
合計	320,332	159,101	161,231

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

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,214,440	946,377

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,952,459	1,628,835

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

	（千円）
（1）退職給付債務	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	133,522
退職給付引当金	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

(1) 勤務費用	102,125
(2) 利息費用	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	41,923
(5) その他	314
退職給付費用	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(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

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	112,660
未認識過去勤務費用	19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759
退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期	第29期
	(平成25年3月31日現在)	(平成26年3月31日現在)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	22,907	-
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	109	-
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	54,172
繰延税金負債合計	-	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の関係会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務 1名, 出向 2名, 転籍 3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,289	未収投資 助言報酬	203,114

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他 の関係 会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務 1名, 出向 2名, 転籍 3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	520,967	未払 費用	175,664
	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	214,290	未払 費用	89,815

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	627,855	未払 費用	224,758
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	251,110	未払 費用	97,587

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	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 預金の預入 (純額) 受取利息	1,661,638 191,782 106	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	142,323 625,561 -
	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 預金の引出 (純額) 受取利息	460,605 1,912,442 3,210	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	100,875 9,527,582 61
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	259,435 11,140	未払 費用 未払 費用	132,250 5,848
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	3,500,000 5,908	金銭の 信託	10,214,440

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
そ の 他 の 関 係 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行 (旧株式 会社みず ほコーポ レート銀 行)	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額)	1,629,874 775,579	未払 手数料 現金・ 預金	224,525 10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の引出 (純額)	432,201 203,876	-	-
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	287,136 11,810	未払 費用 未払金	155,413 2,646
資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	1,000,000 7,933	金銭の 信託	10,952,459	

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 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せん。

（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。

（注7）株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行（株式会社みずほ銀行に商号変更）に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行（旧株式会社みずほコーポレート銀行）に引き継いでおります。

（1株当たり情報）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,723,059
金銭の信託		12,434,692
前払費用		41,958
未収委託者報酬		4,115,165
未収運用受託報酬		2,110,505
未収投資助言報酬		291,921
未収収益		276,092
繰延税金資産		381,830
その他		19,665
	流動資産計	29,394,891
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	112,415
車両運搬具	1	1,278
器具備品	1	155,618
無形固定資産		
商標権	1	148
ソフトウェア	1	1,293,646
ソフトウェア仮勘定		671,614
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	210
投資その他の資産		
投資有価証券		569,502
関係会社株式		1,916,596
繰延税金資産		632,938
差入保証金		731,858
その他		98,609
	固定資産計	6,191,588
資産合計		35,586,479

（単位：千円）

	第30期中間会計期間末 （平成26年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	1,166,764
未払金	1,957,162
未払償還金	51,109
未払手数料	1,643,563
その他未払金	262,489
未払費用	1,591,500
未払法人税等	1,472,835
未払消費税等	371,933
賞与引当金	654,870
その他	20,000
	流動負債計
	7,235,067
固定負債	
退職給付引当金	812,666
役員退職慰労引当金	83,180
	固定負債計
	895,847
負債合計	8,130,914
（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	22,814,599
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	19,480,000
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	2,711,306
	株主資本計
	27,243,077
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	212,487
	評価・換算差額等計
	212,487
純資産合計	27,455,565
負債・純資産合計	35,586,479

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日至平成26年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	13,286,051	
運用受託報酬	3,381,064	
投資助言報酬	490,761	
その他営業収益	421,279	
	営業収益計	17,579,156
営業費用		
支払手数料	5,909,864	
広告宣伝費	92,826	
公告費	159	
調査費	2,887,318	
調査費	2,043,582	
委託調査費	843,735	
委託計算費	190,750	
営業雑経費	236,536	
通信費	17,081	
印刷費	205,572	
協会費	12,088	
諸会費	15	
支払販売手数料	1,778	
	営業費用計	9,317,455
一般管理費		
給料	2,293,163	
役員報酬	121,968	
給料・手当	2,171,195	
交際費	15,267	
寄付金	2,697	
旅費交通費	108,306	
租税公課	63,009	
不動産賃借料	344,346	
退職給付費用	109,300	
固定資産減価償却費	1 271,644	
福利厚生費	11,154	
修繕費	4,020	
賞与引当金繰入額	654,870	
役員退職慰労引当金繰入額	23,042	
役員退職慰労金	25,501	
機器リース料	23	
事務委託費	102,506	
事務用消耗品費	33,911	
器具備品費	1,141	
諸経費	73,631	
	一般管理費計	4,137,538
営業利益		4,124,161

（単位：千円）

	第30期中間会計期間 （自平成26年4月1日至平成26年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,686	
受取利息	1,115	
雑収入	1,165	
営業外収益計		8,967
営業外費用		
為替差損	896	
金銭の信託運用損	2,943	
営業外費用計		3,839
経常利益		4,129,289
特別損失		
関係会社株式評価損	202,477	
特別損失計		202,477
税引前中間純利益		3,926,811
法人税、住民税及び事業税		1,450,315
法人税等調整額		46,321
法人税等合計		1,403,993
中間純利益		2,522,818

(3) 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変更による累積的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の積立				2,350,000			2,350,000	-	-
中間純利益							2,522,818	2,522,818	2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	2,155,181	194,818	194,818
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	2,711,306	22,814,599	27,243,077

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変更による累積的影響額		131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	243,159	27,291,419
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の積立		-
中間純利益		2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	30,671	30,671
当中間期変動額合計	30,671	164,146
当中間期末残高	212,487	27,455,565

重要な会計方針

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5．引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の際会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
<p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ4,584千円増加しております。なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。</p>	

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
	1. 固定資産の減価償却累計額	建物
	車両運搬具	3,645千円
	器具備品	690,539千円
	商標権	789千円
	ソフトウェア	1,737,240千円
	電信電話専用施設利用権	1,386千円

(中間損益計算書関係)

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産
	無形固定資産	235,019千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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26年6月30日 定時株主総会	普通株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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	9,723,059	9,723,059	-
(2) 金銭の信託	12,434,692	12,434,692	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	489,256	489,256	-
資産計	22,647,008	22,647,008	-
(1) 未払法人税等	1,472,835	1,472,835	-
負債計	1,472,835	1,472,835	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	1,916,596
差入保証金	731,858

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

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

なお、当中間会計期間において、関係会社株式について202,477千円減損処理を行っております。

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

（有価証券関係）

第30期中間会計期間末（平成26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1,916,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	474,395	146,101	328,293
債券	-	-	-
その他（投資信託）	14,861	13,000	1,861
小計	489,256	159,101	330,154
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	489,256	159,101	330,154

（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30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

1. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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	13,286,051	3,871,825	421,279	17,579,156

（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

顧客の名称又は氏名	営業収益 （千円）
第一生命グループ	1,799,530

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,143,981円	89銭
1株当たり中間純利益金額	105,117円	43銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

（注1）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30期中間会計期間 （自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）
中間純利益	2,522,818千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,522,818千円
期中平均株式数	24,000株

（注2）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額が5,582円81銭増加し、1株当たり中間純利益金額が122円93銭増加しております。

（重要な後発事象）

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成26年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。
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。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成26年3月末日現在

(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26年6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

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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年4月8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 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和田 渉 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、「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26年2月26日から平成27年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成27年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成27年4月8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 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和田 渉 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、「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26年2月26日から平成27年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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27年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成27年4月8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 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和田 渉 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成26年2月26日から平成27年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成27年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26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26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。