

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2019年5月24日

【計算期間】 第16期(自 2018年2月27日 至 2019年2月25日)

【ファンド名】 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

【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【事務連絡者氏名】 三木谷 正直

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【電話番号】 03-6774-5100

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【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。

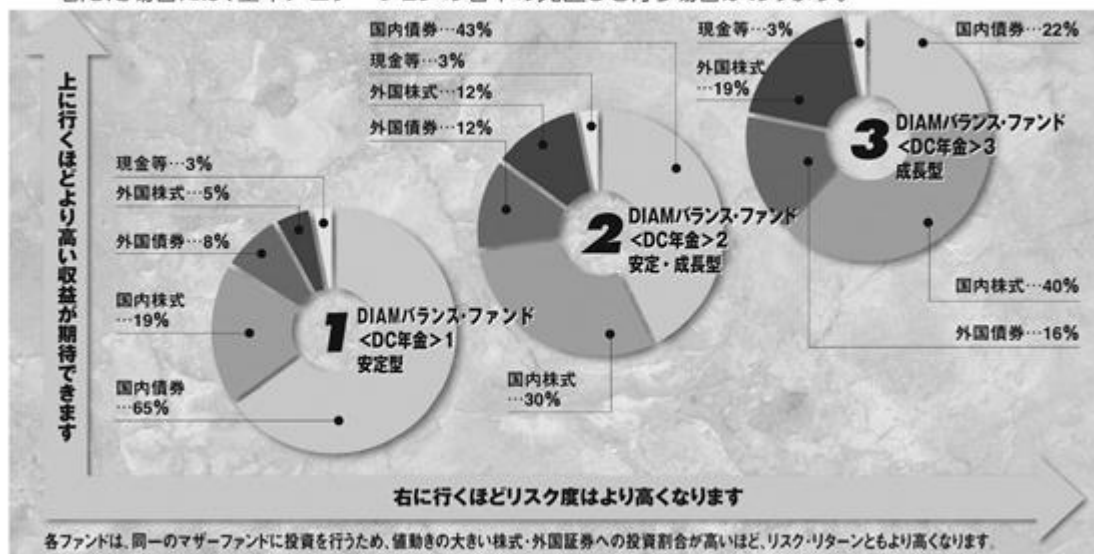
(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

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

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

属性区分表

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型」

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	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	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア	ファミリー ファンド*	あり ()	TOPIX
クレジット属性 ()	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	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、FTSE世界国債 インデックス)
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))		中近東 (中東) エマージング			
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

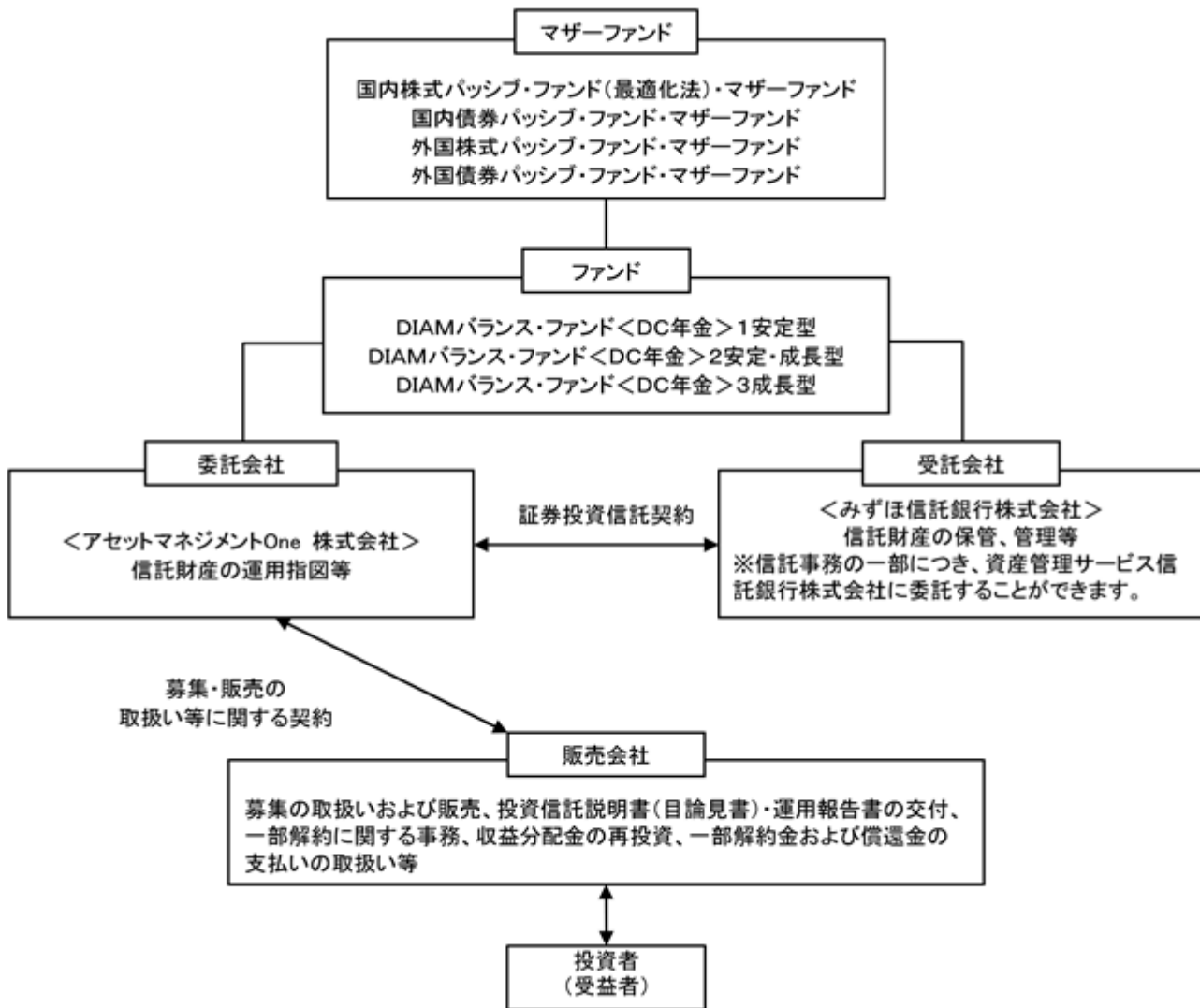
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式、債券） 資産配分固定 型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）へ実質的に投資し、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本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。
ファミリーファンド	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	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な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。
その他	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（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2002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
2005年10月 1日 信託報酬率の変更

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

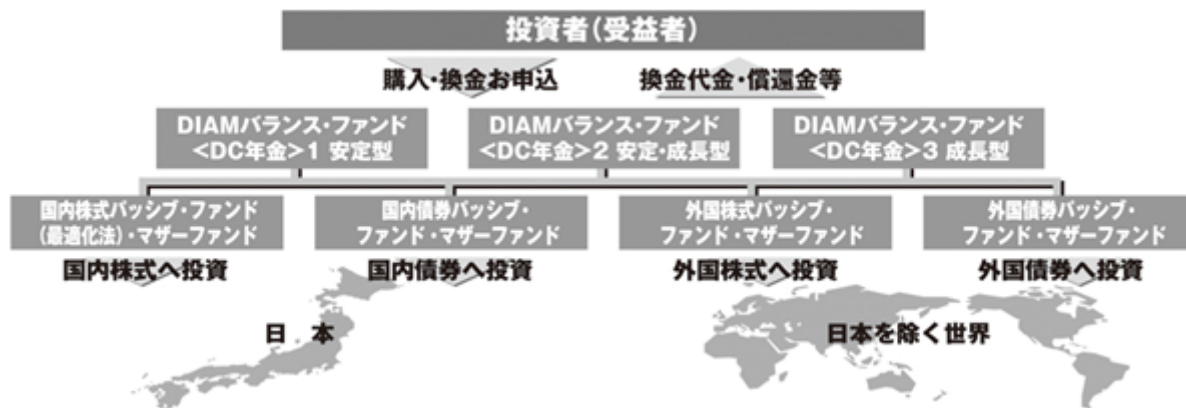
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2019年2月28日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998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
1998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
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社およ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。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（2019年2月28日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

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

<投資態度>

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

2) 「DIAM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。

「DIAM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。

「DIAM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FTSE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) 東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

㈱東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

㈱東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

㈱東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当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、東証株価指数(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、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行また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 総合の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(注3) 本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含む。)については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

(注4) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。

このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income 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せん。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

(1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

- (3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - (4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - (5) 株券または新株引受権証書
 - (6) 国債証券
 - (7) 地方債証券
 - (8) 特別の法律により法人の発行する債券
 - (9) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - (10) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - (11) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - (12) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - (13) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 - (14) コマーシャル・ペーパー
 - (15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - (16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
 - (17) 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
 - (18) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - (19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - (20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 - (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）

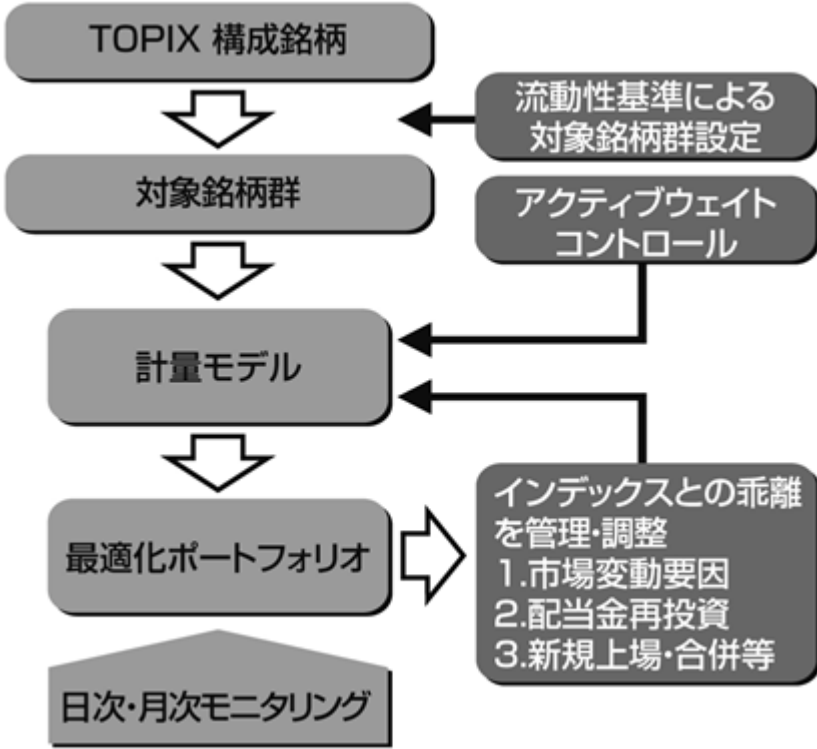
委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- (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) ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

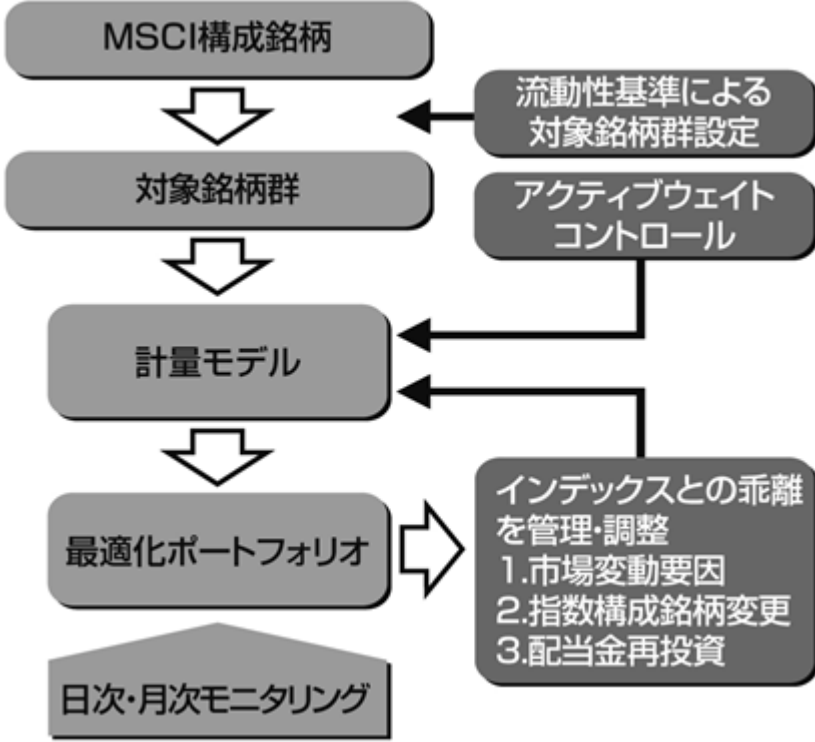
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

運用プロセス	<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	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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。</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	<p>1) 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因、 が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 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、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、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> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</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  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[アクティブウェイトコントロール] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
--------	--

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> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE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。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス

1)流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE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。

2)最適化法によるポートフォリオの構築

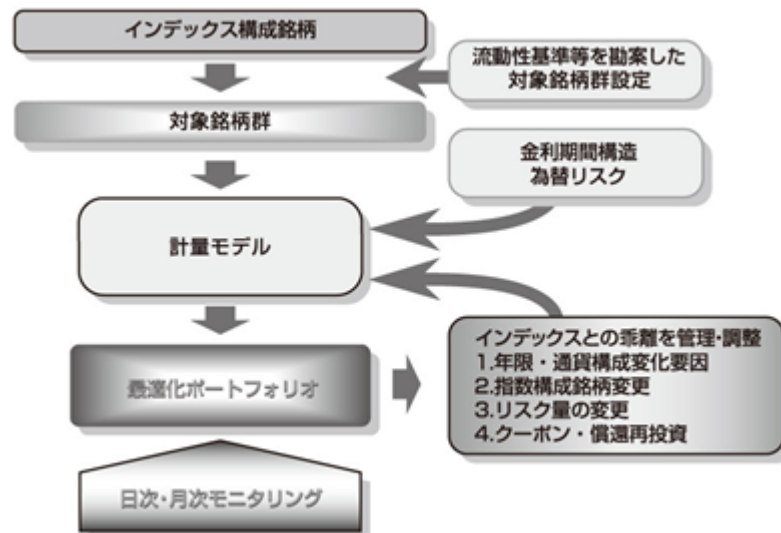
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

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。

- ・ 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

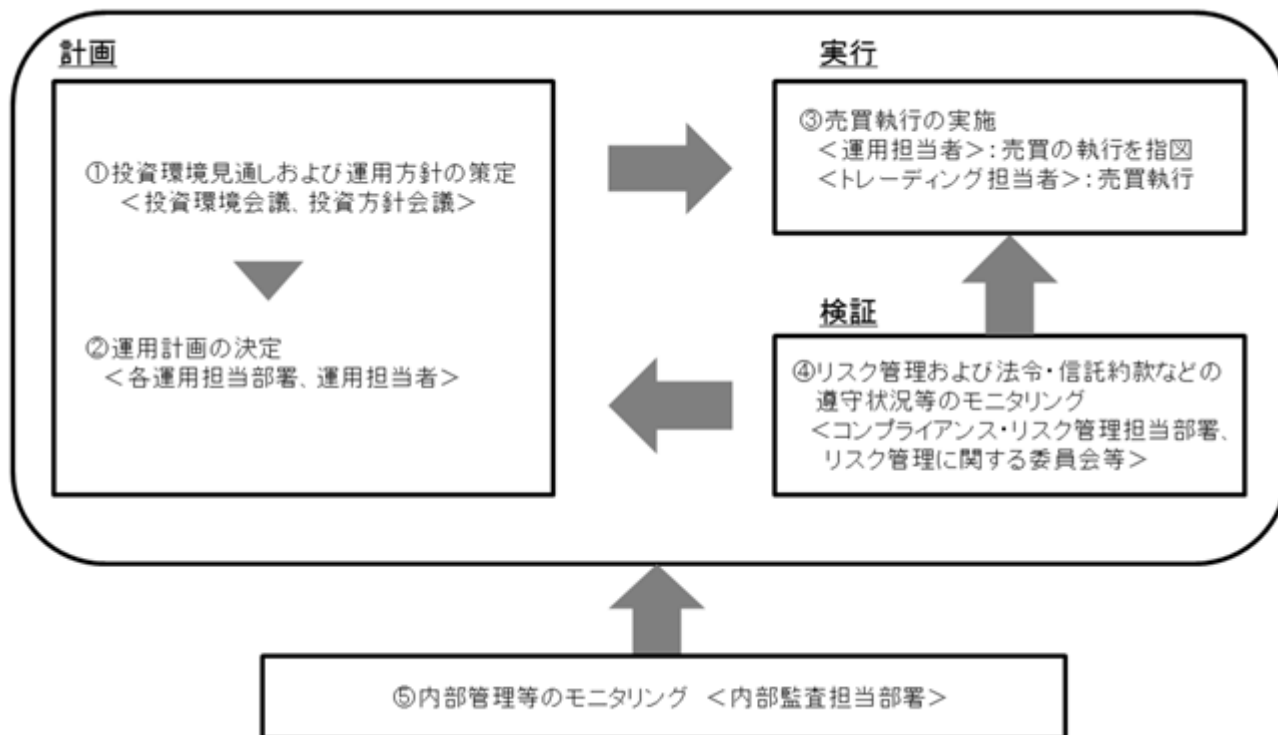


<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</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】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（4）【分配方針】

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、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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】

「DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞1安定型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

「DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞2安定・成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

「DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞3成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。

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)一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款 運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

(6)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。

(7)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。

(8)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。

(9)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書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せん。)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

(10)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2)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。

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

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

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

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

(13) 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。

(14) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)

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

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

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

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

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

(15) 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。

(16) 公社債の借入れ(約款第27条)

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b)上記(a)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c)信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d)上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- (17)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。
- (18)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。
- (19)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。

(20) 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 >

当ファンドは、値動きのある有価証券等(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、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

(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。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<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。

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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。

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

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

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

注意事項

イ.当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ.投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

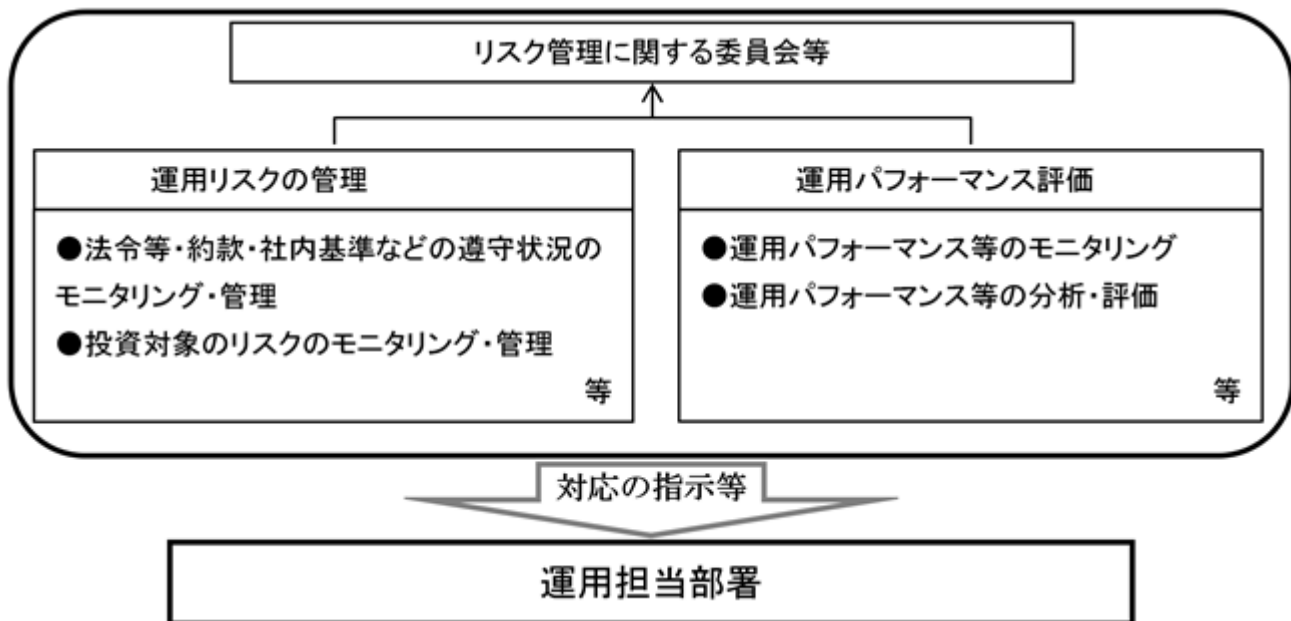
ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ.投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

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

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



リスク管理体制は2019年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

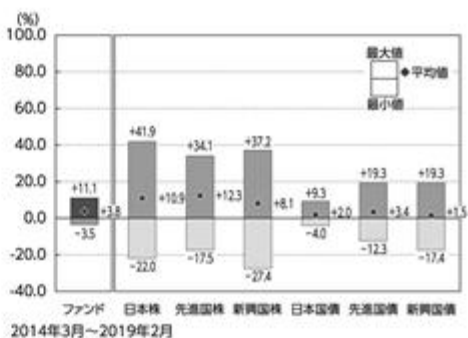
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

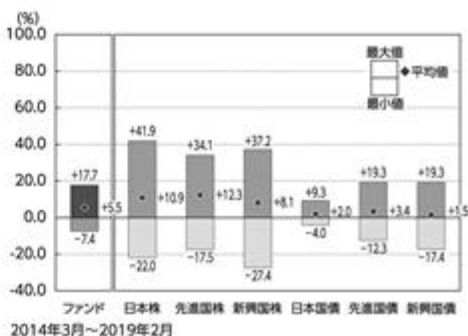
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型



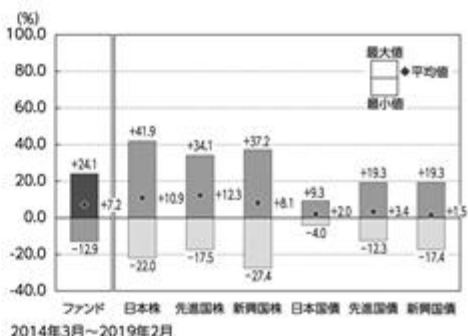
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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(配当込み、円ベース)
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債…NOMURA-BPI国債
先進国債…FTSE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・ディバースファイド(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、円換算しております。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社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。

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% * 1 (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% * 2 (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% * 3 (税抜0.32%)	0.130%	0.160%	0.030%
主な役務	信託財産の運用、目 論見書等各種書類の 作成、基準価額の算 出等の対価	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

消費税率が10%になった場合は、以下の通りとなります。

* 1 年率0.286% * 2 年率0.319% * 3 年率0.352%

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座(源泉徴収口座)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かかる消費税等に相当する金額を含みます。)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

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。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、2019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に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

平成31年2月28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	11,812,005,230	97.00
内 日本	11,812,005,230	97.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	365,847,205	3.00
純資産総額	12,177,852,435	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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

平成31年2月28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	25,050,232,008	96.99
内 日本	25,050,232,008	96.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	776,191,036	3.01
純資産総額	25,826,423,044	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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

平成31年2月28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	19,508,959,940	96.99
内 日本	19,508,959,940	96.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	604,720,015	3.01
純資産総額	20,113,679,955	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31年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	277,549,121,770	97.70
内 日本	277,549,121,770	97.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,532,732,015	2.30
純資産総額	284,081,853,785	100.00

その他資産の投資状況

平成31年2月28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）	6,584,600,000	2.32
内 日本	6,584,600,000	2.32

（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31年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	236,376,167,800	80.63
内 日本	236,376,167,800	80.63
地方債証券	22,039,551,157	7.52
内 日本	22,039,551,157	7.52
特殊債券	18,235,721,088	6.22
内 日本	18,235,721,088	6.22
社債券	14,194,079,280	4.84
内 日本	13,588,527,280	4.64
内 フランス	404,884,000	0.14
内 オランダ	200,668,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,319,224,620	0.79
純資産総額	293,164,743,945	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31年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	342,085,605,011	95.39
内 アメリカ	220,762,776,903	61.56
内 イギリス	21,963,245,436	6.12
内 カナダ	13,658,591,616	3.81
内 フランス	13,140,472,089	3.66
内 スイス	12,526,094,057	3.49
内 ドイツ	11,327,184,340	3.16
内 オーストラリア	8,338,827,565	2.33
内 オランダ	6,297,462,751	1.76
内 アイルランド	6,009,140,958	1.68
内 スペイン	4,020,712,565	1.12
内 香港	3,701,469,377	1.03
内 スウェーデン	3,200,189,118	0.89
内 イタリア	2,477,899,221	0.69
内 デンマーク	2,301,343,846	0.64
内 シンガポール	1,652,360,266	0.46
内 フィンランド	1,646,424,038	0.46

内	バミューダ	1,456,423,666	0.41
内	ベルギー	1,281,044,521	0.36
内	ジャージー	1,184,119,677	0.33
内	ケイマン諸島	982,867,066	0.27
内	ノルウェー	948,081,384	0.26
内	イスラエル	711,619,691	0.20
内	オランダ領キュラソー	595,567,108	0.17
内	ルクセンブルグ	444,302,749	0.12
内	オーストリア	308,433,158	0.09
内	ニュージーランド	292,751,570	0.08
内	パナマ	226,689,307	0.06
内	ポルトガル	225,977,508	0.06
内	リベリア	185,460,415	0.05
内	パプアニューギニア	91,957,448	0.03
内	イギリス領バージン諸島	61,123,513	0.02
内	マン島	49,048,224	0.01
内	モーリシャス	15,943,860	0.00
投資信託受益証券		817,556,986	0.23
内	オーストラリア	668,584,705	0.19
内	シンガポール	148,972,281	0.04
投資証券		8,214,649,619	2.29
内	アメリカ	7,245,148,886	2.02
内	イギリス	252,580,267	0.07
内	香港	233,541,346	0.07
内	オランダ	218,626,109	0.06
内	フランス	197,266,073	0.06
内	カナダ	67,486,938	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,481,561,580	2.09
純資産総額		358,599,373,196	100.00

その他資産の投資状況

平成31年2月28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)		339,792,070	0.09
	-	339,792,070	0.09
為替予約取引(売建)		96,407,090	0.03
	-	96,407,090	0.03
株価指数先物取引(買建)		7,223,516,551	2.01
内	アメリカ	5,066,564,977	1.41
内	ドイツ	1,227,943,856	0.34
内	イギリス	459,991,763	0.13
内	カナダ	274,442,539	0.08
内	オーストラリア	194,573,416	0.05

(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31年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	194,145,201,995	98.11
内 アメリカ	89,946,359,530	45.45
内 フランス	19,678,878,320	9.94
内 イタリア	17,118,565,070	8.65
内 イギリス	13,386,936,643	6.76
内 ドイツ	13,094,215,871	6.62
内 スペイン	11,205,832,986	5.66
内 ベルギー	4,842,660,994	2.45
内 オーストラリア	4,107,438,605	2.08
内 オランダ	3,942,465,441	1.99
内 カナダ	3,872,655,926	1.96
内 オーストリア	2,885,791,131	1.46
内 アイルランド	1,584,415,297	0.80
内 メキシコ	1,440,421,266	0.73
内 フィンランド	1,304,079,535	0.66
内 ポーランド	1,120,006,372	0.57
内 南アフリカ	1,097,986,779	0.55
内 デンマーク	986,214,384	0.50
内 マレーシア	815,493,473	0.41
内 シンガポール	664,051,334	0.34
内 スウェーデン	655,376,130	0.33
内 ノルウェー	395,356,908	0.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,747,294,340	1.89
純資産総額	197,892,496,335	100.00

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

平成31年2月28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	6,046,523,652	1.3067 7,901,522,271	1.3051 7,891,318,018	- -	64.80%
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	935,732,389	2.5030 2,342,231,742	2.4833 2,323,704,241	- -	19.08%
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	533,531,954	1.8196 970,868,096	1.8204 971,241,569	- -	7.98%
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	177,133,387	3.5230 624,058,635	3.5326 625,741,402	- -	5.14%

(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31年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

(注) 投資比率は、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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

平成31年2月28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	8,439,117,643	1.3067 11,028,110,436	1.3051 11,013,892,435	- -	42.65%
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	3,130,737,586	2.5031 7,836,549,252	2.4833 7,774,560,647	- -	30.10%
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	903,478,824	3.5231 3,183,046,245	3.5326 3,191,629,293	- -	12.36%
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	1,686,524,738	1.8196 3,068,969,065	1.8204 3,070,149,633	- -	11.89%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成31年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.99%
合計	96.99%

(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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

平成31年2月28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	3,229,429,211	2.5030 8,083,584,258	2.4833 8,019,641,559	- -	39.87%
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	3,392,518,242	1.3067 4,433,308,997	1.3051 4,427,575,557	- -	22.01%
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	1,088,583,348	3.5230 3,835,187,993	3.5326 3,845,529,535	- -	19.12%
4	外国債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,766,761,860	1.8197 3,215,020,137	1.8204 3,216,213,289	- -	15.99%

(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31年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.99%
合計	96.99%

(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31年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,340,600	6,575.00 8,814,445,000	6,697.00 8,977,998,200	- -	3.16%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	493,400	9,962.00 4,915,250,800	10,280.00 5,072,152,000	- -	1.79%
3	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	8,167,800	578.10 4,721,805,180	576.70 4,710,370,260	- -	1.66%
4	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,050,300	4,473.43 4,698,449,100	4,469.00 4,693,790,700	- -	1.65%
5	ソニー 日本	株式 電気機器	806,900	4,713.00 3,802,919,700	5,341.00 4,309,652,900	- -	1.52%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	807,400	4,636.00 3,743,106,400	4,801.00 3,876,327,400	- -	1.36%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	59,000	62,260.00 3,673,340,000	64,930.00 3,830,870,000	- -	1.35%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	836,300	3,928.00 3,284,986,400	3,942.00 3,296,694,600	- -	1.16%
9	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,014,900	3,002.00 3,046,729,800	3,153.00 3,199,979,700	- -	1.13%
10	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	16,123,100	173.40 2,795,745,540	175.20 2,824,767,120	- -	0.99%
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,040,300	2,658.50 2,765,637,550	2,688.50 2,796,846,550	- -	0.98%
12	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	107,700	23,625.00 2,544,412,500	24,975.00 2,689,807,500	- -	0.95%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	831,400	3,156.00 2,623,898,400	3,139.00 2,609,764,600	- -	0.92%
14	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	823,600	2,916.00 2,401,617,600	3,114.00 2,564,690,400	- -	0.90%
15	花王 日本	株式 化学	292,100	8,049.00 2,351,112,900	8,424.00 2,460,650,400	- -	0.87%
16	セブン&アイ・ホールディン グス 日本	株式 小売業	496,600	4,768.00 2,367,788,800	4,894.00 2,430,360,400	- -	0.86%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	430,100	5,341.00 2,297,164,100	5,426.00 2,333,722,600	- -	0.82%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	213,900	10,160.00 2,173,224,000	10,660.00 2,280,174,000	- -	0.80%
19	任天堂 日本	株式 その他製品	74,100	29,315.00 2,172,241,500	30,440.00 2,255,604,000	- -	0.79%
20	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	847,600	2,554.50 2,165,194,200	2,591.50 2,196,555,400	- -	0.77%

21	村田製作所 日本	株式 電気機器	126,200	17,390.00 2,194,618,000	17,325.00 2,186,415,000	- -	0.77%
22	ファナック 日本	株式 電気機器	114,300	18,795.00 2,148,268,500	18,440.00 2,107,692,000	- -	0.74%
23	キヤノン 日本	株式 電気機器	647,500	3,185.00 2,062,287,500	3,201.00 2,072,647,500	- -	0.73%
24	ダイキン工業 日本	株式 機械	164,200	11,755.00 1,930,171,000	12,090.00 1,985,178,000	- -	0.70%
25	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	697,100	2,726.50 1,900,643,150	2,833.00 1,974,884,300	- -	0.70%
26	日本電産 日本	株式 電気機器	144,800	13,145.00 1,903,396,000	13,475.00 1,951,180,000	- -	0.69%
27	信越化学工業 日本	株式 化学	207,600	9,244.00 1,919,054,400	9,271.00 1,924,659,600	- -	0.68%
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,109,300	1,661.00 1,842,547,300	1,718.50 1,906,332,050	- -	0.67%
29	日立製作所 日本	株式 電気機器	541,600	3,503.00 1,897,224,800	3,335.00 1,806,236,000	- -	0.64%
30	資生堂 日本	株式 化学	239,100	7,200.00 1,721,520,000	7,348.00 1,756,906,800	- -	0.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成31年2月28日現在

種類	投資比率
株式	97.70%
合計	97.70%

(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31年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.56%
情報・通信業		8.19%
輸送用機器		7.93%
化学		7.12%
銀行業		6.10%
医薬品		5.83%
卸売業		4.85%
サービス業		4.77%
小売業		4.75%
陸運業		4.73%
機械		4.71%
食料品		4.16%
建設業		2.91%
不動産業		2.33%
保険業		2.19%
その他製品		1.95%
精密機器		1.94%
電気・ガス業		1.92%
その他金融業		1.12%
鉄鋼		0.96%
ガラス・土石製品		0.89%
証券、商品先物取引業		0.81%
ゴム製品		0.78%
非鉄金属		0.78%
繊維製品		0.63%
石油・石炭製品		0.61%
空運業		0.60%
金属製品		0.56%
パルプ・紙		0.29%
鉱業		0.28%
倉庫・運輸関連業		0.19%
海運業	0.16%	
水産・農林業	0.12%	
合計	97.70%	

(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31年2月28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	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.43 3,013,170,000	100.40 3,012,150,000	0.100000 2020/9/20	1.03%
2	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,850,000,000	101.50 2,892,978,000	101.59 2,895,429,000	0.100000 2028/3/20	0.99%
3	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,760,000,000	103.46 2,855,559,600	103.42 2,854,447,200	0.400000 2025/3/20	0.97%
4	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,730,000,000	101.92 2,782,416,000	101.91 2,782,143,000	0.100000 2026/9/20	0.95%
5	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,610,000,000	101.90 2,659,668,300	101.89 2,659,433,400	0.100000 2026/12/20	0.91%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,600,000,000	101.90 2,649,426,000	101.85 2,648,204,000	0.100000 2026/3/20	0.90%
7	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,510,000,000	103.21 2,590,771,800	103.16 2,589,416,400	0.300000 2025/12/20	0.88%
8	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,460,000,000	103.76 2,552,496,000	103.68 2,550,528,000	0.600000 2023/12/20	0.87%
9	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	101.93 2,548,275,000	101.88 2,547,075,000	0.100000 2026/6/20	0.87%
10	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,450,000,000	103.76 2,542,267,000	103.71 2,540,895,000	0.400000 2025/9/20	0.87%
11	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,440,000,000	103.62 2,528,352,400	103.56 2,527,010,400	0.400000 2025/6/20	0.86%
12	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.50 2,512,700,000	100.47 2,511,750,000	0.100000 2020/12/20	0.86%
13	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,390,000,000	103.15 2,465,285,000	103.09 2,464,066,100	0.600000 2023/3/20	0.84%
14	129回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,420,000,000	100.70 2,437,012,600	100.65 2,435,826,800	0.100000 2021/9/20	0.83%
15	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,370,000,000	101.88 2,414,556,000	101.87 2,414,342,700	0.100000 2027/3/20	0.82%

16	351回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,360,000,000	101.40 2,393,205,200	101.49 2,395,329,200	0.100000 2028/6/20	0.82%
17	329回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,270,000,000	104.22 2,365,794,000	104.16 2,364,432,000	0.800000 2023/6/20	0.81%
18	352回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,270,000,000	101.25 2,298,375,000	101.39 2,301,575,700	0.100000 2028/9/20	0.79%
19	348回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,230,000,000	101.73 2,268,645,900	101.76 2,269,448,700	0.100000 2027/9/20	0.77%
20	312回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,200,000,000	102.53 2,255,726,000	102.45 2,253,966,000	1.200000 2020/12/20	0.77%
21	128回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,200,000,000	100.63 2,213,948,000	100.58 2,212,958,000	0.100000 2021/6/20	0.75%
22	124回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,200,000,000	100.37 2,208,272,000	100.34 2,207,612,000	0.100000 2020/6/20	0.75%
23	334回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,120,000,000	104.15 2,208,001,200	104.06 2,206,178,000	0.600000 2024/6/20	0.75%
24	135回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,100,000,000	101.11 2,123,352,000	101.10 2,123,121,000	0.100000 2023/3/20	0.72%
25	347回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,000,000,000	101.81 2,036,220,000	101.84 2,036,900,000	0.100000 2027/6/20	0.69%
26	131回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,020,000,000	100.83 2,036,927,600	100.82 2,036,725,600	0.100000 2022/3/20	0.69%
27	335回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	1,950,000,000	103.78 2,023,788,000	103.69 2,022,130,500	0.500000 2024/9/20	0.69%
28	132回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,000,000,000	100.90 2,018,140,000	100.88 2,017,600,000	0.100000 2022/6/20	0.69%
29	349回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	1,960,000,000	101.64 1,992,300,800	101.68 1,993,045,600	0.100000 2027/12/20	0.68%
30	333回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	1,800,000,000	103.95 1,871,154,000	103.87 1,869,660,000	0.600000 2024/3/20	0.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成31年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	80.63%
地方債証券	7.52%
特殊債券	6.22%
社債券	4.84%
合計	99.21%

(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31年2月28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	420,491	18,936.59 7,962,668,188	19,387.83 8,152,410,925	- -	2.27%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	634,442	11,852.00 7,519,408,487	12,436.28 7,890,103,367	- -	2.20%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	36,108	179,903.20 6,495,944,944	181,947.64 6,569,765,684	- -	1.83%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	210,280	18,177.13 3,822,288,263	18,050.74 3,795,710,595	- -	1.06%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	233,610	14,890.94 3,478,674,759	15,063.90 3,519,079,290	- -	0.98%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	292,732	11,355.30 3,324,061,260	11,659.08 3,412,988,499	- -	0.95%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	27,382	124,359.55 3,405,213,277	123,736.46 3,388,151,843	- -	0.94%
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	369,652	8,456.05 3,125,797,605	8,810.83 3,256,944,221	- -	0.91%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,079	125,194.40 3,264,944,861	124,494.81 3,246,700,262	- -	0.91%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	827,712	3,147.59 2,605,305,711	3,273.99 2,709,921,721	- -	0.76%
11	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	267,967	9,760.57 2,615,510,768	9,988.90 2,676,695,780	- -	0.75%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	113,163	22,482.21 2,544,155,303	22,427.89 2,538,007,576	- -	0.71%
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	155,128	15,872.14 2,462,214,761	16,322.28 2,532,042,869	- -	0.71%
14	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	511,213	4,653.21 2,378,783,437	4,759.64 2,433,194,495	- -	0.68%
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	216,805	10,916.26 2,366,699,792	10,966.15 2,377,516,519	- -	0.66%

16	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	401,649	5,633.30 2,262,611,199	5,902.71 2,370,821,103	- -	0.66%
17	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	410,672	5,366.10 2,203,710,304	5,719.78 2,348,954,847	- -	0.66%
18	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	83,999	29,417.13 2,471,010,099	27,726.36 2,328,987,320	- -	0.65%
19	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	47,645	45,436.74 2,164,833,639	48,277.23 2,300,168,756	- -	0.64%
20	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	360,110	5,990.30 2,157,169,129	6,288.54 2,264,568,444	- -	0.63%
21	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	398,635	5,379.41 2,144,422,062	5,532.41 2,205,413,456	- -	0.62%
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	164,712	13,100.39 2,157,792,953	13,313.26 2,192,855,262	- -	0.61%
23	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	633,005	3,302.81 2,090,699,864	3,443.62 2,179,830,070	- -	0.61%
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	231,930	8,752.07 2,029,869,404	8,938.33 2,073,069,057	- -	0.58%
25	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	99,838	20,811.40 2,077,769,321	20,363.49 2,033,050,404	- -	0.57%
26	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	80,615	24,370.33 1,964,614,531	24,898.07 2,007,158,388	- -	0.56%
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	187,505	9,875.84 1,851,770,129	10,130.77 1,899,571,153	- -	0.53%
28	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	61,398	30,004.38 1,842,209,414	30,824.60 1,892,569,036	- -	0.53%
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	352,046	5,054.56 1,779,438,791	4,982.49 1,754,068,420	- -	0.49%
30	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	394,384	4,131.01 1,629,206,693	4,271.82 1,684,737,892	- -	0.47%

(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31年2月28日現在

種類	投資比率
株式	95.39%
投資信託受益証券	0.23%
投資証券	2.29%
合計	97.91%

（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31年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.25%
石油・ガス・消耗燃料		6.02%
医薬品		5.66%
ソフトウェア		4.85%
保険		3.83%
情報技術サービス		3.75%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.06%
半導体・半導体製造装置		2.91%
資本市場		2.72%
コンピュータ・周辺機器		2.60%
ヘルスケア機器・用品		2.54%
航空宇宙・防衛		2.36%
インターネット販売・通信販売		2.36%
化学		2.31%
各種電気通信サービス		2.05%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.02%
バイオテクノロジー		1.93%
電力		1.90%
飲料		1.88%
ホテル・レストラン・レジャー		1.85%
食品		1.83%
専門小売り		1.64%
機械		1.54%
食品・生活必需品小売り		1.48%
金属・鉱業		1.48%
繊維・アパレル・贅沢品		1.44%
コングロマリット		1.43%
娯楽		1.43%
家庭用品		1.27%
メディア		1.18%
陸運・鉄道		1.08%
総合公益事業		1.08%
通信機器		0.99%
タバコ		0.98%
各種金融サービス		0.97%
自動車		0.88%
電気設備		0.73%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.73%

専門サービス	0.72%
パーソナル用品	0.69%
不動産管理・開発	0.58%
航空貨物・物流サービス	0.51%
電子装置・機器・部品	0.48%
消費者金融	0.48%
複合小売り	0.46%
商業サービス・用品	0.44%
建設関連製品	0.39%
エネルギー設備・サービス	0.38%
家庭用耐久財	0.38%
自動車部品	0.35%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.30%
無線通信サービス	0.29%
容器・包装	0.28%
建設資材	0.28%
運送インフラ	0.21%
ガス	0.17%
旅客航空輸送業	0.12%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11%
紙製品・林産品	0.10%
水道	0.09%
ヘルスケア・テクノロジー	0.09%
販売	0.07%
海運業	0.06%
レジャー用品	0.05%
各種消費者サービス	0.01%
合計	95.39%

(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31年2月28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 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,829,355,000	100.12 1,831,568,519	100.11 1,831,495,345	2.625000 2020/8/15	0.93%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,696,311,000	101.04 1,714,054,413	101.01 1,713,528,556	3.625000 2020/2/15	0.87%
3	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,552,180,000	101.14 1,569,874,852	101.15 1,570,061,113	3.500000 2020/5/15	0.79%
4	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,330,440,000	98.92 1,316,137,770	98.91 1,316,031,334	2.000000 2021/5/31	0.67%
5	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,330,440,000	98.67 1,312,758,452	98.67 1,312,758,452	1.375000 2020/4/30	0.66%
6	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,242,852,700	97.62 1,213,372,233	97.63 1,213,521,376	1.375000 2021/4/30	0.61%
7	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,219,570,000	99.11 1,208,801,196	99.12 1,208,935,349	1.875000 2020/6/30	0.61%
8	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,219,570,000	99.14 1,209,179,263	99.12 1,208,849,979	2.125000 2021/8/15	0.61%
9	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,225,113,500	98.65 1,208,647,974	98.65 1,208,647,974	2.000000 2022/2/15	0.61%
10	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,197,396,000	98.82 1,183,362,518	98.84 1,183,542,128	1.250000 2020/1/31	0.60%
11	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,181,874,200	97.87 1,156,759,373	97.89 1,157,031,204	1.750000 2022/3/31	0.58%
12	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,171,895,900	97.76 1,145,704,026	97.74 1,145,528,242	1.750000 2022/5/15	0.58%
13	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,153,048,000	98.77 1,138,946,222	98.79 1,139,119,180	2.000000 2021/11/15	0.58%
14	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,145,287,100	99.04 1,134,361,061	99.03 1,134,280,890	2.125000 2021/12/31	0.57%
15	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,134,200,100	97.50 1,105,924,491	97.48 1,105,663,625	1.750000 2022/9/30	0.56%
16	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,108,700,000	99.11 1,098,910,179	99.08 1,098,555,395	2.125000 2021/9/30	0.56%
17	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,082,091,200	99.49 1,076,594,176	99.48 1,076,507,609	2.250000 2021/3/31	0.54%
18	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,038,851,900	101.18 1,051,183,072	101.10 1,050,372,767	2.750000 2023/11/15	0.53%
19	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,053,265,000	98.88 1,041,489,497	98.88 1,041,489,497	2.125000 2022/6/30	0.53%
20	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,053,265,000	98.20 1,034,337,827	98.17 1,034,000,783	2.000000 2023/2/15	0.52%
21	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	983,502,000	105.06 1,033,326,211	104.99 1,032,667,264	2.500000 2020/10/25	0.52%
22	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,025,547,500	100.13 1,026,942,244	100.13 1,026,942,244	2.625000 2020/8/31	0.52%
23	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,053,265,000	97.17 1,023,468,133	97.15 1,023,310,143	1.625000 2022/8/15	0.52%

24	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,053,265,000	97.05 1,022,235,813	96.92 1,020,834,970	2.000000 2025/2/15	0.52%
25	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,044,395,400	96.97 1,012,771,107	96.94 1,012,489,120	1.625000 2022/11/15	0.51%
26	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	997,830,000	100.03 998,139,327	99.90 996,892,039	2.500000 2024/5/15	0.50%
27	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	997,830,000	98.63 984,179,685	98.61 984,030,011	1.750000 2020/12/31	0.50%
28	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	986,743,000	99.31 979,954,208	99.19 978,799,718	2.375000 2024/8/15	0.49%
29	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	990,069,100	97.58 966,158,931	97.42 964,614,423	2.125000 2025/5/15	0.49%
30	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	952,373,300	98.56 938,678,171	98.42 937,335,325	2.250000 2024/11/15	0.47%

(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31年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	98.11%
合計	98.11%

(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31年2月28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 3103月	買建	410	6,600,323,920	6,584,600,000	2.32%

(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31年2月28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2019年03月	買建	2,136,000	236,177,520	236,796,960	0.07%
		ユーロ買/円売201 9年03月	買建	486,000	61,238,430	61,279,740	0.02%
		イギリス・ポンド買/ 円売2019年03月	買建	143,000	20,962,942	21,112,520	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2019年03月	買建	155,000	13,010,855	13,066,500	0.00%
		オーストラリア・ドル 買/円売2019年0 3月	買建	95,000	7,548,320	7,536,350	0.00%
		アメリカ・ドル売/円 買2019年03月	売建	569,000	63,065,115	63,062,270	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 3月	売建	271,000	21,495,720	21,493,010	0.01%
		カナダ・ドル売/円買 2019年03月	売建	68,000	5,731,720	5,731,720	0.00%
		ユーロ売/円買201 9年03月	売建	38,000	4,791,648	4,791,420	0.00%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年03月	売建	9,000	1,328,670	1,328,670	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Mar 19	買建	327	4,992,514,904	5,066,564,977	1.41%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Mar 19	買建	297	1,198,988,549	1,227,943,856	0.34%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Mar 19	買建	44	465,189,781	459,991,763	0.13%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT M ar 19	買建	17	268,933,724	274,442,539	0.08%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Mar 1 9	買建	16	191,387,915	194,573,416	0.05%

(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
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成31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7計算期間末 (平成22年2月25日)	3,884	3,884	1.1365	1.1365
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	4,419	4,419	1.1651	1.1651
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	4,993	4,993	1.1720	1.1720
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	5,846	5,846	1.2689	1.2689
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	6,797	6,797	1.3874	1.3874
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	8,185	8,185	1.5056	1.5056
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	8,608	8,608	1.4954	1.4954
第14計算期間末 (平成29年2月27日)	9,711	9,711	1.5586	1.5586
第15計算期間末 (平成30年2月26日)	10,879	10,879	1.6264	1.6264
第16計算期間末 (平成31年2月25日)	12,140	12,140	1.6261	1.6261
平成30年2月末日	10,952	-	1.6259	-
3月末日	11,039	-	1.6184	-
4月末日	11,131	-	1.6334	-
5月末日	11,213	-	1.6275	-
6月末日	11,299	-	1.6278	-
7月末日	11,477	-	1.6337	-
8月末日	11,496	-	1.6263	-
9月末日	11,749	-	1.6449	-
10月末日	11,603	-	1.6068	-
11月末日	11,778	-	1.6179	-
12月末日	11,562	-	1.5838	-
平成31年1月末日	11,976	-	1.6061	-
2月末日	12,177	-	1.6225	-

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7計算期間末 (平成22年2月25日)	9,529	9,529	1.1659	1.1659
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	10,826	10,826	1.2065	1.2065
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	11,905	11,905	1.1984	1.1984
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	14,251	14,251	1.3506	1.3506
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	16,454	16,454	1.5495	1.5495
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	19,545	19,545	1.7503	1.7503
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	18,932	18,932	1.6738	1.6738
第14計算期間末 (平成29年2月27日)	21,334	21,334	1.8059	1.8059
第15計算期間末 (平成30年2月26日)	23,907	23,907	1.9363	1.9363
第16計算期間末 (平成31年2月25日)	25,795	25,795	1.9233	1.9233
平成30年2月末日	23,978	-	1.9353	-
3月末日	23,974	-	1.9160	-
4月末日	24,407	-	1.9483	-
5月末日	24,549	-	1.9354	-
6月末日	24,669	-	1.9358	-
7月末日	25,057	-	1.9524	-
8月末日	25,179	-	1.9466	-
9月末日	25,836	-	1.9866	-
10月末日	24,981	-	1.9046	-
11月末日	25,439	-	1.9223	-
12月末日	24,415	-	1.8433	-
平成31年1月末日	25,316	-	1.8855	-
2月末日	25,826	-	1.9183	-

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7計算期間末 (平成22年2月25日)	7,667	7,667	1.1890	1.1890
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	8,673	8,673	1.2395	1.2395
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	9,234	9,234	1.2166	1.2166
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	11,326	11,326	1.4236	1.4236
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	13,230	13,230	1.7075	1.7075
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	15,889	15,889	2.0030	2.0030
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	14,524	14,524	1.8463	1.8463
第14計算期間末 (平成29年2月27日)	16,465	16,465	2.0530	2.0530
第15計算期間末 (平成30年2月26日)	18,810	18,810	2.2555	2.2555
第16計算期間末 (平成31年2月25日)	20,092	20,092	2.2234	2.2234
平成30年2月末日	18,871	-	2.2538	-
3月末日	18,762	-	2.2200	-
4月末日	19,238	-	2.2736	-
5月末日	19,293	-	2.2521	-
6月末日	19,398	-	2.2532	-
7月末日	19,819	-	2.2831	-
8月末日	19,930	-	2.2800	-
9月末日	20,584	-	2.3463	-
10月末日	19,561	-	2.2104	-
11月末日	19,950	-	2.2363	-
12月末日	18,748	-	2.1014	-
平成31年1月末日	19,530	-	2.1651	-
2月末日	20,113	-	2.2169	-

【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7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16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7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16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7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16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7計算期間	7.2
第8計算期間	2.5
第9計算期間	0.6
第10計算期間	8.3
第11計算期間	9.3
第12計算期間	8.5
第13計算期間	0.7
第14計算期間	4.2
第15計算期間	4.4
第16計算期間	0.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

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7計算期間	11.8
第8計算期間	3.5
第9計算期間	0.7
第10計算期間	12.7
第11計算期間	14.7
第12計算期間	13.0
第13計算期間	4.4
第14計算期間	7.9
第15計算期間	7.2
第16計算期間	0.7

(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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

	収益率(%)
第7計算期間	16.4
第8計算期間	4.2
第9計算期間	1.8
第10計算期間	17.0
第11計算期間	19.9
第12計算期間	17.3
第13計算期間	7.8
第14計算期間	11.2
第15計算期間	9.9
第16計算期間	1.4

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

	設定口数	解約口数
第7計算期間	717,089,255	374,538,190
第8計算期間	717,088,658	341,609,549
第9計算期間	891,096,153	423,802,872
第10計算期間	792,020,789	445,175,024
第11計算期間	1,211,792,457	920,086,264
第12計算期間	1,286,101,728	748,268,806
第13計算期間	1,428,568,208	1,108,983,410
第14計算期間	1,177,511,256	702,902,178
第15計算期間	1,447,662,999	989,556,322
第16計算期間	1,628,738,236	851,823,010

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

	設定口数	解約口数
第7計算期間	1,585,255,449	499,713,782
第8計算期間	1,458,689,281	659,115,611
第9計算期間	1,799,986,538	838,294,174
第10計算期間	1,442,236,754	824,908,601
第11計算期間	1,713,460,271	1,646,999,165
第12計算期間	1,739,079,770	1,190,841,426
第13計算期間	1,697,863,637	1,553,640,036
第14計算期間	1,423,621,400	920,758,675
第15計算期間	1,657,767,778	1,125,122,159
第16計算期間	1,981,921,051	916,350,971

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

	設定口数	解約口数
第7計算期間	1,360,590,692	447,612,668
第8計算期間	1,167,657,064	618,314,729
第9計算期間	1,241,120,741	648,446,247
第10計算期間	1,210,113,248	844,741,332
第11計算期間	1,548,578,623	1,756,263,299
第12計算期間	1,448,206,115	1,263,916,173
第13計算期間	1,425,335,822	1,490,982,099
第14計算期間	1,086,201,353	932,940,956
第15計算期間	1,357,837,135	1,038,315,671
第16計算期間	1,485,604,296	788,709,795

(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:2019年2月28日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

基準価額・純資産の推移 (2009年2月27日～2019年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
第14期	(2017.02.27)	0円
第15期	(2018.02.26)	0円
第16期	(2019.02.25)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

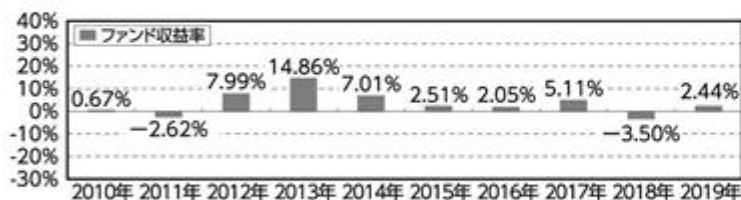
主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	64.80%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.08%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.98%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.14%

※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。

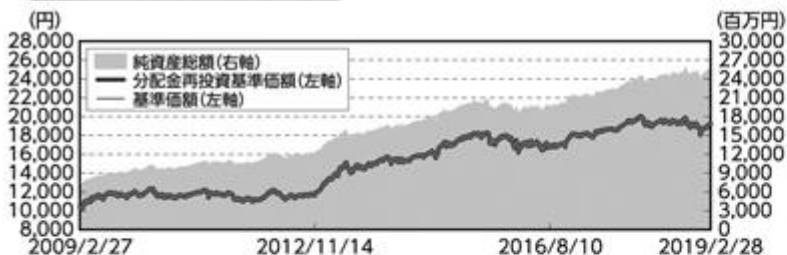
年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2019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 (2009年2月27日～2019年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
第14期	(2017.02.27)	0円
第15期	(2018.02.26)	0円
第16期	(2019.02.25)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
 ○委託会社の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:2019年2月28日

主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	42.65%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30.10%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.36%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.89%

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

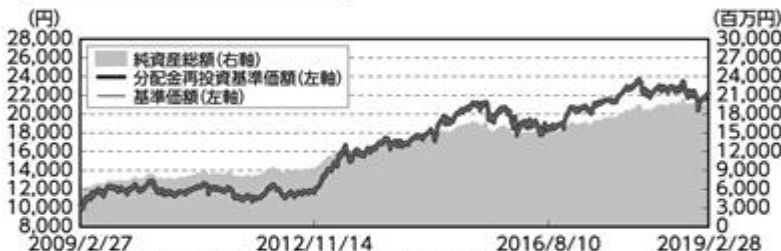
年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019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> 3成長型

基準価額・純資産の推移 (2009年2月27日～2019年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)
※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
第14期	(2017.02.27)	0円
第15期	(2018.02.26)	0円
第16期	(2019.02.25)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	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	39.87%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22.01%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.12%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.99%

※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(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019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、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社の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:2019年2月28日

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

※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。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.16%
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.79%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.66%
4	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.65%
5	ソニー	株式	日本	電気機器	1.52%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.27%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.20%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.83%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.06%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.98%

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.03%
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	0.99%
3	338回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/3/20	0.97%
4	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/9/20	0.95%
5	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/12/20	0.91%

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.93%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.87%
3	US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	アメリカ	3.500000	2020/5/15	0.79%
4	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/5/31	0.67%
5	US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/4/30	0.66%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

・お申込価額（発行価格）はお申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

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

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

・お申込手数料はありません。

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

2【換金（解約）手続等】

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。
- ・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ・解約価額の照会方法等
解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。
 - ・販売会社へのお問い合わせ
 - ・委託会社への照会
ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）
- ・換金（解約）単位は1口単位とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は2002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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

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

ロ. 信託約款の変更

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

八．関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

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

償還金請求権

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、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（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。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(平成30年2月27日から平成31年2月25日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	369,143,553	397,998,432
親投資信託受益証券	10,553,953,494	11,778,526,744
未収入金	-	944,000
流動資産合計	10,923,097,047	12,177,469,176
資産合計		
10,923,097,047		
12,177,469,176		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,458,074	20,162,212
未払受託者報酬	1,761,305	1,887,453
未払委託者報酬	13,503,671	14,470,862
その他未払費用	264,110	241,179
流動負債合計	43,987,160	36,761,706
負債合計		
43,987,160		
36,761,706		
純資産の部		
元本等		
元本	16,689,217,051	17,466,132,277
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,189,892,836	4,674,575,193
(分配準備積立金)	1,509,647,786	1,346,725,218
元本等合計	10,879,109,887	12,140,707,470
純資産合計		
10,879,109,887		
12,140,707,470		
負債純資産合計		
10,923,097,047		
12,177,469,176		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期		第16期	
	自	平成29年2月28日 平成30年2月26日	自	平成30年2月27日 平成31年2月25日
営業収益				
受取利息		180		-
有価証券売買等損益		467,749,000		36,005,250
営業収益合計		467,749,180		36,005,250
営業費用				
支払利息		239,302		299,761
受託者報酬		3,359,146		3,695,274
委託者報酬		25,754,110		28,331,048
その他費用		503,712		482,455
営業費用合計		29,856,270		32,808,538
営業利益又は営業損失()		437,892,910		3,196,712
経常利益又は経常損失()		437,892,910		3,196,712
当期純利益又は当期純損失()		437,892,910		3,196,712
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()		41,314,811		5,800,290
期首剰余金又は期首欠損金()		3,480,403,565		4,189,892,836
剰余金増加額又は欠損金減少額		868,615,874		1,009,094,179
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		868,615,874		1,009,094,179
剰余金減少額又は欠損金増加額		555,704,702		533,408,824
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		555,704,702		533,408,824
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		4,189,892,836		4,674,575,193

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年2月26日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
1. 1 期首元本額	6,231,110,374円	6,689,217,051円
期中追加設定元本額	1,447,662,999円	1,628,738,236円
期中一部解約元本額	989,556,322円	851,823,010円
2. 受益権の総数	6,689,217,051口	7,466,132,277口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26日	第16期 自 平成30年2月27日 至 平成31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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(396,643,211円)、信託約款に規定される収益調整金(2,680,465,281円)及び分配準備積立金(1,113,004,575円)より分配対象収益は4,190,113,067円(1万口当たり6,263.98円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(9,085,672円)、信託約款に規定される収益調整金(3,328,133,778円)及び分配準備積立金(1,337,639,546円)より分配対象収益は4,674,858,996円(1万口当たり6,261.42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15期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26日	第16期 自 平成30年2月27日 至 平成31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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31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15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31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	416,848,422	34,783,697
合計	416,848,422	34,783,697

(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15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.6264円	1.6261円
(1万口当たり純資産額)	(16,264円)	(16,261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31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	935,732,389	2,342,231,742	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	6,000,434,857	7,841,368,271	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	177,133,387	624,058,635	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	533,531,954	970,868,096	
親投資信託受益証券 合計		7,646,832,587	11,778,526,744	
合計		7,646,832,587	11,778,526,744	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(平成30年2月27日から平成31年2月25日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	763,629,983	830,647,583
親投資信託受益証券	23,193,287,280	25,029,515,470
未収入金	-	21,073,000
流動資産合計	23,956,917,263	25,881,236,053
資産合計	23,956,917,263	25,881,236,053
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,476,474	45,756,684
未払受託者報酬	3,873,543	4,055,503
未払委託者報酬	33,571,118	35,148,127
その他未払費用	580,952	465,680
流動負債合計	49,502,087	85,425,994
負債合計	49,502,087	85,425,994
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,346,885,396	1 13,412,455,476
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	11,560,529,780	12,383,354,583
(分配準備積立金)	5,613,716,489	5,229,228,979
元本等合計	23,907,415,176	25,795,810,059
純資産合計	23,907,415,176	25,795,810,059
負債純資産合計	23,956,917,263	25,881,236,053

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期		第16期	
	自	平成29年2月28日 平成30年2月26日	自	平成30年2月27日 平成31年2月25日
営業収益				
受取利息		390		-
有価証券売買等損益		1,635,971,054		82,308,810
営業収益合計		1,635,971,444		82,308,810
営業費用				
支払利息		516,334		642,138
受託者報酬		7,355,614		8,009,875
委託者報酬		63,749,447		69,419,700
その他費用		1,103,180		945,304
営業費用合計		72,724,575		79,017,017
営業利益又は営業損失()		1,563,246,869		161,325,827
経常利益又は経常損失()		1,563,246,869		161,325,827
当期純利益又は当期純損失()		1,563,246,869		161,325,827
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()		88,614,760		11,283,984
期首剰余金又は期首欠損金()		9,520,677,271		11,560,529,780
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,475,479,105		1,830,659,641
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,475,479,105		1,830,659,641
剰余金減少額又は欠損金増加額		910,258,705		857,792,995
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		910,258,705		857,792,995
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		11,560,529,780		12,383,354,583

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年2月26日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	11,814,239,777円 1,657,767,778円 1,125,122,159円	12,346,885,396円 1,981,921,051円 916,350,971円
2. 受益権の総数	12,346,885,396口	13,412,455,476口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26日	第16期 自 平成30年2月27日 至 平成31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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(1,474,764,614円)、信託約款に規定される収益調整金(5,947,305,750円)及び分配準備積立金(4,138,951,875円)より分配対象収益は11,561,022,239円(1万口当たり9,363.51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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(7,154,745,339円)及び分配準備積立金(5,229,228,979円)より分配対象収益は12,383,974,318円(1万口当たり9,233.19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15期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26日	第16期 自 平成30年2月27日 至 平成31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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31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15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31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	1,551,900,349	87,481,322
合計	1,551,900,349	87,481,322

(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15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.9363円	1.9233円
(1万口当たり純資産額)	(19,363円)	(19,233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31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	3,131,241,549	7,837,810,721	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,363,530,331	10,929,461,436	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	906,381,950	3,193,274,248	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,686,524,738	3,068,969,065	
親投資信託受益証券 合計		14,087,678,568	25,029,515,470	
合計		14,087,678,568	25,029,515,470	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(平成30年2月27日から平成31年2月25日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	605,779,458	646,890,967
親投資信託受益証券	18,249,068,031	19,493,551,716
未収入金	-	4,967,000
流動資産合計	18,854,847,489	20,145,409,683
資産合計	18,854,847,489	20,145,409,683
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,232,904	18,999,216
未払受託者報酬	3,046,048	3,166,921
未払委託者報酬	29,445,600	30,613,871
その他未払費用	456,824	404,264
流動負債合計	44,181,376	53,184,272
負債合計	44,181,376	53,184,272
純資産の部		
元本等		
元本	18,339,747,610	19,036,642,111
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,470,918,503	11,055,583,300
(分配準備積立金)	4,802,370,493	4,386,446,336
元本等合計	18,810,666,113	20,092,225,411
純資産合計	18,810,666,113	20,092,225,411
負債純資産合計	18,854,847,489	20,145,409,683

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期		第16期	
	自	平成29年2月28日 平成30年2月26日	自	平成30年2月27日 平成31年2月25日
営業収益				
受取利息		309		-
有価証券売買等損益		1,700,106,670		209,496,315
営業収益合計		1,700,106,979		209,496,315
営業費用				
支払利息		408,389		508,862
受託者報酬		5,748,772		6,282,028
委託者報酬		55,572,375		60,726,976
その他費用		862,153		820,071
営業費用合計		62,591,689		68,337,937
営業利益又は営業損失()		1,637,515,290		277,834,252
経常利益又は経常損失()		1,637,515,290		277,834,252
当期純利益又は当期純損失()		1,637,515,290		277,834,252
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()		133,290,623		16,868,565
期首剰余金又は期首欠損金()		8,445,032,109		10,470,918,503
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,621,639,664		1,835,753,210
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,621,639,664		1,835,753,210
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,099,977,937		990,122,726
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,099,977,937		990,122,726
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		10,470,918,503		11,055,583,300

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年2月26日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
1. 1 期首元本額	8,020,226,146円	8,339,747,610円
期中追加設定元本額	1,357,837,135円	1,485,604,296円
期中一部解約元本額	1,038,315,671円	788,709,795円
2. 受益権の総数	8,339,747,610口	9,036,642,111口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26日	第16期 自 平成30年2月27日 至 平成31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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(1,504,341,180円)、信託約款に規定される収益調整金(5,668,929,911円)及び分配準備積立金(3,298,029,313円)より分配対象収益は10,471,300,404円(1万口当たり12,555.90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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,901,308,054円)及び分配準備積立金(4,386,446,336円)より分配対象収益は11,287,754,390円(1万口当たり12,491.09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15期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26日	第16期 自 平成30年2月27日 至 平成31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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31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15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31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	1,623,527,808	217,641,409
合計	1,623,527,808	217,641,409

(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15期 平成30年2月26日現在	第16期 平成31年2月25日現在
1口当たり純資産額	2,255円	2,223円
(1万口当たり純資産額)	(22,555円)	(22,234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31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	3,222,374,092	8,065,924,589	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,372,611,721	4,407,328,997	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,088,583,348	3,835,187,993	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,750,349,034	3,185,110,137	
親投資信託受益証券 合計		9,433,918,195	19,493,551,716	
合計		9,433,918,195	19,493,551,716	

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)

「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」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30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,427,951,479	2,988,149,655
株式	2	287,790,562,310	278,573,736,940
派生商品評価勘定		55,293,624	138,927,340
未収入金		-	5,556,699,138
未収配当金		501,353,866	432,164,396
前払金		66,515,000	-
流動資産合計		292,841,676,279	287,689,677,469
資産合計		292,841,676,279	287,689,677,469
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		68,935,500	-
前受金		-	101,740,000
未払解約金		17,609,000	587,129,000
流動負債合計		86,544,500	688,869,000
負債合計		86,544,500	688,869,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	109,160,728,872	114,657,645,379
剰余金			
剰余金又は欠損金()		183,594,402,907	172,343,163,090
元本等合計		292,755,131,779	287,000,808,469
純資産合計		292,755,131,779	287,000,808,469
負債純資産合計		292,841,676,279	287,689,677,469

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30年2月26日現在	平成31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	125,576,804,116円	109,160,728,872円
同期中追加設定元本額	22,269,571,713円	38,057,953,684円
同期中一部解約元本額	38,685,646,957円	32,561,037,177円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	9,036,126,148円	12,468,295,739円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,870,405,653円	2,419,303,636円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,013,213円	3,468,286円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,146,230円	7,945,181円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,684,426円	13,800,833円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	20,360,996円	30,525,528円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	15,401,869円	22,705,105円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,840,415円	16,286,084円
たわらノーロード TOPIX	149,657,723円	401,502,285円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	14,607,726円	117,134,289円
たわらノーロード バランス（堅実型）	153,495円	3,005,990円

たわらノーロード バランス(標準型)	1,393,312円	20,772,424円
たわらノーロード バランス(積極型)	4,683,156円	41,336,359円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	14,974円	228,108円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	237,595円	12,480,260円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	811,003円	39,005,761円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	550,423円	29,677,345円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	1,175,545円	77,836,954円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	41,547円	74,811円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	37,941円	202,337円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	338,731円	1,091,080円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	364,996円	677,578円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	978,271円	2,430,418円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	36,793,469,763円	38,451,829,318円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	765,964,168円	935,732,389円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	2,673,224,321円	3,131,241,549円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	2,791,900,084円	3,222,374,092円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	329,271,189円	361,239,458円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,119,268,669円	1,178,711,664円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,054,683,588円	1,114,346,617円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	46,713,000円	40,750,146円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,161,767,467円	1,087,561,549円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	24,024,004円	25,501,335円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国10)	39,477,748円	297,908,998円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国20)	97,811,246円	200,074,391円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国30)	189,483,338円	346,992,463円
投資のソムリエ	1,008,877,316円	4,228,387,335円
クルーズコントロール	201,841,066円	1,465,176,884円
投資のソムリエ<DC年 金>	69,455,867円	401,357,411円
DIAM 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	147,946,865円	222,726,425円
DIAM DC バラン ス・F(成長型)	205,022,193円	277,769,123円
クルーズコントロール< DC年金>	74,862円	1,052,435円
DIAMコア資産設計 ファンド(堅実型)	1,239,139円	14,887,351円
DIAMコア資産設計 ファンド(積極型)	3,802,586円	33,987,494円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	22,937,313円	55,644,561円
ダイナミック・ナビゲー ション	726,871円	534,098円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド	355,728,259円	935,961,743円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー204 5)	668,403円	2,395,527円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー205 5)	513,926円	1,872,352円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド(DC)	108,503円	383,754円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー203 5)	1,237,938円	3,992,711円
4資産分散投資・スタン ダード<DC年金>	- 円	15,741,457円
リスクコントロール世界 資産分散ファンド	- 円	133,194,060円
9資産分散投資・スタン ダード<DC年金>	- 円	18,666円
DIAMワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	70,701,371円	70,041,061円

日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型) (為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	- 円	14,119,938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)	132,883,832円	116,601,135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)	292,283,119円	278,349,861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)	16,233,373円	15,178,664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)	70,408,344円	64,049,107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)	17,521,498円	16,881,660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)	21,833,378円	13,764,104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)	31,638,558円	26,737,416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)	56,259,704円	55,134,608円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,071,953,946円	1,027,917,002円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,013,017,452円	976,717,638円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,782,258,327円	2,697,902,190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)	201,418,412円	192,926,098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)	96,974,567円	52,560,495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)	591,732,801円	559,319,842円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	1,652,857,363円	336,810,390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)	10,313,671円	10,473,598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)	36,951,217円	7,863,061円
D I A M世界バランス ファンド3 5 V A (適格 機関投資家限定)	1,108,127,625円	51,615,818円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	15,040,555,136円	8,689,373,337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)	541,254,717円	152,648,549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)	1,724,496,050円	1,817,626,033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)	9,829,818,156円	10,401,405,545円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	519,843円	4,948,207円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	9,093,798円	296,109円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	3,718,064円	3,683,923円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	8,747,496,476円	9,257,927,089円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	70,015,367円	66,435,729円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	27,507,643円	28,676,956円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	18,240,489円	26,843,008円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	15,682,249円	107,564円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	109,957円	120,467円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関 投資家限定)	426,902,115円	426,124,037円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関 投資家限定)	1,323,021,834円	1,366,625,210円

	D I A M世界アセットバ ランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関 投資家限定)	1,764,382,103円		1,837,729,242円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関 投資家限定)	76,281,237円		72,976,941円
	計	109,160,728,872円		114,657,645,379円
2 .	受益権の総数	109,160,728,872口		114,657,645,379口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,661,500,000円		株式 3,387,000,000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29年2月28日 至 平成30年2月26日	自 平成30年2月27日 至 平成31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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成31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 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年2月26日現在	平成31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	4,038,133,010	8,911,066,610
合計	4,038,133,010	8,911,066,610

(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30年2月8日から平成30年2月26日まで及び平成31年2月8日から平成31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30年2月26日 現在				平成31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	5,334,250,000	-	5,320,705,000	13,545,000	7,410,197,000	-	7,549,275,000	139,078,000
合計	5,334,250,000	-	5,320,705,000	13,545,000	7,410,197,000	-	7,549,275,000	139,078,000

(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30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
1口当たり純資産額	2.6819円	2.5031円
(1万口当たり純資産額)	(26,819円)	(25,031円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成31年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,300	2,982.00	15,804,600	
日本水産	163,500	716.00	117,066,000	
マルハニチロ	23,600	3,705.00	87,438,000	
ハウスイ	900	900.00	810,000	
カネコ種苗	4,600	1,362.00	6,265,200	
サカタのタネ	19,900	3,780.00	75,222,000	
ホクト	13,700	1,956.00	26,797,200	
ホクリヨウ	2,300	636.00	1,462,800	
ヒノキヤグループ	3,500	2,303.00	8,060,500	
ショーボンドホールディングス	11,700	7,900.00	92,430,000	
ミライト・ホールディングス	46,000	1,679.00	77,234,000	
タマホーム	7,900	1,113.00	8,792,700	
サンヨーホームズ	2,500	887.00	2,217,500	
日本アクア	4,100	535.00	2,193,500	
ファーストコーポレーション	4,600	769.00	3,537,400	
ベステラ	3,200	1,366.00	4,371,200	
TATERU	20,100	274.00	5,507,400	
スペースバリューホールディングス	20,100	895.00	17,989,500	
住石ホールディングス	35,500	101.00	3,585,500	
日鉄鉱業	3,700	4,775.00	17,667,500	
三井松島ホールディングス	6,900	1,423.00	9,818,700	
国際石油開発帝石	655,400	1,134.00	743,223,600	
石油資源開発	23,500	2,365.00	55,577,500	
K&Oエナジーグループ	7,800	1,513.00	11,801,400	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	637.00	2,038,400	
第一カッター興業	1,900	1,772.00	3,366,800	
安藤・間	104,600	769.00	80,437,400	
東急建設	47,900	955.00	45,744,500	
コムシスホールディングス	57,900	2,925.00	169,357,500	
ミサワホーム	12,800	738.00	9,446,400	
ビーアールホールディングス	13,600	357.00	4,855,200	
高松コンストラクショングループ	10,200	2,676.00	27,295,200	
東建コーポレーション	5,000	6,730.00	33,650,000	
ソネック	1,800	720.00	1,296,000	
ヤマウラ	6,500	988.00	6,422,000	
大成建設	134,200	5,110.00	685,762,000	
大林組	404,200	1,057.00	427,239,400	
清水建設	412,300	959.00	395,395,700	
飛島建設	11,600	1,536.00	17,817,600	
長谷工コーポレーション	168,600	1,397.00	235,534,200	
松井建設	14,800	742.00	10,981,600	
銭高組	1,600	5,430.00	8,688,000	
鹿島建設	315,900	1,580.00	499,122,000	

不動テトラ	9,300	1,605.00	14,926,500
大木建設	4,900	962.00	4,713,800
鉄建建設	8,200	2,696.00	22,107,200
西松建設	29,000	2,558.00	74,182,000
三井住友建設	97,200	712.00	69,206,400
大豊建設	9,100	3,190.00	29,029,000
前田建設工業	96,100	1,177.00	113,109,700
佐田建設	8,700	379.00	3,297,300
ナカノフドー建設	10,400	512.00	5,324,800
奥村組	22,200	3,460.00	76,812,000
東鉄工業	16,200	2,982.00	48,308,400
イチケン	2,500	1,960.00	4,900,000
富士ビー・エス	4,300	480.00	2,064,000
浅沼組	4,800	2,686.00	12,892,800
戸田建設	156,600	707.00	110,716,200
熊谷組	19,200	3,410.00	65,472,000
青木あすなる建設	6,600	1,004.00	6,626,400
北野建設	2,800	3,130.00	8,764,000
植木組	1,700	2,373.00	4,034,100
矢作建設工業	18,200	763.00	13,886,600
ピーエス三菱	14,400	630.00	9,072,000
日本ハウスホールディングス	26,000	445.00	11,570,000
大東建託	48,000	16,025.00	769,200,000
新日本建設	16,100	1,048.00	16,872,800
N I P P O	35,600	2,101.00	74,795,600
東亜道路工業	2,500	3,115.00	7,787,500
前田道路	42,200	2,132.00	89,970,400
日本道路	3,600	6,430.00	23,148,000
東亜建設工業	11,800	1,643.00	19,387,400
若築建設	6,800	1,516.00	10,308,800
東洋建設	49,300	444.00	21,889,200
五洋建設	160,400	549.00	88,059,600
世紀東急工業	19,800	629.00	12,454,200
福田組	4,400	4,430.00	19,492,000
日本ドライケミカル	3,400	1,224.00	4,161,600
住友林業	95,400	1,452.00	138,520,800
日本基礎技術	14,000	392.00	5,488,000
巴コーポレーション	17,000	390.00	6,630,000
大和ハウス工業	373,300	3,454.00	1,289,378,200
ライト工業	26,000	1,527.00	39,702,000
積水ハウス	412,600	1,654.00	682,440,400
日特建設	11,600	615.00	7,134,000
北陸電気工事	6,600	920.00	6,072,000
ユアテック	21,500	888.00	19,092,000
四電工	2,000	2,684.00	5,368,000
中電工	17,200	2,313.00	39,783,600
関電工	61,300	1,038.00	63,629,400
きんでん	89,500	1,788.00	160,026,000
東京エネシス	13,900	969.00	13,469,100
トーエネック	3,800	3,215.00	12,217,000

住友電設	9,300	1,864.00	17,335,200
日本電設工業	23,000	2,275.00	52,325,000
協和エクシオ	52,800	2,869.00	151,483,200
新日本空調	11,400	1,886.00	21,500,400
日本工営	7,800	2,491.00	19,429,800
九電工	26,600	3,855.00	102,543,000
三機工業	30,400	1,184.00	35,993,600
日揮	116,100	1,667.00	193,538,700
中外炉工業	3,800	1,769.00	6,722,200
ヤマト	12,100	473.00	5,723,300
太平電業	9,100	2,554.00	23,241,400
高砂熱学工業	34,000	1,810.00	61,540,000
三晃金属工業	1,500	3,010.00	4,515,000
NECネットエスアイ	13,000	2,625.00	34,125,000
朝日工業社	2,700	2,959.00	7,989,300
明星工業	24,300	748.00	18,176,400
大気社	18,300	3,320.00	60,756,000
ダイダン	9,000	2,402.00	21,618,000
日比谷総合設備	12,900	1,898.00	24,484,200
東芝プラントシステム	29,200	2,070.00	60,444,000
日本製粉	40,000	1,904.00	76,160,000
日清製粉グループ本社	136,400	2,379.00	324,495,600
日東富士製粉	800	6,490.00	5,192,000
昭和産業	11,100	3,060.00	33,966,000
鳥越製粉	10,800	807.00	8,715,600
中部飼料	14,700	1,099.00	16,155,300
フィード・ワン	81,500	180.00	14,670,000
東洋精糖	2,000	1,028.00	2,056,000
日本甜菜製糖	6,800	1,875.00	12,750,000
三井製糖	9,500	2,857.00	27,141,500
塩水港精糖	13,500	225.00	3,037,500
日新製糖	5,700	2,094.00	11,935,800
LIFULL	40,700	657.00	26,739,900
ジェイエイシーリクルートメント	9,300	2,506.00	23,305,800
日本M&Aセンター	85,700	2,879.00	246,730,300
メンバーズ	4,000	1,639.00	6,556,000
中広	1,100	579.00	636,900
タケエイ	12,000	832.00	9,984,000
E・Jホールディングス	1,400	1,079.00	1,510,600
トラスト・テック	5,600	3,605.00	20,188,000
コシダカホールディングス	30,800	1,629.00	50,173,200
アルトナー	2,200	1,040.00	2,288,000
パソナグループ	14,000	1,486.00	20,804,000
CDS	2,900	1,259.00	3,651,100
リンクアンドモチベーション	21,300	913.00	19,446,900
GCA	11,600	921.00	10,683,600
エス・エム・エス	42,300	2,006.00	84,853,800
パーソルホールディングス	115,000	1,900.00	218,500,000
リニカル	6,500	1,720.00	11,180,000
クックパッド	36,700	292.00	10,716,400

エスクリ	3,200	634.00	2,028,800
アイ・ケイ・ケイ	5,800	740.00	4,292,000
森永製菓	30,400	4,895.00	148,808,000
中村屋	3,000	4,245.00	12,735,000
江崎グリコ	36,300	5,590.00	202,917,000
名糖産業	5,900	1,387.00	8,183,300
井村屋グループ	5,200	2,478.00	12,885,600
不二家	6,700	2,251.00	15,081,700
山崎製パン	98,800	1,908.00	188,510,400
第一屋製パン	2,100	1,012.00	2,125,200
モロゾフ	2,000	4,890.00	9,780,000
亀田製菓	7,500	5,290.00	39,675,000
寿スピリッツ	12,800	4,430.00	56,704,000
カルビー	55,000	3,095.00	170,225,000
森永乳業	24,200	3,515.00	85,063,000
六甲バター	8,800	2,003.00	17,626,400
ヤクルト本社	89,400	7,450.00	666,030,000
明治ホールディングス	85,500	8,710.00	744,705,000
雪印メグミルク	29,100	2,701.00	78,599,100
プリマハム	17,000	2,101.00	35,717,000
日本ハム	52,200	4,055.00	211,671,000
林兼産業	4,100	610.00	2,501,000
丸大食品	12,900	1,915.00	24,703,500
S Foods	10,900	4,300.00	46,870,000
伊藤ハム米久ホールディングス	77,600	665.00	51,604,000
学情	4,700	1,315.00	6,180,500
スタジオアリス	5,800	2,345.00	13,601,000
シミックホールディングス	6,400	1,677.00	10,732,800
システナ	42,200	1,158.00	48,867,600
N J S	2,600	1,496.00	3,889,600
デジタルアーツ	6,300	8,680.00	54,684,000
新日鉄住金ソリューションズ	17,700	2,987.00	52,869,900
総合警備保障	45,700	4,870.00	222,559,000
キューブシステム	6,400	845.00	5,408,000
いちご	151,200	384.00	58,060,800
エイジア	2,400	1,332.00	3,196,800
日本駐車場開発	144,100	156.00	22,479,600
コア	5,000	1,361.00	6,805,000
カカクコム	86,600	2,089.00	180,907,400
アイロムグループ	4,400	1,491.00	6,560,400
セントケア・ホールディング	6,400	570.00	3,648,000
サイネックス	1,800	702.00	1,263,600
ルネサンス	6,500	2,050.00	13,325,000
ディップ	18,600	2,085.00	38,781,000
S B Sホールディングス	11,900	1,872.00	22,276,800
オプトホールディング	7,100	1,706.00	12,112,600
新日本科学	15,700	821.00	12,889,700
ツクイ	27,200	725.00	19,720,000
キャリアデザインセンター	3,000	1,203.00	3,609,000
ベネフィット・ワン	15,900	4,320.00	68,688,000

エムスリー	242,200	1,797.00	435,233,400
ツカダ・グローバルホールディング	7,400	610.00	4,514,000
プラス	800	585.00	468,000
アウトソーシング	60,700	1,463.00	88,804,100
ウェルネット	11,000	1,088.00	11,968,000
ワールドホールディングス	3,200	2,038.00	6,521,600
ディー・エヌ・エー	62,000	1,706.00	105,772,000
博報堂D Yホールディングス	159,800	1,786.00	285,402,800
ぐるなび	16,500	723.00	11,929,500
エスアールジータカミヤ	12,000	689.00	8,268,000
ジャパンベストレスキューシステム	9,200	1,375.00	12,650,000
ファンコミュニケーションズ	31,800	531.00	16,885,800
ライク	4,600	996.00	4,581,600
ビジネス・ブレークスルー	4,900	399.00	1,955,100
WDBホールディングス	5,300	2,851.00	15,110,300
ティア	5,400	677.00	3,655,800
CDG	1,000	1,262.00	1,262,000
バリューコマース	7,800	2,135.00	16,653,000
インフォマート	63,100	1,280.00	80,768,000
サッポロホールディングス	44,100	2,478.00	109,279,800
アサヒグループホールディングス	252,900	4,878.00	1,233,646,200
麒麟ホールディングス	546,200	2,516.50	1,374,512,300
宝ホールディングス	90,500	1,248.00	112,944,000
オエノンホールディングス	34,500	383.00	13,213,500
養命酒製造	3,700	2,142.00	7,925,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	92,500	3,000.00	277,500,000
サントリー食品インターナショナル	80,800	5,030.00	406,424,000
ダイドーグループホールディングス	6,800	5,540.00	37,672,000
伊藤園	36,700	5,240.00	192,308,000
キーコーヒー	11,900	2,064.00	24,561,600
ユニカフェ	3,800	1,011.00	3,841,800
ジャパンフーズ	1,800	1,267.00	2,280,600
日清オイリオグループ	15,500	3,445.00	53,397,500
不二製油グループ本社	29,500	3,805.00	112,247,500
かどや製油	1,300	5,070.00	6,591,000
J・オイルミルズ	6,300	4,025.00	25,357,500
ローソン	30,000	6,820.00	204,600,000
サンエー	9,000	4,370.00	39,330,000
カワチ薬品	9,200	2,100.00	19,320,000
エービーシー・マート	18,500	6,440.00	119,140,000
ハードオフコーポレーション	4,800	823.00	3,950,400
高千穂交易	4,600	1,010.00	4,646,000
アスクル	12,400	2,612.00	32,388,800
ゲオホールディングス	18,000	1,630.00	29,340,000
アダストリア	16,400	1,906.00	31,258,400
ジーフット	6,900	691.00	4,767,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	785.00	1,177,500
伊藤忠食品	2,900	4,910.00	14,239,000
くらコーポレーション	7,000	5,830.00	40,810,000

キャンドウ	5,700	1,616.00	9,211,200
エレマテック	5,500	1,876.00	10,318,000
パルグループホールディングス	6,100	3,190.00	19,459,000
JALUX	3,400	2,510.00	8,534,000
エディオン	50,300	967.00	48,640,100
あらた	6,600	4,375.00	28,875,000
サーラコーポレーション	24,000	582.00	13,968,000
ワッツ	4,000	733.00	2,932,000
トーメンデバイス	1,800	2,501.00	4,501,800
ハローズ	4,500	2,107.00	9,481,500
J Pホールディングス	33,300	276.00	9,190,800
あみやき亭	2,600	3,665.00	9,529,000
東京エレクトロン デバイス	4,300	1,855.00	7,976,500
ひらまつ	23,800	351.00	8,353,800
フィールズ	10,400	735.00	7,644,000
双日	654,500	415.00	271,617,500
アルフレッサ ホールディングス	131,700	3,200.00	421,440,000
大黒天物産	2,800	4,000.00	11,200,000
ハニーズホールディングス	10,500	987.00	10,363,500
ファーマライズホールディングス	2,700	565.00	1,525,500
キッコーマン	79,700	5,640.00	449,508,000
味の素	266,700	1,676.50	447,122,550
キューピー	67,200	2,564.00	172,300,800
ハウス食品グループ本社	46,100	4,465.00	205,836,500
カゴメ	48,400	2,901.00	140,408,400
焼津水産化学工業	5,900	1,209.00	7,133,100
アリアケジャパン	11,000	5,930.00	65,230,000
ピエトロ	1,600	1,643.00	2,628,800
エバラ食品工業	2,600	2,176.00	5,657,600
ニチレイ	62,800	2,827.00	177,535,600
横浜冷凍	31,100	912.00	28,363,200
東洋水産	62,100	4,145.00	257,404,500
イートアンド	4,200	1,717.00	7,211,400
大冷	1,400	1,743.00	2,440,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	635.00	2,095,500
日清食品ホールディングス	51,300	7,720.00	396,036,000
永谷園ホールディングス	6,500	2,385.00	15,502,500
一正蒲鉾	4,800	1,105.00	5,304,000
フジッコ	13,100	2,253.00	29,514,300
ロック・フィールド	13,000	1,617.00	21,021,000
日本たばこ産業	697,100	2,879.00	2,006,950,900
ケンコーマヨネーズ	6,800	2,278.00	15,490,400
わらべや日洋ホールディングス	7,900	1,926.00	15,215,400
なとり	6,800	1,666.00	11,328,800
イフジ産業	2,100	711.00	1,493,100
ピクルスコーポレーション	2,900	1,902.00	5,515,800
北の達人コーポレーション	47,600	484.00	23,038,400
ユーグレナ	48,900	736.00	35,990,400
片倉工業	14,500	1,259.00	18,255,500
グンゼ	7,900	5,120.00	40,448,000

ヒューリック	247,800	1,021.00	253,003,800
神栄	1,600	764.00	1,222,400
ラサ商事	6,400	864.00	5,529,600
アルペン	9,000	1,659.00	14,931,000
ハブ	3,900	965.00	3,763,500
ラクーンホールディングス	5,800	707.00	4,100,600
クオールホールディングス	17,500	1,455.00	25,462,500
アルコニックス	12,600	1,265.00	15,939,000
神戸物産	17,900	3,780.00	67,662,000
ソリトンシステムズ	6,700	1,048.00	7,021,600
ジンズ	8,100	5,500.00	44,550,000
ビックカメラ	63,300	1,269.00	80,327,700
DCMホールディングス	63,800	1,114.00	71,073,200
ペッパーフードサービス	9,300	2,694.00	25,054,200
MonotaRO	74,900	2,624.00	196,537,600
東京一番フーズ	2,500	624.00	1,560,000
DDホールディングス	2,700	2,204.00	5,950,800
あいホールディングス	16,900	1,948.00	32,921,200
ディービーエックス	4,200	1,136.00	4,771,200
きちりホールディングス	3,100	728.00	2,256,800
アークランドサービスホールディングス	8,700	2,021.00	17,582,700
J.フロントリテイリング	151,400	1,247.00	188,795,800
ドトール・日レスホールディングス	20,800	2,154.00	44,803,200
マツモトキヨシホールディングス	49,000	3,930.00	192,570,000
ブロンコビリー	6,200	2,713.00	16,820,600
ZOZO	128,100	2,043.00	261,708,300
トレジャー・ファクトリー	3,700	764.00	2,826,800
物語コーポレーション	2,900	9,980.00	28,942,000
ココカラファイン	13,300	4,835.00	64,305,500
三越伊勢丹ホールディングス	221,600	1,108.00	245,532,800
東洋紡	49,900	1,566.00	78,143,400
ユニチカ	34,500	491.00	16,939,500
富士紡ホールディングス	6,100	2,830.00	17,263,000
日清紡ホールディングス	66,700	977.00	65,165,900
倉敷紡績	11,200	2,250.00	25,200,000
ダイワボウホールディングス	10,800	6,490.00	70,092,000
シキボウ	6,100	1,030.00	6,283,000
日東紡績	17,900	1,997.00	35,746,300
トヨタ紡織	42,000	1,858.00	78,036,000
マクニカ・富士エレホールディングス	32,800	1,571.00	51,528,800
Hamee	3,100	848.00	2,628,800
ラクト・ジャパン	2,600	8,450.00	21,970,000
ウエルシアホールディングス	31,300	4,020.00	125,826,000
クリエイトSDホールディングス	17,500	2,842.00	49,735,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,300	1,095.00	24,418,500
八洲電機	9,300	837.00	7,784,100
メディアスホールディングス	6,700	734.00	4,917,800
UKCホールディングス	7,600	2,052.00	15,595,200

ジュテックホールディングス	2,700	1,084.00	2,926,800
丸善CHIホールディングス	13,700	337.00	4,616,900
大光	3,000	618.00	1,854,000
OCHIホールディングス	3,400	1,209.00	4,110,600
TOKAIホールディングス	62,500	925.00	57,812,500
黒谷	2,000	472.00	944,000
ミサワ	2,400	435.00	1,044,000
ティーライフ	1,600	1,053.00	1,684,800
Cominix	1,900	865.00	1,643,500
エー・ピーカンパニー	2,300	513.00	1,179,900
三洋貿易	6,000	2,154.00	12,924,000
チムニー	3,600	2,685.00	9,666,000
シュッピン	8,100	798.00	6,463,800
ビューティガレージ	1,800	1,442.00	2,595,600
ウイン・パートナーズ	7,700	1,223.00	9,417,100
ネクステージ	18,400	998.00	18,363,200
ジョイフル本田	34,700	1,430.00	49,621,000
鳥貴族	4,000	1,802.00	7,208,000
キリン堂ホールディングス	4,700	1,584.00	7,444,800
ホットランド	6,300	1,367.00	8,612,100
すかいらーくホールディングス	110,500	1,704.00	188,292,000
綿半ホールディングス	4,500	2,340.00	10,530,000
日本毛織	38,700	916.00	35,449,200
ダイトウボウ	19,000	82.00	1,558,000
トーア紡コーポレーション	5,000	453.00	2,265,000
ダイドーリミテッド	14,500	355.00	5,147,500
ヨシックス	1,900	3,090.00	5,871,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34,400	1,194.00	41,073,600
三栄建築設計	4,800	1,676.00	8,044,800
スター・マイカ	5,500	1,368.00	7,524,000
野村不動産ホールディングス	79,000	2,109.00	166,611,000
三重交通グループホールディングス	24,200	607.00	14,689,400
サムティ	16,400	1,523.00	24,977,200
ディア・ライフ	15,400	432.00	6,652,800
コーセーアールイー	3,600	767.00	2,761,200
エー・ディー・ワークス	171,500	35.00	6,002,500
日本商業開発	7,500	1,525.00	11,437,500
プレサンスコーポレーション	18,900	1,422.00	26,875,800
ユニゾホールディングス	17,900	2,164.00	38,735,600
THEグローバル社	5,500	515.00	2,832,500
日本管理センター	7,900	780.00	6,162,000
サンセイランディック	3,200	756.00	2,419,200
エストラスト	1,600	783.00	1,252,800
フージャースホールディングス	26,000	683.00	17,758,000
オープンハウス	19,400	4,005.00	77,697,000
東急不動産ホールディングス	319,300	617.00	197,008,100
飯田グループホールディングス	99,000	2,029.00	200,871,000
イーグランド	1,800	713.00	1,283,400
ムゲンエステート	8,400	629.00	5,283,600

帝国繊維	13,200	2,472.00	32,630,400
日本コークス工業	101,400	100.00	10,140,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	619.00	3,033,100
ミタチ産業	2,900	741.00	2,148,900
B E E N O S	2,800	1,209.00	3,385,200
あさひ	9,900	1,480.00	14,652,000
日本調剤	4,200	3,985.00	16,737,000
コスモス薬品	5,200	20,750.00	107,900,000
シップヘルスケアホールディングス	24,700	4,355.00	107,568,500
トーエル	5,800	720.00	4,176,000
ソフトクリエイイトホールディングス	5,200	1,568.00	8,153,600
オンリー	2,100	998.00	2,095,800
セブン&アイ・ホールディングス	496,600	4,962.00	2,464,129,200
薬王堂	5,200	2,615.00	13,598,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	31,900	1,281.00	40,863,900
明治電機工業	3,800	1,819.00	6,912,200
ツルハホールディングス	25,800	9,760.00	251,808,000
デリカフーズホールディングス	2,200	1,328.00	2,921,600
スターティアホールディングス	2,400	585.00	1,404,000
サンマルクホールディングス	9,400	2,588.00	24,327,200
フェリシモ	2,700	1,145.00	3,091,500
トリドールホールディングス	14,600	2,294.00	33,492,400
帝人	96,000	1,873.00	179,808,000
東レ	914,000	789.40	721,511,600
クラレ	198,800	1,525.00	303,170,000
旭化成	838,200	1,223.00	1,025,118,600
サカイオーベックス	2,900	1,875.00	5,437,500
T O K Y O B A S E	10,700	911.00	9,747,700
稲葉製作所	6,700	1,267.00	8,488,900
宮地エンジニアリンググループ	3,700	2,093.00	7,744,100
トーカロ	30,700	921.00	28,274,700
アルファ	4,200	1,376.00	5,779,200
S U M C O	131,500	1,507.00	198,170,500
川田テクノロジーズ	2,600	6,860.00	17,836,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,400	3,245.00	7,788,000
ビーロッド	1,900	1,471.00	2,794,900
ファーストブラザーズ	3,300	1,157.00	3,818,100
ハウスドゥ	4,500	1,509.00	6,790,500
シーアールイー	4,000	932.00	3,728,000
プロパティエージェント	1,100	1,130.00	1,243,000
ケイアイスター不動産	3,200	1,734.00	5,548,800
アグレ都市デザイン	1,500	637.00	955,500
グッドコムアセット	2,100	1,506.00	3,162,600
ジェイ・エス・ビー	400	4,060.00	1,624,000
住江織物	3,200	2,735.00	8,752,000
日本フェルト	6,600	464.00	3,062,400
イチカワ	1,700	1,396.00	2,373,200
エコナックホールディングス	22,200	123.00	2,730,600
日東製網	1,400	1,363.00	1,908,200

芦森工業	2,500	1,756.00	4,390,000
アツギ	9,800	966.00	9,466,800
ウイルプラスホールディングス	1,100	724.00	796,400
ジャパンミート	4,500	1,749.00	7,870,500
コメダホールディングス	27,400	2,131.00	58,389,400
サツドラホールディングス	1,800	1,896.00	3,412,800
デファクトスタンダード	700	394.00	275,800
ダイユー・リックホールディングス	6,400	1,001.00	6,406,400
パロックジャパンリミテッド	9,600	920.00	8,832,000
クスリのアオキホールディングス	11,800	7,810.00	92,158,000
ダイニック	4,700	771.00	3,623,700
共和レザー	7,400	794.00	5,875,600
力の源ホールディングス	3,400	780.00	2,652,000
スシローグローバルホールディングス	13,000	7,110.00	92,430,000
L I X I L ビバ	10,000	1,475.00	14,750,000
セーレン	29,000	1,865.00	54,085,000
ソトー	4,600	977.00	4,494,200
東海染工	1,700	1,064.00	1,808,800
小松マテーレ	19,300	838.00	16,173,400
ワコールホールディングス	34,200	2,765.00	94,563,000
ホギメディカル	14,700	3,755.00	55,198,500
レナウン	34,500	100.00	3,450,000
クラウディアホールディングス	2,900	472.00	1,368,800
T S Iホールディングス	43,400	705.00	30,597,000
マツオカコーポレーション	3,700	3,350.00	12,395,000
ワールド	11,600	2,160.00	25,056,000
T I S	39,300	5,280.00	207,504,000
ネオス	4,100	987.00	4,046,700
電算システム	4,600	2,589.00	11,909,400
グリー	81,800	468.00	38,282,400
コーエーテクモホールディングス	24,100	1,939.00	46,729,900
三菱総合研究所	4,600	3,280.00	15,088,000
ボルテージ	2,400	578.00	1,387,200
電算	1,300	2,238.00	2,909,400
A G S	6,700	724.00	4,850,800
ファインデックス	10,000	782.00	7,820,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,700	1,628.00	4,395,600
ブレインパッド	2,300	5,000.00	11,500,000
K L a b	21,200	812.00	17,214,400
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,700	881.00	13,831,700
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	1,572.00	3,144,000
ネクソン	300,700	1,665.00	500,665,500
アイスタイル	30,400	766.00	23,286,400
エムアップ	4,100	2,088.00	8,560,800
エイチーム	7,500	1,929.00	14,467,500
テクノスジャパン	10,100	757.00	7,645,700
e n i s h	4,100	465.00	1,906,500
コロブラ	33,700	704.00	23,724,800
オルトプラス	7,300	314.00	2,292,200

ブロードリーフ	58,600	592.00	34,691,200
クロス・マーケティンググループ	3,300	446.00	1,471,800
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,327.00	7,165,800
メディアドゥホールディングス	3,500	2,402.00	8,407,000
じげん	12,700	659.00	8,369,300
ビキューブ	6,300	417.00	2,627,100
サイバーリンクス	1,900	960.00	1,824,000
ディー・エル・イー	7,500	142.00	1,065,000
フィックスターズ	11,400	1,271.00	14,489,400
CARTA HOLDINGS	6,400	1,076.00	6,886,400
オプティム	2,600	3,950.00	10,270,000
セレス	3,900	1,952.00	7,612,800
特種東海製紙	7,500	3,965.00	29,737,500
ベリサーブ	1,100	6,680.00	7,348,000
ティーガイア	11,800	2,007.00	23,682,600
セック	1,900	3,855.00	7,324,500
日本アジアグループ	12,600	373.00	4,699,800
豆蔵ホールディングス	8,100	1,039.00	8,415,900
テクマトリックス	8,300	1,829.00	15,180,700
プロシップ	3,400	1,321.00	4,491,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	284,700	310.00	88,257,000
GMOペイメントゲートウェイ	19,500	6,520.00	127,140,000
ザッパラス	5,900	390.00	2,301,000
システムリサーチ	1,600	3,005.00	4,808,000
インターネットイニシアティブ	19,300	2,451.00	47,304,300
さくらインターネット	14,400	569.00	8,193,600
ヴィンクス	4,000	1,188.00	4,752,000
GMOクラウド	2,700	3,455.00	9,328,500
SRAホールディングス	6,200	2,651.00	16,436,200
MINORIソリューションズ	2,300	1,669.00	3,838,700
システムインテグレータ	3,400	727.00	2,471,800
朝日ネット	10,100	524.00	5,292,400
eBASE	3,600	1,761.00	6,339,600
アバント	3,200	1,444.00	4,620,800
アドソル日進	4,200	1,774.00	7,450,800
フリービット	7,100	1,004.00	7,128,400
コムチュア	6,700	3,105.00	20,803,500
サイバーコム	2,100	2,511.00	5,273,100
アステリア	5,900	830.00	4,897,000
王子ホールディングス	530,500	675.00	358,087,500
日本製紙	56,400	2,182.00	123,064,800
三菱製紙	19,200	566.00	10,867,200
北越コーポレーション	78,200	643.00	50,282,600
中越バルブ工業	5,000	1,386.00	6,930,000
巴川製紙所	4,000	1,095.00	4,380,000
大王製紙	57,500	1,317.00	75,727,500
阿波製紙	3,000	452.00	1,356,000
マークライنز	4,100	1,456.00	5,969,600
メディカル・データ・ビジョン	10,500	1,155.00	12,127,500

g u m i	13,900	597.00	8,298,300
ショーケース・ティービー	2,600	793.00	2,061,800
モバイルファクトリー	3,300	1,488.00	4,910,400
テラスカイ	700	4,130.00	2,891,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,300	1,522.00	8,066,600
P C Iホールディングス	2,100	2,292.00	4,813,200
パイブドHD	2,000	851.00	1,702,000
アイピーシー	2,000	1,240.00	2,480,000
ネオジャパン	2,300	985.00	2,265,500
P R T I M E S	700	2,405.00	1,683,500
ランドコンピュータ	1,400	1,149.00	1,608,600
ダブルスタンダード	700	5,150.00	3,605,000
オープンドア	5,900	3,285.00	19,381,500
マイネット	3,900	1,074.00	4,188,600
アカツキ	4,200	5,970.00	25,074,000
ベネフィットジャパン	600	904.00	542,400
U b i c o mホールディングス	2,200	1,241.00	2,730,200
L I N E	36,000	4,060.00	146,160,000
カナミックネットワーク	1,800	1,950.00	3,510,000
ノムラシステムコーポレーション	900	728.00	655,200
レンゴー	121,600	972.00	118,195,200
トーモク	7,200	1,686.00	12,139,200
ザ・バック	8,900	3,195.00	28,435,500
チェンジ	1,500	3,810.00	5,715,000
シンクロ・フード	5,100	726.00	3,702,600
オークネット	6,300	1,049.00	6,608,700
A O I T Y O H O L D I N G S	12,900	799.00	10,307,100
マクロミル	21,000	1,379.00	28,959,000
ビーグリー	2,300	900.00	2,070,000
オロ	1,100	5,210.00	5,731,000
昭和電工	78,300	3,975.00	311,242,500
住友化学	927,100	559.00	518,248,900
住友精化	5,700	4,455.00	25,393,500
日産化学	72,400	5,820.00	421,368,000
ラサ工業	4,200	2,259.00	9,487,800
クレハ	10,900	6,830.00	74,447,000
多木化学	3,400	5,530.00	18,802,000
テイカ	9,600	2,148.00	20,620,800
石原産業	22,700	1,192.00	27,058,400
片倉コープアグリ	3,000	1,165.00	3,495,000
日東エフシー	7,300	772.00	5,635,600
日本曹達	18,600	2,941.00	54,702,600
東ソー	182,100	1,661.00	302,468,100
トクヤマ	34,000	2,871.00	97,614,000
セントラル硝子	25,700	2,566.00	65,946,200
東亜合成	73,900	1,255.00	92,744,500
大阪ソーダ	12,700	2,798.00	35,534,600
関東電化工業	28,000	900.00	25,200,000
デンカ	46,300	3,395.00	157,188,500

イビデン	73,700	1,575.00	116,077,500
信越化学工業	207,600	9,560.00	1,984,656,000
日本カーバイド工業	4,000	1,524.00	6,096,000
堺化学工業	7,800	2,380.00	18,564,000
第一稀元素化学工業	9,600	912.00	8,755,200
エア・ウォーター	96,400	1,835.00	176,894,000
大陽日酸	97,100	1,587.00	154,097,700
日本化学工業	4,000	2,403.00	9,612,000
東邦アセチレン	1,900	1,385.00	2,631,500
日本パーカラライジング	64,300	1,455.00	93,556,500
高圧ガス工業	18,700	843.00	15,764,100
チタン工業	1,500	2,341.00	3,511,500
四国化成工業	19,800	1,310.00	25,938,000
戸田工業	2,500	2,245.00	5,612,500
ステラ ケミファ	6,900	3,240.00	22,356,000
保土谷化学工業	4,100	3,390.00	13,899,000
日本触媒	19,800	7,540.00	149,292,000
大日精化工業	9,700	3,120.00	30,264,000
カネカ	31,400	4,380.00	137,532,000
協和発酵キリン	150,700	2,099.00	316,319,300
三菱瓦斯化学	121,200	1,765.00	213,918,000
三井化学	106,900	2,773.00	296,433,700
J S R	118,200	1,859.00	219,733,800
東京応化工業	20,200	3,350.00	67,670,000
大阪有機化学工業	10,900	1,235.00	13,461,500
三菱ケミカルホールディングス	787,600	825.10	649,848,760
K Hネオケム	18,000	2,937.00	52,866,000
ダイセル	183,000	1,154.00	211,182,000
住友ベークライト	20,400	4,345.00	88,638,000
積水化学工業	257,400	1,766.00	454,568,400
日本ゼオン	106,200	1,158.00	122,979,600
アイカ工業	35,300	3,910.00	138,023,000
宇部興産	59,500	2,577.00	153,331,500
積水樹脂	19,400	2,104.00	40,817,600
タキロンシーアイ	25,500	618.00	15,759,000
旭有機材	8,200	1,672.00	13,710,400
日立化成	54,500	2,027.00	110,471,500
ニチバン	6,200	2,232.00	13,838,400
リケンテクノス	32,100	467.00	14,990,700
大倉工業	6,000	1,852.00	11,112,000
積水化成品工業	17,600	959.00	16,878,400
群栄化学工業	2,900	2,801.00	8,122,900
タイガースポリマー	6,300	627.00	3,950,100
ミライアル	3,500	1,185.00	4,147,500
ダイキアクシス	4,300	1,033.00	4,441,900
ダイキョーニシカワ	24,800	1,281.00	31,768,800
竹本容器	4,300	1,463.00	6,290,900
森六ホールディングス	6,300	2,591.00	16,323,300
日本化薬	74,900	1,330.00	99,617,000
カーリットホールディングス	12,600	836.00	10,533,600

E P Sホールディングス	17,300	1,808.00	31,278,400
ソルクシーズ	5,100	666.00	3,396,600
レグス	2,900	935.00	2,711,500
プレステージ・インターナショナル	21,600	1,334.00	28,814,400
フェイス	4,200	828.00	3,477,600
ハイマックス	1,500	1,835.00	2,752,500
アミューズ	7,000	2,491.00	17,437,000
野村総合研究所	75,100	4,560.00	342,456,000
ドリームインキュベータ	3,500	1,503.00	5,260,500
サイバネットシステム	9,800	610.00	5,978,000
クイック	7,200	1,662.00	11,966,400
T A C	6,700	239.00	1,601,300
C Eホールディングス	3,200	768.00	2,457,600
ケネディクス	101,100	544.00	54,998,400
日本システム技術	2,000	1,387.00	2,774,000
電通	140,100	4,815.00	674,581,500
インテージホールディングス	15,100	852.00	12,865,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,400	1,755.00	7,722,000
東邦システムサイエンス	3,600	910.00	3,276,000
ぴあ	3,300	4,005.00	13,216,500
イオンファンタジー	3,700	2,815.00	10,415,500
ソースネクスト	46,000	503.00	23,138,000
シーティーエス	13,100	708.00	9,274,800
ネクシィーズグループ	3,600	1,717.00	6,181,200
インフォコム	4,900	4,090.00	20,041,000
メディカルシステムネットワーク	12,800	443.00	5,670,400
日本精化	9,500	1,235.00	11,732,500
扶桑化学工業	12,000	2,189.00	26,268,000
トリケミカル研究所	2,600	5,070.00	13,182,000
F I G	10,600	359.00	3,805,400
A D E K A	58,000	1,715.00	99,470,000
日油	45,400	3,805.00	172,747,000
ミヨシ油脂	4,800	1,070.00	5,136,000
新日本理化	21,900	201.00	4,401,900
ハリマ化成グループ	9,800	1,085.00	10,633,000
アルテリア・ネットワークス	9,900	1,281.00	12,681,900
花王	292,100	8,539.00	2,494,241,900
第一工業製薬	4,400	3,080.00	13,552,000
石原ケミカル	3,000	1,850.00	5,550,000
日華化学	4,000	962.00	3,848,000
ニイタカ	1,900	1,512.00	2,872,800
三洋化成工業	7,900	5,490.00	43,371,000
武田薬品工業	762,600	4,424.00	3,373,742,400
アステラス製薬	1,109,300	1,686.50	1,870,834,450
大日本住友製薬	89,200	2,768.00	246,905,600
塩野義製薬	157,400	7,121.00	1,120,845,400
田辺三菱製薬	125,800	1,540.00	193,732,000
わかもと製薬	14,300	278.00	3,975,400
あすか製薬	14,900	1,257.00	18,729,300
日本新薬	31,500	6,860.00	216,090,000

Bioフェルミン製薬	2,000	2,385.00	4,770,000
中外製薬	125,400	7,590.00	951,786,000
科研製薬	21,700	5,200.00	112,840,000
エーザイ	144,000	9,013.00	1,297,872,000
理研ビタミン	5,700	3,620.00	20,634,000
ロート製薬	61,700	2,950.00	182,015,000
小野薬品工業	284,100	2,284.50	649,026,450
久光製薬	35,500	5,500.00	195,250,000
有機合成薬品工業	8,300	198.00	1,643,400
持田製薬	9,100	11,450.00	104,195,000
参天製薬	228,100	1,676.00	382,295,600
扶桑薬品工業	4,200	2,596.00	10,903,200
日本ケミファ	1,600	2,974.00	4,758,400
ツムラ	37,300	3,465.00	129,244,500
日医工	30,100	1,594.00	47,979,400
テルモ	170,200	6,684.00	1,137,616,800
みらかホールディングス	32,100	2,945.00	94,534,500
キッセイ薬品工業	21,300	2,909.00	61,961,700
生化学工業	23,300	1,292.00	30,103,600
栄研化学	21,200	2,585.00	54,802,000
日水製薬	5,100	1,194.00	6,089,400
鳥居薬品	6,500	2,386.00	15,509,000
JCRファーマ	8,500	6,020.00	51,170,000
東和薬品	5,800	8,780.00	50,924,000
富士製薬工業	8,200	1,880.00	15,416,000
沢井製薬	24,700	6,070.00	149,929,000
ゼリア新薬工業	23,800	1,863.00	44,339,400
第一三共	344,300	3,950.00	1,359,985,000
キョーリン製薬ホールディングス	26,600	2,172.00	57,775,200
大幸薬品	5,400	1,810.00	9,774,000
ダイト	7,000	2,774.00	19,418,000
大塚ホールディングス	229,200	4,542.00	1,041,026,400
大正製薬ホールディングス	26,900	11,230.00	302,087,000
ペプチドリーム	60,000	5,110.00	306,600,000
大日本塗料	13,300	1,093.00	14,536,900
日本ペイントホールディングス	97,300	4,245.00	413,038,500
関西ペイント	132,400	2,111.00	279,496,400
神東塗料	9,400	176.00	1,654,400
中国塗料	38,800	1,003.00	38,916,400
日本特殊塗料	8,900	1,366.00	12,157,400
藤倉化成	15,800	619.00	9,780,200
太陽ホールディングス	9,700	3,770.00	36,569,000
DIC	53,300	3,595.00	191,613,500
サカタインクス	25,700	1,204.00	30,942,800
東洋インキS Cホールディングス	24,800	2,643.00	65,546,400
T & K TOKA	9,100	1,072.00	9,755,200
アルプス技研	10,100	1,995.00	20,149,500
サニックス	20,500	215.00	4,407,500
ダイオーズ	2,700	1,390.00	3,753,000
日本空調サービス	13,100	689.00	9,025,900

オリエンタルランド	135,900	12,175.00	1,654,582,500
フォーカスシステムズ	8,000	1,003.00	8,024,000
ダスキン	30,900	2,756.00	85,160,400
パーク24	69,400	2,671.00	185,367,400
明光ネットワークジャパン	14,600	930.00	13,578,000
ファルコホールディングス	6,400	1,437.00	9,196,800
クレスコ	3,600	3,385.00	12,186,000
フジ・メディア・ホールディングス	122,400	1,669.00	204,285,600
秀英予備校	2,500	498.00	1,245,000
田谷	2,100	646.00	1,356,600
ラウンドワン	35,700	1,437.00	51,300,900
リゾートトラスト	48,600	1,577.00	76,642,200
オービック	40,900	10,700.00	437,630,000
ジャストシステム	16,800	2,821.00	47,392,800
TDCソフト	10,400	937.00	9,744,800
ヤフー	770,400	308.00	237,283,200
ビー・エム・エル	14,800	3,345.00	49,506,000
ワタベウェディング	1,900	688.00	1,307,200
トレンドマイクロ	62,900	5,350.00	336,515,000
りらいあコミュニケーションズ	20,800	985.00	20,488,000
インフォメーション・ディベロプメント	3,400	1,400.00	4,760,000
リソー教育	58,600	483.00	28,303,800
日本オラクル	23,900	8,290.00	198,131,000
早稲田アカデミー	1,600	1,651.00	2,641,600
アルファシステムズ	3,700	2,657.00	9,830,900
フューチャー	16,000	1,723.00	27,568,000
CAC Holdings	8,500	1,274.00	10,829,000
ソフトバンク・テクノロジー	5,000	2,068.00	10,340,000
トーセ	3,200	842.00	2,694,400
ユー・エス・エス	140,300	2,021.00	283,546,300
オービックビジネスコンサルタント	12,100	4,425.00	53,542,500
伊藤忠テクノソリューションズ	53,800	2,658.00	143,000,400
アイティフォー	14,400	849.00	12,225,600
東京個別指導学院	4,100	1,223.00	5,014,300
東計電算	1,700	3,015.00	5,125,500
サイバーエージェント	70,900	3,445.00	244,250,500
楽天	536,100	836.00	448,179,600
エクスネット	2,300	864.00	1,987,200
クリーク・アンド・リバー社	6,800	1,167.00	7,935,600
テー・オー・ダブリュー	10,200	788.00	8,037,600
大塚商会	63,900	4,010.00	256,239,000
サイボウズ	13,900	631.00	8,770,900
ソフトブレーン	9,500	500.00	4,750,000
セントラルスポーツ	4,300	3,480.00	14,964,000
バラカ	3,100	1,900.00	5,890,000
電通国際情報サービス	7,300	3,595.00	26,243,500
デジタルガレージ	23,000	3,045.00	70,035,000
イーエムシステムズ	9,600	1,273.00	12,220,800
ウェザーニューズ	4,000	3,160.00	12,640,000

CIJ	9,300	816.00	7,588,800
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,036.00	2,239,600
日本エンタープライズ	12,700	176.00	2,235,200
WOWOW	5,700	3,045.00	17,356,500
スカラ	8,400	838.00	7,039,200
フルキャストホールディングス	11,500	2,221.00	25,541,500
エン・ジャパン	12,600	3,820.00	48,132,000
富士フィルムホールディングス	249,900	5,049.00	1,261,745,100
コニカミノルタ	262,800	1,093.00	287,240,400
資生堂	239,100	7,331.00	1,752,842,100
ライオン	167,600	2,252.00	377,435,200
高砂香料工業	8,300	3,610.00	29,963,000
マンダム	27,100	2,823.00	76,503,300
ミルボン	14,900	5,020.00	74,798,000
ファンケル	53,600	2,609.00	139,842,400
コーセー	20,400	18,260.00	372,504,000
コタ	5,800	1,494.00	8,665,200
シーボン	1,400	2,667.00	3,733,800
ポーラ・オルビスホールディングス	51,400	3,205.00	164,737,000
ノエビアホールディングス	7,700	5,340.00	41,118,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	997.00	2,791,600
エステー	8,600	1,957.00	16,830,200
アグロ カネショウ	4,900	2,096.00	10,270,400
コニシ	21,300	1,642.00	34,974,600
長谷川香料	14,400	1,756.00	25,286,400
星光PMC	8,100	895.00	7,249,500
小林製薬	33,700	9,090.00	306,333,000
荒川化学工業	10,800	1,424.00	15,379,200
メック	8,300	1,166.00	9,677,800
日本高純度化学	3,200	2,359.00	7,548,800
タカラバイオ	31,500	2,481.00	78,151,500
JCU	15,600	1,819.00	28,376,400
新田ゼラチン	7,700	721.00	5,551,700
OATアグリオ	1,700	1,740.00	2,958,000
デクセリアルズ	31,000	830.00	25,730,000
アース製薬	9,100	5,050.00	45,955,000
北興化学工業	12,500	555.00	6,937,500
大成ラミック	3,700	2,840.00	10,508,000
クミアイ化学工業	49,800	716.00	35,656,800
日本農薬	28,900	483.00	13,958,700
昭和シェル石油	111,400	1,680.00	187,152,000
富士興産	4,600	674.00	3,100,400
ニチレキ	15,400	1,125.00	17,325,000
ユシロ化学工業	6,300	1,327.00	8,360,100
ビービー・カストロール	4,300	1,351.00	5,809,300
富士石油	29,500	281.00	8,289,500
MORESCO	4,400	1,607.00	7,070,800
出光興産	93,200	3,980.00	370,936,000
JXTGホールディングス	2,023,400	536.20	1,084,947,080
コスモエネルギーホールディングス	34,900	2,386.00	83,271,400

横浜ゴム	69,700	2,283.00	159,125,100
TOYO TIRE	61,800	1,364.00	84,295,200
ブリヂストン	369,800	4,452.00	1,646,349,600
住友ゴム工業	108,100	1,407.00	152,096,700
藤倉ゴム工業	10,700	438.00	4,686,600
オカモト	8,400	5,830.00	48,972,000
アキレス	8,700	2,033.00	17,687,100
フコク	5,400	886.00	4,784,400
ニッタ	13,600	3,890.00	52,904,000
クリエートメディック	4,000	999.00	3,996,000
住友理工	23,300	1,044.00	24,325,200
三ツ星ベルト	15,800	2,194.00	34,665,200
バンドー化学	22,900	1,190.00	27,251,000
A G C	118,900	3,855.00	458,359,500
日本板硝子	57,600	974.00	56,102,400
石塚硝子	1,600	1,746.00	2,793,600
有沢製作所	19,000	837.00	15,903,000
日本山村硝子	5,100	1,512.00	7,711,200
日本電気硝子	52,000	3,065.00	159,380,000
オハラ	4,800	1,783.00	8,558,400
住友大阪セメント	24,300	4,665.00	113,359,500
太平洋セメント	76,000	3,795.00	288,420,000
リソルホールディングス	1,300	4,360.00	5,668,000
日本ヒューム	12,100	835.00	10,103,500
日本コンクリート工業	26,200	289.00	7,571,800
三谷セキサン	5,600	2,979.00	16,682,400
アジアパイルホールディングス	17,200	650.00	11,180,000
東海カーボン	109,300	1,606.00	175,535,800
日本カーボン	5,800	5,310.00	30,798,000
東洋炭素	7,100	2,227.00	15,811,700
ノリタケカンパニーリミテド	7,200	5,530.00	39,816,000
TOTO	92,500	4,310.00	398,675,000
日本碍子	146,700	1,725.00	253,057,500
日本特殊陶業	101,500	2,429.00	246,543,500
ダントーホールディングス	9,400	120.00	1,128,000
MARUWA	4,200	6,340.00	26,628,000
品川リフラクトリーズ	3,200	3,515.00	11,248,000
黒崎播磨	2,400	5,940.00	14,256,000
ヨータイ	10,700	615.00	6,580,500
イソライト工業	6,300	572.00	3,603,600
東京窯業	15,400	411.00	6,329,400
ニッカトー	5,500	1,057.00	5,813,500
フジミインコーポレーテッド	10,700	2,380.00	25,466,000
クニミネ工業	4,100	835.00	3,423,500
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,161.00	2,786,400
ニチアス	32,900	2,109.00	69,386,100
新日鐵住金	552,700	2,030.50	1,122,257,350
神戸製鋼所	217,700	877.00	190,922,900
中山製鋼所	16,300	498.00	8,117,400
合同製鐵	5,800	1,723.00	9,993,400

ジェイ エフ イー ホールディングス	321,200	1,941.00	623,449,200
東京製鐵	63,800	903.00	57,611,400
共英製鋼	13,400	1,758.00	23,557,200
大和工業	25,300	3,085.00	78,050,500
東京鐵鋼	4,900	1,186.00	5,811,400
大阪製鐵	7,900	1,856.00	14,662,400
淀川製鋼所	16,000	2,214.00	35,424,000
丸一鋼管	42,100	3,330.00	140,193,000
モリ工業	3,600	2,605.00	9,378,000
大同特殊鋼	19,500	4,745.00	92,527,500
日本高周波鋼業	4,300	537.00	2,309,100
日本冶金工業	98,700	249.00	24,576,300
山陽特殊製鋼	15,000	2,539.00	38,085,000
愛知製鋼	6,600	3,550.00	23,430,000
日立金属	128,200	1,128.00	144,609,600
日本金属	2,800	1,343.00	3,760,400
大平洋金属	8,100	2,963.00	24,000,300
新日本電工	71,400	236.00	16,850,400
栗本鐵工所	6,000	1,540.00	9,240,000
虹 技	1,800	1,402.00	2,523,600
日本鑄鉄管	1,300	931.00	1,210,300
日本製鋼所	36,100	2,061.00	74,402,100
三菱製鋼	8,800	1,659.00	14,599,200
日亜鋼業	17,200	339.00	5,830,800
日本精線	1,700	3,455.00	5,873,500
エンビプロ・ホールディングス	2,500	675.00	1,687,500
大紀アルミニウム工業所	19,700	628.00	12,371,600
日本軽金属ホールディングス	324,000	244.00	79,056,000
三井金属鉱業	32,100	2,721.00	87,344,100
東邦亜鉛	6,600	3,340.00	22,044,000
三菱マテリアル	78,500	3,115.00	244,527,500
住友金属鉱山	162,900	3,345.00	544,900,500
DOWAホールディングス	27,800	3,585.00	99,663,000
古河機械金属	19,600	1,494.00	29,282,400
エス・サイエンス	53,500	62.00	3,317,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,800	1,724.00	23,791,200
東邦チタニウム	21,400	953.00	20,394,200
UACJ	18,100	2,238.00	40,507,800
CKサンエツ	2,200	3,450.00	7,590,000
古河電気工業	34,300	3,605.00	123,651,500
住友電気工業	444,600	1,567.00	696,688,200
フジクラ	143,700	495.00	71,131,500
昭和電線ホールディングス	13,900	718.00	9,980,200
東京特殊電線	1,500	2,184.00	3,276,000
タツタ電線	23,700	511.00	12,110,700
カナレ電気	2,000	1,879.00	3,758,000
平河ヒューテック	5,000	1,670.00	8,350,000
リョービ	14,600	2,796.00	40,821,600
アーレスティ	14,700	696.00	10,231,200

アサヒホールディングス	22,400	2,193.00	49,123,200
東洋製罐グループホールディングス	75,800	2,339.00	177,296,200
ホッカンホールディングス	6,000	1,771.00	10,626,000
コロナ	6,500	1,064.00	6,916,000
横河ブリッジホールディングス	22,200	2,002.00	44,444,400
OSJBホールディングス	59,900	282.00	16,891,800
駒井ハルテック	2,300	1,980.00	4,554,000
高田機工	1,000	2,680.00	2,680,000
三和ホールディングス	122,900	1,304.00	160,261,600
文化シャッター	35,100	837.00	29,378,700
三協立山	16,500	1,497.00	24,700,500
アルインコ	9,400	995.00	9,353,000
東洋シャッター	3,000	720.00	2,160,000
LIXILグループ	175,600	1,530.00	268,668,000
日本ファイルコン	9,300	536.00	4,984,800
ノーリツ	26,500	1,655.00	43,857,500
長府製作所	12,000	2,224.00	26,688,000
リンナイ	21,200	7,420.00	157,304,000
ユニプレス	23,200	2,028.00	47,049,600
ダイニチ工業	6,400	723.00	4,627,200
日東精工	16,500	547.00	9,025,500
三洋工業	1,500	1,872.00	2,808,000
岡部	24,100	980.00	23,618,000
ジーテクト	13,100	1,702.00	22,296,200
中国工業	1,900	561.00	1,065,900
東プレ	22,200	2,415.00	53,613,000
高周波熱錬	22,800	899.00	20,497,200
東京製綱	7,300	1,035.00	7,555,500
サンコール	6,800	705.00	4,794,000
モリテックスチール	9,400	451.00	4,239,400
パイオラックス	19,100	2,358.00	45,037,800
エイチワン	11,700	1,113.00	13,022,100
日本発条	118,500	1,056.00	125,136,000
中央発條	1,400	2,971.00	4,159,400
アドバネクス	1,600	1,790.00	2,864,000
三浦工業	51,500	2,604.00	134,106,000
タクマ	43,400	1,533.00	66,532,200
テクノプロ・ホールディングス	23,100	6,070.00	140,217,000
アトラ	2,300	403.00	926,900
インターワークス	2,300	743.00	1,708,900
アイ・アールジャパンホールディングス	3,600	1,473.00	5,302,800
Keeper 技研	3,900	1,138.00	4,438,200
ファーストロジック	2,300	703.00	1,616,900
三機サービス	1,900	1,457.00	2,768,300
Gunosy	7,200	2,579.00	18,568,800
デザインワン・ジャパン	2,300	329.00	756,700
イー・ガーディアン	5,500	2,203.00	12,116,500
リブセンス	6,300	285.00	1,795,500
ジャパンマテリアル	31,500	1,450.00	45,675,000

ベクトル	14,100	1,467.00	20,684,700
ウチヤマホールディングス	5,900	449.00	2,649,100
ライクキッズネクスト	2,500	887.00	2,217,500
キャリアリンク	4,300	408.00	1,754,400
I B J	7,800	881.00	6,871,800
アサンテ	4,700	2,199.00	10,335,300
N・フィールド	7,500	881.00	6,607,500
バリューHR	2,500	2,214.00	5,535,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,900	5,300.00	15,370,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,189.00	5,707,200
E R Iホールディングス	3,300	808.00	2,666,400
アビスト	1,800	3,300.00	5,940,000
シグマクシス	5,500	954.00	5,247,000
ウィルグループ	7,500	1,340.00	10,050,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,100	263.00	4,234,300
日本ビューホテル	3,800	1,132.00	4,301,600
リクルートホールディングス	823,600	3,072.00	2,530,099,200
エラン	8,000	1,473.00	11,784,000
ツガミ	26,800	788.00	21,118,400
オークマ	15,100	6,160.00	93,016,000
東芝機械	13,400	2,301.00	30,833,400
アマダホールディングス	183,500	1,187.00	217,814,500
アイダエンジニアリング	32,900	834.00	27,438,600
滝澤鉄工所	3,700	1,748.00	6,467,600
F U J I	35,600	1,594.00	56,746,400
牧野フライス製作所	13,900	4,685.00	65,121,500
オーエスジー	58,600	2,246.00	131,615,600
ダイジェット工業	1,400	1,696.00	2,374,400
旭ダイヤモンド工業	31,200	824.00	25,708,800
D M G 森精機	75,300	1,491.00	112,272,300
ソディック	26,000	863.00	22,438,000
ディスコ	16,100	16,310.00	262,591,000
日東工器	6,500	2,323.00	15,099,500
日進工具	3,500	2,468.00	8,638,000
パンチ工業	8,300	635.00	5,270,500
富士ダイス	5,300	719.00	3,810,700
土木管理総合試験所	5,100	528.00	2,692,800
日本郵政	942,200	1,346.00	1,268,201,200
ベルシステム24ホールディングス	19,300	1,530.00	29,529,000
鎌倉新書	8,400	1,889.00	15,867,600
一蔵	1,300	615.00	799,500
L I T A L I C O	2,700	1,987.00	5,364,900
グローバルグループ	1,400	883.00	1,236,200
エポラブルアジア	3,300	2,685.00	8,860,500
アトラエ	2,200	3,445.00	7,579,000
ストライク	3,000	2,165.00	6,495,000
ソラスト	28,000	1,174.00	32,872,000
セラク	2,600	600.00	1,560,000
インソース	3,800	2,414.00	9,173,200

豊田自動織機	97,300	5,700.00	554,610,000
豊和工業	6,600	860.00	5,676,000
OKK	4,900	856.00	4,194,400
石川製作所	2,900	1,204.00	3,491,600
東洋機械金属	8,700	617.00	5,367,900
津田駒工業	2,600	1,999.00	5,197,400
エンシュウ	3,100	1,222.00	3,788,200
島精機製作所	16,400	3,885.00	63,714,000
オプトラ	11,600	2,272.00	26,355,200
NCホールディングス	3,800	487.00	1,850,600
フリュー	9,700	1,037.00	10,058,900
ヤマシンフィルタ	20,700	729.00	15,090,300
日阪製作所	14,700	900.00	13,230,000
やまびこ	23,000	1,069.00	24,587,000
平田機工	5,600	6,880.00	38,528,000
ペガサスミシン製造	11,200	679.00	7,604,800
マルマエ	3,300	724.00	2,389,200
タツモ	3,800	846.00	3,214,800
ナプテスコ	65,400	3,020.00	197,508,000
三井海洋開発	12,600	3,065.00	38,619,000
レオン自動機	11,700	1,663.00	19,457,100
SMC	35,200	41,230.00	1,451,296,000
新川	9,100	525.00	4,777,500
ホソカワミクロン	4,200	4,920.00	20,664,000
ユニオンツール	5,200	3,095.00	16,094,000
オイレス工業	16,600	1,959.00	32,519,400
日精エー・エス・ビー機械	3,500	4,105.00	14,367,500
サトーホールディングス	14,400	2,741.00	39,470,400
技研製作所	8,300	3,435.00	28,510,500
日本エアーテック	3,800	595.00	2,261,000
カワタ	2,500	1,459.00	3,647,500
日精樹脂工業	10,000	917.00	9,170,000
オカダアイオン	4,100	1,500.00	6,150,000
ワイエイシイホールディングス	4,900	827.00	4,052,300
小松製作所	544,700	2,851.00	1,552,939,700
住友重機械工業	68,800	3,920.00	269,696,000
日立建機	48,200	2,918.00	140,647,600
日工	3,300	2,231.00	7,362,300
巴工業	5,200	2,343.00	12,183,600
井関農機	12,000	1,642.00	19,704,000
TOWA	10,400	700.00	7,280,000
丸山製作所	2,600	1,341.00	3,486,600
北川鉄工所	5,400	2,401.00	12,965,400
シンニッタン	18,700	347.00	6,488,900
ローツェ	5,300	1,718.00	9,105,400
タカキタ	4,300	617.00	2,653,100
クボタ	644,500	1,571.50	1,012,831,750
荏原実業	3,500	2,203.00	7,710,500
東洋エンジニアリング	16,000	749.00	11,984,000
三菱化工機	4,200	1,564.00	6,568,800

月島機械	23,900	1,391.00	33,244,900
帝国電機製作所	8,400	1,275.00	10,710,000
東京機械製作所	4,700	415.00	1,950,500
新東工業	28,400	1,047.00	29,734,800
澁谷工業	10,500	3,345.00	35,122,500
アイチコーポレーション	20,900	712.00	14,880,800
小森コーポレーション	32,400	1,221.00	39,560,400
鶴見製作所	9,300	1,797.00	16,712,100
住友精密工業	2,000	2,887.00	5,774,000
酒井重工業	2,300	2,344.00	5,391,200
荏原製作所	53,300	3,140.00	167,362,000
石井鐵工所	1,900	1,789.00	3,399,100
西島製作所	12,200	950.00	11,590,000
北越工業	12,400	1,204.00	14,929,600
千代田化工建設	97,400	310.00	30,194,000
ダイキン工業	164,200	12,200.00	2,003,240,000
オルガノ	4,300	3,210.00	13,803,000
トーヨーカネツ	4,500	2,285.00	10,282,500
栗田工業	65,100	2,890.00	188,139,000
椿本チエイン	15,700	4,125.00	64,762,500
大同工業	5,700	901.00	5,135,700
日機装	38,900	1,267.00	49,286,300
木村化工機	10,000	396.00	3,960,000
新興プランテック	24,200	1,252.00	30,298,400
アネスト岩田	18,700	1,005.00	18,793,500
ダイフク	66,200	5,760.00	381,312,000
サムコ	3,400	959.00	3,260,600
加藤製作所	6,200	2,732.00	16,938,400
油研工業	2,000	1,883.00	3,766,000
タダノ	58,000	1,181.00	68,498,000
フジテック	43,700	1,267.00	55,367,900
CKD	33,500	1,047.00	35,074,500
キトー	9,100	1,848.00	16,816,800
平和	33,500	2,218.00	74,303,000
理想科学工業	10,600	1,949.00	20,659,400
SANKYO	30,100	4,080.00	122,808,000
日本金銭機械	13,300	1,105.00	14,696,500
マースグループホールディングス	7,600	2,180.00	16,568,000
福島工業	7,400	3,920.00	29,008,000
オーイズミ	5,000	367.00	1,835,000
ダイコク電機	5,500	1,500.00	8,250,000
竹内製作所	20,100	2,054.00	41,285,400
アマノ	34,400	2,385.00	82,044,000
JUKI	16,700	1,326.00	22,144,200
サンデンホールディングス	14,800	838.00	12,402,400
蛇の目ミシン工業	11,000	489.00	5,379,000
ブラザー工業	156,700	2,077.00	325,465,900
マックス	18,500	1,494.00	27,639,000
モリタホールディングス	21,000	1,835.00	38,535,000
グローリー	33,300	2,679.00	89,210,700

新晃工業	11,200	1,585.00	17,752,000
大和冷機工業	17,400	1,238.00	21,541,200
セガサミーホールディングス	119,400	1,320.00	157,608,000
日本ピストンリング	4,400	1,697.00	7,466,800
リケン	5,600	5,340.00	29,904,000
T P R	16,200	2,434.00	39,430,800
ツバキ・ナカシマ	18,300	2,024.00	37,039,200
ホシザキ	35,200	7,860.00	276,672,000
大豊工業	9,800	996.00	9,760,800
日本精工	247,000	1,054.00	260,338,000
N T N	258,300	359.00	92,729,700
ジェイテクト	115,300	1,397.00	161,074,100
不二越	11,200	4,570.00	51,184,000
ミネベアミツミ	223,400	1,821.00	406,811,400
日本トムソン	35,800	561.00	20,083,800
T H K	75,000	2,858.00	214,350,000
ユーシン精機	9,400	1,087.00	10,217,800
前澤給装工業	4,700	1,925.00	9,047,500
イーグル工業	14,800	1,349.00	19,965,200
前澤工業	8,100	358.00	2,899,800
日本ビラー工業	12,200	1,415.00	17,263,000
キッツ	48,800	831.00	40,552,800
日立製作所	541,600	3,500.00	1,895,600,000
三菱電機	1,202,900	1,433.00	1,723,755,700
富士電機	78,100	3,590.00	280,379,000
東洋電機製造	4,800	1,318.00	6,326,400
安川電機	139,500	3,400.00	474,300,000
シンフォニアテクノロジー	16,700	1,379.00	23,029,300
明電舎	23,800	1,650.00	39,270,000
オリジン電気	3,300	2,310.00	7,623,000
山洋電気	5,800	4,190.00	24,302,000
デンヨー	11,100	1,437.00	15,950,700
ベイカレント・コンサルティング	6,100	3,370.00	20,557,000
アイモバイル	2,800	881.00	2,466,800
キャリアインデックス	4,000	899.00	3,596,000
M S - J a p a n	4,700	1,784.00	8,384,800
船場	2,000	948.00	1,896,000
グレイステクノロジー	3,100	2,233.00	6,922,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,800	2,113.00	14,368,400
フルテック	1,300	1,127.00	1,465,100
グリーンズ	2,600	1,440.00	3,744,000
ツナグ・ソリューションズ	1,000	629.00	629,000
日総工産	2,900	2,627.00	7,618,300
キュービーネットホールディングス	5,300	2,075.00	10,997,500
三櫻工業	15,500	558.00	8,649,000
マキタ	146,400	4,015.00	587,796,000
東芝テック	15,100	3,105.00	46,885,500
芝浦メカトロニクス	2,200	3,655.00	8,041,000
マブチモーター	33,300	3,900.00	129,870,000

日本電産	144,800	14,115.00	2,043,852,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,500	1,892.00	12,298,000
トレックス・セミコンダクター	4,100	1,169.00	4,792,900
東光高岳	6,100	1,420.00	8,662,000
ダブル・スコープ	17,600	1,427.00	25,115,200
宮越ホールディングス	4,500	1,072.00	4,824,000
ダイヘン	13,200	2,742.00	36,194,400
田淵電機	16,500	124.00	2,046,000
ヤーマン	17,500	1,443.00	25,252,500
JVCケンウッド	89,900	270.00	24,273,000
ミマキエンジニアリング	10,800	770.00	8,316,000
第一精工	5,100	1,081.00	5,513,100
日新電機	28,200	1,026.00	28,933,200
大崎電気工業	24,100	692.00	16,677,200
オムロン	127,800	4,940.00	631,332,000
日東工業	19,300	2,281.00	44,023,300
I D E C	16,200	2,128.00	34,473,600
不二電機工業	1,300	1,305.00	1,696,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43,200	2,292.00	99,014,400
サクサホールディングス	3,000	1,863.00	5,589,000
メルコホールディングス	5,000	3,900.00	19,500,000
テクノメディカ	2,700	2,111.00	5,699,700
日本電気	155,700	3,770.00	586,989,000
富士通	116,000	7,594.00	880,904,000
沖電気工業	52,100	1,304.00	67,938,400
岩崎通信機	5,700	826.00	4,708,200
電気興業	6,300	2,714.00	17,098,200
サンケン電気	14,100	2,275.00	32,077,500
ナカヨ	2,300	1,412.00	3,247,600
アイホン	6,800	1,745.00	11,866,000
ルネサスエレクトロニクス	124,600	680.00	84,728,000
セイコーエプソン	149,200	1,675.00	249,910,000
ワコム	87,100	471.00	41,024,100
アルバック	24,000	3,345.00	80,280,000
アクセル	5,000	515.00	2,575,000
E I Z O	11,000	4,700.00	51,700,000
ジャパンディスプレイ	285,300	73.00	20,826,900
日本信号	30,600	990.00	30,294,000
京三製作所	25,900	406.00	10,515,400
能美防災	15,900	2,020.00	32,118,000
ホーチキ	7,700	1,156.00	8,901,200
星和電機	4,100	431.00	1,767,100
エレコム	11,100	3,385.00	37,573,500
パナソニック	1,374,300	1,053.50	1,447,825,050
シャープ	119,400	1,371.00	163,697,400
アンリツ	77,400	2,207.00	170,821,800
富士通ゼネラル	36,800	1,523.00	56,046,400
ソニー	806,900	5,377.00	4,338,701,300
T D K	62,900	9,030.00	567,987,000
帝国通信工業	5,300	1,211.00	6,418,300

タムラ製作所	46,500	599.00	27,853,500
アルプスアルパイン	125,200	2,303.00	288,335,600
池上通信機	3,800	1,161.00	4,411,800
バイオニア	202,800	65.00	13,182,000
日本電波工業	11,100	366.00	4,062,600
鈴木	6,100	676.00	4,123,600
日本トリム	2,300	5,560.00	12,788,000
ローランド ディー・ジー	6,100	2,229.00	13,596,900
フォスター電機	14,100	1,602.00	22,588,200
クラリオン	10,700	2,499.00	26,739,300
S M K	3,400	2,697.00	9,169,800
ヨコオ	8,600	1,616.00	13,897,600
ティアック	8,600	202.00	1,737,200
ホシデン	35,400	934.00	33,063,600
ヒロセ電機	17,200	11,830.00	203,476,000
日本航空電子工業	27,600	1,485.00	40,986,000
T O A	12,900	1,031.00	13,299,900
マクセルホールディングス	25,900	1,645.00	42,605,500
古野電気	15,500	975.00	15,112,500
ユニデンホールディングス	3,600	2,304.00	8,294,400
スミダコーポレーション	10,300	1,488.00	15,326,400
アイコム	6,600	2,246.00	14,823,600
リオン	5,500	1,920.00	10,560,000
本多通信工業	10,400	570.00	5,928,000
船井電機	12,200	792.00	9,662,400
横河電機	120,400	2,175.00	261,870,000
新電元工業	4,200	4,465.00	18,753,000
アズビル	77,700	2,471.00	191,996,700
東亜ディーケーケー	6,000	857.00	5,142,000
日本光電工業	53,000	3,335.00	176,755,000
チノー	4,200	1,321.00	5,548,200
共和電業	12,500	374.00	4,675,000
日本電子材料	4,700	723.00	3,398,100
堀場製作所	23,800	5,900.00	140,420,000
アドバンテスト	82,000	2,608.00	213,856,000
小野測器	5,700	614.00	3,499,800
エスベック	10,700	2,089.00	22,352,300
キーエンス	59,000	68,050.00	4,014,950,000
日置電機	6,300	4,415.00	27,814,500
シスメックス	93,700	6,913.00	647,748,100
日本マイクロニクス	19,500	799.00	15,580,500
メガチップス	9,500	2,099.00	19,940,500
O B A R A G R O U P	7,000	3,935.00	27,545,000
I M A G I C A G R O U P	10,100	492.00	4,969,200
澤藤電機	1,500	1,709.00	2,563,500
デンソー	264,900	4,847.00	1,283,970,300
原田工業	3,800	977.00	3,712,600
コーセル	15,300	1,192.00	18,237,600
イリソ電子工業	11,000	5,010.00	55,110,000
オプテックスグループ	21,200	2,047.00	43,396,400

千代田インテグレ	5,000	2,169.00	10,845,000
アイ・オー・データ機器	4,500	1,166.00	5,247,000
レーザーテック	24,700	4,120.00	101,764,000
スタンレー電気	85,000	3,245.00	275,825,000
岩崎電気	4,700	1,384.00	6,504,800
ウシオ電機	72,900	1,300.00	94,770,000
岡谷電機産業	8,700	387.00	3,366,900
ヘリオス テクノ ホールディング	11,200	713.00	7,985,600
エノモト	2,500	951.00	2,377,500
日本セラミック	12,200	2,877.00	35,099,400
遠藤照明	6,100	717.00	4,373,700
古河電池	8,700	757.00	6,585,900
双信電機	5,900	427.00	2,519,300
山一電機	8,800	1,170.00	10,296,000
図研	7,800	1,589.00	12,394,200
日本電子	23,800	1,858.00	44,220,400
カシオ計算機	106,400	1,539.00	163,749,600
ファナック	114,300	19,330.00	2,209,419,000
日本シイエムケイ	30,700	685.00	21,029,500
エンプラス	5,400	3,040.00	16,416,000
大真空	4,400	877.00	3,858,800
ローム	58,100	7,410.00	430,521,000
浜松ホトニクス	86,300	4,050.00	349,515,000
三井ハイテック	13,300	1,026.00	13,645,800
新光電気工業	40,400	832.00	33,612,800
京セラ	183,400	6,261.00	1,148,267,400
協栄産業	1,400	1,619.00	2,266,600
太陽誘電	53,500	2,356.00	126,046,000
村田製作所	126,200	17,920.00	2,261,504,000
ユーシン	19,100	982.00	18,756,200
双葉電子工業	19,600	1,770.00	34,692,000
日東電工	90,900	5,981.00	543,672,900
北陸電気工業	4,500	1,076.00	4,842,000
東海理化電機製作所	31,600	2,048.00	64,716,800
ニチコン	37,900	1,018.00	38,582,200
日本ケミコン	8,600	2,134.00	18,352,400
K O A	18,200	1,625.00	29,575,000
三井E & Sホールディングス	43,500	1,243.00	54,070,500
日立造船	95,100	350.00	33,285,000
三菱重工業	201,600	4,402.00	887,443,200
川崎重工業	93,600	2,882.00	269,755,200
I H I	92,400	2,995.00	276,738,000
名村造船所	36,200	418.00	15,131,600
サノヤスホールディングス	16,000	178.00	2,848,000
スプリックス	3,200	2,726.00	8,723,200
日本車輛製造	4,400	2,756.00	12,126,400
三菱ロジスネクスト	14,300	1,464.00	20,935,200
近畿車輛	1,800	2,091.00	3,763,800
F P G	37,400	1,031.00	38,559,400
島根銀行	2,700	708.00	1,911,600

じもとホールディングス	81,100	125.00	10,137,500	
全国保証	33,400	4,010.00	133,934,000	
めぶきフィナンシャルグループ	616,100	305.00	187,910,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,000	1,596.00	25,536,000	
九州フィナンシャルグループ	194,600	456.00	88,737,600	
かんぼ生命保険	44,800	2,492.00	111,641,600	
ゆうちょ銀行	335,900	1,249.00	419,539,100	
富山第一銀行	28,100	384.00	10,790,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	755,800	462.00	349,179,600	
ジェイリース	2,600	387.00	1,006,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	75,900	995.00	75,520,500	
マーキュリアインベストメント	4,700	709.00	3,332,300	
イントラスト	3,400	434.00	1,475,600	
日本モーゲージサービス	1,600	1,330.00	2,128,000	
CASA	4,100	1,067.00	4,374,700	
アルヒ	10,800	2,115.00	22,842,000	
プレミアグループ	2,500	3,500.00	8,750,000	
日産自動車	1,418,700	952.80	1,351,737,360	
いすゞ自動車	380,300	1,606.50	610,951,950	
トヨタ自動車	1,340,600	6,774.00	9,081,224,400	*
日野自動車	150,100	1,038.00	155,803,800	
三菱自動車工業	445,100	635.00	282,638,500	
エフテック	8,500	990.00	8,415,000	
レシップホールディングス	4,500	731.00	3,289,500	
GMB	2,400	954.00	2,289,600	
ファルテック	2,100	916.00	1,923,600	
武蔵精密工業	28,900	1,587.00	45,864,300	
日産車体	23,500	1,010.00	23,735,000	
新明和工業	54,000	1,384.00	74,736,000	
極東開発工業	24,000	1,505.00	36,120,000	
日信工業	21,900	1,574.00	34,470,600	
トピー工業	9,900	2,403.00	23,789,700	
ティラド	4,400	2,389.00	10,511,600	
曙ブレーキ工業	66,700	170.00	11,339,000	
タチエス	20,500	1,703.00	34,911,500	
NOK	64,600	1,812.00	117,055,200	
フタバ産業	33,600	602.00	20,227,200	
KYB	12,500	3,015.00	37,687,500	
市光工業	18,100	691.00	12,507,100	
大同メタル工業	19,600	803.00	15,738,800	
プレス工業	59,600	612.00	36,475,200	
ミクニ	15,500	493.00	7,641,500	
太平洋工業	25,200	1,784.00	44,956,800	
ケーヒン	27,600	1,969.00	54,344,400	
河西工業	14,800	933.00	13,808,400	
アイシン精機	99,100	4,390.00	435,049,000	
マツダ	377,500	1,298.00	489,995,000	
今仙電機製作所	11,200	1,025.00	11,480,000	

本田技研工業	1,014,900	3,151.00	3,197,949,900
スズキ	220,100	5,788.00	1,273,938,800
S U B A R U	373,500	2,844.00	1,062,234,000
安永	5,900	1,558.00	9,192,200
ヤマハ発動機	169,900	2,323.00	394,677,700
ショーワ	28,400	1,597.00	45,354,800
小糸製作所	72,100	6,690.00	482,349,000
T B K	14,300	436.00	6,234,800
エクセディ	16,300	2,659.00	43,341,700
ミツバ	22,200	721.00	16,006,200
豊田合成	38,800	2,499.00	96,961,200
愛三工業	18,700	758.00	14,174,600
盟和産業	1,900	1,078.00	2,048,200
日本プラスト	9,500	847.00	8,046,500
ヨロズ	11,200	1,627.00	18,222,400
エフ・シー・シー	21,600	2,667.00	57,607,200
新家工業	2,700	1,679.00	4,533,300
シマノ	48,500	17,570.00	852,145,000
テイ・エス テック	27,900	3,270.00	91,233,000
関西みらいフィナンシャルグループ	55,800	824.00	45,979,200
三十三フィナンシャルグループ	10,300	1,616.00	16,644,800
第四北越フィナンシャルグループ	20,600	3,550.00	73,130,000
ジャムコ	6,000	2,535.00	15,210,000
小野建	10,500	1,612.00	16,926,000
はるやまホールディングス	5,500	865.00	4,757,500
南陽	2,500	2,297.00	5,742,500
ノジマ	21,100	1,992.00	42,031,200
佐鳥電機	8,700	971.00	8,447,700
カッパ・クリエイト	16,700	1,423.00	23,764,100
エコートレーディング	2,600	599.00	1,557,400
伯東	8,100	1,233.00	9,987,300
コンドーテック	9,100	1,042.00	9,482,200
中山福	6,600	550.00	3,630,000
ライトオン	9,900	792.00	7,840,800
ナガイレーベン	17,100	2,369.00	40,509,900
ジーンズメイト	3,700	488.00	1,805,600
三菱食品	13,000	2,878.00	37,414,000
良品計画	16,800	26,830.00	450,744,000
三城ホールディングス	14,700	399.00	5,865,300
松田産業	8,700	1,467.00	12,762,900
第一興商	17,600	5,490.00	96,624,000
メディパルホールディングス	127,900	2,609.00	333,691,100
アドヴァン	18,100	1,005.00	18,190,500
S P K	2,500	2,363.00	5,907,500
萩原電気ホールディングス	4,400	3,025.00	13,310,000
アルピス	4,500	2,368.00	10,656,000
アズワン	8,500	8,390.00	71,315,000
スズデン	4,200	1,794.00	7,534,800
尾家産業	3,400	1,319.00	4,484,600
シモジマ	7,300	1,130.00	8,249,000

ドウシシャ	11,200	1,747.00	19,566,400
小津産業	2,600	1,880.00	4,888,000
コナカ	15,200	443.00	6,733,600
高速	7,100	1,192.00	8,463,200
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,826.00	2,739,000
G - 7ホールディングス	3,500	2,278.00	7,973,000
たけびし	4,200	1,518.00	6,375,600
イオン北海道	11,600	790.00	9,164,000
コジマ	17,600	660.00	11,616,000
ヒマラヤ	3,800	1,000.00	3,800,000
コーナン商事	15,600	2,842.00	44,335,200
ネットワンシステムズ	41,800	2,606.00	108,930,800
エコス	4,400	1,694.00	7,453,600
ワタミ	15,600	1,664.00	25,958,400
マルシェ	3,300	784.00	2,587,200
リックス	2,700	1,664.00	4,492,800
システムソフト	29,100	101.00	2,939,100
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	71,000	6,660.00	472,860,000
丸文	10,500	738.00	7,749,000
西松屋チェーン	26,000	924.00	24,024,000
ゼンショーホールディングス	55,900	2,543.00	142,153,700
ハピネット	9,900	1,447.00	14,325,300
幸楽苑ホールディングス	7,600	2,364.00	17,966,400
ハークスレイ	2,500	1,143.00	2,857,500
橋本総業ホールディングス	2,200	1,476.00	3,247,200
日本ライフライン	37,200	1,810.00	67,332,000
サイゼリヤ	19,500	2,051.00	39,994,500
タカショー	6,100	428.00	2,610,800
エクセル	4,400	2,352.00	10,348,800
V Tホールディングス	40,400	415.00	16,766,000
マルカキカイ	3,900	2,165.00	8,443,500
アルゴグラフィックス	5,000	4,925.00	24,625,000
魚力	3,300	1,463.00	4,827,900
I D O M	40,100	378.00	15,157,800
日本エム・ディ・エム	7,000	1,108.00	7,756,000
ポプラ	3,100	552.00	1,711,200
フジ・コーポレーション	2,400	2,147.00	5,152,800
ユナイテッドアローズ	13,600	3,475.00	47,260,000
進和	7,000	2,243.00	15,701,000
エスケイジャパン	2,900	713.00	2,067,700
ダイトロン	5,500	1,774.00	9,757,000
ハイデイ日高	15,500	2,363.00	36,626,500
シークス	15,100	1,717.00	25,926,700
京都きもの友禅	7,700	448.00	3,449,600
コロワイド	39,400	2,396.00	94,402,400
ピーシーデポコーポレーション	15,700	449.00	7,049,300
田中商事	3,700	632.00	2,338,400
オーハシテクニカ	6,700	1,461.00	9,788,700
壱番屋	8,300	4,790.00	39,757,000

白銅	3,900	1,661.00	6,477,900
トップカルチャー	4,600	302.00	1,389,200
P L A N T	2,800	1,019.00	2,853,200
スギホールディングス	26,000	4,790.00	124,540,000
島津製作所	154,800	2,770.00	428,796,000
J M S	11,100	654.00	7,259,400
クボテック	2,600	364.00	946,400
長野計器	9,400	805.00	7,567,000
ブイ・テクノロジー	2,800	15,160.00	42,448,000
スター精密	20,500	1,729.00	35,444,500
東京計器	7,700	1,145.00	8,816,500
愛知時計電機	1,600	3,945.00	6,312,000
インターアクション	5,700	1,665.00	9,490,500
オーバル	11,700	252.00	2,948,400
東京精密	21,800	2,938.00	64,048,400
マニー	14,700	4,965.00	72,985,500
ニコン	209,600	1,734.00	363,446,400
トプコン	64,600	1,541.00	99,548,600
オリンパス	179,200	4,865.00	871,808,000
理研計器	10,600	2,228.00	23,616,800
S C R E E Nホールディングス	20,900	4,755.00	99,379,500
キヤノン電子	11,000	1,829.00	20,119,000
タムロン	10,600	2,133.00	22,609,800
H O Y A	242,200	6,888.00	1,668,273,600
シード	5,200	1,292.00	6,718,400
ノーリツ鋼機	9,500	2,188.00	20,786,000
エー・アンド・デイ	11,000	747.00	8,217,000
朝日インテック	51,000	5,620.00	286,620,000
キヤノン	647,500	3,258.00	2,109,555,000
リコー	361,700	1,144.00	413,784,800
シチズン時計	131,400	642.00	84,358,800
リズム時計工業	4,100	1,646.00	6,748,600
大研医器	9,600	593.00	5,692,800
メニコン	16,500	2,902.00	47,883,000
シンシア	1,900	498.00	946,200
中本パックス	3,400	1,711.00	5,817,400
スノーピーク	4,500	1,407.00	6,331,500
パラマウントベッドホールディングス	13,800	5,110.00	70,518,000
トランザクション	6,600	732.00	4,831,200
S H O B I	3,500	366.00	1,281,000
ニホンフラッシュ	5,200	2,028.00	10,545,600
前田工織	13,300	2,790.00	37,107,000
永大産業	15,700	437.00	6,860,900
アートネイチャー	12,900	647.00	8,346,300
バンダイナムコホールディングス	124,400	4,815.00	598,986,000
アイフィスジャパン	2,700	573.00	1,547,100
共立印刷	20,500	222.00	4,551,000
S H O E I	5,800	4,085.00	23,693,000
フランスベッドホールディングス	16,900	859.00	14,517,100
マーベラス	18,100	906.00	16,398,600

パイロットコーポレーション	21,000	5,150.00	108,150,000
萩原工業	6,700	1,642.00	11,001,400
エイベックス	20,300	1,427.00	28,968,100
トッパン・フォームズ	25,600	959.00	24,550,400
フジシールインターナショナル	27,000	4,270.00	115,290,000
タカラトミー	50,400	1,134.00	57,153,600
廣済堂	11,300	727.00	8,215,100
エステールホールディングス	3,300	677.00	2,234,100
アーク	45,900	94.00	4,314,600
レック	12,900	1,658.00	21,388,200
タカノ	4,800	894.00	4,291,200
三光合成	9,500	368.00	3,496,000
プロネクサス	10,400	1,246.00	12,958,400
ホクシン	7,700	141.00	1,085,700
ウッドワン	4,000	1,093.00	4,372,000
大建工業	9,100	1,977.00	17,990,700
きもと	20,900	184.00	3,845,600
凸版印刷	169,700	1,779.00	301,896,300
大日本印刷	169,500	2,626.00	445,107,000
図書印刷	11,300	961.00	10,859,300
共同印刷	3,700	2,460.00	9,102,000
N I S S H A	24,700	1,324.00	32,702,800
光村印刷	1,000	2,259.00	2,259,000
藤森工業	10,800	3,040.00	32,832,000
ヴィア・ホールディングス	14,700	666.00	9,790,200
宝印刷	5,900	1,630.00	9,617,000
前澤化成工業	8,200	1,018.00	8,347,600
未来工業	6,500	2,392.00	15,548,000
アシックス	119,500	1,465.00	175,067,500
ツツミ	3,700	2,027.00	7,499,900
ウェーブロックホールディングス	2,600	852.00	2,215,200
J S P	7,100	2,523.00	17,913,300
ニチハ	16,700	3,130.00	52,271,000
エフピコ	9,900	6,750.00	66,825,000
小松ウオール工業	3,700	1,938.00	7,170,600
ヤマハ	71,600	5,580.00	399,528,000
河合楽器製作所	3,700	3,340.00	12,358,000
クリナップ	11,200	621.00	6,955,200
ビジョン	72,700	4,800.00	348,960,000
天馬	8,300	2,037.00	16,907,100
兼松サステック	800	1,579.00	1,263,200
キングジム	10,100	822.00	8,302,200
象印マホービン	22,400	1,228.00	27,507,200
リンテック	28,600	2,512.00	71,843,200
信越ポリマー	21,600	838.00	18,100,800
東リ	30,000	282.00	8,460,000
イトーキ	22,100	561.00	12,398,100
任天堂	74,100	30,320.00	2,246,712,000
三菱鉛筆	19,800	2,243.00	44,411,400
松風	5,900	1,338.00	7,894,200

タカスタンダード	24,800	1,715.00	42,532,000
コクヨ	57,700	1,662.00	95,897,400
ナカバヤシ	12,000	572.00	6,864,000
ニフコ	48,200	2,875.00	138,575,000
立川ブラインド工業	5,300	1,184.00	6,275,200
グロープライド	5,900	2,859.00	16,868,100
オカムラ	42,000	1,315.00	55,230,000
バルカー	9,800	2,306.00	22,598,800
MUTOHホールディングス	1,600	1,886.00	3,017,600
伊藤忠商事	828,800	2,000.00	1,657,600,000
丸紅	1,168,500	804.20	939,707,700
スクロール	18,400	400.00	7,360,000
高島	1,900	1,817.00	3,452,300
ヨンドシーホールディングス	13,100	2,172.00	28,453,200
三陽商会	7,100	1,793.00	12,730,300
長瀬産業	66,500	1,663.00	110,589,500
ナイガイ	4,600	548.00	2,520,800
蝶理	7,500	1,544.00	11,580,000
豊田通商	132,200	3,575.00	472,615,000
オンワードホールディングス	70,600	668.00	47,160,800
三共生興	19,800	444.00	8,791,200
兼松	47,300	1,296.00	61,300,800
美津濃	11,900	2,574.00	30,630,600
ツカモトコーポレーション	2,200	1,061.00	2,334,200
ユニー・ファミリーマートホールディングス	33,100	12,630.00	418,053,000
ルックホールディングス	4,300	1,320.00	5,676,000
三井物産	976,100	1,775.00	1,732,577,500
日本紙パルプ商事	6,700	4,165.00	27,905,500
東京エレクトロン	80,200	15,610.00	1,251,922,000
日立ハイテクノロジーズ	36,000	4,275.00	153,900,000
カメイ	15,400	1,239.00	19,080,600
東都水産	1,700	2,604.00	4,426,800
OUGホールディングス	1,900	2,580.00	4,902,000
スターゼン	4,400	4,005.00	17,622,000
セイコーホールディングス	18,500	2,556.00	47,286,000
山善	46,200	1,191.00	55,024,200
椿本興業	2,700	3,770.00	10,179,000
住友商事	700,500	1,631.00	1,142,515,500
日本ユニシス	36,900	2,843.00	104,906,700
内田洋行	5,500	2,621.00	14,415,500
三菱商事	831,400	3,200.00	2,660,480,000
第一実業	5,400	3,500.00	18,900,000
キヤノンマーケティングジャパン	33,800	2,110.00	71,318,000
西華産業	6,700	1,537.00	10,297,900
佐藤商事	10,700	956.00	10,229,200
菱洋エレクトロ	12,000	1,570.00	18,840,000
東京産業	12,000	550.00	6,600,000
ユアサ商事	12,100	3,365.00	40,716,500
神鋼商事	2,700	2,596.00	7,009,200

小林産業	7,000	291.00	2,037,000
阪和興業	20,600	3,355.00	69,113,000
正栄食品工業	6,200	3,120.00	19,344,000
カナデン	11,400	1,272.00	14,500,800
菱電商事	9,300	1,479.00	13,754,700
ニプロ	83,300	1,466.00	122,117,800
フルサト工業	6,500	1,672.00	10,868,000
岩谷産業	26,300	3,640.00	95,732,000
すてきナイスグループ	5,000	884.00	4,420,000
昭光通商	4,400	624.00	2,745,600
ニチモウ	1,900	1,754.00	3,332,600
極東貿易	3,700	1,720.00	6,364,000
イワキ	14,400	412.00	5,932,800
兼松エレクトロニクス	6,400	3,340.00	21,376,000
三愛石油	31,800	988.00	31,418,400
稲畑産業	28,500	1,582.00	45,087,000
G S Iクレオス	3,200	1,205.00	3,856,000
明和産業	11,200	471.00	5,275,200
キムラタン	57,100	25.00	1,427,500
ゴールドウイン	10,700	13,680.00	146,376,000
ユニ・チャーム	255,100	3,606.00	919,890,600
デサント	28,800	2,419.00	69,667,200
キング	6,200	592.00	3,670,400
ワキタ	25,200	1,226.00	30,895,200
ヤマトインターナショナル	7,900	437.00	3,452,300
東邦ホールディングス	35,100	2,771.00	97,262,100
サンゲツ	35,800	2,091.00	74,857,800
ミツウロコグループホールディングス	17,200	826.00	14,207,200
シナネンホールディングス	4,900	2,231.00	10,931,900
伊藤忠エネクス	26,100	955.00	24,925,500
サンリオ	36,600	2,347.00	85,900,200
サンワテクノス	7,200	1,004.00	7,228,800
リョーサン	13,100	3,135.00	41,068,500
新光商事	11,200	1,895.00	21,224,000
トーヨー	5,400	2,058.00	11,113,200
三信電気	9,800	1,844.00	18,071,200
東陽テクニカ	13,500	918.00	12,393,000
モスフードサービス	15,500	2,775.00	43,012,500
加賀電子	11,800	2,146.00	25,322,800
三益半導体工業	9,500	1,492.00	14,174,000
ソーダニッカ	12,400	564.00	6,993,600
立花エレテック	8,700	1,681.00	14,624,700
木曽路	14,500	2,593.00	37,598,500
S R Sホールディングス	14,000	1,027.00	14,378,000
千趣会	21,700	250.00	5,425,000
タカキュー	9,200	186.00	1,711,200
ケーヨー	21,800	547.00	11,924,600
上新電機	14,000	2,290.00	32,060,000
日本瓦斯	19,300	4,045.00	78,068,500
ロイヤルホールディングス	20,700	2,737.00	56,655,900

東天紅	800	1,324.00	1,059,200
いなげや	13,200	1,310.00	17,292,000
島忠	26,800	2,921.00	78,282,800
チヨダ	12,400	1,922.00	23,832,800
ライフコーポレーション	9,000	2,420.00	21,780,000
リンガーハット	14,600	2,379.00	34,733,400
MrMaxHD	16,400	513.00	8,413,200
テンアライド	11,400	407.00	4,639,800
AOKIホールディングス	23,600	1,256.00	29,641,600
オークワ	16,900	1,165.00	19,688,500
コメリ	18,300	2,793.00	51,111,900
青山商事	20,700	2,746.00	56,842,200
しまむら	13,800	9,360.00	129,168,000
はせがわ	6,100	398.00	2,427,800
高島屋	93,000	1,480.00	137,640,000
松屋	23,900	1,081.00	25,835,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	60,700	1,538.00	93,356,600
近鉄百貨店	4,500	3,325.00	14,962,500
パルコ	11,200	1,144.00	12,812,800
丸井グループ	100,300	1,991.00	199,697,300
クレディセゾン	83,100	1,642.00	136,450,200
アクシアル リテイリング	9,800	3,455.00	33,859,000
井筒屋	6,400	214.00	1,369,600
イオン	456,000	2,360.50	1,076,388,000
イズミ	24,100	5,170.00	124,597,000
フォーバル	5,300	832.00	4,409,600
平和堂	24,100	2,423.00	58,394,300
フジ	14,300	1,872.00	26,769,600
ヤオコー	13,500	5,810.00	78,435,000
ゼビオホールディングス	14,200	1,300.00	18,460,000
ケーズホールディングス	123,200	1,023.00	126,033,600
PALTAC	21,400	5,690.00	121,766,000
三谷産業	14,400	292.00	4,204,800
Olympicグループ	7,100	705.00	5,005,500
日産東京販売ホールディングス	17,700	321.00	5,681,700
新生銀行	87,100	1,518.00	132,217,800
あおぞら銀行	66,300	3,235.00	214,480,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,263,500	582.50	4,813,488,750
りそなホールディングス	1,302,100	510.30	664,461,630
三井住友トラスト・ホールディングス	233,300	4,197.00	979,160,100
三井住友フィナンシャルグループ	836,300	3,995.00	3,341,018,500
千葉銀行	420,400	685.00	287,974,000
群馬銀行	237,000	470.00	111,390,000
武蔵野銀行	17,600	2,322.00	40,867,200
千葉興業銀行	32,500	335.00	10,887,500
筑波銀行	50,100	206.00	10,320,600
七十七銀行	37,200	1,822.00	67,778,400
青森銀行	9,200	2,907.00	26,744,400
秋田銀行	7,600	2,198.00	16,704,800
山形銀行	13,300	1,941.00	25,815,300

岩手銀行	8,300	3,260.00	27,058,000
東邦銀行	106,100	305.00	32,360,500
東北銀行	6,300	1,105.00	6,961,500
みちのく銀行	7,700	1,603.00	12,343,100
ふくおかフィナンシャルグループ	96,400	2,443.00	235,505,200
静岡銀行	298,500	882.00	263,277,000
十六銀行	15,900	2,307.00	36,681,300
スルガ銀行	121,600	546.00	66,393,600
八十二銀行	214,700	465.00	99,835,500
山梨中央銀行	14,700	1,431.00	21,035,700
大垣共立銀行	18,700	2,249.00	42,056,300
福井銀行	10,200	1,573.00	16,044,600
北國銀行	12,600	3,450.00	43,470,000
清水銀行	5,000	1,802.00	9,010,000
富山銀行	2,300	3,160.00	7,268,000
滋賀銀行	23,700	2,644.00	62,662,800
南都銀行	13,900	2,150.00	29,885,000
百五銀行	106,600	384.00	40,934,400
京都銀行	42,500	4,960.00	210,800,000
紀陽銀行	42,000	1,542.00	64,764,000
ほくほくフィナンシャルグループ	79,000	1,238.00	97,802,000
広島銀行	175,100	634.00	111,013,400
山陰合同銀行	70,300	805.00	56,591,500
中国銀行	76,500	1,063.00	81,319,500
鳥取銀行	4,200	1,417.00	5,951,400
伊予銀行	156,900	620.00	97,278,000
百十四銀行	12,600	2,439.00	30,731,400
四国銀行	16,900	1,038.00	17,542,200
阿波銀行	19,000	2,949.00	56,031,000
大分銀行	7,300	3,335.00	24,345,500
宮崎銀行	7,900	2,711.00	21,416,900
佐賀銀行	7,200	1,831.00	13,183,200
十八銀行	7,300	2,710.00	19,783,000
沖縄銀行	10,800	3,375.00	36,450,000
琉球銀行	27,400	1,196.00	32,770,400
セブン銀行	400,900	329.00	131,896,100
みずほフィナンシャルグループ	16,123,100	175.50	2,829,604,050
高知銀行	4,500	740.00	3,330,000
山口フィナンシャルグループ	148,100	1,043.00	154,468,300
芙蓉総合リース	13,600	5,880.00	79,968,000
興銀リース	22,300	2,709.00	60,410,700
東京センチュリー	23,900	5,040.00	120,456,000
SBIホールディングス	141,400	2,378.00	336,249,200
日本証券金融	52,500	626.00	32,865,000
アイフル	181,300	307.00	55,659,100
日本アジア投資	10,500	195.00	2,047,500
長野銀行	4,000	1,566.00	6,264,000
名古屋銀行	9,600	3,495.00	33,552,000
北洋銀行	178,800	306.00	54,712,800
愛知銀行	4,300	3,435.00	14,770,500

中京銀行	4,900	2,191.00	10,735,900
大光銀行	4,000	1,722.00	6,888,000
愛媛銀行	16,600	1,105.00	18,343,000
トマト銀行	4,800	1,054.00	5,059,200
京葉銀行	52,200	694.00	36,226,800
栃木銀行	61,500	234.00	14,391,000
北日本銀行	3,800	2,092.00	7,949,600
東和銀行	20,900	711.00	14,859,900
福島銀行	10,500	387.00	4,063,500
大東銀行	5,800	635.00	3,683,000
リコーリース	9,300	3,480.00	32,364,000
イオンフィナンシャルサービス	75,700	2,196.00	166,237,200
アコム	238,400	385.00	91,784,000
ジャックス	13,100	1,910.00	25,021,000
オリエントコーポレーション	319,900	122.00	39,027,800
日立キャピタル	27,900	2,587.00	72,177,300
アプラスフィナンシャル	57,700	86.00	4,962,200
オリックス	791,700	1,620.00	1,282,554,000
三菱UFJリース	267,400	553.00	147,872,200
ジャフコ	19,400	3,925.00	76,145,000
九州リースサービス	5,900	701.00	4,135,900
トモニホールディングス	91,600	406.00	37,189,600
大和証券グループ本社	952,000	581.50	553,588,000
野村ホールディングス	2,087,600	443.60	926,059,360
岡三証券グループ	100,900	492.00	49,642,800
丸三証券	35,100	818.00	28,711,800
東洋証券	42,600	162.00	6,901,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	141,300	493.00	69,660,900
光世証券	2,900	747.00	2,166,300
水戸証券	34,400	265.00	9,116,000
いちよし証券	24,900	868.00	21,613,200
松井証券	58,100	1,212.00	70,417,200
SOMP Oホールディングス	209,200	4,195.00	877,594,000
だいこう証券ビジネス	4,900	440.00	2,156,000
日本取引所グループ	320,500	1,985.00	636,192,500
マネックスグループ	111,000	436.00	48,396,000
カブドットコム証券	89,000	561.00	49,929,000
極東証券	15,800	1,170.00	18,486,000
岩井コスモホールディングス	12,200	1,310.00	15,982,000
藍澤證券	22,200	704.00	15,628,800
フィデアホールディングス	116,200	132.00	15,338,400
池田泉州ホールディングス	126,200	296.00	37,355,200
アニコムホールディングス	9,400	3,005.00	28,247,000
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	310,300	3,354.00	1,040,746,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	97,500	2,122.00	206,895,000
マネーパートナーズグループ	14,200	294.00	4,174,800
小林洋行	3,400	273.00	928,200

第一生命ホールディングス	671,300	1,732.50	1,163,027,250
東京海上ホールディングス	430,100	5,533.00	2,379,743,300
アドバンテッジリスクマネジメント	4,600	984.00	4,526,400
イー・ギャランティ	11,200	1,047.00	11,726,400
アサックス	4,900	564.00	2,763,600
NECキャピタルソリューション	4,800	1,674.00	8,035,200
T&Dホールディングス	366,900	1,392.00	510,724,800
アドバンスクリエイト	2,800	1,724.00	4,827,200
三井不動産	629,600	2,640.50	1,662,458,800
三菱地所	831,400	1,907.50	1,585,895,500
平和不動産	22,500	2,056.00	46,260,000
東京建物	129,700	1,295.00	167,961,500
ダイビル	34,900	1,076.00	37,552,400
京阪神ビルディング	21,300	923.00	19,659,900
住友不動産	266,800	4,240.00	1,131,232,000
太平洋興発	4,800	752.00	3,609,600
テーオーシー	27,200	791.00	21,515,200
東京楽天地	1,700	4,680.00	7,956,000
レオパレス21	146,700	216.00	31,687,200
スターツコーポレーション	16,100	2,441.00	39,300,100
フジ住宅	15,300	868.00	13,280,400
空港施設	13,700	540.00	7,398,000
明和地所	6,700	610.00	4,087,000
ゴールドクレスト	9,400	1,610.00	15,134,000
リログループ	62,900	3,000.00	188,700,000
日本エスリード	4,700	1,648.00	7,745,600
日神不動産	17,500	474.00	8,295,000
日本エスコン	21,600	774.00	16,718,400
タカラレーベン	55,900	351.00	19,620,900
サンヨーハウジング名古屋	6,800	941.00	6,398,800
イオンモール	59,500	1,877.00	111,681,500
ファースト住建	4,500	1,240.00	5,580,000
ランド	492,600	8.00	3,940,800
カチタス	13,200	3,635.00	47,982,000
東祥	7,200	3,475.00	25,020,000
トーセイ	16,500	1,038.00	17,127,000
穴吹興産	1,300	2,834.00	3,684,200
サンフロンティア不動産	16,500	1,243.00	20,509,500
エフ・ジェー・ネクスト	10,500	884.00	9,282,000
インテリックス	3,500	690.00	2,415,000
ランドビジネス	6,200	808.00	5,009,600
グランディハウス	10,600	439.00	4,653,400
東武鉄道	126,800	3,125.00	396,250,000
相鉄ホールディングス	41,200	3,340.00	137,608,000
東京急行電鉄	326,800	1,889.00	617,325,200
京浜急行電鉄	164,800	1,850.00	304,880,000
小田急電鉄	192,700	2,571.00	495,431,700
京王電鉄	67,200	6,430.00	432,096,000
京成電鉄	90,200	3,795.00	342,309,000
富士急行	16,400	3,995.00	65,518,000

新京成電鉄	3,100	2,094.00	6,491,400
東日本旅客鉄道	213,900	10,570.00	2,260,923,000
西日本旅客鉄道	107,800	8,263.00	890,751,400
東海旅客鉄道	107,700	24,890.00	2,680,653,000
西武ホールディングス	153,400	1,973.00	302,658,200
鴻池運輸	19,200	1,790.00	34,368,000
西日本鉄道	33,300	2,675.00	89,077,500
ハマキョウレックス	9,200	4,570.00	42,044,000
サカイ引越センター	6,300	6,620.00	41,706,000
近鉄グループホールディングス	114,000	4,960.00	565,440,000
阪急阪神ホールディングス	152,000	4,075.00	619,400,000
南海電気鉄道	50,800	2,967.00	150,723,600
京阪ホールディングス	50,800	4,540.00	230,632,000
神戸電鉄	3,000	3,940.00	11,820,000
名古屋鉄道	91,300	3,040.00	277,552,000
山陽電気鉄道	8,800	2,196.00	19,324,800
トランコム	3,200	6,890.00	22,048,000
日本通運	44,700	6,390.00	285,633,000
ヤマトホールディングス	199,800	2,899.00	579,220,200
山九	31,700	5,430.00	172,131,000
日新	9,800	1,933.00	18,943,400
丸運	6,200	308.00	1,909,600
丸全昭和運輸	9,300	2,903.00	26,997,900
センコーグループホールディングス	62,900	932.00	58,622,800
トナミホールディングス	2,700	6,350.00	17,145,000
ニッコンホールディングス	43,300	2,826.00	122,365,800
日本石油輸送	1,400	3,015.00	4,221,000
福山通運	14,600	4,535.00	66,211,000
セイノーホールディングス	85,400	1,553.00	132,626,200
エスライン	3,100	1,164.00	3,608,400
神奈川中央交通	2,800	3,725.00	10,430,000
日立物流	25,100	3,280.00	82,328,000
丸和運輸機関	6,000	3,405.00	20,430,000
C & F ロジホールディングス	11,600	1,291.00	14,975,600
日本郵船	95,200	1,792.00	170,598,400
商船三井	67,600	2,665.00	180,154,000
川崎汽船	35,100	1,581.00	55,493,100
NSユナイテッド海運	6,300	2,566.00	16,165,800
明治海運	12,100	350.00	4,235,000
飯野海運	53,800	397.00	21,358,600
共栄タンカー	800	1,561.00	1,248,800
九州旅客鉄道	95,600	3,725.00	356,110,000
SGホールディングス	107,700	3,210.00	345,717,000
日本航空	208,500	4,105.00	855,892,500
ANAホールディングス	208,200	4,130.00	859,866,000
パスコ	2,300	959.00	2,205,700
西本Wismettacホールディングス	2,700	4,325.00	11,677,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,176.00	1,058,400
Genky DrugStores	4,700	2,591.00	12,177,700

国際紙パルプ商事	20,900	296.00	6,186,400
総合メディカルホールディングス	10,300	1,901.00	19,580,300
ブックオフグループホールディングス	6,200	801.00	4,966,200
三菱倉庫	39,500	2,777.00	109,691,500
三井倉庫ホールディングス	14,000	1,931.00	27,034,000
住友倉庫	42,800	1,432.00	61,289,600
澁澤倉庫	6,200	1,692.00	10,490,400
ヤマタネ	6,000	1,666.00	9,996,000
東陽倉庫	20,500	336.00	6,888,000
乾汽船	10,400	697.00	7,248,800
日本トランスシティ	25,100	441.00	11,069,100
ケイヒン	2,200	1,402.00	3,084,400
中央倉庫	6,900	1,068.00	7,369,200
川西倉庫	2,300	1,277.00	2,937,100
安田倉庫	9,400	904.00	8,497,600
東洋埠頭	3,300	1,504.00	4,963,200
宇徳	9,900	547.00	5,415,300
上組	70,200	2,549.00	178,939,800
サンリツ	2,800	718.00	2,010,400
キムラユニティー	3,200	1,135.00	3,632,000
キューソー流通システム	2,900	2,107.00	6,110,300
近鉄エクスプレス	21,500	1,768.00	38,012,000
東海運	6,300	285.00	1,795,500
エーアイティー	7,500	1,087.00	8,152,500
内外トランスライン	3,700	1,503.00	5,561,100
日本コンセプト	3,200	1,020.00	3,264,000
東京放送ホールディングス	78,200	2,056.00	160,779,200
日本テレビホールディングス	108,400	1,778.00	192,735,200
朝日放送グループホールディングス	11,600	784.00	9,094,400
テレビ朝日ホールディングス	32,400	2,034.00	65,901,600
スカパーJ S A Tホールディングス	89,900	492.00	44,230,800
テレビ東京ホールディングス	9,700	2,507.00	24,317,900
日本BS放送	4,100	1,076.00	4,411,600
ビジョン	3,700	4,700.00	17,390,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,500	978.00	4,401,000
ワイヤレスゲート	5,300	435.00	2,305,500
コネクシオ	8,400	1,446.00	12,146,400
日本通信	102,600	128.00	13,132,800
クロップス	2,200	659.00	1,449,800
日本電信電話	807,400	4,779.00	3,858,564,600
KDDI	1,040,300	2,712.50	2,821,813,750
ソフトバンク	938,800	1,372.50	1,288,503,000
光通信	13,900	20,080.00	279,112,000
NTTドコモ	847,600	2,607.00	2,209,693,200
エムティーアイ	13,900	628.00	8,729,200
GMOインターネット	43,100	1,898.00	81,803,800
アイドママーケティングコミュニケーション	2,500	500.00	1,250,000
カドカワ	34,500	1,259.00	43,435,500

学研ホールディングス	4,000	5,730.00	22,920,000
ゼンリン	23,600	3,145.00	74,222,000
昭文社	5,400	496.00	2,678,400
インプレスホールディングス	9,700	156.00	1,513,200
東京電力ホールディングス	960,700	686.00	659,040,200
中部電力	368,200	1,781.00	655,764,200
関西電力	491,000	1,655.50	812,850,500
中国電力	166,400	1,452.00	241,612,800
北陸電力	118,000	961.00	113,398,000
東北電力	281,900	1,470.00	414,393,000
四国電力	108,400	1,409.00	152,735,600
九州電力	248,100	1,327.00	329,228,700
北海道電力	112,700	728.00	82,045,600
沖縄電力	22,300	2,084.00	46,473,200
電源開発	95,700	2,833.00	271,118,100
エフオン	5,800	877.00	5,086,600
イーレックス	21,000	900.00	18,900,000
レノバ	12,700	1,102.00	13,995,400
東京瓦斯	236,000	3,066.00	723,576,000
大阪瓦斯	233,400	2,264.00	528,417,600
東邦瓦斯	59,600	4,925.00	293,530,000
北海道瓦斯	6,500	1,454.00	9,451,000
広島ガス	24,900	351.00	8,739,900
西部瓦斯	13,500	2,465.00	33,277,500
静岡ガス	37,000	907.00	33,559,000
メタウォーター	5,800	3,120.00	18,096,000
アイネット	6,700	1,411.00	9,453,700
松竹	7,800	11,550.00	90,090,000
東宝	77,700	4,045.00	314,296,500
エイチ・アイ・エス	20,500	4,235.00	86,817,500
東映	5,000	13,530.00	67,650,000
ラックランド	2,300	2,003.00	4,606,900
エヌ・ティ・ティ・データ	314,300	1,227.00	385,646,100
共立メンテナンス	17,600	5,210.00	91,696,000
イチネンホールディングス	12,000	1,327.00	15,924,000
建設技術研究所	8,000	1,547.00	12,376,000
スペース	7,400	1,347.00	9,967,800
長大	4,700	819.00	3,849,300
アインホールディングス	15,900	7,300.00	116,070,000
燦ホールディングス	2,500	2,523.00	6,307,500
ビー・シー・エー	1,600	2,346.00	3,753,600
スバル興業	700	5,960.00	4,172,000
東京テアトル	4,600	1,298.00	5,970,800
タナベ経営	2,300	1,240.00	2,852,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,100	2,186.00	4,590,600
ナガワ	3,200	5,550.00	17,760,000
よみうりランド	2,500	4,225.00	10,562,500
東京都競馬	7,500	3,720.00	27,900,000
常磐興産	4,700	1,636.00	7,689,200
カナモト	17,200	2,918.00	50,189,600

東京ドーム	43,100	1,022.00	44,048,200
D T S	13,200	4,175.00	55,110,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,900	3,370.00	185,013,000
シーイーシー	12,700	2,303.00	29,248,100
カブコン	50,600	2,201.00	111,370,600
西尾レントオール	11,700	3,450.00	40,365,000
アイ・エス・ビー	2,300	2,166.00	4,981,800
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	63,000	32.00	2,016,000
日本空港ビルデング	37,900	4,445.00	168,465,500
トランス・コスモス	12,800	2,214.00	28,339,200
乃村工藝社	26,900	3,320.00	89,308,000
ジャステック	6,800	984.00	6,691,200
S C S K	31,100	4,945.00	153,789,500
藤田観光	4,600	2,639.00	12,139,400
K N T - C Tホールディングス	6,200	1,334.00	8,270,800
日本管財	12,300	1,927.00	23,702,100
トーカイ	11,100	2,939.00	32,622,900
白洋舎	1,300	2,913.00	3,786,900
セコム	122,000	9,594.00	1,170,468,000
日本システムウエア	3,900	1,970.00	7,683,000
セントラル警備保障	5,600	4,330.00	24,248,000
アイネス	15,000	1,303.00	19,545,000
丹青社	21,800	1,306.00	28,470,800
メイテック	14,600	4,950.00	72,270,000
T K C	10,000	3,825.00	38,250,000
富士ソフト	17,600	4,465.00	78,584,000
応用地質	12,300	1,170.00	14,391,000
船井総研ホールディングス	23,800	2,592.00	61,689,600
N S D	19,400	2,480.00	48,112,000
進学会ホールディングス	5,200	563.00	2,927,600
丸紅建材リース	1,100	2,050.00	2,255,000
オオバ	9,300	635.00	5,905,500
コナミホールディングス	48,300	4,565.00	220,489,500
いであ	2,300	995.00	2,288,500
学究社	4,000	1,368.00	5,472,000
ベネッセホールディングス	42,100	3,070.00	129,247,000
イオンディライト	14,200	4,105.00	58,291,000
ナック	7,300	1,048.00	7,650,400
福井コンピュータホールディングス	3,900	1,901.00	7,413,900
ニチイ学館	16,400	1,216.00	19,942,400
ダイセキ	19,300	2,765.00	53,364,500
ステップ	4,300	1,388.00	5,968,400
日鉄住金物産	8,400	4,765.00	40,026,000
泉州電業	3,900	2,773.00	10,814,700
元気寿司	3,300	3,980.00	13,134,000
トラスコ中山	24,700	3,125.00	77,187,500
ヤマダ電機	360,900	539.00	194,525,100
オートバックスセブン	47,000	1,848.00	86,856,000

モリト	8,700	780.00	6,786,000
アークランドサカモト	20,000	1,437.00	28,740,000
ニトリホールディングス	51,300	14,165.00	726,664,500
グルメ杵屋	8,600	1,173.00	10,087,800
愛眼	9,600	338.00	3,244,800
ケーユーホールディングス	6,200	841.00	5,214,200
吉野家ホールディングス	41,400	1,852.00	76,672,800
加藤産業	18,500	3,620.00	66,970,000
北恵	2,300	926.00	2,129,800
イノテック	7,100	1,046.00	7,426,600
イエローハット	11,200	2,940.00	32,928,000
松屋フーズホールディングス	5,700	3,735.00	21,289,500
JBCホールディングス	9,300	1,639.00	15,242,700
JKホールディングス	10,700	664.00	7,104,800
サガミホールディングス	15,900	1,375.00	21,862,500
日伝	9,800	1,583.00	15,513,400
関西スーパーマーケット	8,900	1,013.00	9,015,700
ミロク情報サービス	11,700	2,918.00	34,140,600
北沢産業	9,200	266.00	2,447,200
杉本商事	6,400	1,819.00	11,641,600
因幡電機産業	16,800	4,580.00	76,944,000
王将フードサービス	8,700	7,410.00	64,467,000
プレナス	13,200	1,813.00	23,931,600
ミニストップ	8,700	1,919.00	16,695,300
アークス	22,200	2,542.00	56,432,400
パローホールディングス	25,600	2,685.00	68,736,000
バイテックホールディングス	5,400	2,035.00	10,989,000
東テク	3,900	2,292.00	8,938,800
ミスミグループ本社	148,300	2,760.00	409,308,000
藤久	900	746.00	671,400
アルテック	8,700	228.00	1,983,600
ベルク	5,800	5,050.00	29,290,000
大庄	6,300	1,561.00	9,834,300
タキヒヨー	3,600	1,816.00	6,537,600
ファーストリテイリング	15,800	51,450.00	812,910,000
ソフトバンクグループ	493,400	10,275.00	5,069,685,000
蔵王産業	1,900	1,331.00	2,528,900
スズケン	54,100	5,930.00	320,813,000
サンドラッグ	44,600	3,400.00	151,640,000
サックスパーホールディングス	10,100	1,118.00	11,291,800
ジェコス	8,200	1,043.00	8,552,600
ヤマザワ	2,400	1,796.00	4,310,400
やまや	2,000	2,412.00	4,824,000
ルネサスイーストン	10,900	448.00	4,883,200
ベルーナ	29,100	913.00	26,568,300
合計	139,832,500		278,573,736,940

*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30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,759,043,801	1,334,883,037
国債証券		295,128,432,800	234,679,606,100
地方債証券		22,904,593,464	22,237,316,388
特殊債券		15,762,062,689	18,755,618,946
社債券		16,876,083,640	14,908,422,410
未収入金		3,043,919,000	-
未収利息		1,052,224,327	777,535,472
前払費用		11,392,773	36,162,082
流動資産合計		356,537,752,494	292,729,544,435
資産合計		356,537,752,494	292,729,544,435
負債の部			
流動負債			
未払解約金		3,707,675,000	53,156,000
流動負債合計		3,707,675,000	53,156,000
負債合計		3,707,675,000	53,156,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	274,056,741,701	223,957,984,513
剰余金			
剰余金又は欠損金()		78,773,335,793	68,718,403,922
元本等合計		352,830,077,494	292,676,388,435
純資産合計		352,830,077,494	292,676,388,435
負債純資産合計		356,537,752,494	292,729,544,435

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30年2月26日現在	平成31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	295,190,206,036円	274,056,741,701円
同期中追加設定元本額	61,855,153,624円	113,120,014,760円
同期中一部解約元本額	82,988,617,959円	163,218,771,948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	14,134,325,523円	18,161,473,639円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	133,630,997円	95,191,294円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	110,362,927円	78,480,076円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	35,282,821円	24,093,695円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	683,723,247円	837,934,831円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	186,801,804円	224,528,250円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,093,209円	28,436,059円
たわらノーロード 国内債券	3,053,849,271円	5,781,811,079円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	28,763,462円	212,652,705円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,797,390円	50,377,218円
たわらノーロード バランス（標準型）	6,736,262円	93,343,080円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,846,591円	15,121,463円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	427,592円	5,370,256円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	2,978,010円	115,630,664円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	4,270,909円	152,360,770円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	1,180,680円	41,213,510円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	401,500円	13,092,153円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,023,651円	2,023,168円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	371,890円	1,536,008円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,490,812円	3,718,621円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	457,571円	629,184円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	61,604円	17,517円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,519,073,028円	13,099,794,697円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	5,538,860,716円	6,000,434,857円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	8,094,578,747円	8,363,530,331円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,297,220,345円	3,372,611,721円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,822,404,385円	1,784,882,053円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,021,440,802円	1,978,282,069円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	317,189,866円	308,704,546円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	88,286,247円	87,118,800円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,216,731,348円	2,329,877,194円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,224,336円	1,151,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	474,201,213円	3,145,822,503円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	434,763,343円	765,014,194円

D I A M D C 8 資産 バランスファンド(新興 国30)	99,374,518円	161,069,244円
投資のソムリエ	3,477,837,094円	4,442,528,933円
クルーズコントロール	444,343,713円	2,654,296,497円
投資のソムリエ<DC年 金>	239,353,124円	421,449,687円
D I A M 8 資産バラン スファンドN<DC年金 >	1,836,523,487円	2,350,099,207円
D I A M D C バラン ス・F(成長型)	232,011,746円	284,518,272円
クルーズコントロール< DC年金>	165,091円	1,907,209円
D I A Mコア資産設計 ファンド(堅実型)	1,123,528円	9,016,033円
D I A Mコア資産設計 ファンド(積極型)	3,353,398円	20,568,924円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	479,665,477円	528,850,348円
ダイナミック・ナビゲー ション	187,857円	1,967,915円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド	7,432,216,368円	8,646,074,074円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー204 5)	627,520円	1,487,648円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー205 5)	487,386円	1,167,712円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド(DC)	2,441,185円	3,642,920円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー203 5)	1,160,053円	2,488,884円
4資産分散投資・スタン ダード<DC年金>	- 円	78,020,738円
リスクコントロール世界 資産分散ファンド	- 円	1,193,667,722円
9資産分散投資・スタン ダード<DC年金>	- 円	290,676円
D I A M高金利通貨ファ ンド	9,608,918円	- 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)	22,730,596,257円	7,862,114,581円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	496,308,197円	427,767,841円

One収益追求型マルチ アセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	- 円	2,650,787,553円
DIAMグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	341,395,897円	260,068,440円
DIAMグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	250,881,142円	206,763,342円
DIAM国際分散バラ ンスファンド30VA(適 格機関投資家限定)	79,938,561円	65,779,975円
DIAM国際分散バラ ンスファンド50VA(適 格機関投資家限定)	223,396,523円	178,262,613円
DIAM国内重視バラ ンスファンド30VA(適 格機関投資家限定)	92,500,119円	78,434,274円
DIAM国内重視バラ ンスファンド50VA(適 格機関投資家限定)	59,711,189円	34,112,030円
DIAM世界バランス ファンド40VA(適格 機関投資家限定)	100,150,915円	74,517,588円
DIAM世界バランス ファンド50VA(適格 機関投資家限定)	178,394,585円	153,733,627円
DIAMバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	6,083,808,272円	5,096,590,720円
DIAMバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	3,221,440,007円	2,723,422,683円
DIAMバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	5,882,071,810円	5,014,334,067円
DIAMグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	647,151,905円	538,816,682円
DIAMグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	512,238,067円	243,934,413円
DIAM 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)	3,765,931,500円	3,121,932,410円
DIAM世界アセットバ ランスファンドVA(適 格機関投資家向け)	3,503,037,017円	642,132,879円
DIAMグローバル 私 募ファンド(適格機関投 資家向け)	194,752,933円	188,050,355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)	229,020,962円	43,906,910円
D I A M世界バランス ファンド3 5 V A (適格 機関投資家限定)	1,835,245,523円	75,249,648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)	85,219,076,699円	43,668,871,451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)	1,149,665,356円	284,720,060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)	7,349,516,600円	6,759,101,749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)	28,046,381,699円	25,778,317,609円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	8,994,522円	73,681,229円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	49,160,062円	1,372,928円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	8,006,452円	6,828,815円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	31,135,137,178円	28,685,329,476円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	497,599,388円	405,294,493円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	137,417,719円	124,390,494円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	395,041,757円	499,470,914円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	118,842,206円	697,893円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	393,617円	371,935円
計	274,056,741,701円	223,957,984,513円
2 . 受益権の総数	274,056,741,701口	223,957,984,513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29年2月28日 至 平成30年2月26日	自 平成30年2月27日 至 平成31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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成31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30年2月26日現在	平成31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	405,859,100	502,539,100
地方債証券	14,402,409	12,199,266
特殊債券	5,464,632	13,002,530
社債券	5,513,390	218,890
合計	431,239,531	503,123,474

(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30年2月15日から平成30年2月26日まで及び平成31年2月15日から平成31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30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.2874円	1.3068円
(1万口当たり純資産額)	(12,874円)	(13,068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31年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 8 7 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,230,000	
	3 8 8 回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,816,000	
	3 9 0 回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,204,680,000	
	3 9 2 回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,392,000	
	3 9 3 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,470,000	
	3 9 4 回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	703,297,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,208,228,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,013,170,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,512,725,000	
	1 2 7 回 利付国庫債券(5年)	1,220,000,000	1,226,929,600	
	1 2 8 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,214,036,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券(5年)	2,420,000,000	2,437,133,600	
	1 3 0 回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,108,701,000	
	1 3 1 回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,037,392,200	
	1 3 2 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,018,660,000	
	1 3 3 回 利付国庫債券(5年)	1,170,000,000	1,181,957,400	
	1 3 4 回 利付国庫債券(5年)	780,000,000	788,533,200	
	1 3 5 回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,124,045,000	
	1 3 6 回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,720,672,000	
	1 3 7 回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,417,710,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	663,485,600	
	3 回 利付国庫債券(40年)	490,000,000	712,033,700	
	4 回 利付国庫債券(40年)	640,000,000	936,742,400	
	5 回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	819,841,600	
	6 回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	806,925,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	841,711,500	
	8 回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	896,068,800	
	9 回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	1,010,317,000	
	1 0 回 利付国庫債券(40年)	1,050,000,000	1,137,024,000	
	1 1 回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	502,425,600	
	3 0 6 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,525,245,000	
	3 0 8 回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	815,568,000	
	3 0 9 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,016,830,000	
	3 1 0 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,527,645,000	
	3 1 1 回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,035,595,800	
	3 1 2 回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,255,022,000	
	3 1 3 回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,844,577,100	
	3 1 4 回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	821,088,000	
	3 1 5 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,547,880,000	
	3 1 6 回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	514,800,000	

317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,032,840,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,648,416,000	
319回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	828,840,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,549,830,000	
321回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,658,096,000	
322回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,033,230,000	
323回	利付国庫債券(10年)	750,000,000	776,985,000	
324回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	877,752,500	
325回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,725,000	
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,895,000	
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,504,563,500	
328回	利付国庫債券(10年)	2,390,000,000	2,465,739,100	
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,366,157,200	
330回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,515,047,000	
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	673,172,500	
332回	利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,552,545,200	
333回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,871,208,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,120,000,000	2,208,086,000	
335回	利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	2,023,944,000	
336回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	883,694,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,610,000,000	1,654,902,900	
338回	利付国庫債券(10年)	1,860,000,000	1,924,914,000	
339回	利付国庫債券(10年)	2,440,000,000	2,528,742,800	
340回	利付国庫債券(10年)	2,450,000,000	2,542,683,500	
341回	利付国庫債券(10年)	2,510,000,000	2,591,298,900	
342回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,650,154,000	
343回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,549,025,000	
344回	利付国庫債券(10年)	2,730,000,000	2,784,327,000	
345回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,661,573,600	
346回	利付国庫債券(10年)	2,370,000,000	2,416,357,200	
347回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,038,640,000	
348回	利付国庫債券(10年)	2,230,000,000	2,271,455,700	
349回	利付国庫債券(10年)	1,960,000,000	1,994,848,800	
350回	利付国庫債券(10年)	2,850,000,000	2,898,136,500	
351回	利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,397,594,800	
352回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,303,823,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	129,375,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,152,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,940,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	266,634,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,798,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,314,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	385,656,000	
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,076,000	
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	243,264,000	
12回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	255,222,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	379,329,000	
14回	利付国庫債券(30年)	290,000,000	384,397,900	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,742,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	538,868,000	

17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,036,000	
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	555,513,000	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,090,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	408,012,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	399,231,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	642,504,100	
23回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	273,990,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	411,840,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	536,640,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	952,651,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	969,101,000	
28回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	945,451,600	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,238,958,000	
30回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,308,432,000	
31回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	943,901,000	
32回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,318,128,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,408,462,400	
34回	利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,416,604,800	
35回	利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,483,204,800	
36回	利付国庫債券(30年)	1,050,000,000	1,395,849,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,020,000,000	1,337,944,200	
38回	利付国庫債券(30年)	720,000,000	931,017,600	
39回	利付国庫債券(30年)	630,000,000	830,188,800	
40回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	843,160,500	
41回	利付国庫債券(30年)	510,000,000	650,841,600	
42回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	869,461,600	
43回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	895,776,000	
44回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	782,123,700	
45回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	864,983,000	
46回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	1,149,721,800	
47回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	958,854,000	
48回	利付国庫債券(30年)	740,000,000	898,278,600	
49回	利付国庫債券(30年)	790,000,000	959,233,800	
50回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	808,556,400	
51回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	609,238,500	
52回	利付国庫債券(30年)	910,000,000	898,033,500	
53回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	657,839,000	
54回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	691,177,500	
55回	利付国庫債券(30年)	740,000,000	786,279,600	
56回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	743,197,000	
57回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	806,253,600	
58回	利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	1,070,579,800	
59回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	826,120,000	
60回	利付国庫債券(30年)	640,000,000	695,193,600	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	515,715,000	
47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	259,350,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	524,420,000	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	630,330,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	582,263,000	
55回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	437,457,700	

58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	644,652,000	
61回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	524,020,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	657,132,000	
72回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	394,628,500	
73回	利付国庫債券(20年)	340,000,000	383,319,400	
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	501,006,000	
78回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	724,300,800	
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	274,480,800	
83回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	901,430,400	
85回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	511,007,200	
88回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	886,177,500	
90回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	825,860,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,530,048,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	821,450,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	945,312,000	
95回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	421,113,000	
97回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	599,855,000	
99回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,075,581,000	
100回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,026,868,000	
102回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	812,420,400	
105回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	845,040,000	
106回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	425,883,500	
107回	利付国庫債券(20年)	650,000,000	787,046,000	
108回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	893,347,500	
109回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	919,957,500	
110回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	911,197,500	
111回	利付国庫債券(20年)	570,000,000	700,758,000	
112回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	914,302,500	
113回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,430,313,300	
114回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	613,210,000	
115回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	494,892,000	
116回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	434,441,000	
117回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,168,709,000	
118回	利付国庫債券(20年)	290,000,000	354,606,200	
119回	利付国庫債券(20年)	300,000,000	360,066,000	
120回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	706,596,000	
121回	利付国庫債券(20年)	730,000,000	886,293,000	
122回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	601,295,000	
123回	利付国庫債券(20年)	680,000,000	843,710,000	
124回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	614,505,000	
125回	利付国庫債券(20年)	260,000,000	326,619,800	
126回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	554,526,000	
127回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	549,139,500	
128回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,039,881,500	
129回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	290,683,200	
130回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,092,555,000	
131回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	540,679,500	
132回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	794,600,400	
133回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	875,959,200	
134回	利付国庫債券(20年)	470,000,000	572,633,900	

135回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	602,745,000	
136回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	596,300,000	
137回	利付国庫債券(20年)	490,000,000	591,826,900	
138回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	295,397,500	
139回	利付国庫債券(20年)	580,000,000	692,926,000	
140回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,197,969,300	
141回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,090,998,000	
142回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	735,468,000	
143回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	792,316,800	
144回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	486,551,100	
145回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,459,584,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,340,141,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,280,000,000	1,543,372,800	
148回	利付国庫債券(20年)	1,080,000,000	1,287,144,000	
149回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,491,425,000	
150回	利付国庫債券(20年)	1,260,000,000	1,485,981,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,332,700,800	
152回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,310,247,600	
153回	利付国庫債券(20年)	1,110,000,000	1,293,682,800	
154回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,322,707,000	
155回	利付国庫債券(20年)	1,180,000,000	1,318,532,000	
156回	利付国庫債券(20年)	870,000,000	885,555,600	
157回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	884,457,000	
158回	利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,011,007,200	
159回	利付国庫債券(20年)	920,000,000	964,224,400	
160回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,117,168,500	
161回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	992,579,000	
162回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	991,391,500	
163回	利付国庫債券(20年)	960,000,000	1,000,588,800	
164回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,236,898,300	
165回	利付国庫債券(20年)	1,220,000,000	1,245,217,400	
166回	利付国庫債券(20年)	880,000,000	929,588,000	
国債証券 合計		212,600,000,000	234,679,606,100	
地方債証券	680回 東京都公募公債	200,000,000	202,894,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	507,250,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	202,856,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	512,515,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	717,262,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	514,325,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	310,926,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	413,564,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	112,619,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	235,260,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	352,200,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	204,824,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	308,760,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	308,376,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	203,106,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	306,720,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	205,806,000	

364回 大阪府公募公債	300,000,000	308,112,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	311,952,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	359,163,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,092,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	317,004,000	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	203,092,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	205,600,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	114,088,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	203,284,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	516,305,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	310,602,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	203,358,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,224,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	412,692,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	353,316,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,678,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	352,890,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	308,190,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	207,320,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,325,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	718,648,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,259,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,190,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	720,125,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,475,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,325,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	822,416,888	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,255,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,027,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,830,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,675,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,445,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,800,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,156,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,900,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,720,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,774,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	464,332,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	118,759,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	304,521,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	203,568,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	204,442,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	462,438,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	415,104,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	206,682,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	102,119,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	205,780,000	
地方債証券 合計	21,443,900,000	22,237,316,388	
特殊債券			
78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,586,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	225,372,000	

26回 高速道路機構債	200,000,000	276,796,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	718,718,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	103,038,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	193,852,000	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,037,000	
18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	316,875,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	594,020,000	
149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	411,500,000	
180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,029,750,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	512,130,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,050,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	343,919,400	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	340,197,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,965,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	236,582,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	811,808,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,002,000	
28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	542,064,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	237,156,000	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	506,995,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,050,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,077,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,019,000	
19回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	238,918,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,129,000	
24回 政保地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	236,900,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,660,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,865,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	562,926,620	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,741,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	227,368,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,572,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	238,360,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	241,116,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	425,838,000	

	2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,583,000	
	2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,137,000	
	6 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	42,762,000	44,873,587	
	8 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,140,000	31,717,829	
	9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,832,000	47,013,076	
	2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	47,898,000	50,823,609	
	1 3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,924,000	17,377,901	
	1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	85,360,000	87,284,014	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,027,000	16,925,954	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,532,000	63,772,883	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,024,000	47,262,143	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,495,000	79,983,172	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,090,000	172,375,306	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,296,000	294,854,382	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,063,000	288,395,386	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	286,293,000	289,422,182	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	290,136,000	292,831,363	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	290,742,000	293,434,270	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,253,000	300,690,869	
	い第779号 利付商工債	200,000,000	200,408,000	
	い第783号 利付商工債	300,000,000	300,876,000	
	3 2 5 回 利附信金中金債	400,000,000	399,884,000	
	2 2 0 号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,096,000	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	118,695,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	515,950,000	
特殊債券	合計	17,623,867,000	18,755,618,946	
社債券	1 回 B P C E S A 円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	199,246,000	
	6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	205,614,000	
	3 3 7 回 東京交通債	200,000,000	209,038,000	
	2 7 回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,664,000	
	2 2 回 中日本高速道路債	300,000,000	304,734,000	
	3 4 回 政保西日本高速道路債	200,000,000	203,798,000	
	9 回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,558,000	
	1 9 回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,382,000	
	6 回 J Xホールディングス社債	100,000,000	104,033,000	
	2 3 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,898,000	
	3 0 回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,938,000	
	1 2 回 パナソニック社債	200,000,000	200,740,000	

13回	パナソニック社債	100,000,000	101,330,000	
56回	日産自動車社債	100,000,000	100,505,000	
14回	トヨタ自動車社債	200,000,000	207,152,000	
16回	トヨタ自動車社債	200,000,000	205,530,000	
94回	丸紅社債	100,000,000	103,596,000	
45回	住友商事社債	100,000,000	103,057,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	103,186,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,604,000	
57回	東京三菱銀行社債	200,000,000	215,380,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	204,118,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,404,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	310,143,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,017,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	203,838,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	103,353,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,171,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	205,016,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	102,790,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	204,216,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	410,896,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	205,270,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,780,000	
14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,391,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,318,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	203,062,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	203,094,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	111,828,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	100,815,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	311,892,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,920,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,015,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	337,032,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,146,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	213,702,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	326,982,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,946,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	312,450,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	218,674,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,736,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	139,863,600	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	306,894,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	508,315,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,154,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	417,064,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	303,264,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	102,860,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,018,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,566,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	418,320,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	303,369,000	

253回 四国電力社債	200,000,000	207,346,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	209,712,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	416,664,000	
320回 北海道電力社債	200,000,000	202,478,000	
321回 北海道電力社債	161,000,000	166,024,810	
340回 北海道電力社債	300,000,000	301,536,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	222,058,000	
38回 電源開発社債	300,000,000	311,004,000	
23回 東京瓦斯社債	300,000,000	312,246,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	105,409,000	
27回 NTTデータ社債	100,000,000	103,571,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,688,000	
社債券 合計	14,381,000,000	14,908,422,410	
合計	266,048,767,000	290,580,963,844	

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30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,233,816,584	5,099,025,965
コール・ローン		174,163,954	123,818,746
株式		276,085,959,059	341,144,407,143
投資信託受益証券		727,049,262	835,637,262
投資証券		5,736,905,378	8,293,800,077
派生商品評価勘定		94,011,486	296,548,872
未収入金		3,784,281	1,516,771
未収配当金		478,226,822	580,952,620
差入委託証拠金		1,981,931,156	2,464,978,816
流動資産合計		290,515,847,982	358,840,686,272
資産合計		290,515,847,982	358,840,686,272
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		96,094,864	879,104
未払解約金		13,251,000	847,137,000
流動負債合計		109,345,864	848,016,104
負債合計		109,345,864	848,016,104
純資産の部			
元本等			
元本	1	85,879,794,434	101,613,958,939
剰余金			
剰余金又は欠損金()		204,526,707,684	256,378,711,229
元本等合計		290,406,502,118	357,992,670,168
純資産合計		290,406,502,118	357,992,670,168
負債純資産合計		290,515,847,982	358,840,686,272

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
<p>1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p> <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p>	<p>91,611,980,480円</p> <p>20,138,120,617円</p> <p>25,870,306,663円</p>	<p>85,879,794,434円</p> <p>41,981,551,642円</p> <p>26,247,387,137円</p>

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,845,103,642円	2,614,853,701円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,104,022円	2,619,600円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,162,575円	8,231,580円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	19,381,505円	16,074,086円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,872,931円	23,052,222円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	12,125,945円	23,592,520円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,759,108円	18,970,941円
たわらノーロード 先進国株式	5,915,663,164円	8,773,854,269円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	424,744円	423,862円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	540,654,638円	1,144,285,514円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	11,463,145円	82,979,758円
たわらノーロード バランス(堅実型)	346,989円	6,355,387円
たわらノーロード バランス(標準型)	4,082,551円	57,146,281円
たわらノーロード バランス(積極型)	10,904,902円	90,389,427円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	14,227円	251,550円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	588,618円	20,195,843円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,820,571円	60,927,417円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	1,168,664円	48,090,509円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	2,375,189円	117,262,632円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,182円	27,111円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	35,270円	147,106円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	325,553円	882,275円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	349,076円	644,665円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,079,503円	2,456,327円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	37,329,263,860円	40,492,182,730円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	155,272,827円	177,133,387円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	854,160,900円	906,381,950円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,042,632,432円	1,088,583,348円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	128,651,065円	128,570,029円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	385,326,790円	360,021,829円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	332,068,806円	323,080,800円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	32,623,606円	29,995,192円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	811,105,505円	800,847,222円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	186,981,108円	211,264,940円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	31,116,597円	215,665,489円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	76,880,278円	143,848,819円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	149,320,860円	247,137,203円
投資のソムリエ	525,467,955円	1,171,005,862円
クルーズコントロール	81,781,664円	538,564,304円
投資のソムリエ<DC年金>	36,100,432円	113,522,125円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	116,625,994円	163,600,987円
DIAM DC バランス・F(成長型)	76,361,478円	95,612,216円
クルーズコントロール<DC年金>	30,467円	386,935円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	402,135円	3,632,855円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	1,245,127円	8,330,426円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 ダイナミック・ナビゲーション	18,021,302円	40,452,146円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	395,905円	388,924円
ワールドアセットバランス(基本コース)	279,057,463円	677,295,161円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	621,453,988円	610,427,443円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	2,329,368,925円	2,047,818,007円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	765,901円	735,605円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	590,045円	574,271円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	86,101円	273,406円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,328,385円	470,923円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	5,581,613円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	97,310,489円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	-円	13,989円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	94,665,820円	90,201,971円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,918,652,247円	2,382,297,294円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	161,164,985円	12,399,511,002円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	208,761,652円	206,162,136円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	23,652,082円	21,819,707円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	103,714,081円	84,862,260円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	228,512,241円	202,579,989円
	12,671,338円	11,034,426円

D I A M国際分散バ ランスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	82,511,736円	69,806,746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)	6,831,650円	6,136,844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)	11,417,217円	6,677,114円
D I A M世界バラン スファンド4 0 V A (適格 機関投資家限定)	24,714,283円	19,449,829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)	65,916,546円	60,207,131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)	557,553,761円	496,243,087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)	691,799,410円	620,862,374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)	2,171,548,593円	1,961,153,073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)	786,997,339円	699,261,389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)	225,669,532円	114,907,490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)	924,836,705円	814,391,071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)	430,329,218円	79,803,916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)	2,754,975円	2,754,975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)	128,701,947円	25,760,341円
D I A M世界バラン スファンド3 5 V A (適格 機関投資家限定)	349,183,417円	14,513,929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)	7,824,134,623円	4,116,217,428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)	422,676,347円	108,241,032円

D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,345,791,625円	1,321,270,885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)	5,115,080,431円	5,041,193,231円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	2,032,372円	17,998,120円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	28,378,177円	860,549円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	10,651,080円	9,815,345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)	6,827,085,597円	6,734,453,010円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	42,301,326円	58,588,772円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	36,544,094円	234,611円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	257,372円	262,654円
計	85,879,794,434円	101,613,958,939円
2. 受益権の総数	85,879,794,434口	101,613,958,939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29年2月28日 至 平成30年2月26日	自 平成30年2月27日 至 平成31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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年2月26日現在	平成31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	4,722,071,531	5,782,419,306
投資信託受益証券	12,729,300	14,215,840
投資証券	91,277,789	42,208,296
合計	4,826,078,620	5,838,843,442

(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30年2月16日から平成30年2月26日まで及び平成31年2月16日から平成31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30年2月26日 現在				平成31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	42,579,342	-	42,579,000	342	1,757,991,985	-	1,758,701,720	709,735
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,194,638,950	-	1,194,765,220	126,270
イギリス・bond	42,579,342	-	42,579,000	342	168,970,416	-	169,068,000	97,584
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	48,270,854	-	48,458,410	187,556
カナダ・ドル	-	-	-	-	61,529,195	-	61,722,240	193,045
ユーロ	-	-	-	-	284,582,570	-	284,687,850	105,280
買 建	328,600,107	-	328,448,150	151,957	-	-	-	-
アメリカ・ドル	240,630,998	-	240,535,060	95,938	-	-	-	-
イギリス・bond	7,468,550	-	7,470,000	1,450	-	-	-	-
カナダ・ドル	9,609,349	-	9,623,880	14,531	-	-	-	-
ユーロ	70,891,210	-	70,819,210	72,000	-	-	-	-
合計	371,179,449	-	371,027,150	151,615	1,757,991,985	-	1,758,701,720	709,735

(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。

株式関連

種類	平成30年2月26日 現在				平成31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	7,903,918,528	-	7,901,986,765	1,931,763	6,309,670,172	-	6,606,049,675	296,379,503
合計	7,903,918,528	-	7,901,986,765	1,931,763	6,309,670,172	-	6,606,049,675	296,379,503

(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30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
1口当たり純資産額	3.3815円	3.5231円
(1万口当たり純資産額)	(33,815円)	(35,231円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成31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	36,108	1,631.560	58,912,368.480	
	ABBOTT LABORATORIES	151,576	76.130	11,539,480.880	
	AES CORP	55,631	17.530	975,211.430	
	ABIOMED INC	3,560	352.600	1,255,256.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	79,815	139.250	11,114,238.750	
	ADVANCED MICRO DEVICES	76,385	24.360	1,860,738.600	
	ADOBE INC	42,294	258.900	10,949,916.600	
	CHUBB LTD	39,378	134.510	5,296,734.780	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,465	180.120	3,506,035.800	
	ALLEGHANY CORP	1,325	630.410	835,293.250	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	127.120	621,998.160	
	ALLSTATE CORP	30,651	94.570	2,898,665.070	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	64,120	153.200	9,823,184.000	
	AMGEN INC	56,543	187.500	10,601,812.500	
	HESS CORP	23,734	57.160	1,356,635.440	
	AMERICAN EXPRESS CO	64,365	107.440	6,915,375.600	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	42,628	81.720	3,483,560.160	
	AFLAC INC	63,317	48.750	3,086,703.750	
	AMERICAN INTL GROUP	77,910	42.870	3,340,001.700	
	AMERCO	551	376.980	207,715.980	
	ANALOG DEVICES	32,962	105.910	3,491,005.420	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,877	43.690	1,873,296.130	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,482	129.730	2,527,399.860	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	81,035	35.770	2,898,621.950	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	167.190	683,305.530	
	VALERO ENERGY CORP	37,219	85.320	3,175,525.080	
	APACHE CORP	36,095	33.470	1,208,099.650	
	ANSYS INC	7,633	175.480	1,339,438.840	
	APPLE INC	420,491	172.970	72,732,328.270	
	APPLIED MATERIALS INC	83,106	39.430	3,276,869.580	
	ALBEMARLE CORP	9,826	89.180	876,282.680	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	49,679	42.490	2,110,860.710	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	93.220	894,912.000	
	AMEREN CORP	22,070	72.180	1,593,012.600	
ARROW ELECTRONICS INC	8,346	81.940	683,871.240		
AUTOLIV INC	6,197	81.230	503,382.310		

AUTODESK INC	19,295	161.510	3,116,335.450
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,336	153.180	5,719,128.480
AUTOZONE INC	2,231	911.660	2,033,913.460
AVERY DENNISON CORP	8,042	106.940	860,011.480
BALL CORP	27,803	55.260	1,536,393.780
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	113,163	201.910	22,848,741.330
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	86,363	53.220	4,596,238.860
BAXTER INTERNATIONAL INC	44,971	74.680	3,358,434.280
BECTON DICKINSON & CO	22,865	249.660	5,708,475.900
AMETEK INC	19,925	79.400	1,582,045.000
VERIZON COMM INC	360,110	56.920	20,497,461.200
WR BERKLEY CORP	8,134	82.550	671,461.700
BEST BUY CO INC	23,206	60.440	1,402,570.640
YUM! BRANDS INC	27,859	95.390	2,657,470.010
FIRSTENERGY CORP	41,503	40.720	1,690,002.160
H&R BLOCK INC	16,114	25.080	404,139.120
BOEING CO	47,645	424.050	20,203,862.250
ROBERT HALF INTL INC	10,827	68.260	739,051.020
BORGWARNER INC	21,554	41.680	898,370.720
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,820	40.520	4,855,106.400
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	91.940	1,080,754.700
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,153	87.070	884,021.710
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	678.830	1,454,053.860
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	142,627	50.980	7,271,124.460
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,215	109.130	569,112.950
INGREDION INC	5,305	93.660	496,866.300
ONEOK INC	37,402	67.870	2,538,473.740
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	99.710	588,289.000
UNITED RENTALS INC	7,693	136.840	1,052,710.120
SEMPRA ENERGY	23,049	118.480	2,730,845.520
FEDEX CORP	21,525	180.490	3,885,047.250
VERISIGN INC	9,648	178.790	1,724,965.920
AMPHENOL CORP	25,201	94.340	2,377,462.340
BROWN-FORMAN CORP	23,558	48.840	1,150,572.720
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153,241	6.060	928,640.460
CSX CORP	71,027	73.310	5,206,989.370
CABOT OIL & GAS CORP	38,255	24.260	928,066.300
CAMPBELL SOUP CO	14,050	32.830	461,261.500
SEAGATE TECHNOLOGY	24,337	47.010	1,144,082.370
CONSTELLATION BRANDS INC	14,553	169.060	2,460,330.180
CARDINAL HEALTH INC	26,919	54.900	1,477,853.100

CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,448	58.820	2,085,051.360	
CATERPILLAR INC	52,182	138.680	7,236,599.760	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	11,232	122.760	1,378,840.320	
CELGENE CORP	60,871	89.140	5,426,040.940	
CITRIX SYSTEMS INC	12,526	105.190	1,317,609.940	
CENTURYLINK INC	80,424	13.440	1,080,898.560	
CERNER CORP	26,414	57.730	1,524,880.220	
JPMORGAN CHASE & CO	292,732	105.000	30,736,860.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	22,243	66.280	1,474,266.040	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,286	86.120	1,230,310.320	
CINTAS CORP	7,944	204.400	1,623,753.600	
CISCO SYSTEMS INC	410,672	50.110	20,578,773.920	
CLOROX COMPANY	10,885	159.580	1,737,028.300	
COCA-COLA CO/THE	352,046	45.280	15,940,642.880	
COPART INC	18,944	58.290	1,104,245.760	
COGNEX CORP	15,291	51.830	792,532.530	
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,000	66.900	4,749,900.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	26,313	128.840	3,390,166.920	
COMERICA INC	14,931	88.100	1,315,421.100	
NRG ENERGY, INC.	25,631	42.220	1,082,140.820	
COMCAST CORP-CL A	394,384	38.610	15,227,166.240	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	23.380	948,596.740	
CONSOLIDATED EDISON INC	26,733	82.100	2,194,779.300	
CMS ENERGY CORP	23,616	54.200	1,279,987.200	
COOPER COS INC	4,484	292.590	1,311,973.560	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	61.930	1,003,266.000	
CORNING INC	68,691	34.850	2,393,881.350	
SEALED AIR CORP	13,870	43.450	602,651.500	
CUMMINS INC	13,193	155.440	2,050,719.920	
DR HORTON INC	32,152	40.840	1,313,087.680	
DANAHER CORP	55,286	113.480	6,273,855.280	
MOODY'S CORP	15,493	172.700	2,675,641.100	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,331	72.380	3,642,957.780	
TARGET CORP	43,650	72.250	3,153,712.500	
DEERE & CO	26,237	165.970	4,354,554.890	
MORGAN STANLEY	113,217	41.790	4,731,338.430	
REPUBLIC SERVICES INC	19,891	77.630	1,544,138.330	
COSTAR GROUP INC	2,994	411.820	1,232,989.080	
THE WALT DISNEY CO	128,037	115.250	14,756,264.250	
DOLLAR TREE INC	20,078	97.110	1,949,774.580	
DOVER CORP	12,635	92.330	1,166,589.550	
OMNICOM GROUP	19,325	75.630	1,461,549.750	
DTE ENERGY CO	16,034	123.720	1,983,726.480	
DUKE ENERGY CORP	61,177	89.910	5,500,424.070	
FLOWSERVE CORP	13,139	46.560	611,751.840	

DARDEN RESTAURANTS INC	10,990	111.760	1,228,242.400
EBAY INC	83,227	37.490	3,120,180.230
BANK OF AMERICA CORP	827,712	29.080	24,069,864.960
CITIGROUP INC	216,690	64.140	13,898,496.600
EASTMAN CHEMICAL CO	13,009	84.450	1,098,610.050
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,624	48.890	1,057,197.360
EATON CORP PLC	38,409	80.790	3,103,063.110
EATON VANCE CORP	9,184	41.640	382,421.760
CADENCE DESIGN SYS INC	24,922	56.570	1,409,837.540
DISH NETWORK CORP	21,762	32.820	714,228.840
ECOLAB INC	22,192	167.010	3,706,285.920
ELECTRONIC ARTS INC	27,214	95.920	2,610,366.880
SALESFORCE.COM INC	62,435	161.310	10,071,389.850
EMERSON ELECTRIC CO	54,324	68.550	3,723,910.200
ATMOS ENERGY CORP	10,220	99.480	1,016,685.600
ENTERGY CORP	16,259	92.770	1,508,347.430
EOG RESOURCES INC	50,726	95.530	4,845,854.780
EQUIFAX INC	10,231	110.760	1,133,185.560
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,424	158.980	3,088,027.520
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	75.800	1,121,233.600
EXXON MOBIL CORP	369,652	78.420	28,988,109.840
FMC CORP	12,634	88.510	1,118,235.340
NEXTERA ENERGY INC	41,234	188.130	7,757,352.420
ASSURANT INC	4,089	98.340	402,112.260
FASTENAL CO	25,418	62.660	1,592,691.880
FIFTH THIRD BANCORP	60,050	27.830	1,671,191.500
M&T BANK CORP	12,494	172.470	2,154,840.180
FISERV INC	35,737	85.030	3,038,717.110
FLIR SYSTEMS INC	11,623	52.600	611,369.800
MACY'S INC	24,741	24.060	595,268.460
FORD MOTOR CO	324,391	8.710	2,825,445.610
FRANKLIN RESOURCES INC	28,548	32.730	934,376.040
FREEPORT-MCMORAN INC	117,269	13.220	1,550,296.180
FLEX LTD	67,669	10.610	717,968.090
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,478	80.600	1,328,126.800
GAP INC/THE	18,295	24.760	452,984.200
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	41.630	727,567.510
GENERAL DYNAMICS CORP	22,143	172.540	3,820,553.220
GENERAL MILLS INC	52,709	46.580	2,455,185.220
GENUINE PARTS CO	13,432	110.810	1,488,399.920
GILEAD SCIENCES INC	113,377	65.740	7,453,403.980
GARTNER INC	8,412	142.300	1,197,027.600
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	19.350	350,176.950
MCKESSON CORP	16,848	131.490	2,215,343.520
NVIDIA CORP	50,490	159.190	8,037,503.100
GENERAL ELECTRIC CO	761,066	10.170	7,740,041.220
WW GRAINGER INC	4,331	312.370	1,352,874.470
HALLIBURTON CO	73,763	31.320	2,310,257.160
MONSTER BEVERAGE CORP	36,373	58.440	2,125,638.120

GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,711	196.000	6,019,356.000
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	37.110	478,756.110
HARRIS CORP	10,033	165.880	1,664,274.040
HASBRO INC	10,927	86.000	939,722.000
HENRY SCHEIN INC	13,800	59.940	827,172.000
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	55.020	553,226.100
HERSHEY FOODS CORP	12,135	110.220	1,337,519.700
HP INC	137,654	23.740	3,267,905.960
F5 NETWORKS INC	4,874	172.080	838,717.920
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	54.480	570,514.560
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	118.300	407,780.100
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	27.610	765,901.400
HOLLYFRONTIER CORP	15,339	55.520	851,621.280
HOLOGIC INC	23,377	46.960	1,097,783.920
UNUM GROUP	20,720	37.270	772,234.400
HOME DEPOT INC	99,838	192.390	19,207,832.820
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	87.870	1,324,991.730
HORMEL FOODS CORP	24,161	42.910	1,036,748.510
CENTERPOINT ENERGY INC	43,020	31.400	1,350,828.000
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,569	248.700	887,610.300
HUMANA INC	11,962	309.680	3,704,392.160
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	109.110	802,940.490
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,648	14.330	1,341,975.840
RED HAT INC	15,843	182.830	2,896,575.690
NEKTAR THERAPEUTICS	15,689	40.050	628,344.450
BIOGEN INC	17,388	325.330	5,656,838.040
IDEX CORP	7,174	144.550	1,037,001.700
ILLINOIS TOOL WORKS	26,425	144.830	3,827,132.750
INTUIT INC	20,880	250.940	5,239,627.200
IDEXX LABORATORIES INC	7,402	209.180	1,548,350.360
INGERSOLL-RAND PLC	21,989	106.330	2,338,090.370
INTEL CORP	401,649	52.490	21,082,556.010
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,446	128.230	954,800.580
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	46.740	1,541,625.420
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	23.750	692,478.750
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	74.450	717,027.950
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,247	132.560	960,662.320
INCYTE CORP	15,601	84.850	1,323,744.850
JOHNSON & JOHNSON	233,610	136.600	31,911,126.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	48.890	1,439,370.490
KLA-TENCOR CORP	13,639	114.490	1,561,529.110
DEVON ENERGY CORP	44,878	29.650	1,330,632.700
KELLOGG CO	21,564	56.730	1,223,325.720

EAST WEST BANCORP INC	14,600	55.340	807,964.000
KEYCORP	88,511	17.650	1,562,219.150
KIMBERLY-CLARK CORP	30,175	119.100	3,593,842.500
BLACKROCK INC/NEW YORK	10,326	436.720	4,509,570.720
KOHL'S CORP	14,910	64.370	959,756.700
KROGER CO	66,610	28.520	1,899,717.200
LAM RESEARCH CORP	13,725	179.220	2,459,794.500
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,982	98.290	882,840.780
AKAMA I TECHNOLOGIES	15,452	69.860	1,079,476.720
LEGGETT & PLATT INC	9,588	45.880	439,897.440
LENNAR CORP	26,065	50.250	1,309,766.250
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	29,862	20.240	604,406.880
ELI LILLY & CO	84,573	124.000	10,487,052.000
L BRANDS INC	21,698	27.060	587,147.880
LINCOLN NATIONAL CORP	18,890	62.810	1,186,480.900
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,555	110.360	6,682,849.800
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,167	78.420	2,208,856.140
LOCKHEED MARTIN CORP	22,560	307.130	6,928,852.800
LOEWS CORP	21,346	47.790	1,020,125.340
LOWE'S COS INC	71,070	106.270	7,552,608.900
DOMINION ENERGY INC	65,473	75.050	4,913,748.650
MGM RESORTS INTERNATIONAL	46,414	27.710	1,286,131.940
MCCORMICK & CO INC	10,952	135.740	1,486,624.480
MCDONALD'S CORPORATION	67,589	183.170	12,380,277.130
S&P GLOBAL INC	21,599	201.880	4,360,406.120
EVEREST RE GROUP LTD	3,751	223.910	839,886.410
MANPOWERGROUP INC	6,265	84.960	532,274.400
MARKEL CORPORATION	1,222	1,002.000	1,224,444.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	18,526	172.510	3,195,920.260
MARSH & MCLENNAN COS	43,593	92.550	4,034,532.150
MASCO CORP	28,638	37.810	1,082,802.780
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	190.000	1,022,580.000
MATTEL INC	24,003	14.070	337,722.210
METLIFE INC	70,251	44.740	3,143,029.740
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,323	55.900	1,359,655.700
MEDTRONIC PLC	117,947	93.770	11,059,890.190
ACTIVISION BLIZZARD INC	62,953	41.500	2,612,549.500
CVS HEALTH CORP	113,150	61.950	7,009,642.500
MERCK & CO. INC.	231,930	80.770	18,732,986.100
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	39,897	22.840	911,247.480
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,994	148.760	1,337,947.440
MICROSOFT CORP	634,442	110.970	70,404,028.740
MICRON TECH INC	101,604	42.570	4,325,282.280

MIDDLEBY CORP	4,100	119.230	488,843.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,269	89.040	1,804,751.760
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	55,242	19.650	1,085,505.300
3M CO	50,559	209.350	10,584,526.650
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,093	140.500	856,066.500
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,680	139.980	2,054,906.400
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	111.350	986,115.600
MYLAN NV	43,574	31.260	1,362,123.240
ILLUMINA INC	12,690	301.060	3,820,451.400
XCEL ENERGY INC	44,702	55.270	2,470,679.540
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	28.480	953,168.640
NETAPP INC	23,104	66.020	1,525,326.080
NEWELL BRANDS INC	43,380	17.060	740,062.800
NEWMONT MINING CORP	45,565	36.480	1,662,211.200
NVR INC	307	2,680.000	822,760.000
NIKE INC-CL B	112,086	84.760	9,500,409.360
NOBLE ENERGY INC	39,436	23.160	913,337.760
NORDSTROM INC	9,487	44.040	417,807.480
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,531	183.300	4,496,532.300
EVERSOURCE ENERGY	27,088	70.300	1,904,286.400
NISOURCE INC	31,548	26.640	840,438.720
TAPESTRY INC	26,818	35.460	950,966.280
NORTHERN TRUST CORP	17,867	92.640	1,655,198.880
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,967	288.710	4,032,412.570
WELLS FARGO & CO	398,635	49.020	19,541,087.700
NUCOR CORP	28,241	61.190	1,728,066.790
CHENIERE ENERGY INC	19,175	65.200	1,250,210.000
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,783	81.200	3,392,779.600
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	65,907	65.930	4,345,248.510
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	151.860	746,695.620
OGE ENERGY CORP	16,028	42.790	685,838.120
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,014	383.990	2,693,305.860
ORACLE CORP	260,788	52.480	13,686,154.240
PACCAR INC	29,661	69.890	2,073,007.290
PTC INC	10,028	92.980	932,403.440
EXELON CORP	82,176	48.740	4,005,258.240
PARKER HANNIFIN CORP	11,023	175.770	1,937,512.710
PAYCHEX INC	28,792	75.890	2,185,024.880
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,875	253.990	1,746,181.250
PPL CORPORATION	63,229	31.640	2,000,565.560
PEPSICO INC	121,484	116.760	14,184,471.840
PENTAIR PLC	16,869	43.050	726,210.450
PFIZER INC	511,213	42.960	21,961,710.480
CONOCOPHILLIPS	99,913	69.970	6,990,912.610
PVH CORP	6,862	117.620	807,108.440

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,308	142.130	2,033,596.040	
ALTRIA GROUP INC	164,568	51.500	8,475,252.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,730	124.150	4,932,479.500	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,726	87.140	498,963.640	
GARMIN LTD	10,774	83.070	894,996.180	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	38.390	377,028.190	
PPG INDUSTRIES INC	20,371	111.440	2,270,144.240	
IPG PHOTONICS CORP	3,652	156.430	571,282.360	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,478	216.290	8,322,406.620	
T ROWE PRICE GROUP INC	21,816	98.050	2,139,058.800	
QUEST DIAGNOSTICS	12,875	87.800	1,130,425.000	
PROCTER & GAMBLE CO	216,805	100.250	21,734,701.250	
PROGRESSIVE CORP	50,598	72.270	3,656,717.460	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,956	57.300	2,518,678.800	
PULTE GROUP INC	21,209	27.980	593,427.820	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	127.730	1,712,348.380	
QUALCOMM INC	122,758	53.120	6,520,904.960	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,337	83.560	1,030,879.720	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,948	145.080	572,775.840	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,045	422.520	2,976,653.400	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,079	144.110	876,044.690	
RESMED INC	12,271	101.240	1,242,316.040	
US BANCORP	135,109	51.280	6,928,389.520	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,269	71.230	731,460.870	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,125	32.300	1,199,137.500	
ROSS STORES INC	32,858	94.370	3,100,809.460	
ROLLINS INC	12,378	39.430	488,064.540	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,248	317.190	2,933,373.120	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	179.230	1,870,981.970	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,121	120.930	1,707,652.530	
RAYTHEON COMPANY	24,616	186.610	4,593,591.760	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	174.060	669,782.880	
ACCENTURE PLC-CL A	55,807	161.500	9,012,830.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	125,693	47.720	5,998,069.960	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	171.090	1,884,727.440	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,127	131.020	3,030,099.540	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,313	107.090	3,139,129.170	
BOOKING HOLDINGS INC	4,154	1,910.520	7,936,300.080	

SCHLUMBERGER LTD	121,122	44.360	5,372,971.920
SCHWAB (CHARLES) CORP	105,264	46.170	4,860,038.880
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,138	124.440	2,257,092.720
BUNGE LTD	10,334	51.770	534,991.180
SEI INVESTMENTS CO	12,294	52.650	647,279.100
ANTHEM INC	22,780	316.790	7,216,476.200
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,724	85.670	1,261,405.080
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,093	52.870	1,379,536.910
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,397	439.880	3,253,792.360
CENTENE CORP	34,256	64.010	2,192,726.560
SVB FINANCIAL GROUP	4,852	245.820	1,192,718.640
IAC INTERACTIVE CORP	6,938	219.080	1,519,977.040
SMITH (A.O.) CORP	14,699	53.180	781,692.820
ACUITY BRANDS INC	3,087	130.630	403,254.810
SNAP-ON INC	4,935	161.340	796,212.900
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,083	95.010	3,333,235.830
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	161.470	1,022,105.100
EDISON INTERNATIONAL	29,504	61.410	1,811,840.640
SOUTHERN CO	86,524	50.370	4,358,213.880
BB&T CORP	67,781	51.490	3,490,043.690
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	53.620	608,694.240
AT&T INC	633,005	31.150	19,718,105.750
CHEVRON CORP	164,712	119.390	19,664,965.680
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	138.920	1,816,656.840
STATE STREET CORP	33,680	72.400	2,438,432.000
STARBUCKS CORP	117,920	71.300	8,407,696.000
STEEL DYNAMICS INC	19,030	39.060	743,311.800
STRYKER CORP	29,638	188.670	5,591,801.460
NETFLIX INC	38,042	363.020	13,810,006.840
SUNTRUST BANKS INC	40,838	66.270	2,706,334.260
SYMANTEC CORP	55,368	22.670	1,255,192.560
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	33.600	329,044.800
SYNOPSIS INC	13,239	102.300	1,354,349.700
SYSCO CORP	43,043	67.330	2,898,085.190
INTUITIVE SURGICAL INC	9,901	551.860	5,463,965.860
TELEFLEX INC	3,905	285.420	1,114,565.100
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	80,553	17.250	1,389,539.250
TEXAS INSTRUMENTS INC	84,628	107.310	9,081,430.680
TEXTRON INC	22,199	55.060	1,222,276.940
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35,336	252.100	8,908,205.600
TIFFANY & CO	8,733	92.700	809,549.100
TORCHMARK CORP	10,661	82.940	884,223.340
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	93.790	1,349,075.360

DAVITA INC	10,878	58.700	638,538.600
TRACTOR SUPPLY CO	11,088	96.040	1,064,891.520
TRIMBLE INC	20,073	40.000	802,920.000
TYSON FOODS INC	24,607	63.320	1,558,115.240
UGI CORP	14,725	54.360	800,451.000
MARATHON OIL CORP	71,846	16.890	1,213,478.940
UNION PACIFIC CORP	63,870	170.060	10,861,732.200
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,943	127.770	9,064,387.110
UNITEDHEALTH GROUP INC	83,999	267.110	22,436,972.890
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,743	136.040	1,053,357.720
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,438	133.020	1,122,422.760
VF CORP	30,057	86.500	2,599,930.500
CBS CORP	30,711	51.690	1,587,451.590
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,369	185.760	4,155,265.440
VULCAN MATERIALS CO	12,142	112.680	1,368,160.560
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	71,945	70.430	5,067,086.350
WALMART INC	127,054	99.550	12,648,225.700
WASTE MANAGEMENT INC	36,986	99.730	3,688,613.780
WATERS CORP	6,953	235.410	1,636,805.730
ALLERGAN PLC	29,620	136.700	4,049,054.000
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,459	101.420	1,060,751.780
VAIL RESORTS INC	3,773	208.560	786,896.880
WESTERN DIGITAL CORP	26,076	49.490	1,290,501.240
WABTEC CORP	7,530	73.360	552,400.800
WHIRLPOOL CORP	5,553	145.580	808,405.740
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,296	82.420	1,343,116.320
WYNN RESORTS LTD	9,240	131.750	1,217,370.000
NASDAQ INC	9,132	89.040	813,113.280
CME GROUP INC	30,437	178.060	5,419,612.220
WILLIAMS COS INC	106,174	27.110	2,878,377.140
LKQ CORP	26,690	27.330	729,437.700
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	45.680	909,488.800
WEC ENERGY GROUP INC	28,063	76.640	2,150,748.320
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,664	57.000	1,462,848.000
CARMAX INC	15,979	60.540	967,368.660
XEROX CORP	17,455	31.490	549,657.950
XILINX INC	21,093	122.750	2,589,165.750
CIMAREX ENERGY CO	9,253	74.180	686,387.540
TJX COMPANIES INC	107,399	50.350	5,407,539.650
ZIONS BANCORP NA	16,584	51.170	848,603.280
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	9.000	246,600.000
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.280	556,192.000

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	71.210	1,117,997.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	40.280	688,788.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	78.180	640,450.560	
SIGNATURE BANK	4,171	135.920	566,922.320	
CBRE GROUP INC	29,499	50.870	1,500,614.130	
LIBERTY GLOBAL PLC	19,835	26.070	517,098.450	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,350	276.260	1,201,731.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	92,992	16.240	1,510,190.080	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	260.710	848,871.760	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	75.570	226,710.000	
T-MOBILE US INC	30,213	73.200	2,211,591.600	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,332	61.610	2,053,584.520	
MOSAIC CO/THE	31,433	32.300	1,015,285.900	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	39,026	50.830	1,983,691.580	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	91,784	51.170	4,696,587.280	
CELANESE CORP	11,880	103.740	1,232,431.200	
DEXCOM INC	7,665	136.860	1,049,031.900	
DISCOVERY INC-A	10,423	29.210	304,455.830	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	126.980	1,317,163.540	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	44.070	814,193.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,493	134.890	1,685,180.770	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	25.170	1,052,559.060	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,425	75.180	3,715,771.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	21.680	318,609.280	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	29.190	883,931.580	
LIVE NATION	13,682	56.860	777,958.520	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,224	600.220	1,334,889.280	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,191	89.430	553,661.130	
TRANSDIGM GROUP INC	4,312	436.890	1,883,869.680	
MASTERCARD INC	80,615	223.320	18,002,941.800	
QURATE RETAIL INC	35,733	21.800	778,979.400	
HANESBRANDS INC	27,619	19.130	528,351.470	
WESTERN UNION CO	35,222	17.830	628,008.260	
OWENS CORNING	10,591	51.120	541,411.920	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,182	64.490	850,107.180	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	46.370	537,242.820	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	98.000	899,150.000	

MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	23.720	429,308.280	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,519	100.840	1,060,735.960	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,653	17.690	524,561.570	
DELTA AIR LINES INC	13,898	51.520	716,024.960	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	44.780	284,532.120	
DISCOVER FINANCIAL	29,057	71.460	2,076,413.220	
TE CONNECTIVITY LTD	29,610	83.350	2,467,993.500	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	17,807	106.040	1,888,254.280	
WABCO HOLDING INC	4,076	119.070	485,329.320	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,080	149.260	1,355,280.800	
VMWARE INC	6,648	173.380	1,152,630.240	
MERCADOLIBRE INC	3,750	374.060	1,402,725.000	
ULTA BEAUTY INC	5,020	310.720	1,559,814.400	
INVESCO LTD	42,125	19.050	802,481.250	
MSCI INC	7,537	177.160	1,335,254.920	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	136,077	87.150	11,859,110.550	
VISA INC	155,128	145.870	22,628,521.360	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,933	100.980	1,608,914.340	
DISCOVERY INC-C	29,484	27.510	811,104.840	
MARATHON PETROLEUM CORP	59,929	65.020	3,896,583.580	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	48.650	565,507.600	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	176,914	19.320	3,417,978.480	
XYLEM INC	15,111	74.800	1,130,302.800	
ALKERMES PLC	12,053	33.430	402,931.790	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	28,987	89.140	2,583,901.180	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	217.110	755,325.690	
SPLUNK INC	12,240	134.560	1,647,014.400	
HCA HEALTHCARE INC	24,178	144.040	3,482,599.120	
VERISK ANALYTICS INC	13,405	125.030	1,676,027.150	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,474	126.010	689,778.740	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,443	228.430	1,700,204.490	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,676	103.670	1,417,790.920	
CIT GROUP INC	9,287	51.300	476,423.100	
NXP SEMICONDUCTOR NV	30,600	94.510	2,892,006.000	
TARGA RESOURCES CORP	17,811	41.880	745,924.680	
LEAR CORP	6,172	155.620	960,486.640	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,084	96.600	974,114.400	

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	59.880	1,017,960.000	
DOLLAR GENERAL CORP	22,291	118.380	2,638,808.580	
FORTINET INC	11,399	86.790	989,319.210	
AON PLC	20,942	172.060	3,603,280.520	
TESLA INC	10,991	294.710	3,239,157.610	
GENERAL MOTORS CO	110,050	39.990	4,400,899.500	
WORLDPAY INC	26,592	88.790	2,361,103.680	
XPO LOGISTICS INC	12,825	52.170	669,080.250	
TRIPADVISOR INC	9,263	54.940	508,909.220	
ALLY FINANCIAL INC	39,819	26.950	1,073,122.050	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	43.840	532,129.920	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	49.950	675,573.750	
APTIV PLC	22,571	82.360	1,858,947.560	
PHILLIPS 66	38,115	97.360	3,710,876.400	
FACEBOOK INC	210,280	161.890	34,042,229.200	
IQVIA HOLDINGS INC	13,426	142.460	1,912,667.960	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	104.030	1,363,729.270	
SERVICENOW INC	15,071	235.000	3,541,685.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,935	230.100	1,825,843.500	
WORKDAY INC	12,376	194.700	2,409,607.200	
ABBVIE INC	131,976	80.020	10,560,719.520	
ZOETIS INC	42,209	94.610	3,993,393.490	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	19,821	55.350	1,097,092.350	
COTY INC	38,541	11.270	434,357.070	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.980	392,813.740	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	44.240	570,297.840	
CDW CORP	13,040	95.750	1,248,580.000	
SPRINT CORP	63,882	6.440	411,400.080	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	35.490	361,962.510	
ARCONIC INC	36,761	18.280	671,991.080	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	17,852	32.180	574,477.360	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.530	202,893.180	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	40.770	731,046.870	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	19.660	302,960.600	
BAKER HUGHES A GE CO	43,404	26.350	1,143,695.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,611	70.500	889,075.500	
TECHNIPFMC LTD	38,724	22.710	879,422.040	
BROADCOM INC	37,655	276.500	10,411,607.500	
BURLINGTON STORES INC	6,007	164.190	986,289.330	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	43.080	430,153.800	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	9.640	126,891.320	
VEEVA SYSTEMS INC	10,852	118.690	1,288,023.880	
TWITTER INC	56,256	31.710	1,783,877.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	17,181	51.030	876,746.430	

EVERGY INC	24,427	55.490	1,355,454.230
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	23.650	353,212.750
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	23.820	307,754.400
ALLEGION PLC	7,325	89.700	657,052.500
WIX.COM LTD	4,000	111.960	447,840.000
PERRIGO CO PLC	10,553	48.940	516,463.820
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	23,927	85.030	2,034,512.810
ARAMARK	21,772	32.270	702,582.440
CIGNA CORP	32,831	193.770	6,361,662.870
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	56.180	728,092.800
GRUBHUB INC	8,158	79.970	652,395.260
SABRE CORP	25,826	22.790	588,574.540
PARSLEY ENERGY INC	17,454	19.330	337,385.820
ARISTA NETWORKS INC	4,441	274.970	1,221,141.770
IHS MARKIT LTD	34,991	53.110	1,858,372.010
FNF GROUP	25,311	35.130	889,175.430
SYNCHRONY FINANCIAL	60,568	31.880	1,930,907.840
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	40,320	37.230	1,501,113.600
CDK GLOBAL INC	12,715	58.180	739,758.700
WAYFAIR INC	5,091	149.950	763,395.450
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,515	82.460	1,279,366.900
QORVO INC	10,887	67.800	738,138.600
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	25.800	415,096.200
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	10,018	90.080	902,421.440
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	23,155	27.050	626,342.750
GODADDY INC	14,641	76.000	1,112,716.000
NIELSEN HOLDINGS PLC	32,827	26.100	856,784.700
TRANSUNION	17,208	63.530	1,093,224.240
SQUARE INC	26,820	76.080	2,040,465.600
DOWDUPONT INC	199,338	54.970	10,957,609.860
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	47.090	805,239.000
WESTROCK CO	22,394	39.270	879,412.380
KRAFT HEINZ CO	54,603	34.950	1,908,374.850
FORTIVE CORP	26,779	81.370	2,179,007.230
WASTE CONNECTIONS INC	23,491	83.420	1,959,619.220
ALPHABET INC-CL A	26,079	1,116.560	29,118,768.240
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,608	16.320	2,049,922.560
PAYPAL HOLDINGS INC	98,655	95.980	9,468,906.900
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	19.340	449,074.800
FIRST DATA CORP	44,487	25.270	1,124,186.490
DXC TECHNOLOGY CO	23,734	66.670	1,582,345.780
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	44.280	360,173.520

	ALPHABET INC-CL C	27,382	1,110.370	30,404,151.340	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	137.780	435,247.020	
	L3 TECHNOLOGIES INC	6,752	213.850	1,443,915.200	
	CHEMOURS CO	12,723	39.220	498,996.060	
	LINDE PLC	48,171	173.500	8,357,668.500	
	ATHENE HOLDING LTD	11,784	44.730	527,098.320	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,227	350.080	4,980,588.160	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	26.890	806,700.000	
アメリカ・ドル 小計		26,370,087		2,089,833,884.770 (231,511,797,754)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	46,324	9.460	438,225.040	
	ASHTED GROUP	42,154	20.570	867,107.780	
	SEVERN TRENT PLC	25,530	20.310	518,514.300	
	BHP GROUP PLC	182,343	18.274	3,332,135.980	
	BARCLAYS PLC	1,506,906	1.561	2,352,280.260	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103,764	5.752	596,850.520	
	BT GROUP PLC	760,443	2.280	1,733,810.040	
	BUNZL PLC	27,838	25.390	706,806.820	
	EASYJET PLC	13,628	12.975	176,823.300	
	AVIVA PLC	350,451	4.257	1,491,869.900	
	CRODA INTERNATIONAL	10,645	50.780	540,553.100	
	DIAGEO PLC	212,915	30.195	6,428,968.420	
	SCHRODERS PLC	10,932	27.140	296,694.480	
	DCC PLC	9,753	65.900	642,722.700	
	NATIONAL GRID PLC	293,775	8.616	2,531,165.400	
	KINGFISHER PLC	165,680	2.336	387,028.480	
	BAE SYSTEMS PLC	268,920	4.708	1,266,075.360	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	200,984	28.715	5,771,255.560	
	NEXT PLC	12,064	49.930	602,355.520	
	IMPERIAL BRANDS PLC	84,312	26.040	2,195,484.480	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	31.840	478,141.280	
	ANGLO AMERICAN PLC	96,727	20.570	1,989,674.390	
	COMPASS GROUP PLC	139,409	17.260	2,406,199.340	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,745,053	6.235	10,880,405.450	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	508,463	2.719	1,382,510.890	
	CENTRICA PLC	471,340	1.225	577,391.500	
	UNILEVER PLC	100,306	41.900	4,202,821.400	
	MEGGITT PLC	62,181	5.656	351,695.730	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,551	2.296	529,345.090	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.528	464,665.130	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.370	434,239.680		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	23.130	699,451.200		
PEARSON PLC	65,009	9.030	587,031.270		

PERSIMMON PLC	26,085	24.680	643,777.800
PRUDENTIAL PLC	221,979	15.350	3,407,377.650
RIO TINTO PLC	99,624	44.650	4,448,211.600
VODAFONE GROUP PLC	2,332,041	1.418	3,306,834.130
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58,278	58.790	3,426,163.620
RELX PLC	173,666	17.695	3,073,019.870
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	138,993	9.818	1,364,633.270
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	449,443	2.561	1,151,023.520
ST JAMES'S PLACE PLC	61,191	9.566	585,353.100
SSE PLC	84,479	11.820	998,541.780
BP PLC	1,755,946	5.371	9,431,185.960
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.638	566,028.890
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.480	459,305.600
STANDARD CHARTERED PLC	258,366	6.091	1,573,707.300
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,133,835	0.600	3,680,301.000
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.675	423,811.850
TESCO PLC	877,157	2.228	1,954,305.790
3I GROUP PLC	88,662	9.530	844,948.860
SMITH & NEPHEW PLC	74,903	14.335	1,073,734.500
GLAXOSMITHKLINE PLC	436,021	15.362	6,698,154.600
WEIR GROUP	18,336	16.285	298,601.760
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	45.100	1,184,596.600
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	5.720	121,847.440
WPP PLC	107,494	8.450	908,324.300
FERGUSON PLC	21,079	53.850	1,135,104.150
ASTRAZENECA PLC	111,261	61.590	6,852,564.990
WHITBREAD PLC	15,639	48.940	765,372.660
CARNIVAL PLC	16,492	43.510	717,566.920
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.884	346,916.360
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	5.324	260,812.110
INTERTEK GROUP PLC	14,335	51.500	738,252.500
BURBERRY GROUP PLC	38,727	19.565	757,693.750
INVESTEC PLC	50,655	4.875	246,943.120
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,125	45.970	695,296.250
ITV PLC	370,908	1.339	496,645.810
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.336	320,534.240
G4S PLC	122,250	2.135	261,003.750
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	21.850	347,262.050
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	38.320	411,020.320
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	404,766	23.985	9,708,312.510
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	324,753	24.145	7,841,161.180
TUI AG-DI	45,043	8.332	375,298.270
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.356	505,868.540

	EXPERIAN PLC	80,395	20.560	1,652,921.200	
	MONDI PLC	28,318	18.890	534,927.020	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	17.100	364,059.000	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	9.934	155,357.820	
	INFORMA PLC	102,475	7.238	741,714.050	
	GLENCORE PLC	982,806	3.088	3,034,904.920	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	6.280	311,601.040	
	NMC HEALTH PLC	8,149	27.700	225,727.300	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.545	399,500.230	
	COCA-COLA HBC AG	19,447	26.410	513,595.270	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.290	152,736.000	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	2.867	157,857.020	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.616	180,933.790	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	18.655	603,340.010	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.665	356,163.420	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.740	726,658.800	
イギリス・ポンド	小計	26,012,586		152,379,716.950 (22,058,487,825)	
イスラエル・シユケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	24.820	1,946,582.960	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	128,049	23.880	3,057,810.120	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	3.250	611,747.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	480.600	845,856.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	20.200	998,102.200	
	NICE LTD	6,065	420.000	2,547,300.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	69.150	722,202.600	
	AZRIELI GROUP	4,428	200.600	888,256.800	
イスラエル・シユケル	小計	466,815		11,617,858.180 (356,552,068)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	59.880	665,566.200	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	251,648	27.950	7,033,561.600	
	AMCOR LTD	110,142	14.910	1,642,217.220	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	293,260	26.770	7,850,570.200	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	8.890	271,758.410	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	6.320	721,270.000	
	TELSTRA CORP LTD	360,654	3.240	1,168,518.960	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	9.920	387,018.880	
	AMP LTD	302,414	2.350	710,672.900	
	ASX LTD	15,573	70.300	1,094,781.900	
	BHP GROUP LTD	259,625	37.690	9,785,266.250	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	27.040	566,379.840	

HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.590	79,633.380
COMPUTERSHARE LT	38,040	17.640	671,025.600
CSL LIMITED	39,608	186.500	7,386,892.000
REA GROUP LTD	4,119	80.310	330,796.890
TRANSURBAN GROUP	223,354	12.550	2,803,092.700
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.230	399,986.230
COCHLEAR LTD	5,374	171.220	920,136.280
ORIGIN ENERGY LTD	163,057	7.630	1,244,124.910
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	153,519	73.850	11,337,378.150
BORAL LIMITED	86,101	4.960	427,060.960
RIO TINTO LIMITED	32,562	94.700	3,083,621.400
APA GROUP	116,193	9.810	1,139,853.330
ARISTOCRAT LEISU	53,168	25.930	1,378,646.240
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	206,789	7.380	1,526,102.820
TPG TELECOM LTD	28,719	6.600	189,545.400
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	44.900	147,047.500
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,091	18.010	830,098.910
ORICA LTD	25,308	17.800	450,482.400
CIMIC GROUP LTD	8,709	49.650	432,401.850
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	12.350	456,221.350
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.170	610,382.100
MACQUARIE GROUP LTD	28,250	127.640	3,605,830.000
WORLEYPARSONS LTD	35,828	14.630	524,163.640
SUNCORP GROUP LTD	107,913	13.160	1,420,135.080
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	234,196	24.690	5,782,299.240
NEWCREST MINING LTD	69,638	25.410	1,769,501.580
OIL SEARCH LTD	138,806	8.370	1,161,806.220
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.370	459,755.620
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	129,436	11.480	1,485,925.280
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	8.320	380,282.240
SANTOS LTD	133,862	7.010	938,372.620
SONIC HEALTHCARE	43,041	24.520	1,055,365.320
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	5,000	29.030	145,150.000
TABCORP HOLDINGS LTD	194,274	4.690	911,145.060
WESFARMERS LTD	96,821	35.170	3,405,194.570
ALUMINA LIMITED	184,613	2.690	496,608.970
WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	35.510	2,809,373.650
WOOLWORTHS GROUP LTD	117,557	28.650	3,368,008.050
SEEK LTD	25,899	17.020	440,800.980

	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	43.890	201,060.090	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.760	290,516.160	
	AGL ENERGY LTD	60,649	21.530	1,305,772.970	
	BRAMBLES LTD	144,062	11.600	1,671,119.200	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.500	377,901.500	
	AURIZON HOLDINGS LTD	190,969	4.670	891,825.230	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	69,179	14.930	1,032,842.470	
	MEDIBANK PVT LTD	273,424	2.840	776,524.160	
	SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	3.830	1,697,302.800	
	COLES GROUP LTD	96,821	11.530	1,116,346.130	
	オーストラリア・ドル 小計	6,523,079		107,263,041.590 (8,508,104,460)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	57.260	1,161,290.060	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	39,722	73.310	2,912,019.820	
	BARRICK GOLD CORP	150,726	17.130	2,581,936.380	
	ATCO LTD	7,193	42.470	305,486.710	
	BANK OF MONTREAL	55,083	98.730	5,438,344.590	
	BANK OF NOVA SCOTIA	104,973	75.380	7,912,864.740	
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,553	62.580	1,786,846.740	
	BCE INC	11,568	58.090	671,985.120	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	74,072	58.430	4,328,026.960	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	31.200	805,552.800	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.790	423,005.850	
	SAPUTO INC	18,601	42.910	798,168.910	
	BLACKBERRY LTD	39,652	11.350	450,050.200	
	CGI INC	22,736	88.410	2,010,089.760	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	55.060	624,380.400	
	CAE INC	23,000	28.090	646,070.000	
	CAMECO CORP	32,627	16.130	526,273.510	
	ROGERS COMM-CL B	30,822	73.210	2,256,478.620	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,586	114.240	4,408,064.640	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	108,040	36.890	3,985,595.600	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	145.420	707,032.040	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	33.690	307,219.110	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,781	112.760	7,191,945.560	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	21.690	247,634.730	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,176	46.130	930,718.880	
	OPEN TEXT CORP	25,788	49.810	1,284,500.280	
	EMPIRE CO LTD	15,093	30.940	466,977.420	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.770	475,764.570	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	24.320	240,573.440	
	FORTIS INC	36,000	46.820	1,685,520.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	15.400	851,558.400	

TELUS CORP	15,945	47.340	754,836.300
GREAT WEST LIFECO INC	27,766	29.910	830,481.060
IMPERIAL OIL LTD	21,542	36.000	775,512.000
ENBRIDGE INC	177,176	48.670	8,623,155.920
IGM FINANCIAL INC	8,426	34.400	289,854.400
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.790	245,506.050
MANULIFE FINANCIAL CORP	173,640	22.310	3,873,908.400
LOBLAW CO LTD	15,354	64.090	984,037.860
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,590	71.580	2,046,472.200
SUN LIFE FINANCIAL INC	52,457	49.700	2,607,112.900
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,419	658.280	1,592,379.320
METRO INC	19,226	49.190	945,726.940
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.900	457,109.100
EMERA INC	6,509	46.470	302,473.230
METHANEX CORP	5,281	77.070	407,006.670
ONEX CORP	6,646	79.620	529,154.520
GOLDCORP INC	81,902	14.600	1,195,769.200
POWER CORP OF CANADA	37,942	27.560	1,045,681.520
POWER FINANCIAL CORP	27,773	28.620	794,863.260
ROYAL BANK OF CANADA	125,549	101.740	12,773,355.260
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	34.760	456,537.840
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,884	273.590	3,524,933.560
SHAW COMM INC-B	35,748	27.170	971,273.160
SUNCOR ENERGY INC	142,403	44.920	6,396,742.760
LUNDIN MINING CORP	71,805	7.090	509,097.450
ENCANA CORP	127,517	9.070	1,156,579.190
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	31.210	1,280,109.360
THOMSON REUTERS CORP	19,218	70.000	1,345,260.000
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	157,419	76.220	11,998,476.180
TRANSCANADA CORP	80,543	58.720	4,729,484.960
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	68.940	392,682.240
WESTON (GEORGE) LTD	8,239	95.130	783,776.070
INTACT FINANCIAL CORP	12,716	110.720	1,407,915.520
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42,447	29.470	1,250,913.090
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	1,158.290	2,002,683.410
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,887	100.860	1,703,222.820
CI FINANCIAL CORP	20,695	18.980	392,791.100
TOURMALINE OIL CORP	27,410	20.240	554,778.400
KEYERA CORP	23,206	31.060	720,778.360
ALTAGAS LTD	23,944	15.670	375,202.480
PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	47.830	2,094,188.720
DOLLARAMA INC	28,295	36.470	1,031,918.650
STARS GROUP INC	18,529	21.970	407,082.130

	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	11.690	941,571.050	
	VERMILION ENERGY INC	12,923	33.010	426,588.230	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	10.160	233,649.520	
	INTER PIPELINE LTD	38,609	21.140	816,194.260	
	NUTRIEN LTD	54,224	71.310	3,866,713.440	
	WSP GLOBAL INC	8,400	70.350	590,940.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,997	51.180	665,186.460	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	20.010	299,369.610	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	10.370	178,685.470	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	83.430	1,723,997.520	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	9.140	457,000.000	
	SHOPIFY INC	7,671	241.470	1,852,316.370	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	58.510	1,090,275.340	
	HYDRO ONE LTD	27,340	20.310	555,275.400	
カナダ・ドル 小計		3,659,521		158,680,562.070 (13,381,531,800)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.730	466,250.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	2.670	217,338.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.490	308,013.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.285	197,259.900	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	158,100	25.010	3,954,081.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	9.280	269,120.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	36.440	216,599.360	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	90,100	5.150	464,015.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.870	542,243.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.460	665,755.900	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	1.070	445,548.000	
	KEPPEL CORP LTD	168,400	6.340	1,067,656.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.440	434,076.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	267,053	11.390	3,041,733.670	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	734,322	3.070	2,254,368.540	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.170	483,075.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	120,500	25.580	3,082,390.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.760	273,780.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.120	338,520.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.260	463,898.000	
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.460	275,648.000		
シンガポール・ドル 小計		3,891,374		19,461,368.370 (1,597,583,730)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,040	11.900	2,594,676.000	

NESTLE SA-REGISTERED	267,967	90.940	24,368,918.980	
CIE FINANC RICHEMONT	46,547	74.360	3,461,234.920	
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	61,398	277.200	17,019,525.600	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	226.600	817,346.200	
SIKA INHABER	11,291	134.800	1,522,026.800	
SGS SA-REG	484	2,543.000	1,230,812.000	
NOVARTIS AG-REG SHS	187,505	90.860	17,036,704.300	
BALOISE HOLDING AG -R	4,127	158.900	655,780.300	
BARRY CALLEBAUT AG	144	1,728.000	248,832.000	
CLARIANT AG-REG	19,496	21.340	416,044.640	
SWISSCOM AG-REG	2,280	459.500	1,047,660.000	
ABB LTD	162,358	20.230	3,284,502.340	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	53.240	657,034.840	
GEBERIT AG	3,243	403.700	1,309,199.100	
LONZA GROUP AG-REG	6,228	286.500	1,784,322.000	
LINDT & SPRUENGLI PART	105	6,430.000	675,150.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	73,500.000	661,500.000	
GIVAUDAN-REG	771	2,470.000	1,904,370.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,046	326.300	4,256,909.800	
LAFARGEHOLCIM LTD	40,615	48.940	1,987,698.100	
TEMENOS GROUP	4,521	142.000	641,982.000	
SONOVA HOLDING AG	5,319	184.250	980,025.750	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,105	138.100	705,000.500	
STRAUMANN HOLDING AG	782	772.500	604,095.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,691	284.100	764,513.100	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	55.250	253,708.000	
SCHINDLER NAMEN	1,663	222.200	369,518.600	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,119	418.600	1,305,613.400	
VIFOR PHARMA AG	4,583	123.800	567,375.400	
EMS-CHEMIE HOLDING	904	566.000	511,664.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	84.400	505,556.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	79.300	237,900.000	
DUFREY GROUP	2,390	99.120	236,896.800	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	714.000	1,074,570.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	40.390	720,921.110	
SWISS RE LTD	27,609	98.440	2,717,829.960	
UBS GROUP AG	336,464	12.370	4,162,059.680	
スイス・フラン 小計	1,489,688		103,299,477.220 (11,447,648,065)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	57,191	254.850	14,575,126.350	
ATLAS COPCO AB-B SHS	38,314	236.600	9,065,092.400	
ERICSSON LM-B SHS	271,783	87.780	23,857,111.740	
LUNDBERGS B	7,382	291.400	2,151,114.800	
SKF AB-B SHS	37,198	160.100	5,955,399.800	
SANDVIK AB	96,746	153.900	14,889,209.400	

SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	147,588	93.240	13,761,105.120	
SKANSKA AB-B SHS	32,547	166.500	5,419,075.500	
SWEDBANK AB	82,410	171.400	14,125,074.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,539	103.850	13,141,075.150	
VOLVO AB-B SHS	141,608	138.500	19,612,708.000	
SWEDISH MATCH AB	16,488	451.300	7,441,034.400	
TELE2 AB-B SHS	44,876	121.700	5,461,409.200	
INDUSTRIVARDEN C	11,403	193.200	2,203,059.600	
ELECTROLUX AB-SER B	19,191	242.700	4,657,655.700	
SECURITAS AB-B SHS	24,098	149.750	3,608,675.500	
INVESTOR AB-B SHS	37,657	419.000	15,778,283.000	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,779	139.960	10,885,948.840	
ASSA ABLOY AB-B	88,327	193.100	17,055,943.700	
TELIA CO AB	231,855	40.650	9,424,905.750	
LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	306.700	5,149,493.000	
BOLIDEN AB	21,855	251.850	5,504,181.750	
ALFA LAVAL AB	23,343	208.400	4,864,681.200	
KINNEVIK AB-B	18,310	226.500	4,147,215.000	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	581.500	3,100,558.000	
ICA GRUPPEN AB	5,920	358.600	2,122,912.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	77.180	2,600,348.560	
HEXAGON AB	22,037	485.500	10,698,963.500	
EPIROC AB-A	63,358	92.120	5,836,538.960	
EPIROC AB-B	30,899	86.910	2,685,432.090	
ESSITY AB-B	52,522	265.400	13,939,338.800	
NORDEA BANK ABP	267,838	81.790	21,906,470.020	
スウェーデン・クローナ 小計	2,152,876		295,625,140.830 (3,509,070,421)	
デンマーク・ク ローネ				
CARLSBERG AS-B	9,644	800.200	7,717,128.800	
A P MOLLER A/S	604	8,836.000	5,336,944.000	
AP MOLLER MAERSK A	273	8,345.000	2,278,185.000	
DANSKE BANK A/S	61,114	120.700	7,376,459.800	
GENMAB A/S	5,622	1,069.000	6,009,918.000	
NOVOZYMES-B SHS	19,111	304.600	5,821,210.600	
NOVO NORDISK A/S-B	159,660	326.900	52,192,854.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	547.000	8,646,976.000	
COLOPLAST-B	11,212	637.400	7,146,528.800	
DSV A/S	17,123	548.000	9,383,404.000	
WILLIAM DEMANT	6,537	195.000	1,274,715.000	
H LUNDBECK A/S	4,840	298.400	1,444,256.000	
TRYG A/S	11,107	176.800	1,963,717.600	
PANDORA A/S	8,251	336.300	2,774,811.300	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	664.000	5,118,112.000	
ISS A/S	16,240	212.500	3,451,000.000	

	ORSTED A/S	17,249	478.400	8,251,921.600	
デンマーク・クローネ 小計		372,103		136,188,142.500 (2,293,408,319)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	114,550	7.420	849,961.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	10.990	328,535.060	
	A2 MILK CO LTD	55,091	14.600	804,328.600	
	FISHER & PAYKEL	42,678	14.410	614,989.980	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	4.980	319,237.920	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.710	592,201.330	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.710	334,541.830	
ニュージーランド・ドル 小計		556,113		3,843,795.720 (292,781,920)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	33,000	197.500	6,517,500.000	
	DNB ASA	79,783	161.300	12,868,997.900	
	NORSK HYDRO ASA	137,190	35.190	4,827,716.100	
	TELENOR ASA	62,076	168.550	10,462,909.800	
	ORKLA ASA	84,809	68.760	5,831,466.840	
	EQUINOR ASA	98,397	196.350	19,320,250.950	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	361.000	5,776,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	298.600	2,553,627.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	152.700	2,547,494.100	
	SCHIBSTED ASA	7,445	320.000	2,382,400.000	
ノルウェー・クローネ 小計		543,935		73,088,362.890 (942,108,997)	
ユーロ	CRH PLC	71,394	27.590	1,969,760.460	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	69.800	435,970.800	
	KERRY GROUP PLC-A	13,865	92.300	1,279,739.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	14,756	39.400	581,386.400	
	UMICORE	19,109	36.730	701,873.570	
	AIR LIQUIDE	37,092	109.500	4,061,574.000	
	AIRBUS SE	51,553	113.700	5,861,576.100	
	AXA	165,252	21.635	3,575,227.020	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,632	19.605	973,035.360	
	ADIDAS AG	16,356	204.100	3,338,259.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	104,014	15.290	1,590,374.060	
	DASSAULT AVIATION SA	274	1,379.000	377,846.000	
	DANONE	54,023	67.480	3,645,472.040	
	SAFRAN SA	29,268	120.000	3,512,160.000	
	INTESA SANPAOLO	1,349,921	2.042	2,756,538.680	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30,304	73.130	2,216,131.520	
	ACCOR SA	16,000	37.940	607,040.000	
	BOUYGUES	22,276	32.800	730,652.800	
	BNP PARIBAS	96,988	41.925	4,066,221.900	
	THALES SA	9,883	107.650	1,063,904.950	
	CAPGEMINI SA	13,759	102.850	1,415,113.150	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	44.600	190,174.400		

INGENICO GROUP	4,334	57.280	248,251.520
UNICREDIT SPA	170,144	11.140	1,895,404.160
NATIXIS	70,166	4.533	318,062.470
KONINKLIJKE DSM NV	15,111	91.960	1,389,607.560
COMMERZBANK AG	83,118	6.623	550,490.510
EIFFAGE	5,949	84.560	503,047.440
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,640	48.740	1,688,353.600
UNITED INTERNET	9,882	31.770	313,951.140
FUCHS PETROLUB SE PEF	5,546	39.100	216,848.600
PUBLICIS GROUPE	18,222	48.130	877,024.860
FAURECIA	6,117	41.130	251,592.210
IBERDROLA SA	532,301	7.418	3,948,608.810
ENI SPA	222,205	15.288	3,397,070.040
IMERYS SA	2,256	49.580	111,852.480
JERONIMO MARTINS	19,517	12.940	252,549.980
KBC GROUPE	20,803	61.040	1,269,815.120
HANNOVER RUECK SE	4,868	130.000	632,840.000
WARTSILA OYJ	34,935	14.280	498,871.800
L'OREAL	21,581	225.100	4,857,883.100
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	24,437	299.750	7,324,990.750
GEA GROUP AG	11,838	20.820	246,467.160
BOLLORE	71,347	3.620	258,276.140
MEDIOBANCA SPA	62,022	8.256	512,053.630
MICHELIN(CGDE) -B	15,018	103.100	1,548,355.800
CONTINENTAL AG	9,528	143.900	1,371,079.200
DEUTSCHE POST AG-REG	86,663	26.750	2,318,235.250
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	13.450	194,029.700
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	30.680	288,361.320
AXEL SPRINGER SE	7,792	50.750	395,444.000
OMV AG	12,817	46.530	596,375.010
VERBUND AG	6,778	41.000	277,898.000
PERNOD-RICARD	18,479	151.900	2,806,960.100
PEUGEOT SA	50,087	22.310	1,117,440.970
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	57.100	756,517.900
RENAULT SA	17,786	59.740	1,062,535.640
REPSOL SA	126,723	15.155	1,920,487.060
REMY COINTREAU	1,860	113.100	210,366.000
MERCK KGAA	11,193	96.200	1,076,766.600
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,331	32.410	1,436,767.710
RWE AG	45,905	21.940	1,007,155.700
SEB SA	1,405	138.100	194,030.500
SOCIETE GENERALE-A	69,792	25.335	1,768,180.320
VINCI S.A.	43,889	82.360	3,614,698.040
SODEXO	8,639	97.220	839,883.580
SOLVAY SA	7,086	100.300	710,725.800
SCHNEIDER ELECTRIC SE	48,032	69.380	3,332,460.160

VIVENDI SA	93,560	24.230	2,266,958.800
SAP SE	86,471	95.410	8,250,198.110
TELEFONICA S.A	415,379	7.768	3,226,664.070
TOTAL SA	212,519	49.955	10,616,386.640
VALEO	24,798	27.890	691,616.220
E.ON SE	197,427	9.740	1,922,938.980
VOEST-ALPINE AG	9,875	27.150	268,106.250
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	82.500	767,250.000
SIEMENS AG-REG	67,182	95.840	6,438,722.880
UPM-KYMMENE OYJ	49,371	26.670	1,316,724.570
ING GROEP NV-CVA	341,295	11.084	3,782,913.780
PUMA AG	600	479.500	287,700.000
BAYER AG	81,767	67.000	5,478,389.000
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	11.795	498,963.880
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,350	89.140	1,368,299.000
DAIMLER AG	80,758	52.200	4,215,567.600
BASF SE	79,836	65.250	5,209,299.000
BEIERSDORF AG	8,371	91.420	765,276.820
HOCHTIEF AG	1,707	138.600	236,590.200
HEIDELBERGCEMENT AG	14,126	64.820	915,647.320
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	70.460	1,303,087.240
ORANGE	172,654	13.665	2,359,316.910
SAMPO OYJ-A SHS	39,403	41.870	1,649,803.610
RANDSTAD NV	12,061	46.610	562,163.210
ALLIANZ SE	37,494	194.060	7,276,085.640
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	242,094	3.252	787,289.680
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	109,641	22.865	2,506,941.460
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	15.785	277,847.570
HERMES INTL	2,703	553.800	1,496,921.400
ENDESA S.A.	29,314	22.000	644,908.000
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	24,926	23.360	582,271.360
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	31.300	786,162.100
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,966	206.400	2,676,182.400
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	20.510	1,193,456.390
SOCIETE BIC SA	2,478	84.000	208,152.000
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	129.200	1,409,959.600
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,521	38.150	897,326.150
HEINEKEN NV	23,051	88.020	2,028,949.020
AKZO NOBEL	18,786	80.160	1,505,885.760
ASML HOLDING NV	36,062	162.860	5,873,057.320
AEGON NV	150,349	4.621	694,762.720
BANKINTER S.A.	57,960	6.902	400,039.920
VOLKSWAGEN AG	3,545	152.000	538,840.000
VOLKSWAGEN AG PFD	15,382	146.720	2,256,847.040

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	595,667	5.227	3,113,551.400
KERING	6,609	480.000	3,172,320.000
CNP ASSURANCES	13,987	20.220	282,817.140
FORTUM OYJ	37,452	18.950	709,715.400
AGEAS	17,904	43.030	770,409.120
UCB SA	11,267	77.900	877,699.300
THYSSENKRUPP AG	37,894	13.410	508,158.540
UNILEVER NV-CVA	134,883	48.780	6,579,592.740
CARREFOUR SA	51,094	17.950	917,137.300
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	23.910	693,629.100
ATOS SE	8,816	85.800	756,412.800
NOKIA OYJ	495,975	5.444	2,700,087.900
KONINKLIJKE PHILIPS NV	83,260	34.720	2,890,787.200
WOLTERS KLUWER-CVA	25,051	58.040	1,453,960.040
SANOFI	97,788	72.570	7,096,475.160
STMICROELECTRONICS NV	55,611	14.820	824,155.020
ELISA OYJ	14,176	36.630	519,266.880
BANCO SANTANDER SA	1,411,232	4.128	5,825,565.690
METSO OYJ	8,585	29.490	253,171.650
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.150	662,513.400
QIAGEN N.V.	17,387	34.280	596,026.360
1&1 DRILLISCH AG	3,149	34.940	110,026.060
DEUTSCHE BANK AG-REG	171,985	7.622	1,310,869.670
BMW VORZUG	4,116	63.950	263,218.200
ENEL SPA	674,493	5.278	3,559,974.050
COLRUYT NV	4,673	62.700	292,997.100
VOPAK (KON.)	5,364	43.020	230,759.280
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	288,779	14.680	4,239,275.720
SARTORIUS AG	2,712	142.000	385,104.000
LEONARDO SPA	26,269	8.758	230,063.900
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	65.980	390,007.780
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	19.660	1,947,676.880
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.759	802,949.010
EUROFINS SCIENTIFIC	794	360.200	285,998.800
TELEPERFORMANCE	5,363	153.700	824,293.100
DEUTSCHE BOERSE AG	16,913	112.100	1,895,947.300
EURAZEO	4,725	65.100	307,597.500
BANCO SABADELL	563,371	0.945	532,385.590
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,448	83.900	708,787.200
FRAPORT AG	3,149	70.520	222,067.480
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	84.600	828,318.600
INDITEX	96,734	25.530	2,469,619.020
JC DECAUX SA	6,058	27.540	166,837.320
ANDRITZ AG	6,265	44.620	279,544.300
MAPFRE SA	84,474	2.489	210,255.780
ESSILORLUXOTTICA	24,121	107.650	2,596,625.650

SNAM SPA	199,702	4.214	841,544.220
CREDIT AGRICOLE SA	99,973	10.562	1,055,914.820
ENAGAS	18,095	25.270	457,260.650
WENDEL	2,220	109.500	243,090.000
WIRECARD AG	9,891	115.100	1,138,454.100
TENARIS SA	36,959	12.045	445,171.150
TELECOM ITALIA SPA	1,158,473	0.537	622,100.000
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.476	236,855.690
ATLANTIA SPA	43,688	21.050	919,632.400
ILIAD SA	2,102	87.340	183,588.680
PROXIMUS	14,283	22.980	328,223.340
SES FDR	34,268	18.340	628,475.120
TERNA SPA	112,686	5.438	612,786.460
BIOMERIEUX	3,248	69.700	226,385.600
GRIFOLS SA	23,518	23.240	546,558.320
FERROVIAL SA	46,831	20.030	938,024.930
LANXESS AG	6,856	48.830	334,778.480
NESTE OYJ	10,840	86.520	937,876.800
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	22.580	217,693.780
RECORDATI SPA	6,859	32.830	225,180.970
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	55,725	8.280	461,403.000
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,859	194.000	942,646.000
KONE OYJ	29,124	44.600	1,298,930.400
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,881	104.100	299,912.100
ENGIE	159,735	14.060	2,245,874.100
ALSTOM	12,046	37.770	454,977.420
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	38.460	139,763.640
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.220	228,515.240
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	12.715	684,067.000
IPSEN SA	3,646	123.100	448,822.600
DEUTSCHE WOHNEN	30,689	41.800	1,282,800.200
ARKEMA SA	5,230	87.500	457,625.000
LEGRAND SA	23,308	58.560	1,364,916.480
ADP	2,313	173.700	401,768.100
ORION OYJ	8,051	30.140	242,657.140
RTL GROUP SA	3,446	49.060	169,060.760
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	52,232	14.675	766,504.600
SYMRISE AG	11,548	77.380	893,584.240
SCOR SE	13,875	39.150	543,206.250
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	25.920	450,930.240
REXEL SA	23,245	11.065	257,205.920
PRYSMIAN SPA	29,418	17.595	517,609.710
CAIXABANK	297,224	3.010	894,644.240
BUREAU VERITAS SA	21,480	19.900	427,452.000
GETLINK	37,646	12.600	474,339.600
SUEZ SA	38,331	11.320	433,906.920

	AMADEUS IT GROUP SA	38,492	69.320	2,668,265.440	
	BRENNTAG AG	12,353	44.160	545,508.480	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.456	333,633.630	
	EVONIK INDUSTRIES AG	22,784	24.860	566,410.240	
	EDENRED	22,652	39.800	901,549.600	
	BANKIA SA	100,675	2.546	256,318.550	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.933	180,499.750	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	64.940	338,856.920	
	OSRAM LICHT AG	7,017	38.350	269,101.950	
	KION GROUP AG	4,686	52.720	247,045.920	
	VONOVIA SE	40,775	43.770	1,784,721.750	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	106,363	5.220	555,214.860	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	15,254	36.200	552,194.800	
	FERRARI NV	10,895	111.100	1,210,434.500	
	METRO AG	10,774	14.745	158,862.630	
	CNH INDUSTRIAL NV	94,317	9.560	901,670.520	
	AROUNDTOWN SA	71,783	7.490	537,654.670	
	AIB GROUP PLC	52,322	3.884	203,218.640	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	37.385	365,214.060	
	MONCLER SPA	14,353	34.510	495,322.030	
	NN GROUP NV	28,528	37.620	1,073,223.360	
	ZALANDO SE	14,353	26.180	375,761.540	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	13.130	1,181,398.010	
	AENA SME SA	6,175	155.800	962,065.000	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	20.530	703,173.030	
	EXOR NV	7,726	55.820	431,265.320	
	COVESTRO AG	15,802	51.600	815,383.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,858	65.770	4,331,480.660	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	7.782	311,396.730	
	AMUNDI SA	3,894	55.720	216,973.680	
	PIRELLI & C SPA	34,086	6.012	204,925.030	
	UNIPER SE	13,897	25.630	356,180.110	
	DELIVERY HERO SE	7,238	33.580	243,052.040	
ユーロ 小計		17,270,867		322,294,515.860 (40,509,197,698)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,700	87.400	2,857,980.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.080	3,129,120.000	
	BANK OF EAST ASIA	153,660	28.650	4,402,359.000	
	CLP HOLDINGS LTD	149,500	96.850	14,479,075.000	
	PCCW LTD	331,000	4.750	1,572,250.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	65.400	3,204,600.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	102,440	266.800	27,330,992.000	

MTR CORP	150,000	44.900	6,735,000.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	24.500	1,543,500.000	
HANG SENG BANK LTD	65,400	191.200	12,504,480.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	132,228	45.400	6,003,151.200	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	123,000	53.900	6,629,700.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	25.400	2,432,050.000	
HONG KONG & CHINA GAS	837,050	17.980	15,050,159.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	42.400	2,120,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	203,000	57.150	11,601,450.000	
KERRY PROPERTIES LTD	73,500	33.300	2,447,550.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	324,000	32.900	10,659,600.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	20.800	2,808,000.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	26.200	1,323,100.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	605,266	13.320	8,062,143.120	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	10.580	1,100,320.000	
SINO LAND CO	255,400	14.860	3,795,244.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	133.600	18,036,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	94.500	4,488,750.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	47.600	5,402,600.000	
WHEELLOCK & CO LTD	86,000	53.450	4,596,700.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	31.950	1,405,800.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.470	1,477,320.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	19.860	2,470,584.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	16.520	1,070,496.000	
AIA GROUP LTD	1,063,027	76.550	81,374,716.850	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	11.920	3,361,440.000	
SANDS CHINA LTD	232,800	39.000	9,079,200.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	31.650	3,297,930.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	56.400	5,400,300.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	8.270	1,902,100.000	
WH GROUP LTD	701,500	7.890	5,534,835.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	242,832	82.700	20,082,206.400	
CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	66.800	14,885,177.600	
香港・ドル 小計	8,195,535		335,657,979.170 (4,736,134,086)	
合計	97,504,579		341,144,407,143 (341,144,407,143)	

(2) 株式以外の有価証券

平成31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	80,596.000	1,000,196.360	
		GOODMAN GROUP	147,572.000	1,900,727.360	
		GPT GROUP	144,955.000	871,179.550	
		LENLEASE GROUP	60,871.000	863,759.490	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	769,035.800	
		SCENTRE GROUP	476,956.000	1,874,437.080	
		STOCKLAND	194,018.000	706,225.520	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	673,403.070	
	オーストラリア・ドル	小計	1,671,194.000	8,658,964.230 (686,829,042)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	200,806.000	562,256.800	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	396,096.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	485,560.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	368,832.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,812,744.800 (148,808,220)	
投資信託受益証券	合計		2,469,400	835,637,262 (835,637,262)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	792,363.110	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,644.000	1,318,527.680	
		AMERICAN TOWER CORP	38,497.000	6,799,725.110	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	125,554.000	1,273,117.560	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,353.000	2,421,682.120	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,309.000	1,805,632.030	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	383,244.960	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	787,012.440	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	35,534.000	4,259,460.580	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,388.000	2,178,794.120	
		DUKE REALTY TRUST	32,954.000	991,585.860	
		EQUINIX INC	6,964.000	2,984,352.560	
		EQUITY RESIDENTIAL	32,976.000	2,447,808.480	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,653.000	1,591,149.910	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,885.000	1,123,845.600	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	810,960.000	
		HCP INC	39,277.000	1,227,406.250	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,288,980.140	
		INVITATION HOMES INC	30,427.000	701,342.350	
		IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	853,101.660	
		KIMCO REALTY	32,980.000	584,735.400	
LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	554,375.910			
MID AMERICA	10,258.000	1,071,961.000			

	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	719,165.810	
	PROLOGIS INC	55,164.000	3,950,845.680	
	PUBLIC STORAGE	13,721.000	2,759,841.940	
	REALTY INCOME CORP	26,616.000	1,856,199.840	
	REGENCY CENTERS CORP	13,023.000	857,955.240	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,277.000	1,876,066.350	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	26,500.000	4,866,195.000	
	SL GREEN	7,097.000	655,336.980	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	394,452.640	
	UDR INC	21,658.000	972,011.040	
	VENTAS INC	30,244.000	1,943,177.000	
	VEREIT INC	93,429.000	757,709.190	
	VORNADO REALTY TRUST	15,346.000	1,057,185.940	
	WELLTOWER INC	33,309.000	2,512,830.960	
	WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,661,906.910	
	WP CAREY INC	15,148.000	1,132,313.000	
アメリカ・ドル 小計		1,082,101.000	66,224,358.350 (7,336,334,418)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	417,570.510	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	217,406.740	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	517,028.740	
	SEGRO PLC	82,914.000	539,106.820	
イギリス・ポンド 小計		272,463.000	1,691,112.810 (244,805,490)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	242,582.360	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	242,455.500	
	SMARTCENTRES REIT	9,288.000	313,005.600	
カナダ・ドル 小計		29,711.000	798,043.460 (67,299,005)	
ユーロ	COVIVIO	4,675.000	410,231.250	
	GECINA SA	3,670.000	469,760.000	
	ICADE	2,234.000	166,544.700	
	KLEPIERRE	17,042.000	514,838.820	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,061.000	1,717,727.620	
ユーロ 小計		39,682.000	3,279,102.390 (412,150,379)	
香港・ドル	LINK REIT	185,500.000	16,528,050.000	
香港・ドル 小計		185,500.000	16,528,050.000 (233,210,785)	
投資証券 合計		1,609,457	8,293,800,077 (8,293,800,077)	
合計			9,129,437,339 (9,129,437,339)	

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 593銘柄	64.67%	-%	-%	68.19%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	2.05%	
イギリス・ポンド	株式 92銘柄	6.16%	-%	-%	6.37%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.07%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.38%	-%	-%	2.63%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.19%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.74%	-%	-%	3.84%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.45%	-%	-%	0.50%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.20%	-%	-%	3.27%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.98%	-%	-%	1.00%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.64%	-%	-%	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.08%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.26%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 237銘柄	11.32%	-%	-%	11.68%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.32%	-%	-%	1.42%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.07%	

(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30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,427,443,670	1,433,930,600
コール・ローン		409,777,133	864,450,769
国債証券		211,625,176,962	194,119,015,713
派生商品評価勘定		189,709	-
未収利息		1,890,523,698	1,527,339,406
前払費用		30,377,614	61,821,628
流動資産合計		216,383,488,786	198,006,558,116
資産合計		216,383,488,786	198,006,558,116
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		124,925	-
未払解約金		343,581,000	58,133,000
流動負債合計		343,705,925	58,133,000
負債合計		343,705,925	58,133,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	121,490,410,134	108,779,748,990
剰余金			
剰余金又は欠損金()		94,549,372,727	89,168,676,126
元本等合計		216,039,782,861	197,948,425,116
純資産合計		216,039,782,861	197,948,425,116
負債純資産合計		216,383,488,786	198,006,558,116

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. 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30年2月26日現在	平成31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	143,480,057,319円	121,490,410,134円
同期中追加設定元本額	24,072,066,564円	28,206,257,484円
同期中一部解約元本額	46,061,713,749円	40,916,918,628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	8,178,188,221円	8,076,973,092円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	16,550,949円	8,939,016円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	43,087,731円	25,280,519円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	50,607,050円	30,864,769円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	84,738,289円	78,670,973円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	73,029,025円	72,349,714円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	35,964,363円	36,374,320円
たわらノーロード 先進国債券	1,550,612,754円	3,288,664,575円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	21,598,989円	159,313,737円
たわらノーロード バランス（堅実型）	170,191円	3,057,784円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,177,165円	16,253,990円
たわらノーロード バランス（積極型）	532,097円	4,344,216円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	28,212円	462,941円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	563,219円	28,154,903円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	751,296円	53,242,012円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	147,764円	15,484,756円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	18,809,442円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	57,145円	410,279円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	343,053円	1,639,658円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	193,352円	563,883円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	262,467円	1,095,766円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,032,915,649円	5,433,559,638円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	474,597,820円	533,531,954円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,526,634,357円	1,686,524,738円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,682,020,108円	1,750,349,034円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	366,252,324円	371,729,174円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	780,311,672円	812,192,171円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	633,352,049円	621,735,533円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,441,361円	22,475,278円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	585,178,050円	600,919,427円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,898,943円	3,924,410円

DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国10)	17,867,916円	119,017,497円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国20)	39,193,230円	71,193,232円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国30)	71,081,407円	115,407,689円
クルーズコントロール DIAM 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	471,522,151円	2,914,474,463円
DIAM DC バラン ス・F(成長型)	67,264,964円	87,907,821円
クルーズコントロール< DC年金>	121,175,646円	149,376,214円
DIAMコア資産設計 ファンド(堅実型)	175,031円	2,093,489円
DIAMコア資産設計 ファンド(積極型)	1,547,650円	9,876,940円
ダイナミック・ナビゲー ション	4,761,061円	22,578,913円
4資産分散投資・スタン ダード<DC年金>	135,460円	1,609,469円
9資産分散投資・スタン ダード<DC年金>	- 円	16,166,435円
DIAMパッシブ資産分 散ファンド	- 円	11,075円
DIAM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)	1,427,367,462円	1,310,116,672円
DIAM外国債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	6,984,591,409円	7,061,418,108円
外国債券パッシブファン ド(適格機関投資家限 定)	4,074,076,473円	3,708,371,551円
先進国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家限 定)	3,765,907,771円	3,093,632,320円
DIAMワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	576,382,992円	6,083,963,306円
DIAMグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	107,448,126円	94,789,701円
DIAMグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	968,520,974円	758,173,712円
DIAMグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	708,041,760円	602,968,210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)	57,495,581円	47,915,924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)	107,057,634円	86,538,439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)	26,555,966円	22,844,836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)	10,750,815円	6,207,173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)	72,188,716円	54,280,724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)	85,457,559円	74,645,150円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	3,796,951,947円	3,248,429,813円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	2,498,788,864円	2,149,221,047円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	4,222,249,727円	3,652,641,455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)	766,253,872円	653,772,438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)	515,526,816円	248,926,518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)	3,592,931,221円	3,039,294,314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)	8,998,213,463円	1,703,028,963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)	13,975,529円	14,665,687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)	82,547,070円	15,979,183円
D I A M世界バラン スファンド35VA(適格 機関投資家限定)	2,967,288,873円	122,749,235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)	15,212,015,467円	7,940,500,740円

D I A M世界アセットバ ランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	19,892,468,598円	18,777,555,210円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	2,361,904円	20,111,944円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	34,508,457円	999,291円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	5,621,656円	4,973,567円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	17,700,778,938円	16,714,600,651円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	107,612,203円	88,655,549円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	83,137,353円	109,040,954円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	59,633,095円	362,862円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	165,250円	162,392円
計	121,490,410,134円	108,779,748,990円
2 . 受益権の総数	121,490,410,134口	108,779,748,990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29年2月28日 至 平成30年2月26日	自 平成30年2月27日 至 平成31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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成31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 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年2月26日現在	平成31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	461,126,505	4,226,488
合計	461,126,505	4,226,488

(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30年2月22日から平成30年2月26日まで及び平成31年2月22日から平成31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30年2月26日 現在				平成31年2月25日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	326,384,024	-	326,319,240	64,784	-	-	-	-
アメリカ・ドル	112,189,343	-	112,143,010	46,333	-	-	-	-
イギリス・ポンド	23,904,192	-	23,904,000	192	-	-	-	-
マレーシア・リン ギット	35,800,875	-	35,925,800	124,925	-	-	-	-
ユーロ	130,597,950	-	130,470,270	127,680	-	-	-	-
南アフリカ・ラン ド	23,891,664	-	23,876,160	15,504	-	-	-	-
合計	326,384,024	-	326,319,240	64,784	-	-	-	-

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年2月26日現在	平成31年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.7782円	1.8197円
(1万口当たり純資産額)	(17,782円)	(18,197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31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 1.125 02/28/21	3,680,000.000	3,581,376.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,675,908.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	2,750,000.000	2,691,755.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,221,691.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,841,480.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	10,947,237.600	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,450,230.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,685,000.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,620,635.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,488,090.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,170,825.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	7,330,000.000	6,874,733.700	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	5,118,634.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,236,090.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	9,420,000.000	9,139,189.800	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,380,307.600	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,570,000.000	8,340,324.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	10,660,000.000	10,437,632.400	
		US T N/B 1.75 05/15/22	10,570,000.000	10,339,574.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,798,750.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	10,230,000.000	9,981,411.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,924,040.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,879,040.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,651,372.800	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,907,600.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	8,450,000.000	8,283,619.500	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,575,910.400	
		US T N/B 2.0 02/15/22	11,050,000.000	10,905,355.500	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,329,950.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,221,650.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,875,200.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	6,180,000.000	6,030,753.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	6,920,000.000	6,693,992.800	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,951,700.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,277,696.000			
US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,712,300.000			
US T N/B 2.0 11/30/20	7,920,000.000	7,850,700.000			
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,480,276.500			
US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,964,050.000			
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,278,264.000			

US T N/B 2.125 05/15/25	8,930,000.000	8,716,483.700	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,399,015.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,908,040.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,983,110.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,914,800.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	5,710,000.000	5,597,113.300	
US T N/B 2.125 12/31/21	10,330,000.000	10,235,480.500	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,900,000.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	346,307.500	
US T N/B 2.25 02/15/27	7,040,000.000	6,862,873.600	
US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,711,883.200	
US T N/B 2.25 08/15/27	6,750,000.000	6,561,675.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,070,000.000	3,485,222.400	
US T N/B 2.25 11/15/24	8,590,000.000	8,468,451.500	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,868,190.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	7,610,000.000	7,384,667.900	
US T N/B 2.25 12/31/23	5,860,000.000	5,799,993.600	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	6,224,162.400	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,843,663.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,280,163.000	
US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,854,042.500	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	4,085,505.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	4,460,000.000	4,033,847.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,021,193.400	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,004,860.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,976,500.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,010,560.000	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	4,101,664.800	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,831,375.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,523,100.000	
US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,264,800.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,010,740.000	
US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,786,927.300	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,081,267.000	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,300,717.200	
US T N/B 2.75 02/15/24	8,040,000.000	8,141,706.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	6,003,431.000	
US T N/B 2.75 02/28/25	5,810,000.000	5,881,695.400	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,517,215.700	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,306,525.900	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	799,685.400	
US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,575,660.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	1,728,270.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	4,420,000.000	4,191,397.600	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,196,105.100	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,659,466.800	
US T N/B 2.75 11/15/23	9,370,000.000	9,486,375.400	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,190,000.000	3,058,891.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,360,000.000	3,182,793.600	

US T N/B 2.75 11/30/20	7,840,000.000	7,871,516.800	
US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	7,252,360.800	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	3,798,442.400	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,579,208.500	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,456,444.000	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,730,000.000	5,835,145.500	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,400,000.000	4,290,660.000	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	854,565.600	
US T N/B 2.875 10/31/23	6,010,000.000	6,115,595.700	
US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	4,932,020.800	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,285,864.000	
US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,743,945.200	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,549,043.200	
US T N/B 3.0 02/15/47	4,430,000.000	4,423,399.300	
US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	4,001,146.200	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	983,518.200	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,440,000.000	4,436,181.600	
US T N/B 3.0 05/15/47	3,380,000.000	3,372,057.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	4,770,000.000	4,748,725.800	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,448,211.000	
US T N/B 3.0 10/31/25	4,480,000.000	4,601,766.400	
US T N/B 3.0 11/15/44	3,760,000.000	3,757,932.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,897,543.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,846,674.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,658,890.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,111,200.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,435,608.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,699,544.000	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,830,000.000	6,062,267.200	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,848,078.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	4,166,574.200	
US T N/B 3.375 11/15/48	5,270,000.000	5,642,589.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,426,841.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,155,820.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	15,300,000.000	15,458,355.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,619,185.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,510,000.000	5,005,378.400	
US T N/B 3.625 08/15/43	3,700,000.000	4,104,077.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,261,240.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,120,000.000	4,662,027.200	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,430,000.000	1,646,502.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	981,169.200	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,423,580.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	922,440.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,462,500.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,700,000.000	2,097,239.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,470,000.000	1,809,467.100	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,230,000.000	1,519,812.600	
US T N/B 4.5 05/15/38	800,000.000	999,744.000	

	US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,751,302.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,923,875.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,329,578.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,053,432.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,224,920.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,830,930.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,909,335.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,361,074.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,360,000.000	2,874,385.600	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,779,036.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,880,690.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,158,350.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,865,980.000	
アメリカ・ドル 小計		811,860,000.000 (89,937,850,800)	813,126,940.800 (90,078,202,502)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,329,531.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,554,477.600	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	580,000.000	583,050.800	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,320,000.000	2,355,728.000	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,738,880.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,970,000.000	2,045,648.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,400,000.000	2,302,320.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,790,000.000	1,866,379.300	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,010,000.000	1,036,017.600	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	620,000.000	630,230.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,730,000.000	1,812,348.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,101,460.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,900,000.000	1,943,320.000	
	UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,820,000.000	1,852,086.600	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,187,178.300	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,977,492.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,890,000.000	2,468,547.900	

UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,201,920.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,460,000.000	3,240,312.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,300,000.000	3,171,470.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,720,000.000	2,856,576.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,630,000.000	2,523,566.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,032,211.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,989,841.500	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,530,000.000	2,648,124.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,141,410.400	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	2,951,130.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,492,135.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,550,000.000	2,262,225.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,155,464.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,780,000.000	2,631,730.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,810,000.000	2,837,537.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,430,000.000	2,320,318.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,750,000.000	3,038,875.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,820,000.000	2,581,306.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,820,000.000	2,836,288.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	2,069,700.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,473,926.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,519,230.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,050,000.000	1,522,510.500	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	1,980,398.000	
イギリス・ボンド 小計	74,480,000.000 (10,781,724,800)	92,262,899.000 (13,355,977,259)	

オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,024,786.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,150,000.000	2,150,795.500	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,787,452.200	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,609,835.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	909,473.200	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	830,000.000	861,133.300	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,256,364.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	947,322.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	3,057,992.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,854,737.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,654,941.600	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,339,125.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,356,184.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,424,849.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	1,006,119.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,431,564.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	4,159,584.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,910,385.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,950,000.000	3,559,647.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,461,610.000	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,972,430.000		
オーストラリア・ドル 小計		47,170,000.000 (3,741,524,400)	51,736,328.800 (4,103,725,600)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,464,990.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	2,300,000.000	2,253,609.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,363,376.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	584,880.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	746,688.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	778,280.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,272,239.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,659,047.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,157,993.200	
	CANADA 1.75 05/01/20	2,770,000.000	2,768,836.600	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,029,373.800	

	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	746,549.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	250,000.000	241,747.500	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	541,315.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,536,840.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	629,184.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,655,536.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,230,000.000	3,327,610.600	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,642,995.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	680,000.000	807,262.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,852,280.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,859,724.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,720,000.000	2,186,429.600	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,400,000.000	1,856,428.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	2,012,822.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,166,848.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,260,000.000	1,841,805.000	
カナダ・ドル 小計		42,320,000.000 (3,568,845,600)	45,984,689.300 (3,877,888,849)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	982,600.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	210,420.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	194,666.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	509,500.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	683,694.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	572,275.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	425,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	488,290.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	851,148.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,663,200.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	538,785.600	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	990,900.000	
シンガポール・ドル 小計		7,770,000.000 (637,839,300)	8,110,878.600 (665,822,024)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	5,171,086.200	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,234,101.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,442,330.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,463,390.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,430,040.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,600,000.000	6,688,446.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,468,582.700	
スウェーデン・クローナ 小計		48,610,000.000 (577,000,700)	54,897,976.700 (651,638,983)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,441,010.600	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,989,500.000	

	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,724,017.400	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,870,000.000	9,726,398.500	
	DENMARK 4.5 11/15/39	13,930,000.000	24,827,717.600	
デンマーク・クローネ	小計	44,900,000.000 (756,116,000)	58,708,644.100 (988,653,567)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	6,006,240.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,021,808.500	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,873,720.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,129,636.700	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,830,280.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,705,424.000	
ノルウェー・クローネ	小計	29,640,000.000 (382,059,600)	30,567,109.200 (394,010,038)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,211,308.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,141,865.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,058,000.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,380,415.500	
	POLAND 2.5 04/25/24	1,050,000.000	1,063,650.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,200,882.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,981,880.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	1,913,775.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,476,847.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,373,699.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,970,000.000	3,155,031.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,839,427.200	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,628,960.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,076,888.000	
ポーランド・ズロチ	小計	36,520,000.000 (1,059,080,000)	38,502,627.700 (1,116,576,203)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,970,120.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,206,994.800	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,201,100.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,480,461.200	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,963,340.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,147,031.600	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	794,552.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,812,574.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,053,560.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,469,754.800	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,149,942.800	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,856,898.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,075,700.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,749,984.000	
マレーシア・リングgit	小計	29,750,000.000 (811,282,500)	29,932,013.700 (816,246,014)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	14,610,440.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	38,043,600.000	

	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	12,942,931.950	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	24,823,240.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,735,360.000	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	10,880,000.000	10,649,126.400	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,559,100.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,444,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	19,904,060.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,504,470.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,622,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	13,947,640.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	31,341,620.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	14,738,850.000	
	メキシコ・ペソ 小計	251,739,000.000 (1,457,568,810)	247,867,538.350 (1,435,153,047)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	531,866.400	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	450,000.000	467,005.500	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,359,319.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	353,920.000	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	475,842.100	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,079,590.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	300,000.000	322,773.000	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	287,659.700	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,375,962.500	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,532,020.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	220,000.000	272,637.200	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	780,000.000	958,042.800	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	720,000.000	1,048,572.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	844,909.800	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,093,800.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,352,880.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,484,913.400	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,802,850.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,410,000.000	2,177,040.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,472,295.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,728,887.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	671,022.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,100,077.700	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,570,000.000	1,640,194.700	

BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,136,179.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,260,000.000	1,291,890.600	
BELGIUM 0.9 06/22/29	500,000.000	513,105.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,583,220.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,140,000.000	1,163,415.600	
BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	529,053.600	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	453,406.800	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,000,000.000	1,005,880.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	730,000.000	803,255.500	
BELGIUM 2.15 06/22/66	680,000.000	727,600.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,885,130.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	380,000.000	424,045.800	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,724,465.300	
BELGIUM 3.0 06/22/34	720,000.000	919,260.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	990,000.000	1,475,109.900	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,349,050.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,705,080.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	920,000.000	1,278,330.800	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,740,000.000	2,689,152.600	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,098,457.900	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,387,706.600	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,565,064.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,980,000.000	3,120,895.800	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,270,000.000	3,288,866.800	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,520,340.000	
BUNDESABL 04/08/22	2,010,000.000	2,042,803.200	
BUNDESABL 04/09/21	2,200,000.000	2,226,048.000	
BUNDESABL 04/14/23	1,130,000.000	1,151,244.000	
BUNDESABL 04/17/20	1,130,000.000	1,137,503.200	
BUNDESABL 10/07/22	2,730,000.000	2,779,358.400	
BUNDESABL 10/13/23	1,280,000.000	1,304,268.800	
BUNDESSCHAT 06/12/20	1,270,000.000	1,279,474.200	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,680,000.000	2,759,488.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	400,000.000	406,180.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,780,000.000	1,815,137.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,305,820.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,690,000.000	2,824,500.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,312,632.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,830,707.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,370,000.000	2,399,672.400	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,439,240.400	

DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,705,875.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,300,000.000	1,484,990.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,266,299.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,708,275.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,196,300.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,767,925.500	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,660,920.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,907,225.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,897,073.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,664,835.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,381,566.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,145,852.300	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,327,534.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,710,000.000	3,879,365.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,600,000.000	3,783,650.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,145,740.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,433,059.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,500,000.000	2,371,110.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,310,000.000	3,719,608.200	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,390,000.000	2,390,952.900	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,120,000.000	1,618,344.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,080,000.000	3,452,841.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,740,000.000	3,224,133.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,500,000.000	2,445,030.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,409,216.000	

DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,251,956.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,834,140.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,740,905.600	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	506,695.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	618,420.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	306,690.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	670,000.000	679,386.700	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	459,400.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	317,544.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	323,804.800	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	232,444.900	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	443,641.800	
FINLAND 1.375 04/15/47	40,000.000	43,661.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,020,490.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	428,224.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	756,126.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	500,000.000	684,445.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	772,821.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,023,463.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	759,486.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,007,096.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,323,985.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	1,100,000.000	1,114,498.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	3,002,490.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,809,298.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,560,000.000	3,644,443.200	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,590,000.000	3,688,007.000	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,940,000.000	3,005,738.400	
FRANCE OAT 02/25/21	1,370,000.000	1,382,508.100	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,918,354.000	
FRANCE OAT 03/25/24	1,390,000.000	1,396,658.100	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,534,974.500	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,033,660.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,350,000.000	3,536,829.500	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,000,000.000	3,182,130.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,290,000.000	1,340,761.500	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,840,000.000	2,900,776.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,090,000.000	5,532,117.400	

FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,773,780.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,150,000.000	1,148,493.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,440,000.000	1,574,395.200	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,630,000.000	4,004,107.800	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,580,000.000	2,875,461.600	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,495,680.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,720,076.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,490,000.000	4,185,975.800	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,800,000.000	8,193,510.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,580,000.000	4,321,418.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	4,790,000.000	5,302,961.100	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,470,000.000	3,469,806.600	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,190,000.000	4,603,930.100	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	6,500,000.000	6,805,305.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,810,000.000	4,726,686.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,640,000.000	5,064,467.200	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,440,000.000	2,374,128.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,400,000.000	2,367,274.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,630,000.000	3,954,967.700	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,044,100.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,620,000.000	5,900,238.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,690,000.000	4,217,785.500	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,455,801.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,390,000.000	5,561,261.100	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,045,645.000	
IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	980,618.500	
IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	591,710.200	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,252,320.000	
IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	349,207.200	
IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	455,980.500	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	217,982.100	
IRISH 1.7 05/15/37	570,000.000	597,930.000	
IRISH 10/18/22	220,000.000	221,326.600	
IRISH 2.0 02/18/45	870,000.000	948,848.100	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,273,954.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,087,337.400	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	815,038.000	

IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,194,895.900	
IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	926,355.500	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,651,204.800	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,669,434.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	902,902.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	1,998,024.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,605,076.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	963,555.600	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,420,000.000	2,356,160.400	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,434,000.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	768,152.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,837,740.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,503,750.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	2,630,000.000	2,514,911.200	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,499,640.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	1,948,431.400	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,392,875.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,423,950.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,260,000.000	1,926,989.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	2,084,670.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,090,000.000	1,982,929.300	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,010,000.000	1,972,593.900	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,870,000.000	1,790,655.900	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,260,720.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,040,000.000	1,982,064.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,300,050.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,008,106.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	554,845.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	989,885.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,413,060.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	541,068.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,395,590.000	

ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,270,000.000	1,177,696.400	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,780,000.000	1,682,224.600	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,100,000.000	1,100,462.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,376,274.900	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,570,000.000	2,688,811.100	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,496,845.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,444,670.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,407,680.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,060,854.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,020,000.000	3,266,130.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	3,891,068.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,783,816.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,674,386.100	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,394,639.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,556,898.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,140,540.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,696,252.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,805,864.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,790,000.000	2,101,549.500	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,590,000.000	2,873,605.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,773,080.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,510,000.000	3,014,510.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,430,000.000	2,924,748.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,250,000.000	2,701,125.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,502,330.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,480,000.000	2,819,140.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,848,300.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,240,000.000	2,855,328.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	4,001,480.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,020,000.000	3,901,538.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,437,480.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,510,000.000	1,993,200.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,740,307.000	

NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,763,240.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,528,169.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,260,000.000	1,324,096.200	
NETHERLANDS 01/15/22	2,310,000.000	2,342,316.900	
NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,701,369.600	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,184,840.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,748,666.400	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,693,204.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,300,000.000	1,652,495.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,430,000.000	2,134,403.700	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,029,855.200	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,764,338.300	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	686,288.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,620,000.000	2,672,125.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,560,000.000	2,459,652.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,350,000.000	1,991,385.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	401,860.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,460,000.000	1,471,913.600	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,234,892.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,363,342.800	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,738,488.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,143,449.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,400,000.000	2,479,968.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,230,000.000	2,286,731.200	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,950,000.000	1,988,902.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	980,000.000	995,180.200	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,200,000.000	2,275,812.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,000,000.000	2,082,200.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,160,000.000	2,299,557.600	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	1,936,422.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,367,859.200	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,303,973.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,620,000.000	1,746,360.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	950,000.000	1,011,864.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,390,000.000	2,698,596.800	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	2,010,888.000	

	SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,203,520.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	2,023,924.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,521,656.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	2,648,783.200	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,745,947.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,360,000.000	2,962,342.800	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	3,062,052.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,685,188.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,150,299.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,840,000.000	2,736,448.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,582,100.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,346,705.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,388,308.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,044,780.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,290,000.000	3,453,045.200	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,702,362.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,040,000.000	2,786,170.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,750,000.000	3,985,437.500	
	ユーロ 小計	524,540,000.000 (65,929,432,600)	601,082,306.200 (75,550,035,066)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,508,000.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,579,002.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,276,100.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,640,760.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,595,716.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,998,665.300	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,085,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,755,722.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,011,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	18,251,391.600	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	11,713,113.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,417,840.000	
	南アフリカ・ランド 小計	151,470,000.000 (1,201,157,100)	136,833,109.900 (1,085,086,562)	
国債証券 合計		180,841,482,210 (180,841,482,210)	194,119,015,713 (194,119,015,713)	
合計		180,841,482,210 (180,841,482,210)	194,119,015,713 (194,119,015,713)	

- (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 151銘柄	45.51%	46.40%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	6.75%	6.88%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	2.07%	2.11%
カナダ・ドル	国債証券 27銘柄	1.96%	2.00%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.34%	0.34%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.33%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.50%	0.51%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.20%	0.20%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.56%	0.58%
マレーシア・リンギット	国債証券 14銘柄	0.41%	0.42%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.73%	0.74%
ユーロ	国債証券 284銘柄	38.17%	38.92%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.55%	0.56%

(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

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

平成31年2月28日現在

資産総額	12,185,787,318円
負債総額	7,934,883円
純資産総額(-)	12,177,852,435円
発行済数量	7,505,581,281口
1口当たり純資産額(/)	1.6225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31年2月28日現在

資産総額	25,845,344,047円
負債総額	18,921,003円
純資産総額(-)	25,826,423,044円
発行済数量	13,463,289,130口
1口当たり純資産額(/)	1.9183円

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

平成31年2月28日現在

資産総額	20,127,585,161円
負債総額	13,905,206円
純資産総額(-)	20,113,679,955円
発行済数量	9,072,701,064口
1口当たり純資産額(/)	2.2169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31年2月28日現在

資産総額	285,775,483,605円
負債総額	1,693,629,820円
純資産総額(-)	284,081,853,785円
発行済数量	114,397,427,932口
1口当たり純資産額(/)	2.4833円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年2月28日現在

資産総額	299,246,831,945円
負債総額	6,082,088,000円
純資産総額(-)	293,164,743,945円
発行済数量	224,633,912,051口
1口当たり純資産額(/)	1.3051円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年2月28日現在

資産総額	359,058,513,495円
負債総額	459,140,299円
純資産総額(-)	358,599,373,196円
発行済数量	101,511,475,103口
1口当たり純資産額(/)	3.5326円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年2月28日現在

資産総額	198,095,254,335円
負債総額	202,758,000円
純資産総額(-)	197,892,496,335円
発行済数量	108,707,898,852口
1口当たり純資産額(/)	1.8204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) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 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。

(6) 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。

(7)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、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。

第二部【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(2019年2月28日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2019年2月28日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役(監査等委員である取締役を除く。)の補欠として選任された取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、現任取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,208,218,266,308
追加型株式投資信託	871	12,971,273,353,960
単位型公社債投資信託	46	178,520,111,161
単位型株式投資信託	154	1,193,507,472,892
合計	1,097	15,551,519,204,321

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)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33期事業年度(自平成29年4月1日至平成30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34期中間会計期間(自平成30年4月1日至平成30年9月30日)の中間財務諸表について、EY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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	27,972,477	49,071,217
金銭の信託	12,366,219	12,083,824
有価証券	297,560	-
未収委託者報酬	10,164,041	11,769,015
未収運用受託報酬	7,250,239	4,574,225
未収投資助言報酬	316,414	341,689
未収収益	52,278	59,526
前払費用	533,411	569,431
繰延税金資産	678,104	842,996
その他	445,717	427,238
流動資産計	60,076,462	79,739,165
固定資産		
有形固定資産	1,900,343	1,643,826
建物	1 1,243,812	1 1,156,953
器具備品	1 656,235	1 476,504
建設仮勘定	295	10,368
無形固定資産	1,614,084	1,934,700
商標権	5	-
ソフトウェア	1,511,558	1,026,319
ソフトウェア仮勘定	98,483	904,389
電話加入権	3,934	3,931
電信電話専用施設利用権	103	60
投資その他の資産	10,055,336	7,427,316
投資有価証券	3,265,786	1,721,433
関係会社株式	3,306,296	3,229,196
長期差入保証金	1,800,827	1,518,725
前払年金費用	686,322	-
繰延税金資産	893,887	856,537
その他	102,215	101,425
固定資産計	13,569,764	11,005,844
資産合計	73,646,227	90,745,010

(単位:千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038
未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911
役員賞与引当金	27,495	49,986
本社移転費用引当金	-	156,587
流動負債計	17,211,706	22,211,034
固定負債		
退職給付引当金	1,305,273	1,637,133
時効後支払損引当金	216,466	199,026
本社移転費用引当金	942,315	-
固定負債計	2,464,055	1,836,160
負債合計	19,675,761	24,047,195
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	31,899,643	44,349,855
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	31,776,350	44,226,562
別途積立金	24,580,000	24,580,000
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	6,696,350	19,146,562
株主資本計	53,452,601	65,902,812
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,864	795,002
評価・換算差額等計	517,864	795,002
純資産合計	53,970,465	66,697,815
負債・純資産合計	73,646,227	90,745,010

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	56,355,754		84,705,447	
運用受託報酬	12,834,241		19,124,427	
投資助言報酬	1,002,482		1,217,672	
その他営業収益	378,715		117,586	
営業収益計		70,571,194		105,165,133
営業費用				
支払手数料	24,957,038		37,242,284	
広告宣伝費	838,356		379,873	
公告費	991		1,485	
調査費	15,105,578		23,944,438	
調査費	7,780,474		10,677,166	
委託調査費	7,325,104		13,267,272	
委託計算費	891,379		1,073,938	
営業雑経費	1,102,921		1,215,963	
通信費	51,523		48,704	
印刷費	926,453		947,411	
協会費	37,471		64,331	
諸会費	74		22,412	
支払販売手数料	87,399		133,104	
営業費用計		42,896,265		63,857,984
一般管理費				
給料	8,517,089		11,304,873	
役員報酬	220,145		189,022	
給料・手当	7,485,027		9,565,921	
賞与	811,916		1,549,929	
交際費	66,813		58,863	
寄付金	13,467		5,150	
旅費交通費	297,237		395,605	
租税公課	430,779		625,498	
不動産賃借料	1,961,686		1,534,255	
退職給付費用	358,960		595,876	
固定資産減価償却費	825,593		1,226,472	
福利厚生費	39,792		49,797	
修繕費	27,435		4,620	
賞与引当金繰入額	1,432,264		1,393,911	
役員賞与引当金繰入額	27,495		49,986	
役員退職慰労金	63,072		-	
機器リース料	210		148	
事務委託費	1,530,113		3,037,804	
事務用消耗品費	127,265		144,804	
器具備品費	271,658		5,253	
諸経費	129,981		149,850	
一般管理費計		16,120,918		20,582,772
営業利益		11,554,010		20,724,376

(単位:千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		537		1,430
受取配当金		51,036		74,278
時効成立分配金・償還金		103		256
為替差益		7,025		8,530
投資信託解約益		2		236,398
投資信託償還益		-		93,177
雑収入	1	18,213	1	10,306
時効後支払損引当金戻入額		-		17,429
営業外収益計		76,918		441,807
営業外費用				
投資信託解約損		31,945		4,138
投資信託償還損		47,201		17,065
金銭の信託運用損		552,635		99,303
時効成立後支払分配金・償還金		39		-
時効後支払損引当金繰入額		209,210		-
営業外費用計		841,031		120,507
経常利益		10,789,897		21,045,676
特別利益				
固定資産売却益	2	2,348	2	1
投資有価証券売却益		-		479,323
関係会社株式売却益	1	-	1	1,492,680
貸倒引当金戻入益		8,883		-
訴訟損失引当金戻入益		21,677		-
本社移転費用引当金戻入額		-		138,294
その他特別利益		746		350
特別利益計		33,655		2,110,649
特別損失				
固定資産除却損	3	23,600	3	36,992
固定資産売却損	4	10,323	4	134
投資有価証券評価損		12,085		-
ゴルフ会員権評価損		4,832		-
訴訟和解金		30,000		-
本社移転費用	5	1,511,622	5	-
退職給付制度終了損		-		690,899
システム移行損失		-		76,007
その他特別損失		-		50
特別損失計		1,592,463		804,083
税引前当期純利益		9,231,089		22,352,243
法人税、住民税及び事業税		2,965,061		6,951,863
法人税等調整額		177,275		249,832
法人税等合計		2,787,786		6,702,031
当期純利益		6,443,302		15,650,211

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	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	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による 増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の 積立	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による 増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	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	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

重要な会計方針

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. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 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。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 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、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分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、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、そ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年または10年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、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年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 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き方式によっております。

会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、当事業年度においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度末の減価償却費が413,260千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ同額減少しております。

追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」(企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日)及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第2号 平成19年2月7日)を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。

本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
建物	53,098	140,580
器具備品	734,064	847,466

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
雑収入	8,183	-
関係会社株式売却益	-	1,492,680

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	546	-
車両運搬具	696	-
器具備品	1,104	1

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	-	298
器具備品	4,727	8,217
ソフトウェア	2,821	28,472
電話加入権	16,052	3

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	543	-
器具備品	9,779	134

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	942,315	-
旧日本社不動産賃借料	418,583	-
賃貸借契約解約損	150,723	-

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

(注) 普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

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28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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29年6月21日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式					

第33期(自平成29年4月1日 至平成30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	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

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29年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成30年6月20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30年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21日
	A種種類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っている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。当該デリバティブ取引は、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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（為替予約取引及び株価指数先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(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

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

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り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32期（平成29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	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

第33期(平成30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	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

(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) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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) 未払手数料

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

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	337,468	272,464
関係会社株式	3,306,296	3,229,196

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、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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。

(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32期(平成29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) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

第33期(平成30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) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第32期(平成29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	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)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33期(平成30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	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	717,905	2	79,146

(注) 投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

(注) 投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

第33期において、該当事項はありません。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付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）を採用しております。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社は平成29年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
退職給付債務の期首残高	1,086,550	2,718,372
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
数理計算上の差異の発生額	89,303	61,792
退職給付の支払額	144,062	111,758
合併による増加	1,486,547	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,316,796
退職一時金制度改定に伴う増加額	-	526,345
退職給付債務の期末残高	2,718,372	2,154,607

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
年金資産の期首残高	-	1,363,437
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の発生額	1,894	-
事業主からの拠出額	37,402	36,672
退職給付の支払額	28,876	-
合併による増加	1,336,984	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,417,152
年金資産の期末残高	1,363,437	-

（3）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（平成29年3月31日現在）	（平成30年3月31日現在）
積立型制度の退職給付債務	1,275,346	-
年金資産	1,363,437	-
	88,090	-
非積立型制度の退職給付債務	1,443,026	2,154,607
未積立退職給付債務	1,354,935	2,154,607
未認識数理計算上の差異	430,203	204,636
未認識過去勤務費用	4,852	312,836
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133
退職給付引当金	1,245,019	1,637,133
前払年金費用	325,140	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の費用処理額	78,229	88,417
過去勤務費用の費用処理額	4,852	39,611
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	-	70,560
その他	7,498	1,620
確定給付制度に係る退職給付費用	274,580	456,577
制度移行に伴う損失(注)	-	690,899

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
株式	31.5%	-
債券	29.0%	-
共同運用資産	24.1%	-
生命保険一般勘定	10.5%	-
現金及び預金	4.6%	-
合計	100.0%	-

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.02% ~ 1.09%	0.09%
長期期待運用収益率	2.50%	-
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	300,927
退職給付費用	22,562	53,156
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	36,177	35,640
合併による増加	287,313	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	391,600
退職一時金制度改定に伴う振替額	-	108,189
退職給付引当金の期末残高	300,927	-

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	789,261	-
年金資産	1,150,443	-
	361,181	-
非積立型制度の退職給付債務	60,254	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-
退職給付引当金	60,254	-
前払年金費用	361,181	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 22,562千円 当事業年度53,156千円

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度61,817千円、当事業年度86,141千円であります。

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	124,081	290,493
未払事業所税	11,054	11,683
賞与引当金	441,996	426,815
未払法定福利費	84,152	81,186
資産除去債務	86,421	90,524
減価償却超過額(一括償却資産)	10,666	11,331
減価償却超過額	116,920	176,791
繰延資産償却超過額(税法上)	32,949	34,977
退職給付引当金	399,808	501,290
時効後支払損引当金	66,282	60,941
ゴルフ会員権評価損	14,295	13,173
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	69,683	28,976
未払給与	12,344	9,186
本社移転費用引当金	289,865	47,947
その他	14,309	29,193
繰延税金資産小計	1,941,573	1,981,254
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,941,573	1,981,254
繰延税金負債		
前払年金費用	210,151	-
その他有価証券評価差額金	159,429	281,720
繰延税金負債合計	369,581	281,720

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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。

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ(以下「MHFG」という)及び第一生命ホールディングス株式会社(以下「第一生命」という)の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率(議決権比率)

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率	50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率	20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率	70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」(企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分)に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,059,836千円
負債合計	13,059,836千円
純資産	101,210,659千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額70,507,975千円及び顧客関連資産の金額45,200,838千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	9,012,128千円
経常利益	9,012,128千円
税引前当期純利益	9,012,128千円
当期純利益	7,419,617千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額3,811,241千円及び顧客関連資産の償却額5,233,360千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)及び第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

(1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500 億円	資産管理 等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473 億円	信託銀行 業	-	-	投資一任契約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30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				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

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) 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3) 運用受託報酬は、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4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734株)	(15,510株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		34,067,025
金銭の信託		18,936,052
未収委託者報酬		12,755,452
未収運用受託報酬		3,856,616
未収投資助言報酬		346,291
未収収益		58,816
前払費用		722,476
その他		443,661
	流動資産計	71,186,392
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,139,616
器具備品	1	425,343
無形固定資産		
ソフトウェア		875,280
ソフトウェア仮勘定		1,787,307
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		40
投資その他の資産		
投資有価証券		8,242,396
関係会社株式		2,436,769
長期差入保証金		3,229,196
繰延税金資産		1,318,800
繰延税金資産		1,167,835
その他		89,794
	固定資産計	12,473,915
資産合計		83,660,307

(単位:千円)

	第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	2,420,695
未払金	5,448,301
未払収益分配金	1,091
未払償還金	48,968
未払手数料	4,999,441
その他未払金	398,799
未払費用	6,877,637
未払法人税等	3,090,099
未払消費税等	599,967
前受収益	70,778
賞与引当金	1,310,878
役員賞与引当金	25,584
流動負債計	19,843,940
固定負債	
退職給付引当金	1,739,495
時効後支払損引当金	177,842
固定負債計	1,917,338
負債合計	21,761,279
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	39,054,769
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	38,931,475
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	7,251,475
株主資本計	60,607,726
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,291,302
評価・換算差額等計	1,291,302
純資産合計	61,899,028
負債・純資産合計	83,660,307

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,913,511	
運用受託報酬	8,532,726	
投資助言報酬	628,443	
その他営業収益	58,808	
	営業収益計	52,133,489
営業費用		
支払手数料	18,339,539	
広告宣伝費	179,085	
公告費	125	
調査費	12,096,339	
調査費	4,887,455	
委託調査費	7,208,884	
委託計算費	514,718	
営業雑経費	613,114	
通信費	23,463	
印刷費	467,622	
協会費	31,454	
諸会費	17,206	
支払販売手数料	73,367	
	営業費用計	31,742,923
一般管理費		
給料	4,854,622	
役員報酬	92,217	
給料・手当	4,634,136	
賞与	128,268	
交際費	26,068	
寄付金	5,806	
旅費交通費	164,824	
租税公課	284,716	
不動産賃借料	779,131	
退職給付費用	256,835	
固定資産減価償却費	1 294,442	
福利厚生費	22,384	
修繕費	12,644	
賞与引当金繰入額	1,310,878	
役員賞与引当金繰入額	25,584	
機器リース料	60	
事務委託費	1,757,115	
事務用消耗品費	70,698	
器具備品費	3,043	
諸経費	98,264	
	一般管理費計	9,967,124
営業利益		10,423,441

(単位:千円)

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	887	
受取配当金	49,212	
時効成立分配金・償還金	8,482	
時効後支払損引当金戻入額	19,806	
雑収入	12,895	
営業外収益計		91,283
営業外費用		
為替差損	19,977	
金銭の信託運用損	23,814	
雑損失	3,708	
営業外費用計		47,500
経常利益		10,467,225
特別損失		
固定資産除却損	18,830	
特別損失計		18,830
税引前中間純利益		10,448,394
法人税、住民税及び事業税		2,910,819
法人税等調整額		312,661
法人税等合計		3,223,481
中間純利益		7,224,913

(3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日至平成30年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		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	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当中間期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
中間純利益									7,224,913
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
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	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	11,895,086
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	7,251,475

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
中間純利益	7,224,913	7,224,913			7,224,913
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)			496,300	496,300	496,300
当中間期変動額合計	5,295,086	5,295,086	496,300	496,300	4,798,786
当中間期末残高	39,054,769	60,607,726	1,291,302	1,291,302	61,899,028

重要な会計方針

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：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</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算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。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 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、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分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、退職一時金制度について、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。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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 過去勤務費用については、そ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費用処理しております。 数理計算上の差異については、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年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 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き方式によっております。

表示方法の変更

<p>第34期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）</p>
<p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。</p>

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第34期中間会計期間末 （平成30年9月30日現在）						
1.有形固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 10%;">建物</td> <td style="width: 10%;">...</td> <td style="width: 10%;">184,810千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>860,618千円</td> </tr> </table>	建物	...	184,810千円	器具備品	...	860,618千円
建物	...	184,810千円					
器具備品	...	860,618千円					

（中間損益計算書関係）

項目	第34期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）						
1.減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 10%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%;">...</td> <td style="width: 10%;">112,547千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td>...</td> <td>181,894千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	112,547千円	無形固定資産	...	181,894千円
有形固定資産	...	112,547千円					
無形固定資産	...	181,894千円					

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30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	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

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30年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(平成30年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成30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	34,067,025	34,067,025	-
(2) 金銭の信託	18,936,052	18,936,052	-
(3) 未収委託者報酬	12,755,452	12,755,452	-
(4) 未収運用受託報酬	3,856,616	3,856,616	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,164,304	2,164,304	-
資産計	71,779,451	71,779,451	-
(1) 未払手数料	4,999,441	4,999,441	-
負債計	4,999,441	4,999,441	-

(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) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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) 未払手数料

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

(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	272,464
関係会社株式	3,229,196

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、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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。

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末
（平成30年9月30日現在）

1. 子会社株式

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

2. 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	1,976,064	146,101	1,829,962
投資信託	184,247	153,000	31,247
小計	2,160,311	299,101	1,861,209
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,993	4,000	6
小計	3,993	4,000	6
合計	2,164,304	303,101	1,861,202

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額272,464千円）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。

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成30年4月1日から平成30年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	109,432,950千円
資産合計	109,432,950千円
流動負債	- 千円
固定負債	11,942,856千円
負債合計	11,942,856千円
純資産	97,490,094千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額68,602,354千円及び顧客関連資産の金額42,580,212千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,521,569千円
経常利益	4,521,569千円
税引前中間純利益	4,521,569千円
中間純利益	3,720,565千円
1株当たり中間純利益	93,014円14銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,620,626千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

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%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,547,475円72銭
1株当たり中間純利益金額	180,622円83銭

(注)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。

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34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
中間純利益金額	7,224,913千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,224,913千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

(注) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(重要な後発事象)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
<p>アセットマネジメントOne株式会社(取締役社長:菅野 暁、以下「AM-One」)は、平成30年6月1日に株式会社みずほ銀行(頭取:藤原 弘治)と締結した株式譲渡基本合意書に基づき、平成30年11月1日に株式譲渡契約を締結の上、同日付でみずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(取締役社長:安藤 学、以下「MGAI」)の発行済株式の全てを取得し、子会社化しました。本再編に伴いMGAIは、商号をアセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社(取締役社長:安藤 学、以下「AMOAI」)に改称しました。</p>
<p>1. 株式取得の目的</p> <p>本再編により、AM-OneとAMOAI(旧MGAI)は両社のオルタナティブ投資のゲートキーピング()に係る機能について一体運営を行ない、ゲートキーピング能力と受託体制の強化を実現するとともに、株式会社みずほフィナンシャルグループ及び第一生命ホールディングス株式会社とも連携し、お客様の多様なニーズに応えるものであります。</p> <p>() 外部の運用会社およびファンドを調査し、優良なファンドを選定・管理すること</p>
<p>2. 株式取得対象会社の概要</p> <p>(1) 商号 :アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社</p> <p>(2) 事業内容:投資運用業務、投資助言・代理業務</p> <p>(3) 資本金 :10億円(平成30年11月1日現在)</p>
<p>3. 株式取得の時期</p> <p>平成30年11月1日</p>
<p>4. 取得する株式の数、取得原価及び取得後の議決権比率</p> <p>(1) 取得株式数 :20,000株</p> <p>(2) 取得原価 :12億7千万円</p> <p>(3) 取得後の議決権比率 :100%</p>

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) 通常の見積り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店頭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、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(以下「MGAI」といいます。)の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社(新商号:アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社)としました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

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

2018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	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
労働金庫連合会	(1) 120,000	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央機関です。
第一生命保険株式会社	60,000	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2018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】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	2018年5月25日、2018年11月26日
有価証券報告書	2018年5月25日
半期報告書	2018年11月26日

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne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 湯原 尚 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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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、アセットマネジメントOne株式会社の平成30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) XBR 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31年4月5日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型の平成30年2月27日から平成31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> 1安定型の平成31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。

その他の事項

ファンドの平成30年2月26日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年4月11日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

(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31年4月5日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型の平成30年2月27日から平成31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31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。

その他の事項

ファンドの平成30年2月26日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年4月11日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

(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31年4月5日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型の平成30年2月27日から平成31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> 3成長型の平成31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。

その他の事項

ファンドの平成30年2月26日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年4月11日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

(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。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY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	湯原	尚 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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間(平成30年4月1日から平成30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、アセットマネジメントOne株式会社の平成30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30年4月1日から平成30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) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。