

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成22年5月25日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 中島 敬雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【電話番号】 03-3287-3110

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 D I A M D C バランス30インデックスファンド  
D I A M D C バランス50インデックスファンド  
D I A M D C バランス70インデックスファンド

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

D I A M D C バランス30インデックスファンド  
D I A M D C バランス50インデックスファンド  
D I A M D C バランス70インデックスファンド

（以上を総称して、または個別に「D I A M D C バランスインデックスファンド」または「ファンド」ということがあります。また各々、「D I A M D C バランス30インデックスファンド」を「D C バランス30インデックスファンド」、「D I A M D C バランス50インデックスファンド」を「D C バランス50インデックスファンド」、「D I A M D C バランス70インデックスファンド」を「D C バランス70インデックスファンド」という場合もあります。）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）

格付けは取得していません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### (3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、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1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

<基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

### (5)【申込手数料】

ありません。

## (6)【申込単位】

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

## (7)【申込期間】

継続申込期間：平成22年5月26日から平成23年5月25日まで

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

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

## (8)【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

## (9)【払込期日】

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

## (10)【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

## (11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

## 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

## （参考）

## 投資信託振替制度

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

## (12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

なお、海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

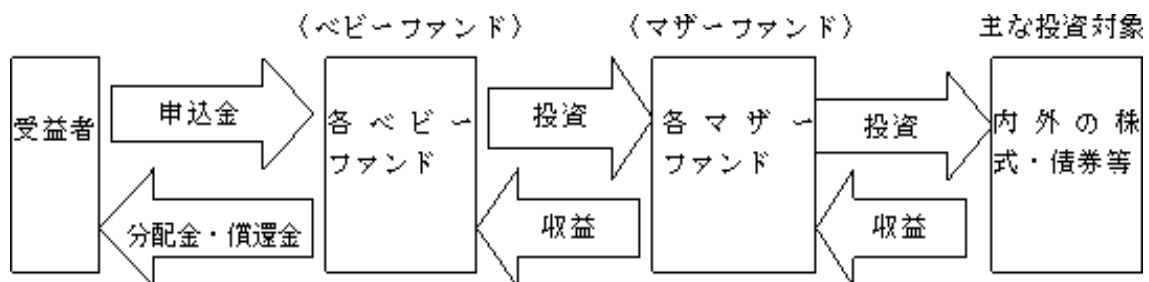
##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

当ファンドは、追加型株式投資信託に属します。

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「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、投資家からの資金をまとめてベビーファンド（「D I A M D C バランス30インデックスファンド」、「D I A M D C バランス50インデックスファンド」、「D I A M D C バランス70インデックスファンド」）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド（国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドおよび外国債券パッシブ・ファンド・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。当ファンドは、「ベビーファンド」に当たります。

各ファンドの信託金の限度額は1兆円とします。



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

マザーファンドの運用方針等は、「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 2.投資方針（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」、「国内債券パッシブ・ファンド・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」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」」の投資方針をご参照ください。

## 商品分類表

D I A M D C バランス30インデックスファンド

D I A M D C バランス50インデックスファンド

D I A M D C バランス70インデックスファンド

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

## 単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

## 投資対象地域

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

## 投資対象資産

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

## 補足分類

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

## 属性区分表

D I A M D C バランス30インデックスファンド

D I A M D C バランス50インデックスファンド

D I A M D C バランス70インデックスファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	日本 北米 欧州 アジア	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225  TOPIX
不動産投信	日々	オセアニア		なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産配 分固定型))	その他 ( )	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ		その他 (MSCIコクサ イ・インデックス、 NOMURA-B PI総合、シティグ ループ世界国債イ ンデックス)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

## 投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））」とは目論見書または投資信託約款において、マザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

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

## 決算頻度

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

## 投資対象地域

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

## 投資形態

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

## 為替ヘッジ

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

## 対象インデックス

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

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

よび属性区分の定義については、以下の方法でご確認ください。

・投資信託協会への照会

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

## (2)【ファンドの仕組み】

ファンドの関係法人は次の通りです。

委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

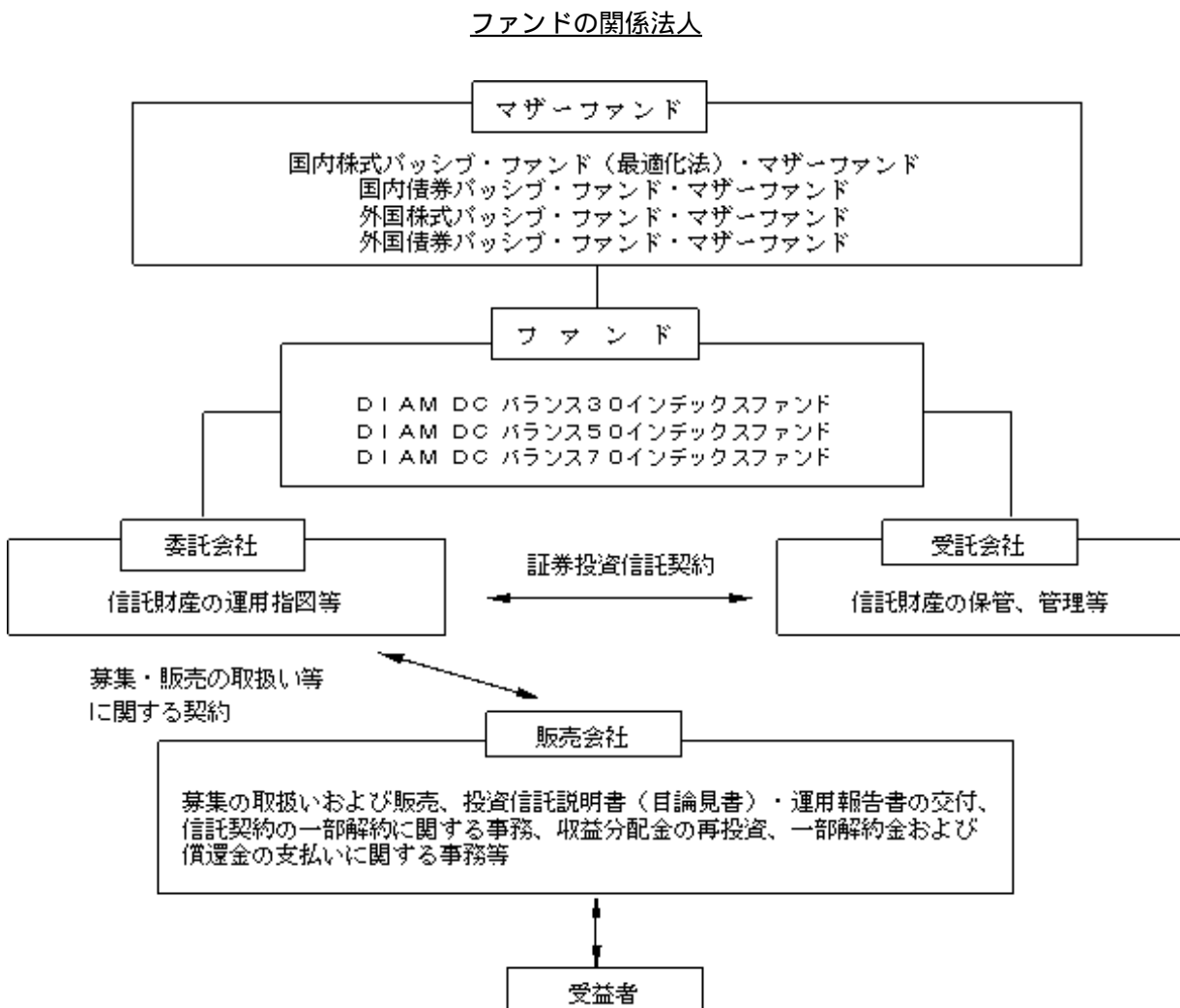
当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。



### ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

### ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約



金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

### 委託会社の概況

#### 資本金の額

20億円（平成22年3月31日現在）

#### 委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日

会社設立

平成10年 3月31日

「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

平成10年12月 1日

証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月 1日

第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年1月1日

「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

#### 大株主の状況

（平成22年3月31日現在）

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

（ ）平成22年4月1日現在

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

「DIAM DC バランス30インデックスファンド」

「DIAM DC バランス50インデックスファンド」

「DIAM DC バランス70インデックスファンド」

#### 基本方針

これらの投資信託は、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、安定的な運用を行うことを基本方針とします。

#### 投資態度

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。

(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、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して、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 DC バランス30インデックスファンド」

（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。）

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35%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を行います。

### 「DIAM DC バランス50インデックスファンド」

（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。）

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45%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を行います。

### 「DIAM DC バランス70インデックスファンド」

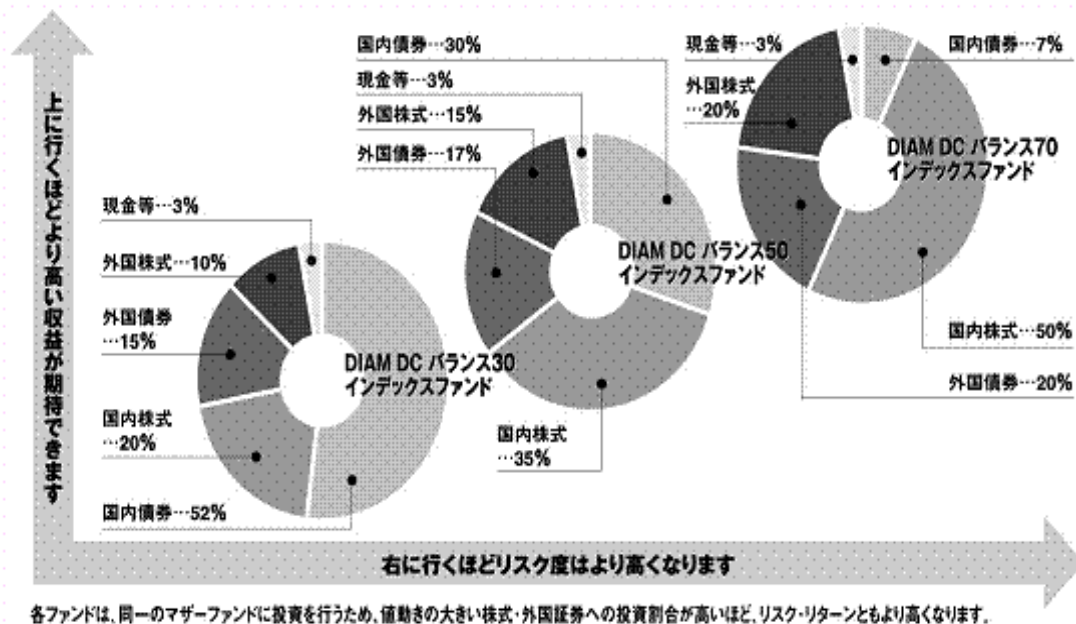
（株式・外国証券等リスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。）

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%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を行います。

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。

各ファンドの基本アロケーションは、以下の比率となります。



（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。

#### 共通

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

（注1）東証株価指数（TOPIX）（配当込み）とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）が公表する株式指数で、東京証券取引所第1部に上場されている全ての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化

法)・マザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

(株)東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

(株)東京証券取引所は、当社又は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

- (注2) NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- (注3) M S C I コクサイ・インデックスは、M S C I I n c . が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I I n c . に属しており、また、M S C I I n c . は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注4) シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。

- (3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産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リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- (5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引ならびに外国の市場における通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引(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。)、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。)、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。
- (6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。
- (7) 信託財産に属する資産の効率的な運用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ができます。

## (2)【投資対象】

### 1. 投資の対象とする資産（約款第16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24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。)
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
- b. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

### 2. 有価証券の指図範囲（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(4)までのD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）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) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（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) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（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、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
- (17) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
- (18) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- (19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- (20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- (21) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- (23) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

(26) 外国の者に対する権利で前号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17条第2項）

委託会社は、信託金を、前記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前号の権利の性質を有するもの

### 4. 前記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前記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17条第3項)

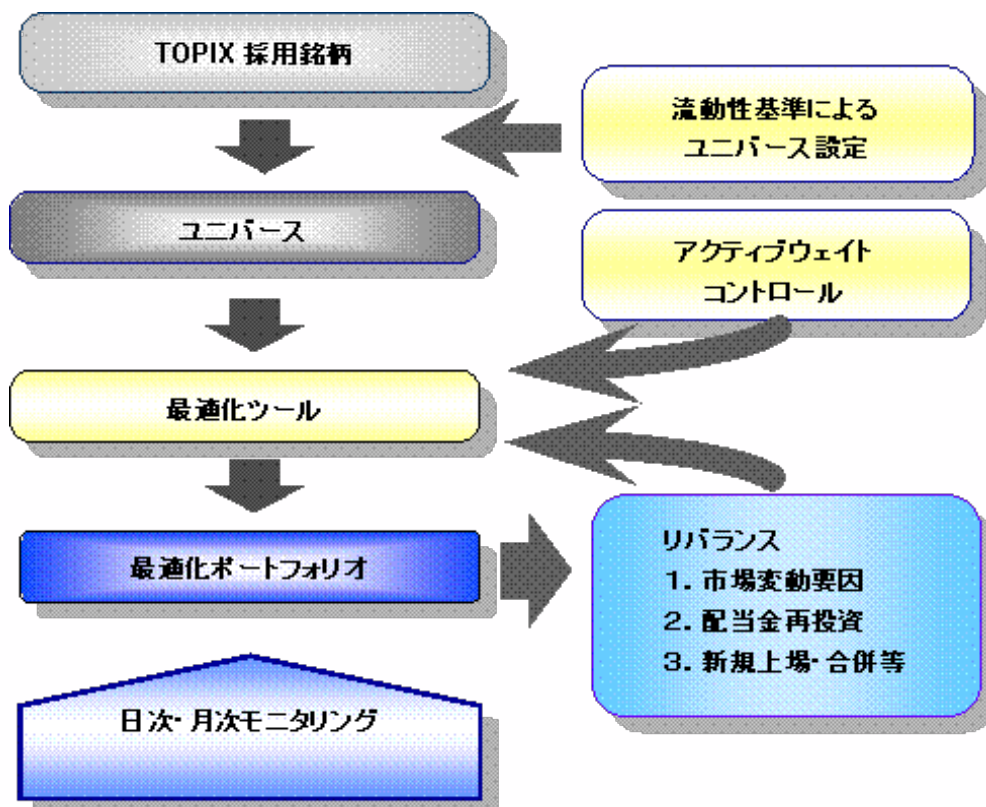
（参考）「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の投資方針

### 基本方針

当ファンドは、わが国の株式市場全体の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 投資態度

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. 運用プロセス
  - 1) 流動性基準によるユニバース設定  
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ユニバースを設定します。
  - 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、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。
  - 3) リバランス  
日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。リバランス要因には以下のものがあります。
    - ・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



3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
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。
6. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。



## 投資対象

### 1. 有価証券の指図範囲（約款第13条第1項）

委託会社は、信託金を主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1) 株券
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 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。）
  - 6) 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。）
  - 7) 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。）
  - 8) 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。）
  - 9) 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。）
  - 10) コマーシャル・ペーパー
  - 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  - 12) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 13) 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。）
  - 14) 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。）
  - 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 16) 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。）
  - 17) 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。）
  - 18) 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
  - 19) 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記1)、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および11)ならびに14)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

### 2. 金融商品の指図範囲（約款第13条第2項）

委託会社は、信託金を、前記1.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前号の権利の性質を有するもの

### 3. 前記1.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は、委託会社は、信託金を、前記2.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第13条第3項）

## 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。



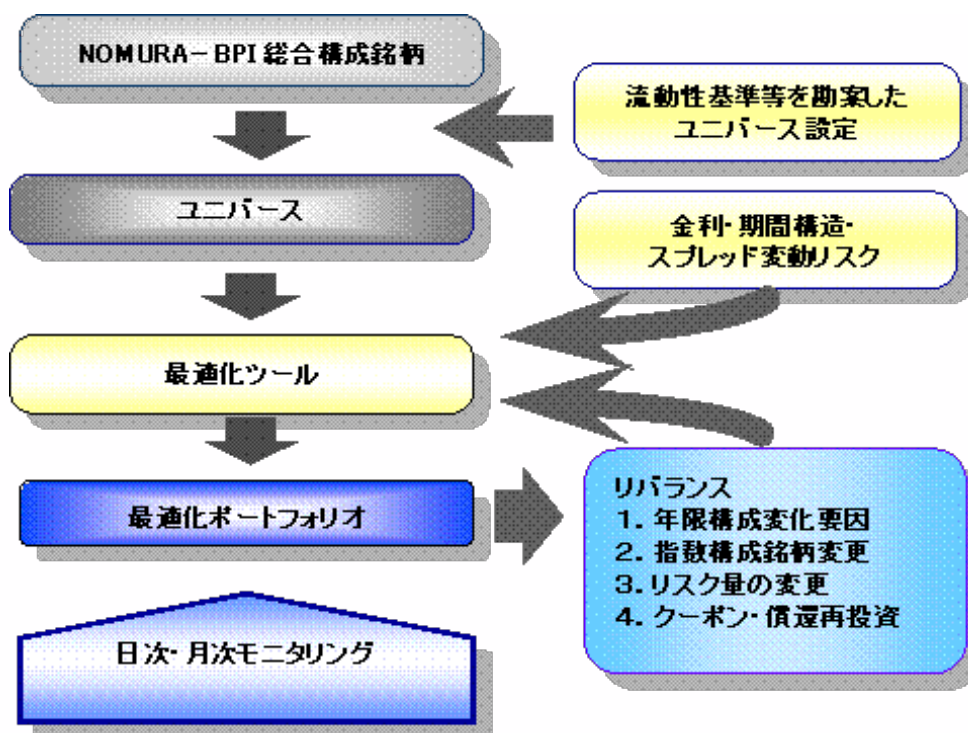
（参考）「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

### 基本方針

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

### 投資態度

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。
2. 運用プロセス
  - 1) 流動性基準によるユニバース設定  
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ユニバースを設定します。
  - 2) 最適化法によるポートフォリオの構築  
債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因  
金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因  
が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。
  - 3) リバランス  
日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。  
リバランス要因には以下のものがあります。
    - ・ 年限構成変化要因
    - ・ 指数構成銘柄変更
    - ・ リスク量の変更
    - ・ クーボン、償還再投資



3. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用します。
5. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

### 投資対象

1. 有価証券の指図範囲（約款第13条第1項）  
委託会社は、信託金を主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされ

る同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1) 国債証券
  - 2) 地方債証券
  - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
  - 5) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 6) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  - 7) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  - 8) 特定目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  - 9) 転換社債の転換および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、)の行使、株主割当または社債権者割当により取得した株券
  - 10) コマーシャル・ペーパー
  - 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  - 12) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 15) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、)
  - 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 17) 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記9)の証券または証書および11)の証券または証書のうち9)の性質を有するものを以下「株式」といい、1)から5)までの証券および11)ならびに13)の証券または証書のうち1)から5)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。
2. 金融商品の指図範囲（約款第13条第2項）  
委託会社は、信託金を、前記1.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前号の権利の性質を有するもの
  3. 前記1.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、前記2.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第13条第3項）

#### 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、
- 2) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 5) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

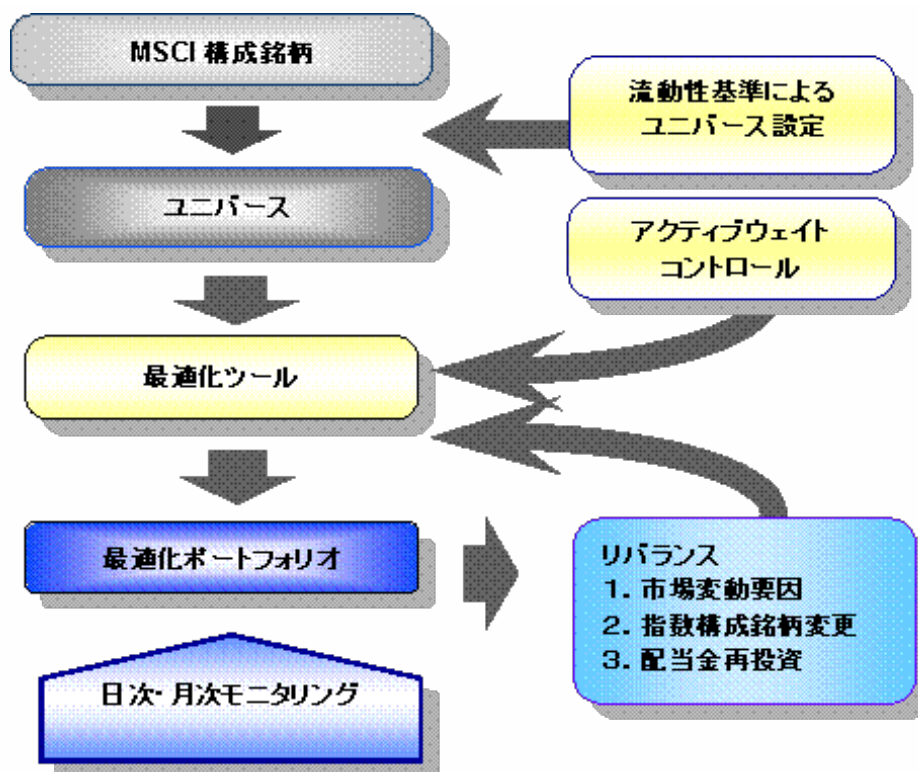
（参考）「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

#### 基本方針

当ファンドは、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。

### 投資態度

1. 海外の株式を主要投資対象とします。
2. 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。
3. 運用プロセス
  - 1) 流動性基準によるユニバース設定  
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ユニバースを設定します。
  - 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、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。
  - 3) リバランス  
日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。  
リバランス要因には以下のものがあります。
    - ・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



4. 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
5. 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。
6. 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

### 投資対象

1. 有価証券の指図範囲（約款第15条第1項）

委託会社は、信託金を主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1) 株券
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 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。)
  - 6) 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。)
  - 7) 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。)
  - 8) 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。)
  - 9) 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。)
  - 10) コマーシャル・ペーパー
  - 11) 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
  - 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  - 13) 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。)
  - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  - 15) 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。)
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 18) 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。)
  - 19) 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
  - 20) 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの  
なお、前記1)、12)ならびに15)の証券または証書のうち1)の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および12)ならびに15)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。
2. 金融商品の指図範囲(約款第15条第2項)
- 委託会社は、信託金を、前記1.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前号の権利の性質を有するもの
3. 前記1.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は、委託会社は、信託金を、前記2.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第15条第3項)

#### 投資対象

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 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。
- 3) 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。

4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

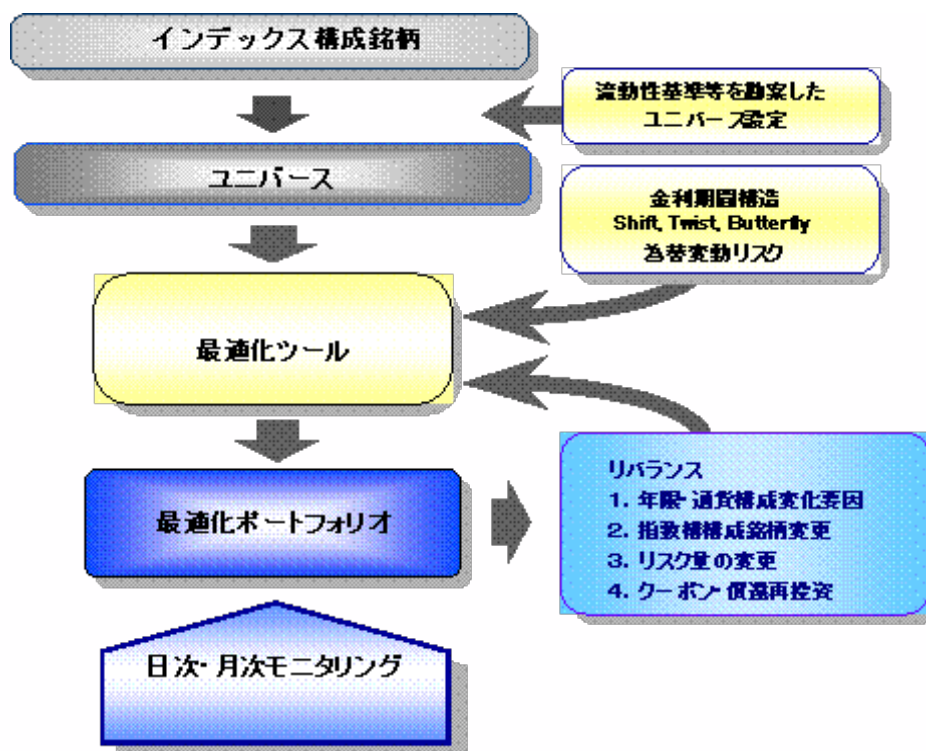
（参考）「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

### 基本方針

当ファンドは、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。

### 投資態度

1. 海外の公社債を主要投資対象とします。
2. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
3. 運用プロセス
  - 1) 流動性基準によるユニバース設定  
シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資ユニバースを設定します。
  - 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) リバランス  
日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。  
リバランス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
    - ・ クーボン・償還再投資



4. 外国債券の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
5. 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。
6. 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに有価証券等の価格変動リスクおよび為替リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことがあります。



## 投資対象

### 1. 有価証券の指図範囲（約款第14条第1項）

委託会社は、信託金を主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1) 国債証券
  - 2) 地方債証券
  - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
  - 5) 転換社債の転換および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使、株主割当または社債権者割当により取得した株券
  - 6) コマーシャル・ペーパー
  - 7) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  - 8) 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。）
  - 9) 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。）
  - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 11) 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、）
  - 12) 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
  - 13) 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記5)の証券または証書および7)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、1)から4)までの証券ならびに7)および9)の証券または証書のうち1)から4)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

### 2. 金融商品の指図範囲（約款第14条第2項）

委託会社は、信託金を、前記1.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前号の権利の性質を有するもの

### 3. 前記1.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、前記2.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第14条第3項）

## 投資制限

### 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、

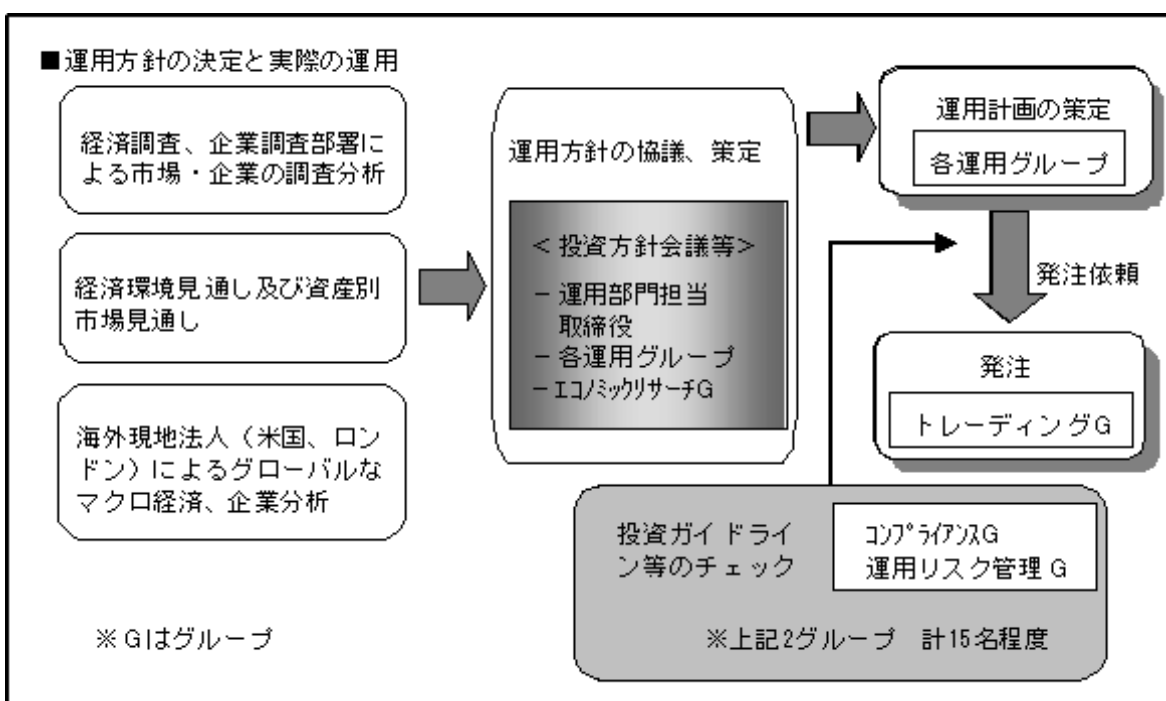
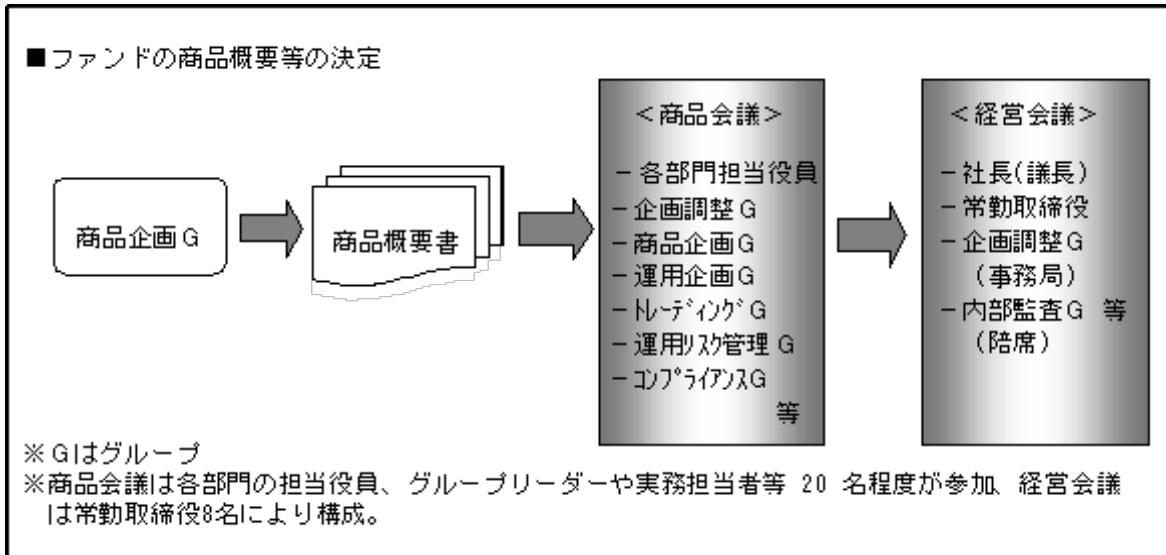
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### 2) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

## (3) 【運用体制】



## &lt;ファンドの商品概要等の決定&gt;

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

## &lt;運用方針の決定と実際の運用&gt;

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

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

個別の有価証券等の発注は、運用担当者の発注依頼に基づき、運用部門から独立したトレーディンググループでその大半が執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループ、運用リスク管理グループにて行われ、有価証券の売買執行等についてはコンプライアンスグループにてチェックが行われます。



前記体制は平成22年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4)【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時（原則2月25日、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) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時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. 前記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各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各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

##### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に全額再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し、支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## (5)【投資制限】

## 「D I A M D C バランス30インデックスファンド」

## (1)株式への実質投資割合（約款第17条第4項）

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（約款第30条第1項）

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35%以下とします。

## 「D I A M D C バランス50インデックスファンド」

## (1)株式への実質投資割合（約款第17条第4項）

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（約款第30条第1項）

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45%以下とします。

## 「D I A M D C バランス70インデックスファンド」

## (1)株式への実質投資割合（約款第17条第4項）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

## (2)外貨建資産への実質投資割合（約款第30条第1項）

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。

## 共通

## (3)投資信託証券への実質投資割合（約款第17条第5項）

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（約款第17条第6項）

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

## (5)投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

## (6)同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限（約款第21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が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

## (7)同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第22条）

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

## (8)信用取引の指図範囲（約款第23条）

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

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

- 1) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - 2) 株式分割により取得する株券
  - 3) 有償増資により取得する株券
  - 4) 売出しにより取得する株券
  - 5) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- (9) 先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第24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かかる利払金および償還金等ならびに前記（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かかる利払金および償還金等ならびに前記（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かかる利払金および償還金等ならびに前記（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かか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かかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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前記（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かかる利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額、以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかか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かかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(10)スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第25条)

- (a)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (b)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d)前(c)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供を要求され委託会社が必要と認めるときあるいは担保の受入れが必要と委託会社が認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(11)金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第26条)

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかか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かかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産にかか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かかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当す

る金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- (d) 前(c)においてマザーファンドの信託財産にかか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かか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かか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かか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、当該信託財産にかか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かかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (f) 前(e)においてマザーファンドの信託財産にかか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かかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (g) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (h) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (12) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第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、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
- 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価総額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - 2) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b) 前(a)各号で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- (13) 公社債の空売りの指図範囲（約款第28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) 前(a)の売り付けの指図は、当該売り付けにかか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、前(b)の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- (14) 公社債の借入れ（約款第29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) 前(a)の指図は、当該借入れにかか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、前(b)の借入れにかか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) 前(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

## (15) 特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第31条）

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

## (16) 外国為替予約の指図（約款第32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) 前(a)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかか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、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかか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) 前(b)においてマザーファンドの信託財産にかか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かか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かか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かか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) 前(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

## (17) 資金の借入れ（約款第39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に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

(d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

#### (1) 株式投資リスク

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

### 1) 価格変動リスク

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

### 2) 信用リスク

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

## (2) 債券投資リスク

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

### 1) 金利リスク

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

### 2) 信用リスク

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

## (3) 為替リスク

当ファンドで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。したがって、外貨建証券が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該証券の円ベースの評価額が減価し、ファンドの受益権の基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また、外貨建証券への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替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

当ファンドで行われる各資産（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、基準価額は予想外に下落する要因となる場合があります。

## < その他の留意点 >

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

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

当ファンドの収益分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により、分配を

行わないことがあります。

資金動向、市場動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

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

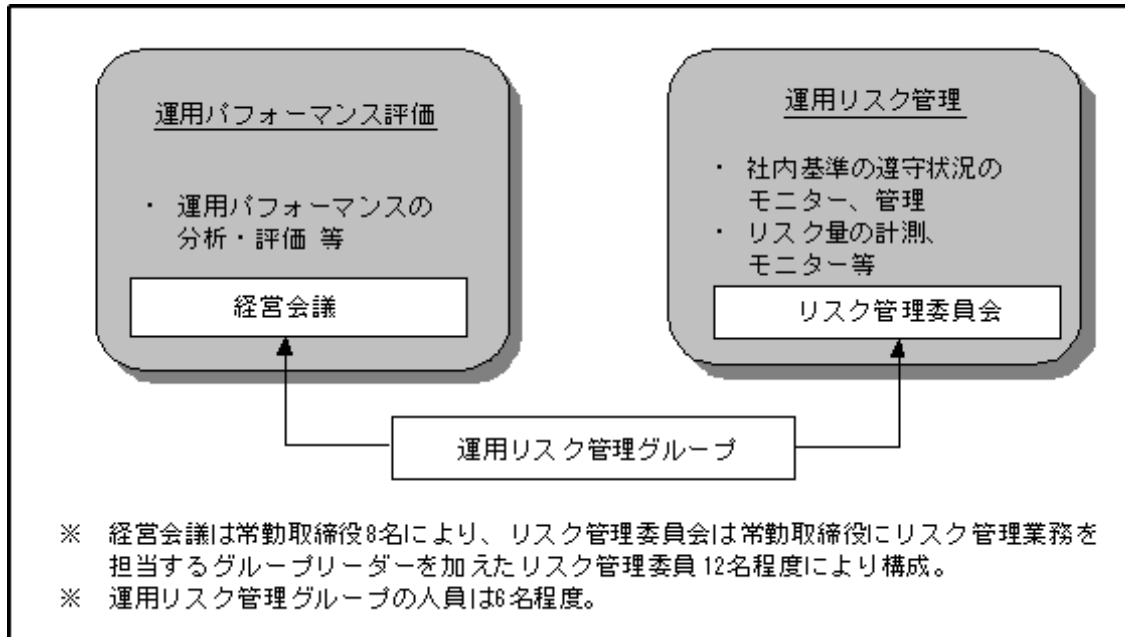
各ファンドにつき、受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合等、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

#### 注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。
- ロ．証券投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．証券投資信託は金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ．証券投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります。これによる損失は購入者が負担することとなります。



## &lt; 運用評価・運用リスク管理体制 &gt;



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

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

上記体制は平成22年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

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

DC バランス30 インデックスファンド	純資産総額に対して年率0.2520%（税抜0.240%） （内訳：委託会社0.09450%（税抜0.090%）、販売会社0.12600% （税抜0.120%）、受託会社0.03150%（税抜0.030%））
DC バランス50 インデックスファンド	純資産総額に対して年率0.28350%（税抜0.270%） （内訳：委託会社0.11025%（税抜0.105%）、販売会社0.14175% （税抜0.135%）、受託会社0.03150%（税抜0.030%））
DC バランス70 インデックスファンド	純資産総額に対して年率0.3150%（税抜0.300%） （内訳：委託会社0.12600%（税抜0.120%）、販売会社0.15750% （税抜0.150%）、受託会社0.03150%（税抜0.030%））

信託報酬の総額は、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

また、信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中より支弁します。

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息ならびに借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額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、信託財産中から支弁します。

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

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

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

## (5)【課税上の取扱い】

確定拠出年金の加入者におかれましては、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

なお、前記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

## 法人の受益者に対する課税

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還

時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成24年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

（注）法人の形態等により、税金の取扱いが異なることがありますので、ご注意ください。

税法および確定拠出年金法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 個別元本方式について

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

#### < 個別元本について >

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

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

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

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

#### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成22年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,395,652,515	97.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		73,784,042	2.99
合 計（純資産総額）		2,469,436,557	100.00

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

## D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成22年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	4,188,365,793	97.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		125,117,971	2.90
合 計（純資産総額）		4,313,483,764	100.00

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

## D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成22年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,295,065,099	97.11
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		68,346,625	2.89
合 計（純資産総額）		2,363,411,724	100.00

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

（参考）マザーファンドの投資状況

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成22年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	272,075,821,387	95.42
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		13,058,510,528	4.58
合 計（純資産総額）		285,134,331,915	100.00

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	米国	158,648,973,584	51.27
	英国	30,700,769,148	9.92
	カナダ	16,756,392,136	5.42
	スイス	14,113,178,580	4.56
	スウェーデン	4,183,599,289	1.35
	デンマーク	1,470,182,938	0.48
	ノルウェー	1,025,474,954	0.33
	アイルランド	1,588,019,251	0.51
	オランダ	4,069,114,497	1.32
	ベルギー	1,498,357,391	0.48
	ルクセンブルク	928,414,171	0.30
	フランス	15,111,770,900	4.88
	ドイツ	11,688,412,404	3.78
	ポルトガル	402,651,183	0.13
	スペイン	5,962,188,653	1.93
	イタリア	4,832,893,014	1.56
	フィンランド	1,873,130,147	0.61
	オーストリア	485,260,454	0.16
	キプロス	53,378,927	0.02
	ギリシャ	614,713,933	0.20
	香港	3,402,453,960	1.10
	中国	28,926,834	0.01
	シンガポール	2,211,236,788	0.71
	オーストラリア	12,637,391,639	4.08
	ニュージーランド	128,634,266	0.04
	パナマ	359,207,250	0.12
	バミューダ諸島	973,099,157	0.31
	オランダ領アンティル	1,125,904,550	0.36
	ケイマン諸島	285,276,534	0.09
	ガーンジー・チャンネル諸島	40,871,147	0.01
	ジャージー・チャンネル諸島	524,769,463	0.17
	マン島	42,596,714	0.01
リベリア	72,524,825	0.02	
モーリシャス	44,444,163	0.01	
小計	297,884,212,847	96.27	

投資信託受益証券	シンガポール	76,964,869	0.02
	オーストラリア	806,477,584	0.26
	小計	883,442,453	0.29
投資証券	米国	2,374,158,609	0.77
	英国	378,084,383	0.12
	カナダ	72,994,207	0.02
	オランダ	53,332,356	0.02
	フランス	430,861,603	0.14
	香港	84,029,436	0.03
	小計	3,393,460,595	1.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		7,273,186,320	2.35
合 計 （純資産総額）		309,434,302,215	100.00

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

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	321,038,474,000	75.03
地方債証券	日本	27,853,309,235	6.51
特殊債券	日本	40,806,561,195	9.54
社債券	日本	34,513,834,320	8.07
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,647,728,596	0.85
合 計 （純資産総額）		427,859,907,346	100.00

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	米国	149,813,219,360	35.66
	英国	29,442,367,448	7.01
	カナダ	11,970,994,035	2.85
	スウェーデン	2,943,676,879	0.70
	デンマーク	3,554,857,147	0.85
	ノルウェー	1,423,835,566	0.34
	アイルランド	3,745,449,797	0.89
	オランダ	10,584,500,368	2.52
	ベルギー	12,354,550,705	2.94
	フランス	40,451,620,554	9.63
	ドイツ	43,782,437,144	10.42
	ポルトガル	4,630,721,743	1.10
	スペイン	19,448,513,395	4.63
	イタリア	46,232,972,441	11.01
	フィンランド	2,283,830,970	0.54
	ポーランド	3,967,596,171	0.94
	オーストリア	7,371,645,657	1.75
	ギリシャ	8,840,656,161	2.10
	シンガポール	1,578,600,613	0.38
	マレーシア	2,136,360,336	0.51
オーストラリア	3,434,598,612	0.82	
	小計	409,993,005,100	97.60
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		10,102,254,605	2.40
合 計 （純資産総額）		420,095,259,705	100.00

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

## (2) 【投資資産】

## D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成22年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,154,539,525	10,948.00	1,263,989,890	10,946.00	1,263,758,964	51.18
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	416,695,257	11,397.83	474,942,096	12,174.00	507,284,805	20.54
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	299,223,226	12,150.21	363,562,543	12,295.00	367,894,956	14.90
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	195,249,308	12,240.32	238,991,486	13,148.00	256,713,790	10.40

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

## 種類別業種別投資比率

平成22年3月25日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.01
合計	97.01

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。



## D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成22年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,267,137,760	11,397.62	1,444,235,820	12,174.00	1,542,613,509	35.76
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,148,316,937	10,948.00	1,257,177,383	10,946.00	1,256,947,719	29.14
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	581,947,231	12,150.82	707,113,331	12,295.00	715,504,120	16.59
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	512,093,433	12,239.27	626,764,796	13,148.00	673,300,445	15.61

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

## 種類別業種別投資比率

平成22年3月25日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.10
合計	97.10

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## D I A M D C バランス70インデックスファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成22年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	980,202,512	11,397.59	1,117,194,807	12,174.00	1,193,298,538	50.49
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	370,024,078	12,238.87	452,867,592	13,148.00	486,507,657	20.58
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	372,434,609	12,150.99	452,544,917	12,295.00	457,908,351	19.37
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	143,751,648	10,948.00	157,379,304	10,946.00	157,350,553	6.66

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

## 種類別業種別投資比率

平成22年3月25日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.11
合計	97.11

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成22年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	2,953,500	3,280.00	9,687,480,000	3,705.00	10,942,717,500	3.84
2	三菱UFJフィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	16,158,000	455.00	7,351,890,000	471.00	7,610,418,000	2.67
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,833,600	3,035.00	5,564,976,000	3,275.00	6,005,040,000	2.11
4	キャノン	株式	日本	電気機 器	1,332,800	3,495.00	4,658,136,000	4,185.00	5,577,768,000	1.96
5	三井住友フィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,614,900	2,777.18	4,484,861,039	2,952.00	4,767,184,800	1.67
6	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,147,300	2,973.00	3,410,922,900	3,470.00	3,981,131,000	1.40
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,695,200	2,097.00	3,554,834,400	2,345.00	3,975,244,000	1.39
8	任天堂	株式	日本	その他 製品	121,300	24,310.00	2,948,803,000	32,000.00	3,881,600,000	1.36
9	みずほフィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	18,612,300	173.00	3,219,927,900	194.00	3,610,786,200	1.27
10	武田薬品	株式	日本	医薬品	845,500	4,000.00	3,382,000,000	4,245.00	3,589,147,500	1.26
11	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	893,900	3,945.00	3,526,435,500	3,845.00	3,437,045,500	1.21
12	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	1,352,000	2,436.00	3,293,472,000	2,435.00	3,292,120,000	1.15
13	パナソニック	株式	日本	電気機 器	2,101,100	1,318.00	2,769,249,800	1,379.00	2,897,416,900	1.02
14	野村ホールデ ィングス	株式	日本	証券 商品先 物取引 業	4,246,900	644.00	2,735,003,600	668.00	2,836,929,200	0.99
15	三井物産	株式	日本	卸売業	1,827,800	1,280.00	2,339,584,000	1,531.00	2,798,361,800	0.98
16	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	18,822	138,800.00	2,612,493,600	140,800.00	2,650,137,600	0.93
17	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	399,800	5,980.00	2,390,804,000	6,190.00	2,474,762,000	0.87
18	東芝	株式	日本	電気機 器	4,839,000	423.00	2,046,897,000	475.00	2,298,525,000	0.81
19	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	6,315,000	321.00	2,027,115,000	350.00	2,210,250,000	0.78
20	東京海上HD	株式	日本	保険業	861,300	2,395.00	2,062,813,500	2,540.00	2,187,702,000	0.77
21	ファナック	株式	日本	電気機 器	222,200	8,710.00	1,935,362,000	9,750.00	2,166,450,000	0.76

22	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,489,000	1,384.00	2,060,776,000	1,452.00	2,162,028,000	0.76
23	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	927,200	2,247.00	2,083,418,400	2,158.00	2,000,897,600	0.70
24	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	2,581,400	714.00	1,843,119,600	768.00	1,982,515,200	0.70
25	信越化学	株式	日本	化学	370,100	4,780.00	1,769,078,000	5,320.00	1,968,932,000	0.69
26	小松製作所	株式	日本	機械	998,000	1,726.00	1,722,548,000	1,942.00	1,938,116,000	0.68
27	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	905,600	1,966.00	1,780,409,600	2,120.00	1,919,872,000	0.67
28	関西電力	株式	日本	電気・ガス業	878,300	2,101.00	1,845,308,300	2,117.00	1,859,361,100	0.65
29	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	5,353	320,000.00	1,712,960,000	337,500.00	1,806,637,500	0.63
30	J F E ホールディングス	株式	日本	鉄鋼	482,300	3,120.00	1,504,776,000	3,575.00	1,724,222,500	0.60

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

## 種類別業種別投資比率

平成22年3月25日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	14.45
	輸送用機器	9.56
	銀行業	9.25
	化学	5.62
	情報・通信業	5.06
	卸売業	4.97
	電気・ガス業	4.77
	機械	4.51
	医薬品	3.99
	陸運業	3.58
	小売業	3.32
	食料品	3.11
	鉄鋼	2.52
	その他製品	2.39
	不動産業	2.12
	保険業	2.05
	建設業	1.88
	証券、商品先物取引業	1.73
	精密機器	1.52
	サービス業	1.47
	ガラス・土石製品	1.19
	非鉄金属	1.18
	繊維製品	0.78
	その他金融業	0.69
	金属製品	0.68
	石油・石炭製品	0.61
	海運業	0.55
	ゴム製品	0.54
	鉱業	0.37
	パルプ・紙	0.36
空運業	0.28	
倉庫・運輸関連業	0.22	
水産・農林業	0.09	
合計		95.42

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成22年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	787,717	5,951.23	4,687,886,617	6,107.36	4,810,871,297	1.55
2	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	1,328,655	2,565.09	3,408,121,248	2,723.06	3,618,001,970	1.17
3	APPLE INC	株式	米国	コン ピュー タ・周 辺機器	148,448	18,402.90	2,731,873,580	21,065.34	3,127,107,711	1.01
4	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コング ロマ リット	1,759,706	1,428.11	2,513,057,255	1,694.45	2,981,730,312	0.96
5	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用 品	485,063	5,672.04	2,751,295,962	5,841.94	2,833,710,106	0.92
6	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	457,315	5,760.20	2,634,228,058	5,946.64	2,719,487,672	0.88
7	BP PLC	株式	英国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	3,114,930	785.11	2,445,557,864	872.01	2,716,244,502	0.88
8	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金 融サー ビス	651,611	3,577.17	2,330,922,018	4,127.29	2,689,387,304	0.87
9	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイ ス	食品	575,869	4,319.02	2,487,191,456	4,619.25	2,660,084,606	0.86
10	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀 行	2,880,336	889.11	2,560,948,358	923.05	2,658,703,506	0.86
11	BANK OF AMERICA CORP	株式	米国	各種金 融サー ビス	1,647,248	1,352.30	2,227,568,684	1,613.63	2,658,046,814	0.86
12	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	コン ピュー タ・周 辺機器	217,386	11,388.16	2,475,626,550	11,804.20	2,566,066,778	0.83
13	AT&T INC	株式	米国	各種電 気通信 サービ ス	977,648	2,302.43	2,250,964,911	2,411.72	2,357,811,670	0.76
14	CISCO SYSTEMS INC	株式	米国	通信機 器	954,486	2,181.20	2,081,924,863	2,429.17	2,318,606,848	0.75
15	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀 行	804,471	2,468.66	1,985,964,735	2,834.18	2,280,017,550	0.74
16	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	332,123	6,521.56	2,165,959,540	6,789.73	2,255,025,895	0.73
17	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,337,685	1,634.75	2,186,783,229	1,617.30	2,163,441,161	0.70

18	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	40,131	48,958.99	1,964,773,051	51,185.19	2,054,112,748	0.66
19	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	556,721	3,418.27	1,903,020,911	3,630.97	2,021,435,245	0.65
20	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・生活必需品小売り	386,256	4,858.34	1,876,561,430	5,104.47	1,971,631,083	0.64
21	HEWLETT-PACKARD CO	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	395,694	4,450.57	1,761,062,421	4,873.03	1,928,228,891	0.62
22	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	929,150	1,876.29	1,743,355,968	2,059.97	1,914,022,240	0.62
23	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	352,177	5,097.81	1,795,332,752	5,197.01	1,830,268,957	0.59
24	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	8,750,577	190.22	1,664,547,883	203.77	1,783,102,012	0.58
25	MERCK & CO. INC.	株式	米国	医薬品	506,482	3,390.73	1,717,345,130	3,490.84	1,768,046,815	0.57
26	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	349,839	4,945.22	1,730,029,770	5,026.71	1,758,538,500	0.57
27	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	346,469	4,957.52	1,717,628,106	5,016.30	1,737,992,722	0.56
28	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	116,462	15,294.57	1,781,236,677	14,917.14	1,737,280,192	0.56
29	PEPSICO INC	株式	米国	飲料	270,373	5,594.89	1,512,707,951	6,085.32	1,645,305,792	0.53
30	BANCO SANTANDER SA	株式	スペイン	商業銀行	1,348,688	1,169.96	1,577,905,496	1,198.98	1,617,051,692	0.52

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

## 種類別業種別投資比率

平成22年3月25日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	石油・ガス・消耗燃料	9.73
	商業銀行	8.88
	医薬品	6.12
	保険	4.22
	金属・鉱業	3.98
	各種電気通信サービス	3.11
	コンピュータ・周辺機器	3.00
	各種金融サービス	2.98
	食品	2.63
	食品・生活必需品小売り	2.58
	ソフトウェア	2.54
	資本市場	2.46
	メディア	2.36
	化学	2.35
	コングロマリット	2.16
	飲料	2.08
	電力	2.03
	通信機器	1.92
	航空宇宙・防衛	1.84
	半導体・半導体製造装置	1.58
	家庭用品	1.56
	機械	1.56
	総合公益事業	1.51
	エネルギー設備・サービス	1.50
	ヘルスケア機器・用品	1.50
	専門小売り	1.45
	タバコ	1.31
	ホテル・レストラン・レジャー	1.28
	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	1.24
	情報技術サービス	1.04
	バイオテクノロジー	1.00
	インターネットソフトウェア・サービス	0.99
	無線通信サービス	0.97
	電気設備	0.86
	繊維・アパレル・贅沢品	0.75
	自動車	0.71
	陸運・鉄道	0.67
	不動産管理・開発	0.62
	複合小売り	0.60
	航空貨物・物流サービス	0.59
建設・土木	0.54	
電子装置・機器・部品	0.42	



建設資材	0.41
商業サービス・用品	0.39
消費者金融	0.37
インターネット販売・カタログ販売	0.34
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.31
専門サービス	0.29
家庭用耐久財	0.29
自動車部品	0.26
パーソナル用品	0.25
紙製品・林産品	0.24
ガス	0.22
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.21
建設関連製品	0.18
運送インフラ	0.17
容器・包装	0.17
商社・流通業	0.16
旅客航空輸送業	0.13
海運業	0.11
各種消費者サービス	0.11
販売	0.11
貯蓄・抵当・不動産金融	0.09
事務用電子機器	0.08
レジャー用品	0.06
水道	0.04
ヘルスケア・テクノロジー	0.03
不動産投資信託	0.02
株式 計	96.27
投資信託受益証券	0.29
投資証券	1.10
合計	97.65

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成22年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	63回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	7,500,000,000	102.17	7,662,600,000	102.09	7,656,375,000	1.20	2012/ 3/20	1.79
2	81回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	7,500,000,000	101.59	7,618,950,000	101.58	7,618,800,000	0.80	2014/ 3/20	1.78
3	85回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	7,400,000,000	101.01	7,474,666,000	101.01	7,474,592,000	0.70	2014/ 9/20	1.75
4	303回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	7,100,000,000	101.11	7,178,810,000	100.97	7,168,941,000	1.40	2019/ 9/20	1.68
5	83回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	6,500,000,000	101.98	6,628,570,000	101.95	6,626,750,000	0.90	2014/ 6/20	1.55
6	66回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	6,400,000,000	102.30	6,547,358,000	102.27	6,545,152,000	1.10	2012/ 9/20	1.53
7	301回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	6,400,000,000	102.30	6,547,392,000	102.15	6,537,728,000	1.50	2019/ 6/20	1.53
8	61回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	6,300,000,000	101.93	6,421,653,000	101.84	6,416,046,000	1.20	2011/ 12/20	1.50
9	60回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	6,300,000,000	101.69	6,406,659,000	101.59	6,400,296,000	1.20	2011/ 9/20	1.50
10	64回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	6,200,000,000	103.07	6,390,216,000	102.98	6,384,822,000	1.50	2012/ 6/20	1.49
11	285回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	5,900,000,000	105.85	6,245,386,000	105.66	6,234,176,000	1.70	2017/ 3/20	1.46
12	299回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	6,100,000,000	100.90	6,154,961,000	100.77	6,146,909,000	1.30	2019/ 3/20	1.44
13	72回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,600,000,000	103.96	5,821,816,000	103.93	5,820,192,000	1.50	2013/ 6/20	1.36
14	293回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	105.87	5,822,795,000	105.60	5,807,890,000	1.80	2018/ 6/20	1.36
15	75回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	102.71	5,649,050,000	102.70	5,648,445,000	1.10	2013/ 9/20	1.32
16	286回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	5,200,000,000	106.41	5,533,372,000	106.25	5,524,948,000	1.80	2017/ 6/20	1.29

17	297回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	5,200,000,000	102.09	5,308,524,000	101.90	5,298,852,000	1.40	2018/12/20	1.24
18	296回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	5,000,000,000	103.24	5,161,775,000	102.98	5,149,050,000	1.50	2018/9/20	1.20
19	70回利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	5,000,000,000	101.64	5,082,051,000	101.68	5,084,100,000	0.80	2013/3/20	1.19
20	57回利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	5,000,000,000	101.70	5,084,900,000	101.57	5,078,250,000	1.40	2011/6/20	1.19
21	288回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,800,000,000	105.57	5,067,264,000	105.35	5,056,560,000	1.70	2017/9/20	1.18
22	87回利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	5,000,000,000	100.01	5,000,300,000	99.98	4,998,800,000	0.50	2014/12/20	1.17
23	305回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,500,000,000	99.95	4,497,935,000	99.74	4,488,345,000	1.30	2019/12/20	1.05
24	266回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,300,000,000	104.25	4,482,707,000	104.18	4,479,697,000	1.40	2014/12/20	1.05
25	289回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,300,000,000	103.94	4,469,205,000	103.70	4,458,971,000	1.50	2017/12/20	1.04
26	284回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,200,000,000	105.94	4,449,312,000	105.74	4,441,248,000	1.70	2016/12/20	1.04
27	290回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,200,000,000	102.95	4,323,984,000	102.76	4,316,046,000	1.40	2018/3/20	1.01
28	78回利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	4,000,000,000	102.00	4,080,160,000	102.00	4,080,160,000	0.90	2013/12/20	0.95
29	69回利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	3,800,000,000	101.86	3,870,604,000	101.90	3,872,086,000	0.90	2012/12/20	0.90
30	280回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	3,300,000,000	107.28	3,540,174,000	107.13	3,535,125,000	1.90	2016/6/20	0.83

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

## 種類別業種別投資比率

平成22年3月25日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	75.03
地方債証券	6.51
特殊債券	9.54
社債券	8.07
合計	99.15

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成22年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債 証券	米国	4,040,960,000	107.17	4,330,737,242	106.71	4,312,108,416	4.00	2012/ 11/15	1.03
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,673,600,000	108.72	3,993,864,448	108.19	3,974,357,632	4.25	2013/ 11/15	0.95
3	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,673,600,000	107.86	3,962,308,224	107.32	3,942,507,520	4.00	2014/ 2/15	0.94
4	US T N/B 4.875 04/30/11	国債 証券	米国	3,673,600,000	105.19	3,864,149,632	104.79	3,849,638,912	4.88	2011/ 4/30	0.92
5	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	3,214,400,000	110.77	3,560,430,160	110.25	3,543,876,000	4.75	2014/ 5/15	0.84
6	US T N/B 5.0 08/15/11	国債 証券	米国	3,306,240,000	106.51	3,521,377,037	105.96	3,503,291,904	5.00	2011/ 8/15	0.83
7	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	3,214,400,000	108.59	3,490,356,240	108.04	3,472,805,616	4.25	2013/ 8/15	0.83
8	US T N/B 4.375 08/15/12	国債 証券	米国	3,214,400,000	107.88	3,467,759,008	107.39	3,451,944,160	4.38	2012/ 8/15	0.82
9	US T N/B 1.125 06/30/11	国債 証券	米国	3,214,400,000	100.77	3,238,990,160	100.59	3,233,461,392	1.13	2011/ 6/30	0.77

10	US T N/B 1.0 09/30/11	国債 証券	米国	3,214,400,000	100.43	3,228,189,776	100.29	3,223,561,040	1.00	2011/ 9/30	0.77
11	US T N/B 1.125 12/15/12	国債 証券	米国	3,214,400,000	99.22	3,189,263,392	98.89	3,178,720,160	1.13	2012/ 12/15	0.76
12	US T N/B 4.5 03/31/12	国債 証券	米国	2,938,880,000	107.30	3,153,535,795	106.86	3,140,457,779	4.50	2012/ 3/31	0.75
13	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,938,880,000	107.06	3,146,423,706	106.58	3,132,199,526	3.88	2013/ 2/15	0.75
14	US T N/B 1.375 09/15/12	国債 証券	米国	3,030,720,000	100.24	3,038,054,342	99.98	3,030,235,085	1.38	2012/ 9/15	0.72
15	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,755,200,000	108.66	2,993,910,528	108.19	2,980,768,224	4.25	2014/ 11/15	0.71
16	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,663,360,000	106.41	2,833,974,842	105.94	2,821,483,683	3.63	2013/ 5/15	0.67
17	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,755,200,000	101.81	2,805,014,016	101.32	2,791,568,640	2.63	2014/ 6/30	0.66
18	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,571,520,000	108.88	2,799,922,406	108.30	2,785,059,021	4.25	2014/ 8/15	0.66
19	US T N/B 0.875 03/31/11	国債 証券	米国	2,755,200,000	100.46	2,767,873,920	100.46	2,767,873,920	0.88	2011/ 3/31	0.66
20	US T N/B 4.5 11/30/11	国債 証券	米国	2,571,520,000	106.48	2,738,257,357	106.11	2,728,717,018	4.50	2011/ 11/30	0.65
21	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,571,520,000	100.30	2,579,234,560	99.88	2,568,382,746	2.38	2014/ 9/30	0.61
22	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	2,326,930,000	108.87	2,533,212,345	109.51	2,548,221,043	4.25	2014/ 7/4	0.61
23	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債 証券	ドイツ	2,326,930,000	106.81	2,485,372,868	107.50	2,501,449,750	3.75	2015/ 1/4	0.60
24	US T N/B 1.125 01/15/12	国債 証券	米国	2,479,680,000	100.40	2,489,648,314	100.23	2,485,383,264	1.13	2012/ 1/15	0.59
25	US T N/B 4.875 02/15/12	国債 証券	米国	2,296,000,000	107.77	2,474,468,080	107.25	2,462,460,000	4.88	2012/ 2/15	0.59
26	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	国債 証券	フランス	2,204,460,000	108.66	2,395,366,236	108.74	2,397,129,804	4.75	2012/ 10/25	0.57
27	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	国債 証券	ドイツ	2,204,460,000	108.36	2,388,752,856	108.68	2,395,696,905	4.50	2013/ 1/4	0.57
28	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債 証券	ドイツ	2,204,460,000	106.62	2,350,395,252	107.00	2,358,661,977	3.75	2013/ 7/4	0.56
29	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	国債 証券	イタリア	2,204,460,000	106.62	2,350,373,207	106.71	2,352,423,355	5.00	2012/ 2/1	0.56

30	US T N/B 1.875 06/15/12	国債 証券	米国	2,296,000,000	101.71	2,335,192,720	101.39	2,328,006,240	1.88	2012/ 6/15	0.55
----	-------------------------------	----------	----	---------------	--------	---------------	--------	---------------	------	---------------	------

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

#### 種類別業種別投資比率

平成22年3月25日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.60
合計	97.60

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（平成22年3月25日）、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 D C バランス30インデックスファンド

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成20年2月25日現在）	2,675	2,675	0.9710	0.9710
第2期末（平成21年2月25日現在）	2,141	2,141	0.8095	0.8095
第3期末（平成22年2月25日現在）	2,414	2,414	0.8824	0.8824
平成21年3月末	2,202		0.8246	
4月末	2,271		0.8474	
5月末	2,319		0.8651	
6月末	2,380		0.8788	
7月末	2,418		0.8885	
8月末	2,440		0.8956	
9月末	2,413		0.8870	
10月末	2,413		0.8866	
11月末	2,372		0.8723	
12月末	2,429		0.8962	
平成22年1月末	2,420		0.8835	
2月末	2,409		0.8807	
3月25日	2,469		0.9022	

## D I A M D C バランス50インデックスファンド

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成20年2月25日現在）	4,722	4,722	0.9331	0.9331
第2期末（平成21年2月25日現在）	3,473	3,473	0.6847	0.6847
第3期末（平成22年2月25日現在）	4,138	4,138	0.7770	0.7770
平成21年3月末	3,618		0.7041	
4月末	3,808		0.7362	
5月末	3,952		0.7616	
6月末	4,073		0.7768	
7月末	4,175		0.7906	
8月末	4,236		0.7983	
9月末	4,166		0.7845	
10月末	4,152		0.7840	
11月末	4,014		0.7611	
12月末	4,191		0.7944	
平成22年1月末	4,155		0.7790	
2月末	4,128		0.7751	
3月25日	4,313		0.8054	

## D I A M D C バランス70インデックスファンド

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成20年2月25日現在）	2,611	2,611	0.8961	0.8961
第2期末（平成21年2月25日現在）	1,747	1,747	0.5753	0.5753
第3期末（平成22年2月25日現在）	2,234	2,234	0.6792	0.6792
平成21年3月末	1,848		0.5977	
4月末	1,986		0.6354	
5月末	2,087		0.6658	
6月末	2,175		0.6819	
7月末	2,244		0.6989	
8月末	2,284		0.7069	
9月末	2,226		0.6891	
10月末	2,235		0.6888	
11月末	2,131		0.6593	
12月末	2,275		0.6994	
平成22年1月末	2,249		0.6818	
2月末	2,227		0.6771	
3月25日	2,363		0.7139	



## 【分配の推移】

## D I A M D C バランス30インデックスファンド

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-

## D I A M D C バランス50インデックスファンド

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-

## D I A M D C バランス70インデックスファンド

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-

## 【収益率の推移】

## D I A M D C バランス30インデックスファンド

	収益率（％）
第1期	2.90
第2期	16.63
第3期	9.01

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

## D I A M D C バランス50インデックスファンド

	収益率（％）
第1期	6.69
第2期	26.62
第3期	13.48

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

## D I A M D C バランス70インデックスファンド

	収益率（％）
第1期	10.39
第2期	35.80
第3期	18.06

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

## 6【手続等の概要】

### 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お申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
- ・ただし、海外休業日には、お申込みの受付を行いません。また委託会社は、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当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

#### お申込価額（発行価額）

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、ファンドの純資産総額（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。）

#### お申込単位

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本 1口 = 1円）

#### お申込手数料

ありません。

#### 払込期日

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

### 換金（解約）手続等

#### 解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

原則として販売会社の毎営業日の午後3時までには解約の請求が行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の受付

が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとし、

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとし、

#### 解約価額

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。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

#### 解約代金の受渡日

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。

## 7【管理及び運営の概要】

#### 資産の評価

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

なお、外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

#### 信託期間

信託期間は、平成18年12月27日から原則として無期限です。

ただし、下記 その他イ．償還規定により、信託を終了する場合があります。

#### 計算期間

計算期間は、原則として毎年2月26日から翌年2月25日（休業日の場合には翌営業日とします。）までとします。

#### その他

##### イ．償還規定

委託会社は、次のいずれかに該当する場合等には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了する場合があります。

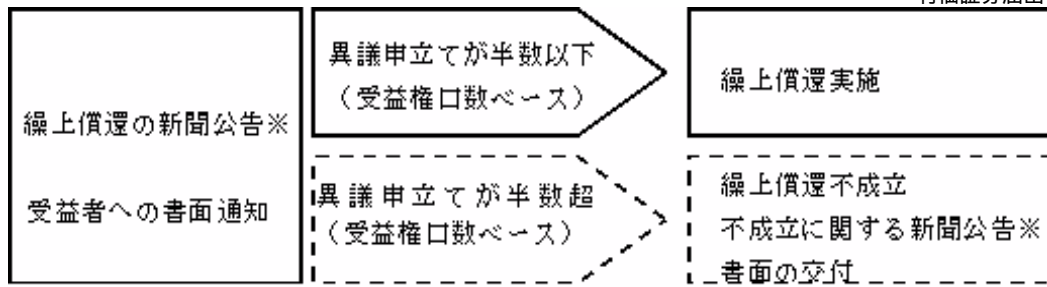
受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合。

受益者のために有利であると認めるとき。

やむを得ない事情が発生したとき。

この場合において、委託会社は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

委託会社は上記によって信託を終了させる場合等には、原則として以下の手続きにより行います。



受益者の異議申立て

期間は1ヵ月以上。

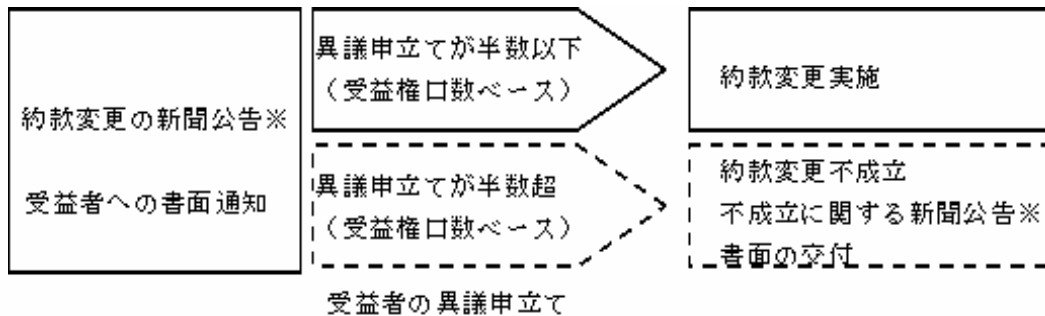
全受益者に書面を通知した場合は、新聞公告を行わない場合があります。

## ロ. 信託約款の変更

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け出ます。

なお、信託約款の変更を行った場合、運用報告書にてお知らせします。

委託会社は前述の変更事項のうち、その内容が重大なものに該当する場合は、以下の手続きにより行います。



全受益者に書面を通知した場合は、新聞公告を行わない場合があります。

## ハ. 運用報告書

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

## ニ. 保管

該当事項はありません。

## 第2【財務ハイライト情報】

- (1) 当財務ハイライト情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「1 財務諸表」（以下「財務諸表」という。）より抜粋しております。
- (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2期計算期間（平成20年2月26日から平成21年2月25日まで）及び第3期計算期間（平成21年2月26日から平成22年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。  
その監査報告書は、当該財務諸表に添付しております。

【D I A M D C バランス30インデックスファンド】  
1【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成21年2月25日現在	第3期 平成22年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	70,852,830	75,477,515
親投資信託受益証券	2,078,182,753	2,342,149,523
未収入金	5,100,000	-
流動資産合計	2,154,135,583	2,417,627,038
資産合計	2,154,135,583	2,417,627,038
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,426,946	121,569
未払受託者報酬	367,144	383,890
未払委託者報酬	2,570,376	2,687,509
その他未払費用	61,109	63,901
流動負債合計	12,425,575	3,256,869
負債合計	12,425,575	3,256,869
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,645,787,769	2,735,997,783
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* <sub>3</sub> 504,077,761	* <sub>3</sub> 321,627,614
（分配準備積立金）	57,177,256	98,661,641
元本等合計	2,141,710,008	2,414,370,169
純資産合計	2,141,710,008	2,414,370,169
負債純資産合計	2,154,135,583	2,417,627,038



## 2【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期	第3期
	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	317,338	60,391
有価証券売買等損益	439,017,217	201,016,770
営業収益合計	438,699,879	201,077,161
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	784,531	742,947
委託者報酬	5,492,380	5,201,218
その他費用	130,593	123,669
営業費用合計	6,407,504	6,067,834
営業利益又は営業損失（ ）	445,107,383	195,009,327
経常利益又は経常損失（ ）	445,107,383	195,009,327
当期純利益又は当期純損失（ ）	445,107,383	195,009,327
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（ ）	30,963,358	9,996,330
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	79,850,864	504,077,761
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,431,977	28,854,906
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,431,977	28,854,906
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,514,849	31,417,756
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,514,849	31,417,756
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	504,077,761	321,627,614

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
*1 期首元本額	2,755,316,499円	2,645,787,769円
期中追加設定元本額	229,578,698円	243,751,371円
期中解約元本額	339,107,428円	153,541,357円
*2 計算期間末日における受益権の総数	2,645,787,769口	2,735,997,783口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は504,077,761円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は321,627,614円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（43,430,838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（3,310,849円）及び分配準備積立金（13,746,418円）より分配対象収益は60,488,105円（1万口当たり228.62円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（44,638,097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（8,710,155円）及び分配準備積立金（54,023,544円）より分配対象収益は107,371,796円（1万口当たり392.44円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	---	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,078,182,753	436,716,062	2,342,149,523	177,580,964
合計	2,078,182,753	436,716,062	2,342,149,523	177,580,964

## （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 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8095円 (8,095円)

【D I A M D C バランス50インデックスファンド】  
1【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成21年2月25日現在	第3期 平成22年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	110,426,756	129,479,885
親投資信託受益証券	3,370,386,361	4,015,165,043
未収入金	-	1,500,000
流動資産合計	3,480,813,117	4,146,144,928
資産合計	3,480,813,117	4,146,144,928
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,012,167	1,370,925
未払受託者報酬	606,183	660,171
未払委託者報酬	4,849,779	5,281,656
その他未払費用	100,945	109,953
流動負債合計	7,569,074	7,422,705
負債合計	7,569,074	7,422,705
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,072,568,524	5,326,465,806
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* <sub>3</sub> 1,599,324,481	* <sub>3</sub> 1,187,743,583
（分配準備積立金）	106,996,673	184,870,082
元本等合計	3,473,244,043	4,138,722,223
純資産合計	3,473,244,043	4,138,722,223
負債純資産合計	3,480,813,117	4,146,144,928

## 2【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期	第3期
	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	551,229	102,878
有価証券売買等損益	1,259,096,724	486,044,682
営業収益合計	1,258,545,495	486,147,560
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,345,933	1,266,412
委託者報酬	10,768,117	10,131,942
その他費用	224,159	210,911
営業費用合計	12,338,209	11,609,265
営業利益又は営業損失( )	1,270,883,704	474,538,295
経常利益又は経常損失( )	1,270,883,704	474,538,295
当期純利益又は当期純損失( )	1,270,883,704	474,538,295
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( )	53,603,498	20,643,141
期首剰余金又は期首欠損金( )	338,573,196	1,599,324,481
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,558,461	75,295,025
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,558,461	75,295,025
剰余金減少額又は欠損金増加額	73,029,540	117,609,281
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	73,029,540	117,609,281
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,599,324,481	1,187,743,583

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
*1 期首元本額	5,061,246,701円	5,072,568,524円
期中追加設定元本額	439,067,605円	495,694,818円
期中解約元本額	427,745,782円	241,797,536円
*2 計算期間末日における受益権の総数	5,072,568,524口	5,326,465,806口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,599,324,481円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,187,743,583円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（85,944,551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（5,842,062円）及び分配準備積立金（21,052,122円）より分配対象収益は112,838,735円（1万口当たり222.44円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（82,682,303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（16,710,470円）及び分配準備積立金（102,187,779円）より分配対象収益は201,580,552円（1万口当たり378.45円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	--	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,370,386,361	1,253,855,262	4,015,165,043	450,314,177
合計	3,370,386,361	1,253,855,262	4,015,165,043	450,314,177

## （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 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6847円 (6,847円)

【D I A M D C バランス70インデックスファンド】  
1【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成21年2月25日現在	第3期 平成22年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	56,253,218	71,383,809
親投資信託受益証券	1,696,230,877	2,166,983,221
未収入金	400,000	-
流動資産合計	1,752,884,095	2,238,367,030
資産合計	1,752,884,095	2,238,367,030
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,228,934	109,536
未払受託者報酬	312,385	355,638
未払委託者報酬	2,811,903	3,201,120
その他未払費用	51,986	59,193
流動負債合計	5,405,208	3,725,487
負債合計	5,405,208	3,725,487
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,037,589,450	3,289,937,121
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* <sub>3</sub> 1,290,110,563	* <sub>3</sub> 1,055,295,578
（分配準備積立金）	66,188,347	110,205,037
元本等合計	1,747,478,887	2,234,641,543
純資産合計	1,747,478,887	2,234,641,543
負債純資産合計	1,752,884,095	2,238,367,030



## 2【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期	第3期
	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	299,636	54,958
有価証券売買等損益	949,817,684	328,218,344
営業収益合計	949,518,048	328,273,302
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	719,694	673,857
委託者報酬	6,478,080	6,065,434
その他費用	119,780	112,142
営業費用合計	7,317,554	6,851,433
営業利益又は営業損失( )	956,835,602	321,421,869
経常利益又は経常損失( )	956,835,602	321,421,869
当期純利益又は当期純損失( )	956,835,602	321,421,869
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( )	33,108,382	18,430,397
期首剰余金又は期首欠損金( )	302,630,882	1,290,110,563
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,647,209	79,830,634
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,647,209	79,830,634
剰余金減少額又は欠損金増加額	89,399,670	148,007,121
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	89,399,670	148,007,121
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,290,110,563	1,055,295,578

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
*1 期首元本額	2,914,025,924円	3,037,589,450円
期中追加設定元本額	362,375,624円	443,121,260円
期中解約元本額	238,812,098円	190,773,589円
*2 計算期間末日における受益権の総数	3,037,589,450口	3,289,937,121口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,290,110,563円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,055,295,578円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（52,424,781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（4,221,043円）及び分配準備積立金（13,763,566円）より分配対象収益は70,409,390円（1万口当たり231.79円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（47,842,668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（14,259,597円）及び分配準備積立金（62,362,369円）より分配対象収益は124,464,634円（1万口当たり378.32円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	---	---

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,696,230,877	946,573,079	2,166,983,221	307,711,810
合計	1,696,230,877	946,573,079	2,166,983,221	307,711,810

（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 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5753円 (5,753円)

### 第 3 【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益権の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者集会

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) 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。

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

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

(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、社振法の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け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第4【ファンドの詳細情報の項目】

### 第1 ファンドの沿革

### 第2 手続等

- 1 申込（販売）手続等
- 2 換金（解約）手続等

### 第3 管理及び運営

- 1 資産管理等の概要
  - (1) 資産の評価
  - (2) 保管
  - (3) 信託期間
  - (4) 計算期間
  - (5) その他
- 2 受益者の権利等

### 第4 ファンドの経理状況

- 1 財務諸表
  - (1) 貸借対照表
  - (2) 損益及び剰余金計算書
  - (3) 注記表
  - (4) 附属明細表
- 2 ファンドの現況

#### 純資産額計算書

資産総額

負債総額

純資産総額（ - ）

発行済数量

1単位当たり純資産額（ / ）

### 第5 設定及び解約の実績

## 第三部【ファンドの詳細情報】

### 第1【ファンドの沿革】

平成18年12月27日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

### 第2【手続等】

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

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

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

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

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

##### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、ファンドの純資産総額（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。）

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・お申込単位

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本 1口 = 1円）

・お申込手数料はかかりません。

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

## ・解約価額の照会方法等

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

### 第3【管理及び運営】

#### 1【資産管理等の概要】

##### (1)【資産の評価】

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

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

##### (2)【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

##### (3)【信託期間】

信託期間は平成18年12月27日から無期限ですが、下記(5)イ.の場合には、信託を終了する場合があります。

##### (4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとすることを原則とします。

b. 前記a.の規定にかかわらず、前記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

##### (5)【その他】

###### イ. 償還規定

a. 委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこ



の信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

- c. 委託会社は前記a. b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 前記a. b. につき、前記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 前c. ~ e. の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記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き継ぐことを命じたときは、後記「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、委託会社は後記「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. 前記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面にて付記します。

#### 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、前記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は前記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 前記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、前記a. ~ e. の規定にしたがいます。
- g. 前記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面にて付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは、「運用報告書」にてお知らせいたします。

#### ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として3ヵ月前までに、当事者間の別段の意志表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契

約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 二．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

### ホ．運用報告書

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

## 2【受益者の権利等】

### 収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に全額再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）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、解約の請求をすることができます。

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

### 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4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、第2期計算期間（平成20年2月26日から平成21年2月25日まで）については改正前の、第3期計算期間（平成21年2月26日から平成22年2月25日まで）については改正後の「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2期計算期間（平成20年2月26日から平成21年2月25日まで）及び第3期計算期間（平成21年2月26日から平成22年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【D I A M D C バランス30インデックスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成21年2月25日現在	第3期 平成22年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	70,852,830	75,477,515
親投資信託受益証券	2,078,182,753	2,342,149,523
未収入金	5,100,000	-
流動資産合計	2,154,135,583	2,417,627,038
<b>資産合計</b>		
	2,154,135,583	2,417,627,038
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,426,946	121,569
未払受託者報酬	367,144	383,890
未払委託者報酬	2,570,376	2,687,509
その他未払費用	61,109	63,901
流動負債合計	12,425,575	3,256,869
<b>負債合計</b>		
	12,425,575	3,256,869
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,645,787,769	2,735,997,783
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	* <sub>3</sub> 504,077,761	* <sub>3</sub> 321,627,614
(分配準備積立金)	57,177,256	98,661,641
元本等合計	2,141,710,008	2,414,370,169
<b>純資産合計</b>		
	2,141,710,008	2,414,370,169
<b>負債純資産合計</b>		
	2,154,135,583	2,417,627,038

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 2 期	第 3 期
	自 平成20年 2 月26日 至 平成21年 2 月25日	自 平成21年 2 月26日 至 平成22年 2 月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	317,338	60,391
有価証券売買等損益	439,017,217	201,016,770
営業収益合計	438,699,879	201,077,161
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	784,531	742,947
委託者報酬	5,492,380	5,201,218
その他費用	130,593	123,669
営業費用合計	6,407,504	6,067,834
営業利益又は営業損失（ ）	445,107,383	195,009,327
経常利益又は経常損失（ ）	445,107,383	195,009,327
当期純利益又は当期純損失（ ）	445,107,383	195,009,327
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（ ）	30,963,358	9,996,330
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	79,850,864	504,077,761
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,431,977	28,854,906
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,431,977	28,854,906
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,514,849	31,417,756
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,514,849	31,417,756
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	504,077,761	321,627,614

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
*1 期首元本額	2,755,316,499円	2,645,787,769円
期中追加設定元本額	229,578,698円	243,751,371円
期中解約元本額	339,107,428円	153,541,357円
*2 計算期間末日における受益権の総数	2,645,787,769口	2,735,997,783口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は504,077,761円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は321,627,614円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（43,430,838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（3,310,849円）及び分配準備積立金（13,746,418円）より分配対象収益は60,488,105円（1万口当たり228.62円）であります。なお、分配を行っておりませんが、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（44,638,097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（8,710,155円）及び分配準備積立金（54,023,544円）より分配対象収益は107,371,796円（1万口当たり392.44円）であります。なお、分配を行っておりませんが、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	--	---

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,078,182,753	436,716,062	2,342,149,523	177,580,964
合計	2,078,182,753	436,716,062	2,342,149,523	177,580,964

## （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 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8095円 (8,095円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	418,128,815	476,541,410	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,157,999,209	1,267,777,534	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	198,061,463	242,447,036	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	292,448,604	355,383,543	
合計		2,066,638,091	2,342,149,523	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



【D I A M D C バランス50インデックスファンド】  
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 平成21年2月25日現在	第3期 平成22年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	110,426,756	129,479,885
親投資信託受益証券	3,370,386,361	4,015,165,043
未収入金	-	1,500,000
流動資産合計	3,480,813,117	4,146,144,928
資産合計	3,480,813,117	4,146,144,928
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,012,167	1,370,925
未払受託者報酬	606,183	660,171
未払委託者報酬	4,849,779	5,281,656
その他未払費用	100,945	109,953
流動負債合計	7,569,074	7,422,705
負債合計	7,569,074	7,422,705
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,072,568,524	5,326,465,806
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	*3 1,599,324,481	*3 1,187,743,583
（分配準備積立金）	106,996,673	184,870,082
元本等合計	3,473,244,043	4,138,722,223
純資産合計	3,473,244,043	4,138,722,223
負債純資産合計	3,480,813,117	4,146,144,928

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 2 期	第 3 期
	自 平成20年 2月26日 至 平成21年 2月25日	自 平成21年 2月26日 至 平成22年 2月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	551,229	102,878
有価証券売買等損益	1,259,096,724	486,044,682
営業収益合計	1,258,545,495	486,147,560
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,345,933	1,266,412
委託者報酬	10,768,117	10,131,942
その他費用	224,159	210,911
営業費用合計	12,338,209	11,609,265
営業利益又は営業損失（ ）	1,270,883,704	474,538,295
経常利益又は経常損失（ ）	1,270,883,704	474,538,295
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,270,883,704	474,538,295
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（ ）	53,603,498	20,643,141
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	338,573,196	1,599,324,481
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,558,461	75,295,025
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,558,461	75,295,025
剰余金減少額又は欠損金増加額	73,029,540	117,609,281
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	73,029,540	117,609,281
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,599,324,481	1,187,743,583

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
*1 期首元本額	5,061,246,701円	5,072,568,524円
期中追加設定元本額	439,067,605円	495,694,818円
期中解約元本額	427,745,782円	241,797,536円
*2 計算期間末日における受益権の総数	5,072,568,524口	5,326,465,806口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,599,324,481円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,187,743,583円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（85,944,551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（5,842,062円）及び分配準備積立金（21,052,122円）より分配対象収益は112,838,735円（1万口当たり222.44円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（82,682,303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（16,710,470円）及び分配準備積立金（102,187,779円）より分配対象収益は201,580,552円（1万口当たり378.45円）ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	--	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,370,386,361	1,253,855,262	4,015,165,043	450,314,177
合計	3,370,386,361	1,253,855,262	4,015,165,043	450,314,177

## （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 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6847円 (6,847円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,260,397,262	1,436,474,759	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,151,600,710	1,260,772,457	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	507,589,655	621,340,496	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	573,220,319	696,577,331	
合計		3,492,807,946	4,015,165,043	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【D I A M D C バランス70インデックスファンド】  
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 平成21年2月25日現在	第3期 平成22年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	56,253,218	71,383,809
親投資信託受益証券	1,696,230,877	2,166,983,221
未収入金	400,000	-
流動資産合計	1,752,884,095	2,238,367,030
資産合計	1,752,884,095	2,238,367,030
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,228,934	109,536
未払受託者報酬	312,385	355,638
未払委託者報酬	2,811,903	3,201,120
その他未払費用	51,986	59,193
流動負債合計	5,405,208	3,725,487
負債合計	5,405,208	3,725,487
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,037,589,450	3,289,937,121
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	*3 1,290,110,563	*3 1,055,295,578
（分配準備積立金）	66,188,347	110,205,037
元本等合計	1,747,478,887	2,234,641,543
純資産合計	1,747,478,887	2,234,641,543
負債純資産合計	1,752,884,095	2,238,367,030

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 2 期	第 3 期
	自 平成20年 2月26日 至 平成21年 2月25日	自 平成21年 2月26日 至 平成22年 2月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	299,636	54,958
有価証券売買等損益	949,817,684	328,218,344
営業収益合計	949,518,048	328,273,302
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	719,694	673,857
委託者報酬	6,478,080	6,065,434
その他費用	119,780	112,142
営業費用合計	7,317,554	6,851,433
営業利益又は営業損失（ ）	956,835,602	321,421,869
経常利益又は経常損失（ ）	956,835,602	321,421,869
当期純利益又は当期純損失（ ）	956,835,602	321,421,869
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（ ）	33,108,382	18,430,397
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	302,630,882	1,290,110,563
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,647,209	79,830,634
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,647,209	79,830,634
剰余金減少額又は欠損金増加額	89,399,670	148,007,121
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	89,399,670	148,007,121
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,290,110,563	1,055,295,578

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
*1 期首元本額	2,914,025,924円	3,037,589,450円
期中追加設定元本額	362,375,624円	443,121,260円
期中解約元本額	238,812,098円	190,773,589円
*2 計算期間末日における受益権の総数	3,037,589,450口	3,289,937,121口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,290,110,563円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,055,295,578円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
*1 分配金の計算過程		



	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（52,424,781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（4,221,043円）及び分配準備積立金（13,763,566円）より分配対象収益は70,409,390円（1万口当たり231.79円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（47,842,668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（14,259,597円）及び分配準備積立金（62,362,369円）より分配対象収益は124,464,634円（1万口当たり378.32円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	--	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		第 3 期 自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,696,230,877	946,573,079	2,166,983,221	307,711,810
合計	1,696,230,877	946,573,079	2,166,983,221	307,711,810

（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 2 期 平成21年2月25日現在	第 3 期 平成22年2月25日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5753円 (5,753円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	976,532,444	1,112,954,026	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	143,751,648	157,379,304	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	367,497,733	449,853,974	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	367,672,743	446,795,917	
合計		1,855,454,568	2,166,983,221	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

D I A M D C バランス30インデックスファンド、D I A M D C バランス50インデックスファンド、D I A M D C バランス70インデックスファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記番号	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,592,425,553	1,876,621,924
株式		146,351,970,385	264,115,174,600
派生商品評価勘定		25,619,215	6,940,865
未収入金		39,656	-
未収配当金		224,683,150	307,816,364
前払金		96,619,193	19,227,814
差入委託証拠金		406,825,807	69,605,186
流動資産合計		149,698,182,959	266,395,386,753
資産合計		149,698,182,959	266,395,386,753
負債の部			
流動負債			

派生商品評価勘定		69,942,328	31,096,326
未払解約金		2,157,000	162,725,000
流動負債合計		72,099,328	193,821,326
負債合計		72,099,328	193,821,326
純資産の部			
元本等			
元本		159,884,634,622	233,574,423,007
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	10,258,550,991	32,627,142,420
元本等合計		149,626,083,631	266,201,565,427
純資産合計		149,626,083,631	266,201,565,427
負債純資産合計		149,698,182,959	266,395,386,753

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
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）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式及び新株予約権証券 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。	先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年2月10日から平成22年2月8日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月9日から平成23年2月7日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	96,925,434,312円	159,884,634,622円
同期中追加設定元本額	79,926,058,428円	121,665,042,924円
同期中解約元本額	16,966,858,118円	47,975,254,539円
同期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,023,296,735円	1,267,533,687円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,003,714円	749,811,436円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	23,286,506,142円	27,785,350,686円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	629,112,053円	642,998,905円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,250,053,947円	2,476,148,985円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,305,267,267円	2,661,398,182円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	428,968,268円	418,128,815円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,202,087,156円	1,260,397,262円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	865,529,162円	976,532,444円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	138,084,517円	163,416,214円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	893,422,568円	1,278,998,146円
D I A Mワールドバランス25 V A（適格機関投資家限定）	- 円	273,845,181円
D I A Mグローバル・バランスファンド25 V A（適格機関投資家限定）	12,921,770,343円	11,610,765,719円
D I A Mグローバル・バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	1,960,370,710円	1,869,361,848円
D I A M国際分散バランスファンド30 V A（適格機関投資家限定）	232,547,839円	219,843,217円
D I A M国際分散バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	825,131,793円	807,812,105円
D I A M国内重視バランスファンド30 V A（適格機関投資家限定）	258,718,553円	227,441,435円
D I A M国内重視バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	331,792,349円	303,242,611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 )	22,073,160,231円	20,794,111,285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 )	7,072,364,564円	6,791,172,198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 )	6,084,603,221円	5,498,244,510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 )	3,931,888,630円	3,755,150,130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 )	9,153,461,263円	8,733,276,034円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A ( 適格機関投資 家限定 )	1,333,947,054円	1,253,721,860円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2 ( 適格機関投 資家限定 )	2,898,287,315円	2,681,101,035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 )	2,589,798,284円	2,790,469,753円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A ( 適格機関投資家 向け )	14,648,830,272円	14,545,694,295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 )	250,442,913円	243,609,429円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド ( 適格機関投資家向け )	564,187,884円	541,675,984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 )	5,023,768,241円	4,808,055,363円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A ( 適格機 関投資家限定 )	10,610,398,708円	9,344,521,039円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A ( 適格機関投資家限定 )	528,031,855円	452,944,061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 )	21,129,551,193円	41,335,843,161円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	2,438,249,878円	2,903,591,558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 )	- 円	5,078,768,426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 )	- 円	25,288,084,193円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	- 円	282,165,442円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	- 円	91,029円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	- 円	140,254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)	- 円	21,303,265,635円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	- 円	42,891,050円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	- 円	37,771,600円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	- 円	74,822,249円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	- 円	86,022円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	- 円	128,534円
(合 計)	159,884,634,622円	233,574,423,007円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	159,884,634,622口	233,574,423,007口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 10,258,550,991円であります。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	146,351,970,385	6,427,555,873	264,115,174,600	2,474,642,237
合計	146,351,970,385	6,427,555,873	264,115,174,600	2,474,642,237

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

区分	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	株価の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成21年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	3,624,555,000	-	3,580,800,000	44,323,113
合計		3,624,555,000	-	3,580,800,000	44,323,113

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

(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。

(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21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
1口当たり純資産額	0.9358円	1.1397円
(1万口当たり純資産額)	(9,358円)	(11,397円)



[次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株 式

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	110,000	194	21,340,000	
日本水産	269,200	258	69,453,600	
マルハニチロホールディングス	532,000	124	65,968,000	
ハウスイ	22,000	108	2,376,000	
サカタのタネ	37,800	1,195	45,171,000	
ホクト	27,300	1,882	51,378,600	
ショーボンドHD	24,100	1,699	40,945,900	
住石ホールディングス	70,700	86	6,080,200	
日鉄鉱業	68,000	380	25,840,000	
三井松島	144,000	164	23,616,000	
国際石油開発帝石	1,222	645,000	788,190,000	
日本海洋掘削	4,000	4,955	19,820,000	
関東天然瓦斯	28,000	461	12,908,000	
石油資源開発	42,200	4,190	176,818,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	114,200	2,512,400	
間組	106,000	79	8,374,000	
東急建設	87,350	248	21,662,800	
コムシスホールディングス	108,700	846	91,960,200	
ミサワホーム	31,500	304	9,576,000	
高松コンストラクショングP	20,300	1,098	22,289,400	
東建コーポレーション	9,010	2,015	18,155,150	
ヤマウラ	8,500	203	1,725,500	
大成建設	1,131,000	185	209,235,000	
大 林 組	694,000	344	238,736,000	
清水建設	701,000	346	242,546,000	
飛鳥建設	750,500	25	18,762,500	
長谷工コーポレーション	1,455,500	87	126,628,500	
松井建設	2,000	349	698,000	
鹿島建設	1,095,000	211	231,045,000	
不動テトラ	181,500	56	10,164,000	
大末建設	96,000	33	3,168,000	
鉄建建設	154,000	72	11,088,000	
安藤建設	86,000	115	9,890,000	

太平工業	35,000	415	14,525,000	
西松建設	329,000	108	35,532,000	
三井住友建設	144,700	75	10,852,500	
大豊建設	71,000	71	5,041,000	
前田建設	179,000	279	49,941,000	
佐田建設	97,000	33	3,201,000	
ナカノフドー建設	21,000	183	3,843,000	
奥村組	238,000	321	76,398,000	
大和小田急建設	13,500	260	3,510,000	
東鉄工業	32,000	489	15,648,000	
イチケン	34,000	118	4,012,000	
浅沼組	78,000	62	4,836,000	
戸田建設	287,000	317	90,979,000	
熊谷組	201,000	58	11,658,000	
青木あすなろ建設	18,000	451	8,118,000	
北野建設	62,000	204	12,648,000	
植木組	30,000	120	3,600,000	
三井ホーム	30,000	470	14,100,000	
矢作建設	34,000	514	17,476,000	
ピーエス三菱	18,800	317	5,959,600	
大東建託	107,100	4,290	459,459,000	
新日本建設	33,300	152	5,061,600	
N I P P O	54,000	700	37,800,000	
東亜道路	49,000	178	8,722,000	
前田道路	71,000	757	53,747,000	
日本道路	74,000	209	15,466,000	
東亜建設	221,000	96	21,216,000	
若築建設	145,000	45	6,525,000	
東洋建設	342,000	46	15,732,000	
五洋建設	276,000	106	29,256,000	
大林道路	35,000	200	7,000,000	
世紀東急	80,000	54	4,320,000	
福田組	39,000	161	6,279,000	
東北ミサワホーム	13,400	190	2,546,000	
住友林業	184,200	693	127,650,600	
日本基礎技術	36,000	190	6,840,000	
日成ビルド工業	79,000	55	4,345,000	
エス・バイ・エル	127,000	46	5,842,000	

巴コーポレーション	38,200	228	8,709,600
パナホーム	88,000	603	53,064,000
大和ハウス	622,000	943	586,546,000
ライト工業	60,300	223	13,446,900
積水ハウス	752,000	862	648,224,000
日特建設	54,000	44	2,376,000
北陸電気工事	2,000	253	506,000
コミュニチュア	17,000	511	8,687,000
ユアテック	44,000	410	18,040,000
西部電気工業	1,000	344	344,000
四電工	2,000	439	878,000
中電工	34,500	1,124	38,778,000
関電工	108,000	557	60,156,000
大明	31,200	663	20,685,600
きんでん	159,000	766	121,794,000
東京エネシス	31,000	577	17,887,000
トーエネック	39,000	470	18,330,000
住友電設	20,500	437	8,958,500
日本電設工業	49,000	718	35,182,000
協和エクシオ	88,100	754	66,427,400
新日本空調	20,100	562	11,296,200
日本工営	84,000	259	21,756,000
東電通	46,000	152	6,992,000
日本電話施設	44,000	286	12,584,000
九電工	51,000	518	26,418,000
三機工業	56,000	611	34,216,000
日揮	249,000	1,660	413,340,000
中外炉工業	86,000	238	20,468,000
ヤマト	16,000	301	4,816,000
太平電業	32,000	798	25,536,000
高砂熱学	70,900	672	47,644,800
三晃金属	30,000	208	6,240,000
NEC ネットエスアイ	19,000	1,047	19,893,000
朝日工業社	8,000	365	2,920,000
アタカ大機	4,000	202	808,000
大気社	35,800	1,475	52,805,000
ダイダン	25,000	460	11,500,000
日比谷総合設	36,400	782	28,464,800

東芝プラントシステム	36,000	1,053	37,908,000	
日本製粉	156,000	460	71,760,000	
日清製粉G本社	242,500	1,167	282,997,500	
日東富士製粉	8,000	344	2,752,000	
昭和産業	113,000	284	32,092,000	
鳥越製粉	24,300	746	18,127,800	
協同飼料	96,000	112	10,752,000	
中部飼料	26,000	820	21,320,000	
日本配合飼料	77,000	102	7,854,000	
ユニ・チャーム ペットケア	15,300	2,879	44,048,700	
東洋精糖	43,000	119	5,117,000	
日本甜菜糖	139,000	239	33,221,000	
三井製糖	96,000	327	31,392,000	
日本M & A センター	44	313,500	13,794,000	
アコーディア・ゴルフ	621	93,900	58,311,900	
パソナグループ	214	61,800	13,225,200	
リンクアンドモチベーション	53	40,500	2,146,500	
テンプホールディングス	34,100	720	24,552,000	
森永製菓	267,000	206	55,002,000	
中村屋	64,000	464	29,696,000	
江崎グリコ	97,000	1,034	100,298,000	
名糖産業	12,400	1,245	15,438,000	
不二家	153,000	209	31,977,000	
山崎製パン	196,000	1,145	224,420,000	
第一屋製パン	37,000	116	4,292,000	
モロゾフ	46,000	294	13,524,000	
森永乳業	226,000	371	83,846,000	
ヤクルト	143,200	2,709	387,928,800	
明治ホールディングス	79,200	3,570	282,744,000	
雪印メグミルク	52,400	1,350	70,740,000	
プリマハム	135,000	95	12,825,000	
日本ハム	186,000	1,069	198,834,000	
伊藤ハム	166,000	336	55,776,000	
林兼産業	80,000	116	9,280,000	
丸大食品	109,000	263	28,667,000	
米久	21,500	765	16,447,500	
S Foods	15,500	777	12,043,500	
学情	8,300	271	2,249,300	

スタジオアリス	11,800	730	8,614,000
シミック	400	18,770	7,508,000
システムプロ	171	41,550	7,105,050
NECフィールドینگ	20,300	1,196	24,278,800
新日鉄ソリューションズ	19,600	1,397	27,381,200
総合警備保障	83,200	1,022	85,030,400
日本駐車場開発	2,613	3,925	10,256,025
コア	10,000	687	6,870,000
カカクコム	149	351,000	52,299,000
アイロムホールディングス	565	1,936	1,093,840
ルネサンス	11,000	318	3,498,000
セキュアードキャピタルJ	75	73,800	5,535,000
新日本科学	12,500	555	6,937,500
エムスリー	97	332,500	32,252,500
ディー・エヌ・エー	287	705,000	202,335,000
博報堂DYHLDGS	31,630	4,345	137,432,350
ぐるなび	131	180,200	23,606,200
一休	159	39,950	6,352,050
ジャパンベストレスキューS	46	62,400	2,870,400
ジェイコムホールディングス	24	89,900	2,157,600
パシフィックゴルフGRP	527	64,900	34,202,300
サッポロホールディングス	379,000	460	174,340,000
アサヒビール	465,500	1,708	795,074,000
麒麟HD	1,093,000	1,256	1,372,808,000
宝ホールディングス	210,000	487	102,270,000
オエノンホールディングス	71,000	171	12,141,000
メルシャン	83,000	177	14,691,000
養命酒	3,000	837	2,511,000
三国コカ・コ-ラ	33,400	698	23,313,200
コカ・コーラウエスト	65,900	1,453	95,752,700
コカコーラセントラルジャパン	30,800	1,091	33,602,800
ダイドードリンコ	11,200	2,979	33,364,800
伊藤園	67,700	1,360	92,072,000
キーコーヒー	22,400	1,570	35,168,000
ユニカフェ	6,400	552	3,532,800
ジャパンフーズ	4,200	817	3,431,400
日清オイリオグループ	103,000	448	46,144,000
不二製油	64,900	1,403	91,054,700

J - オイルミルズ	100,000	277	27,700,000	
ローソン	66,300	3,830	253,929,000	
インターニックス	7,100	321	2,279,100	
サンエー	8,000	3,210	25,680,000	
キリン堂	9,600	395	3,792,000	
ダイユーエイト	1,900	599	1,138,100	
カワチ薬品	14,500	1,717	24,896,500	
エービーシー・マート	24,700	2,917	72,049,900	
ハードオフコーポレーション	9,700	416	4,035,200	
高千穂交易	9,900	914	9,048,600	
アスクル	16,900	1,605	27,124,500	
ゲオ	390	93,600	36,504,000	
ポイント	21,160	5,370	113,629,200	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	5,000	119	595,000	
伊藤忠食品	6,000	2,972	17,832,000	
くらコーポレーション	61	275,100	16,781,100	
キャンドゥ	115	91,000	10,465,000	
エレマテック	16,100	998	16,067,800	
パル	5,950	1,891	11,251,450	
J A L U X	7,000	739	5,173,000	
エディオン	93,600	914	85,550,400	
サーラコーポレーション	24,000	541	12,984,000	
トーマンデバイス	3,100	1,707	5,291,700	
バルス	98	70,700	6,928,600	
あみやき亭	41	240,300	9,852,300	
双日	1,575,300	157	247,322,100	
アルフレッサホールディングス	57,500	3,550	204,125,000	
ハニーズ	20,500	666	13,653,000	
キッコーマン	203,000	1,055	214,165,000	
味の素	674,000	916	617,384,000	
キューピー	138,600	992	137,491,200	
ハウス食品	98,800	1,296	128,044,800	
カゴメ	96,200	1,591	153,054,200	
焼津水産化工	13,200	1,049	13,846,800	
アリアケジャパン	22,300	1,372	30,595,600	
ニチレイ	278,000	341	94,798,000	
横浜冷凍	52,000	613	31,876,000	
東洋水産	115,000	2,465	283,475,000	

日清食品HD	94,300	3,065	289,029,500	
永谷園	2,000	871	1,742,000	
フジッコ	27,000	1,044	28,188,000	
ロックフィールド	13,500	1,199	16,186,500	
日本たばこ産業	5,551	319,500	1,773,544,500	
わらべや日洋	13,700	1,081	14,809,700	
なとり	13,400	845	11,323,000	
片倉工業	28,800	811	23,356,800	
ゲンゼ	171,000	314	53,694,000	
昭栄	39,900	702	28,009,800	
神栄	22,000	124	2,728,000	
川島織物セルコン	91,000	65	5,915,000	
山下医科器械	400	1,109	443,600	
ラサ商事	8,600	335	2,881,000	
アルペン	17,900	1,385	24,791,500	
ビックカメラ	584	30,600	17,870,400	
DCM JAPAN HLDGS	117,800	511	60,195,800	
Monotaro	1,200	1,185	1,422,000	
あいホールディングス	49,800	280	13,944,000	
ユニバース	3,700	1,210	4,477,000	
J. フロントリテイリング	555,000	485	269,175,000	
ドトール・日レスHD	37,500	1,126	42,225,000	
マツモトキヨシHLDGS	39,600	1,954	77,378,400	
ココカラファインHD	17,600	1,485	26,136,000	
三越伊勢丹HD	408,700	936	382,543,200	
東洋紡績	835,000	133	111,055,000	
ユニチカ	531,000	69	36,639,000	
富士紡ホールディングス	112,000	146	16,352,000	
日清紡ホールディングス	163,000	868	141,484,000	
倉敷紡績	239,000	155	37,045,000	
ダイワボウHD	216,000	181	39,096,000	
シキボウ	152,000	128	19,456,000	
日東紡績	203,000	173	35,119,000	
トヨタ紡織	69,400	1,491	103,475,400	
クリエイトSDH	8,200	1,528	12,529,600	
バイタルKSKHD	31,400	537	16,861,800	
UKCホールディングス	13,000	1,170	15,210,000	
CHIグループ	11,500	365	4,197,500	



日本毛織	85,000	581	49,385,000
大東紡織	41,000	60	2,460,000
トーア紡コーポレーション	91,000	62	5,642,000
ダイドーリミテッド	31,500	675	21,262,500
東京建物不動産販	11,300	272	3,073,600
野村不動産HLDGS	112,500	1,302	146,475,000
ヒューリック	65,500	670	43,885,000
帝国繊維	23,000	447	10,281,000
ブックオフコーポレーション	10,000	909	9,090,000
日本コークス工業	201,500	112	22,568,000
ミタチ産業	3,800	430	1,634,000
JFE商事HLDGS	158,000	306	48,348,000
あさひ	9,800	1,409	13,808,200
サークルKサンクス	44,500	1,115	49,617,500
日本調剤	2,960	2,305	6,822,800
コスモス薬品	10,300	1,879	19,353,700
シップヘルスケアHD	276	49,550	13,675,800
セブン&アイ・HLDGS	939,100	1,971	1,850,966,100
ツルハホールディングス	17,500	3,405	59,587,500
サンマルクホールディングス	6,700	2,964	19,858,800
フェリシモ	6,000	1,169	7,014,000
トリドール	58	161,600	9,372,800
帝人	875,000	261	228,375,000
東レ	1,556,000	488	759,328,000
三菱レイヨン	578,000	377	217,906,000
クラレ	340,500	1,159	394,639,500
旭化成	1,350,000	467	630,450,000
サカイオーベックス	68,000	81	5,508,000
稲葉製作所	12,600	859	10,823,400
宮地エンジニアリングG	78,000	96	7,488,000
三協・立山HLDGS	288,000	116	33,408,000
トーカロ	12,900	1,718	22,162,200
アルファCO	8,400	806	6,770,400
SUMCO	133,500	1,613	215,335,500
川田テクノロジーズ	5,900	1,570	9,263,000
住江織物	62,000	159	9,858,000
日本フェルト	16,200	393	6,366,600
イチカワ	14,000	156	2,184,000

日本パイリ - ン	29,000	404	11,716,000	
エコナック	71,000	41	2,911,000	
日東製網	29,000	113	3,277,000	
芦森工業	62,000	116	7,192,000	
アツギ	232,000	112	25,984,000	
ダイニック	45,000	160	7,200,000	
共和レザー	16,400	310	5,084,000	
セーレン	57,500	558	32,085,000	
東海染工	36,000	73	2,628,000	
小松精練	41,000	339	13,899,000	
ワコールホールディングス	138,000	1,060	146,280,000	
ホギメディカル	11,000	4,485	49,335,000	
サンエー・インターナショナル	11,800	1,031	12,165,800	
レナウン	42,200	155	6,541,000	
クラウディア	2,700	1,123	3,032,100	
I Tホールディングス	70,000	993	69,510,000	
コーエーテクモHD	47,000	590	27,730,000	
特種東海H L D G S	159,000	222	35,298,000	
ドワンゴ	132	154,700	20,420,400	
ベリサーブ	14	186,800	2,615,200	
マクロミル	115	131,200	15,088,000	
ティーガイア	189	133,300	25,193,700	
GMOペイメントゲートウェイ	52	112,500	5,850,000	
ザッパラス	96	133,200	12,787,200	
インターネットイニシアティブ	137	176,800	24,221,600	
ソネットエンタテインメント	114	238,200	27,154,800	
S R Aホールディングス	11,300	803	9,073,900	
J B I Sホールディングス	25,800	290	7,482,000	
朝日ネット	20,000	281	5,620,000	
王子製紙	1,024,000	382	391,168,000	
三菱製紙	332,000	103	34,196,000	
北越紀州製紙	155,500	434	67,487,000	
中越パルプ	95,000	160	15,200,000	
巴川製紙	40,000	182	7,280,000	
大王製紙	105,000	713	74,865,000	
日本製紙G本社	103,300	2,280	235,524,000	
レンゴー	184,000	566	104,144,000	
トーモク	82,000	198	16,236,000	

ザ・パック	16,300	1,264	20,603,200	
コ - プケミカル	38,000	129	4,902,000	
昭和電工	1,552,000	181	280,912,000	
住友化学	1,593,000	399	635,607,000	
日本化成	48,000	170	8,160,000	
住友精化	48,000	344	16,512,000	
日産化学	155,000	1,203	186,465,000	
ラサ工業	95,000	90	8,550,000	
クレハ	148,000	416	61,568,000	
テイカ	40,000	235	9,400,000	
石原産業	418,000	71	29,678,000	
片倉チツカリン	13,000	265	3,445,000	
日本曹達	149,000	345	51,405,000	
東ソー	578,000	212	122,536,000	
トクヤマ	388,000	473	183,524,000	
セントラル硝子	239,000	398	95,122,000	
東亜合成	274,000	347	95,078,000	
ダイソー	101,000	218	22,018,000	
関東電化	55,000	654	35,970,000	
電気化学	487,000	359	174,833,000	
イビデン	156,300	3,010	470,463,000	
信越化学	383,800	4,790	1,838,402,000	
日本カ - バイド	56,000	149	8,344,000	
堺 化 学	86,000	399	34,314,000	
エア・ウォーター	187,000	1,041	194,667,000	
大陽日酸	328,000	822	269,616,000	
日本化学工業	93,000	198	18,414,000	
日本パ - カライジング	54,000	1,146	61,884,000	
高圧ガス	38,000	512	19,456,000	
チタン工業	30,000	181	5,430,000	
四国化成	36,000	476	17,136,000	
戸田工業	39,000	620	24,180,000	
ステラ ケミファ	11,900	3,780	44,982,000	
保土谷化学	57,000	315	17,955,000	
日本触媒	139,000	779	108,281,000	
大日精化	90,000	324	29,160,000	
カネカ	311,000	533	165,763,000	
協和発酵キリン	299,000	915	273,585,000	

三菱瓦斯化学	394,000	476	187,544,000	
三井化学	907,000	243	220,401,000	
J S R	227,200	1,751	397,827,200	
東京応化工業	41,400	1,575	65,205,000	
三菱ケミカルH L D G S	1,338,000	401	536,538,000	
日本合成化学	58,000	593	34,394,000	
ダイセル化学	297,000	580	172,260,000	
住友ベ - クライト	214,000	456	97,584,000	
積水化学	479,000	591	283,089,000	
日本ゼオン	215,000	466	100,190,000	
アイカ工業	62,600	930	58,218,000	
宇部興産	1,046,000	225	235,350,000	
積水樹脂	33,000	758	25,014,000	
タキロン	60,000	242	14,520,000	
旭有機材	83,000	205	17,015,000	
日立化成	107,900	1,837	198,212,300	
ニチバン	29,000	290	8,410,000	
リケンテクノス	46,000	254	11,684,000	
大倉工業	60,000	253	15,180,000	
積水化成成品	66,000	435	28,710,000	
群栄化学	70,000	200	14,000,000	
タイガース ポリマー	13,000	311	4,043,000	
日本カ - リット	20,500	406	8,323,000	
日本化薬	176,000	734	129,184,000	
イーピーエス	67	365,500	24,488,500	
パナソニック電工 I S	4,800	2,291	10,996,800	
フェイス	793	8,810	6,986,330	
アミューズ	6,800	949	6,453,200	
野村総合研究所	133,100	1,944	258,746,400	
ドリームインキュベータ	72	59,200	4,262,400	
サイバネットシステム	203	36,200	7,348,600	
T A C	13,500	354	4,779,000	
ケネディクス	1,161	26,260	30,487,860	
電通	226,500	2,150	486,975,000	
インテージ	7,100	1,570	11,147,000	
テイクアンドギヴニーズ	851	8,440	7,182,440	
ぴあ	8,700	1,228	10,683,600	
シンプレクス・テクノロジー	305	42,400	12,932,000	

イオンファンタジー	8,100	1,024	8,294,400	
ソースネクスト	31	21,880	678,280	
ネクシィーズ	1,028	2,728	2,804,384	
日本精化	21,100	693	14,622,300	
A D E K A	100,000	823	82,300,000	
日油	204,000	352	71,808,000	
ミヨシ油脂	92,000	143	13,156,000	
ハリマ化成	9,000	483	4,347,000	
花 王	639,700	2,248	1,438,045,600	

[次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
第一工業製薬	43,000	242	10,406,000	
三洋化成	70,000	537	37,590,000	
武田薬品	876,800	4,005	3,511,584,000	
アステラス製薬	493,200	3,340	1,647,288,000	
大日本住友製薬	177,100	875	154,962,500	
塩野義製薬	337,900	1,807	610,585,300	
田辺三菱製薬	208,000	1,313	273,104,000	
わかもと製薬	4,000	296	1,184,000	
あすか製薬	27,000	637	17,199,000	
日本新薬	57,000	1,001	57,057,000	
中外製薬	248,700	1,726	429,256,200	
科研製薬	106,000	787	83,422,000	
エーザイ	285,500	3,450	984,975,000	
ロート製薬	105,000	1,040	109,200,000	
小野薬品	116,300	4,085	475,085,500	
久光製薬	70,400	3,260	229,504,000	
有機合成薬品	17,000	228	3,876,000	
持田製薬	93,000	863	80,259,000	
大正製薬	200,000	1,538	307,600,000	
参天製薬	70,900	2,892	205,042,800	
エスエス製薬	53,000	704	37,312,000	
扶桑薬品	85,000	289	24,565,000	
日本ケミファ	38,000	255	9,690,000	
ツムラ	68,100	2,710	184,551,000	
テルモ	171,700	4,805	825,018,500	
みらかホールディングス	47,600	2,675	127,330,000	
キッセイ薬品工業	46,000	1,871	86,066,000	
生化学工業	43,600	955	41,638,000	
栄研化学	18,000	803	14,454,000	
日水製薬	9,900	688	6,811,200	
鳥居薬品	15,200	1,732	26,326,400	
東和薬品	11,500	4,785	55,027,500	
沢井製薬	15,100	6,150	92,865,000	
ゼリア新薬工業	36,000	944	33,984,000	
第一三共	734,900	1,788	1,314,001,200	

キョーリン	61,000	1,332	81,252,000
大日本塗料	147,000	88	12,936,000
日本ペイント	216,000	559	120,744,000
関西ペイント	283,000	717	202,911,000
トウベ	29,000	80	2,320,000
中国塗料	67,000	569	38,123,000
日本特殊塗料	20,900	337	7,043,300
藤倉化成	29,800	440	13,112,000
太陽インキ製造	18,500	2,305	42,642,500
D I C	764,000	184	140,576,000
サカタインクス	52,000	423	21,996,000
東洋インキ	225,000	380	85,500,000
アルプス技研	10,900	583	6,354,700
サニックス	32,500	150	4,875,000
ダイオーズ	1,400	474	663,600
日本空調サービス	7,000	725	5,075,000
オリエンタルランド	60,600	6,370	386,022,000
ダスキン	70,100	1,641	115,034,100
パーク24	131,800	934	123,101,200
明光ネットワークジャパン	21,500	562	12,083,000
ファルコバイオシステムズ	13,100	863	11,305,300
クレスコ	5,400	418	2,257,200
フジ・メディア・HD	2,449	121,300	297,063,700
秀英予備校	4,600	515	2,369,000
田谷	900	690	621,000
ラウンドワン	33,500	565	18,927,500
リゾートトラスト	34,600	1,243	43,007,800
オービック	7,360	15,890	116,950,400
ティーディーシーソフトウェア	300	729	218,700
ヤフー	12,898	32,950	424,989,100
ビー・エム・エル	13,100	2,308	30,234,800
ワタベウェディング	6,700	1,094	7,329,800
トレンドマイクロ	93,400	3,075	287,205,000
もしもしホットライン	15,600	1,803	28,126,800
東急コミュニティー	5,500	2,099	11,544,500
リソー教育	2,562	4,835	12,387,270
日本オラクル	37,700	4,080	153,816,000
アルファシステムズ	6,500	1,506	9,789,000

フューチャーアーキテクト	256	31,850	8,153,600	
ウェアハウス	6,700	327	2,190,900	
シーエーシー	14,900	609	9,074,100	
ソフトバンク・テクノ	6,000	708	4,248,000	
トーセ	4,100	620	2,542,000	
ユー・エス・エス	31,470	5,690	179,064,300	
オービックビジネスC	5,950	3,870	23,026,500	
日立ビジネスソリュー	8,000	654	5,232,000	
伊藤忠テクノソリュー	33,300	2,845	94,738,500	
アイティフォー	26,700	309	8,250,300	
東京個別指導学院	15,200	145	2,204,000	
東計電算	5,100	1,117	5,696,700	
カルチュア・コンビニエンス	85,700	457	39,164,900	
エクスネット	18	131,600	2,368,800	
テー・オー・ダブリュー	8,300	478	3,967,400	
大塚商会	18,700	5,370	100,419,000	
総合メディカル	5,200	1,984	10,316,800	
サイボウズ	310	34,400	10,664,000	
ソフトブレイン	329	5,190	1,707,510	
アグレックス	5,300	739	3,916,700	
セントラルスポーツ	7,600	870	6,612,000	
電通国際情報S	15,200	482	7,326,400	
ウェザーニューズ	5,300	1,090	5,777,000	
C I J	23,800	274	6,521,200	
フルキャストホールディングス	186	5,200	967,200	
富士フイルムHLDGS	495,200	2,827	1,399,930,400	
コニカミノルタHLDGS	511,500	912	466,488,000	
資生堂	424,800	1,930	819,864,000	
ライオン	288,000	442	127,296,000	
高砂香料	75,000	454	34,050,000	
マンダム	23,200	2,474	57,396,800	
ミルボン	11,300	2,049	23,153,700	
ファンケル	48,300	1,794	86,650,200	
コーセー	35,800	1,908	68,306,400	
ドクターシーラボ	166	194,500	32,287,000	
エステー	15,600	999	15,584,400	
コニシ	20,000	940	18,800,000	
長谷川香料	31,800	1,335	42,453,000	



小林製薬	34,700	3,605	125,093,500	
荒川化学工業	19,700	1,004	19,778,800	
メック	18,600	514	9,560,400	
日本高純度化学	66	293,400	19,364,400	
荏原ユーザライト	3,400	1,526	5,188,400	
アース製薬	18,000	2,650	47,700,000	
イハラケミカル	47,000	246	11,562,000	
北興化学	11,000	265	2,915,000	
大成ラミック	7,000	2,173	15,211,000	
クミアイ化学	51,000	273	13,923,000	
日本農薬	52,000	489	25,428,000	
新日本石油	1,409,000	467	658,003,000	
昭和シエル石油	223,600	620	138,632,000	
コスモ石油	626,000	208	130,208,000	
富士興産	84,000	67	5,628,000	
ニチレキ	34,000	362	12,308,000	
東燃ゼネラル石油	335,000	731	244,885,000	
ユシロ化学	12,600	1,063	13,393,800	
ビーピー・カストロール	13,800	316	4,360,800	
新日鉱ホールディングス	893,000	433	386,669,000	
AOCホールディングス	57,800	489	28,264,200	
出光興産	26,600	6,430	171,038,000	
横浜ゴム	254,000	384	97,536,000	
東洋ゴム	225,000	198	44,550,000	
ブリヂストン	722,200	1,515	1,094,133,000	
住友ゴム	175,100	709	124,145,900	
藤倉ゴム	17,100	316	5,403,600	
オカモト	96,000	353	33,888,000	
アキレス	190,000	144	27,360,000	
フコク	10,700	693	7,415,100	
ニッタ	22,400	1,267	28,380,800	
クリエートメディック	8,500	820	6,970,000	
東海ゴム工業	38,400	1,163	44,659,200	
三ツ星ベルト	65,000	385	25,025,000	
バンドー化学	89,000	263	23,407,000	
鬼怒川ゴム	50,000	284	14,200,000	
旭硝子	1,142,000	893	1,019,806,000	
日本板硝子	694,000	235	163,090,000	

石塚硝子	35,000	184	6,440,000
有沢製作所	33,500	624	20,904,000
日本山村硝子	101,000	292	29,492,000
日本電気硝子	405,000	1,130	457,650,000
オハラ	9,500	1,411	13,404,500
住友大阪セメント	412,000	147	60,564,000
太平洋セメント	915,000	117	107,055,000
デイ・シイ	27,500	191	5,252,500
リゾートソリューション	24,000	162	3,888,000
日本ヒユ - ム	21,000	265	5,565,000
日本コンクリ - ト	37,000	122	4,514,000
東海カーボン	234,000	470	109,980,000
日本カーボン	123,000	273	33,579,000
東洋炭素	12,300	4,620	56,826,000
ノリタケ	130,000	240	31,200,000
T O T O	358,000	578	206,924,000
日本碍子	275,000	1,960	539,000,000
日本特殊陶業	204,000	1,048	213,792,000
ダントーホールディングス	39,000	87	3,393,000
M A R U W A	6,700	2,093	14,023,100
品川リフラクトリーズ	64,000	217	13,888,000
黒崎播磨	55,000	230	12,650,000
東京窯業	13,000	190	2,470,000
ニッカトー	9,300	390	3,627,000
フジインコーポレーテッド	22,900	1,461	33,456,900
エーアンドエーマテリアル	55,000	65	3,575,000
ニチアス	121,000	388	46,948,000
新日本製鐵	6,549,000	329	2,154,621,000
住友金属工業	4,269,000	242	1,033,098,000
神戸製鋼所	3,228,000	159	513,252,000
日新製鋼	882,000	160	141,120,000
中山製鋼所	117,000	124	14,508,000
合同製鐵	126,000	186	23,436,000
J F Eホールディングス	500,200	3,255	1,628,151,000
東京製鐵	114,500	980	112,210,000
共英製鋼	23,200	1,631	37,839,200
大和工業	58,500	2,785	162,922,500
東京鐵鋼	49,000	276	13,524,000

大阪製鐵	15,800	1,353	21,377,400	
淀川製鋼所	178,000	369	65,682,000	
東洋鋼鋳	53,000	479	25,387,000	
住友鋼管	15,500	478	7,409,000	
丸一鋼管	69,500	1,740	120,930,000	
モリ工業	44,000	273	12,012,000	
大同特殊鋼	385,000	351	135,135,000	
日本高周波	103,000	86	8,858,000	
日本金属工業	171,000	133	22,743,000	
日本冶金工	137,000	265	36,305,000	
山陽特殊鋼	123,000	355	43,665,000	
愛知製鋼	133,000	366	48,678,000	
日立金属	135,000	861	116,235,000	
日本金属	65,000	146	9,490,000	
大平洋金属	174,000	646	112,404,000	
日本電工	106,000	544	57,664,000	
栗本鉄工所	131,000	87	11,397,000	
旭テック	128,000	22	2,816,000	
日本鑄鉄管	26,000	134	3,484,000	
日本製鋼所	357,000	1,019	363,783,000	
三菱製鋼	149,000	152	22,648,000	
日亜鋼業	36,000	208	7,488,000	
日本精線	20,000	238	4,760,000	
日本軽金属	568,000	98	55,664,000	
大紀アルミニウム	40,000	193	7,720,000	
三井金属	679,000	245	166,355,000	
東邦亜鉛	121,000	387	46,827,000	
三菱マテリアル	1,326,000	227	301,002,000	
住友鉱山	603,000	1,249	753,147,000	
DOWAホールディングス	271,000	501	135,771,000	
古河機金	423,000	97	41,031,000	
大阪チタニウム	24,500	2,825	69,212,500	
東邦チタニウム	40,400	1,558	62,943,200	
住友軽金属	354,000	79	27,966,000	
古河スカイ	101,000	188	18,988,000	
古河電工	732,000	435	318,420,000	
住友電工	764,200	1,077	823,043,400	
フジクラ	348,000	472	164,256,000	

三菱電線工業	163,000	73	11,899,000	
昭和電線HLDGS	301,000	82	24,682,000	
東京特殊電線	36,000	85	3,060,000	
タツタ電線	51,000	218	11,118,000	
日立電線	195,000	230	44,850,000	
沖電線	30,000	110	3,300,000	
カナレ電気	3,100	1,099	3,406,900	
平河ヒューテック	5,500	646	3,553,000	
リョービ	139,000	275	38,225,000	
アサヒHD	35,000	1,388	48,580,000	
東洋製罐	176,300	1,437	253,343,100	
ホッカンホールディングス	63,000	240	15,120,000	
コロナ	11,400	1,144	13,041,600	
横河ブリッジHLDGS	48,000	721	34,608,000	
日本橋梁	9,050	229	2,072,450	
駒井鉄工	39,000	195	7,605,000	
ハルテック	24,000	130	3,120,000	
サクラダ	199,000	25	4,975,000	
高田機工	22,000	156	3,432,000	
三和ホールディングス	230,000	257	59,110,000	
文化シャツタ-	65,000	253	16,445,000	
東洋シャツタ-	6,000	509	3,054,000	
住生活グループ	301,400	1,749	527,148,600	
日本フィルコン	18,500	425	7,862,500	
ノーリツ	37,900	1,247	47,261,300	
長府製作所	26,800	2,120	56,816,000	
リンナイ	40,200	4,660	187,332,000	
ユニプレス	33,100	1,246	41,242,600	
ダイニチ工業	13,400	627	8,401,800	
日東精工	30,000	251	7,530,000	
三洋工業	36,000	116	4,176,000	
岡部	50,200	309	15,511,800	
日立ツール	14,800	865	12,802,000	
中国工業	38,000	82	3,116,000	
東プレ	48,300	686	33,133,800	
高周波熱錬	36,800	527	19,393,600	
東京製網	157,000	219	34,383,000	
パイオラックス	10,800	1,712	18,489,600	

日本発条	163,000	737	120,131,000	
中央発條	34,000	296	10,064,000	
アドバネクス	48,000	62	2,976,000	
三浦工業	34,100	2,353	80,237,300	
タクマ	92,000	209	19,228,000	
ツガミ	70,000	413	28,910,000	
オークマ	162,000	529	85,698,000	
東芝機械	124,000	361	44,764,000	
アマダ	381,000	668	254,508,000	
アイダエンジニア	59,300	292	17,315,600	
牧野フライス	115,000	444	51,060,000	
オーエスジー	102,600	900	92,340,000	
ダイジェット	22,000	121	2,662,000	
旭ダイヤモンド	61,000	642	39,162,000	
森精機製作所	113,900	959	109,230,100	
ディスコ	22,600	4,905	110,853,000	
日東工器	14,800	1,935	28,638,000	
豊田自動織機	192,900	2,269	437,690,100	
豊和工業	139,000	48	6,672,000	
大阪機工	80,000	72	5,760,000	
石川製作所	61,000	50	3,050,000	
東洋機械金属	17,900	155	2,774,500	
オ - エム製作所	20,000	317	6,340,000	
津田駒工業	62,000	134	8,308,000	
エンシュウ	58,000	76	4,408,000	
島精機製作所	29,900	1,700	50,830,000	
日本スピンドル	35,000	119	4,165,000	
日阪製作所	27,000	822	22,194,000	
やまびこ	10,200	845	8,619,000	
ペガサスミシン製造	25,700	179	4,600,300	
ナブテスコ	94,000	1,106	103,964,000	
三井海洋開発	16,600	1,583	26,277,800	
レオン自動機	4,000	225	900,000	
S M C	74,400	11,100	825,840,000	
新川	19,300	1,243	23,989,900	
ホソカワミクロン	39,000	329	12,831,000	
ユニオンツール	15,500	2,500	38,750,000	
オイレス工業	27,800	1,406	39,086,800	

サトー	26,100	1,095	28,579,500
日本エアーテック	7,800	418	3,260,400
日精樹脂工業	19,700	243	4,787,100
ワイエイシイ	10,900	569	6,202,100
小松製作所	1,034,900	1,784	1,846,261,600
住友重機械	493,000	461	227,273,000
日立建機	101,800	1,802	183,443,600
日工	18,000	220	3,960,000
巴工業	9,600	1,080	10,368,000
井関農機	237,000	258	61,146,000
T O W A	25,900	648	16,783,200
丸山製作所	56,000	153	8,568,000
北川鉄工所	111,000	91	10,101,000
シンニッタン	23,200	218	5,057,600
クボタ	952,000	778	740,656,000
荏原実業	6,300	1,151	7,251,300
東洋エンジニア	157,000	293	46,001,000
三菱化工機	71,000	230	16,330,000
月島機械	41,000	551	22,591,000
帝国電機製作所	8,500	1,660	14,110,000
東京機械	76,000	90	6,840,000
新東工業	46,300	638	29,539,400
渋谷工業	14,500	757	10,976,500
アイチ コーポレーション	41,700	332	13,844,400
小森コーポレーション	66,000	985	65,010,000
鶴見製作所	14,000	558	7,812,000
住友精密	36,000	253	9,108,000
酒井重工業	47,000	125	5,875,000
荏原製作所	469,000	427	200,263,000
石井鉄工所	38,000	157	5,966,000
西島製作所	22,200	1,919	42,601,800
千代田化工建	193,000	801	154,593,000
ダイキン工業	260,300	3,385	881,115,500
オルガノ	43,000	549	23,607,000
ト - ヨ - カネツ	124,000	176	21,824,000
栗田工業	127,800	2,540	324,612,000
椿本チエイン	127,000	376	47,752,000
大同工業	47,000	131	6,157,000

日本コンベヤ	82,000	80	6,560,000	
日機装	71,000	552	39,192,000	
木村化工機	21,500	846	18,189,000	
新興プランテック	44,500	867	38,581,500	
アネスト岩田	43,000	303	13,029,000	
ダイフク	93,000	651	60,543,000	
加藤製作所	53,000	153	8,109,000	
油研工業	43,000	123	5,289,000	
タダノ	106,000	416	44,096,000	
フジテック	63,000	484	30,492,000	
シーケーディ	61,500	685	42,127,500	
キトー	77	76,200	5,867,400	
平和	44,800	932	41,753,600	
理想科学工業	19,500	895	17,452,500	
SANKYO	65,000	4,300	279,500,000	
日本金銭機械	22,200	744	16,516,800	
マースエンジニアリング	10,100	1,735	17,523,500	
福島工業	7,100	754	5,353,400	
キヤノンファインテック	19,000	1,404	26,676,000	
アビリット	42,400	115	4,876,000	
オーイズミ	2,400	201	482,400	
ダイコク電機	7,800	1,534	11,965,200	
アマノ	66,500	768	51,072,000	
JUKI	143,000	111	15,873,000	
サンデン	135,000	276	37,260,000	
蛇の目ミシン	219,000	59	12,921,000	
ブラザー工業	308,000	1,023	315,084,000	
シルバー精工	404,000	5	2,020,000	
マックス	41,000	924	37,884,000	
モリタホールディングス	36,000	386	13,896,000	
グローリー	67,200	1,983	133,257,600	
大和冷機工業	31,000	413	12,803,000	
セガサミーホールディングス	251,500	1,106	278,159,000	
日本ピストンリング	91,000	89	8,099,000	
リケン	95,000	303	28,785,000	
帝国ピストン	29,200	430	12,556,000	
ホシザキ電機	48,000	1,210	58,080,000	
大豊工業	16,900	607	10,258,300	

日本精工	449,000	621	278,829,000	
N T N	512,000	362	185,344,000	
ジェイテクト	213,900	941	201,279,900	
不二越	239,000	253	60,467,000	
ミネベア	325,000	486	157,950,000	
日本トムソン	76,000	552	41,952,000	
T H K	148,500	1,727	256,459,500	
ユーシン精機	10,700	1,523	16,296,100	
前澤給装工業	9,500	1,279	12,150,500	
イーグル工業	26,000	574	14,924,000	
前澤工業	16,200	168	2,721,600	
日本ピラ - 工業	26,000	459	11,934,000	
キッツ	107,000	476	50,932,000	
日立	5,016,000	296	1,484,736,000	
東芝	5,018,000	446	2,238,028,000	
三菱電機	2,066,000	740	1,528,840,000	
富士電機H L D G S	607,000	209	126,863,000	
東洋電機製造	38,000	570	21,660,000	
安川電機	261,000	714	186,354,000	
シンフォニアテクノロジー	132,000	200	26,400,000	
明電舎	219,000	402	88,038,000	
オリジン電気	32,000	317	10,144,000	
デンヨー	22,900	672	15,388,800	
日立工機	63,700	937	59,686,900	
三桜工業	28,000	574	16,072,000	
マキタ	145,100	2,909	422,095,900	
東芝テック	149,000	345	51,405,000	
芝浦メカトロニクス	35,000	292	10,220,000	
マブチモーター	32,500	4,860	157,950,000	
日本電産	107,300	8,660	929,218,000	
高岳製作所	94,000	279	26,226,000	
ダイヘン	120,000	380	45,600,000	
J V CケンウッドH D	886,000	40	35,440,000	
日新電機	40,000	414	16,560,000	
大崎電気	34,000	765	26,010,000	
オムロン	265,500	1,943	515,866,500	
日東工業	36,200	812	29,394,400	
I D E C	31,400	682	21,414,800	



エルピーダメモリ	232,700	1,597	371,621,900	
ジーエス・ユアサ コーポ	429,000	617	264,693,000	
サクサホールディングス	61,000	155	9,455,000	
メルコホールディングス	11,500	2,319	26,668,500	
テクノメディカ	13	271,000	3,523,000	
日本電気	2,891,000	241	696,731,000	
富士通	2,297,000	578	1,327,666,000	
沖電気	761,000	70	53,270,000	
岩崎通信機	102,000	67	6,834,000	

[前へ](#) [次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
電気興業	64,000	453	28,992,000	
サンケン電気	130,000	296	38,480,000	
ナカヨ通信機	18,000	154	2,772,000	
アイホン	15,500	1,539	23,854,500	
NECエレクトロニクス	54,700	828	45,291,600	
セイコーエプソン	177,400	1,537	272,663,800	
ワコム	436	136,000	59,296,000	
アルバック	43,800	2,154	94,345,200	
ピクセラ	9,200	328	3,017,600	
ナナオ	18,600	2,150	39,990,000	
日本信号	55,400	799	44,264,600	
京三製作所	52,000	400	20,800,000	
能美防災	27,000	552	14,904,000	
ホーチキ	23,000	512	11,776,000	
マスプロ電工	17,400	802	13,954,800	
日本無線	82,000	170	13,940,000	
パナソニック	2,178,800	1,250	2,723,500,000	
シャープ	1,069,000	1,036	1,107,484,000	
アンリツ	114,000	334	38,076,000	
富士通ゼネラル	56,000	359	20,104,000	
日立国際電気	55,000	826	45,430,000	
ソニー	1,189,700	3,045	3,622,636,500	
T D K	115,100	5,480	630,748,000	
帝国通信工業	55,000	202	11,110,000	
三洋電機	2,369,000	150	355,350,000	
宮越商事	5,700	535	3,049,500	
ミツミ電機	71,200	1,678	119,473,600	
タムラ製作所	61,000	258	15,738,000	
アルプス電気	188,100	525	98,752,500	
池上通信機	73,000	68	4,964,000	
パイオニア	186,400	322	60,020,800	
日本電波工業	15,300	1,894	28,978,200	
日本トリム	3,200	1,763	5,641,600	
ローランド ディー・ジー	9,400	1,300	12,220,000	
コロムビアミュージックエンタ	160,000	31	4,960,000	

山水電気	957,000	4	3,828,000	
フオスタ - 電機	19,600	2,270	44,492,000	
クラリオン	126,000	154	19,404,000	
S M K	70,000	427	29,890,000	
ヨコオ	19,300	520	10,036,000	
東 光	101,000	145	14,645,000	
ティアック	108,000	31	3,348,000	
ホシデン	59,100	1,067	63,059,700	
ヒロセ電機	38,500	9,430	363,055,000	
日本航空電子	48,000	628	30,144,000	
T O A	30,000	448	13,440,000	
ユニデン	69,000	224	15,456,000	
アルパイン	46,500	1,078	50,127,000	
スミダコーポレーション	16,500	852	14,058,000	
アイコム	12,200	2,267	27,657,400	
船井電機	18,700	3,915	73,210,500	
横河電機	238,700	739	176,399,300	
新電元工業	76,000	280	21,280,000	
山武	61,200	2,045	125,154,000	
日本光電工業	40,800	1,546	63,076,800	
チ ノ ー	44,000	201	8,844,000	
共和電業	3,000	255	765,000	
日本電子材料	9,200	558	5,133,600	
堀場製作所	37,800	2,380	89,964,000	
アドバンテスト	162,500	2,120	344,500,000	
小野測器	23,000	304	6,992,000	
エスペック	23,100	568	13,120,800	
サンクス	22,200	356	7,903,200	
キーエンス	45,000	19,590	881,550,000	
日置電機	11,700	1,555	18,193,500	
シスメックス	41,800	5,250	219,450,000	
メガチップス	18,000	1,177	21,186,000	
O B A R A	17,300	976	16,884,800	
日本電産コパル電子	25,100	650	16,315,000	
ミヤチテクノス	12,700	618	7,848,600	
東京電波	7,000	567	3,969,000	
澤藤電機	14,000	134	1,876,000	
デンソー	523,500	2,418	1,265,823,000	

コーセル	31,900	1,187	37,865,300	
日立メディコ	15,000	726	10,890,000	
新日本無線	17,000	239	4,063,000	
オプテックス	16,600	954	15,836,400	
千代田インテグレ	12,600	1,134	14,288,400	
東光電気	15,000	598	8,970,000	
スタンレー電気	148,400	1,629	241,743,600	
岩崎電気	81,000	133	10,773,000	
ウシオ電機	134,400	1,429	192,057,600	
岡谷電機	13,400	283	3,792,200	
ヘリオステクノH	18,900	276	5,216,400	
日本セラミック	15,800	1,088	17,190,400	
新神戸電機	19,000	833	15,827,000	
日本デジタル研究所	20,200	958	19,351,600	
古河電池	15,000	730	10,950,000	
双信電機	12,000	336	4,032,000	
山一電機	19,800	313	6,197,400	
函研	16,800	664	11,155,200	
日本電子	89,000	311	27,679,000	
カシオ	247,900	666	165,101,400	
ファナック	230,500	8,660	1,996,130,000	
日本シイエムケイ	46,500	631	29,341,500	
エンプラス	12,500	1,615	20,187,500	
ローム	110,900	5,990	664,291,000	
浜松ホトニクス	86,800	2,174	188,703,200	
三井ハイテック	31,400	636	19,970,400	
新光電気工業	59,900	1,297	77,690,300	
京セラ	184,100	7,990	1,470,959,000	
協栄産業	7,000	178	1,246,000	
日本インター	26,200	204	5,344,800	
太陽誘電	89,000	1,239	110,271,000	
村田製作所	250,000	4,695	1,173,750,000	
ユーシン	26,200	582	15,248,400	
双葉電子工業	41,000	1,540	63,140,000	
日東電工	192,800	3,310	638,168,000	
北陸電気工業	90,000	157	14,130,000	
パナソニック電工	389,000	1,016	395,224,000	
東海理化電機	55,800	1,591	88,777,800	

ニチコン	74,900	994	74,450,600	
日本ケミコン	113,000	290	32,770,000	
K O A	29,900	852	25,474,800	
三井造船	924,000	209	193,116,000	
日立造船	1,003,000	124	124,372,000	
佐世保重工業	157,000	195	30,615,000	
三菱重工業	3,745,000	329	1,232,105,000	
川崎重工業	1,731,000	228	394,668,000	
I H I	1,628,000	156	253,968,000	
日本車輛	87,000	559	48,633,000	
日本輸送機	31,000	176	5,456,000	
近畿車輛	36,000	606	21,816,000	
日産自動車	2,676,700	708	1,895,103,600	
いすゞ自動車	1,507,000	218	328,526,000	
トヨタ自動車	3,062,700	3,270	10,015,029,000	
日野自動車	298,000	329	98,042,000	
三菱自動車工業	4,919,000	125	614,875,000	
エフテック	8,300	1,225	10,167,500	
武蔵精密工業	23,100	1,730	39,963,000	
トヨタ車体	43,500	1,366	59,421,000	
日産車体	93,000	690	64,170,000	
関東自動車	36,200	639	23,131,800	
新明和工業	98,000	293	28,714,000	
極東開発工業	41,900	300	12,570,000	
日信工業	38,900	1,331	51,775,900	
トピー工業	196,000	159	31,164,000	
ティラド	72,000	217	15,624,000	
曙ブレーキ	90,500	438	39,639,000	
タチエス	31,200	892	27,830,400	
N O K	115,200	1,235	142,272,000	
フタバ産業	72,600	648	47,044,800	
カヤバ工業	149,000	296	44,104,000	
シロキ工業	46,000	274	12,604,000	
市光工業	59,000	141	8,319,000	
大同メタル工業	33,000	242	7,986,000	
プレス工業	110,000	171	18,810,000	
カルソニックカンセイ	162,000	232	37,584,000	
太平洋工業	49,000	441	21,609,000	

ケーヒン	43,800	1,553	68,021,400
河西工業	23,000	343	7,889,000
アイシン精機	196,200	2,296	450,475,200
富士機工	18,000	187	3,366,000
マ ッ ダ	1,449,000	225	326,025,000
ダイハツ	221,000	850	187,850,000
愛知機械	54,000	347	18,738,000
今仙電機製作所	17,300	1,143	19,773,900
本田技研	1,901,400	3,060	5,818,284,000
スズキ	441,800	1,869	825,724,200
富士重工業	753,000	395	297,435,000
ヤマハ発動機	275,600	1,158	319,144,800
ショーワ	50,700	534	27,073,800
小糸製作所	107,000	1,098	117,486,000
T B K	25,000	173	4,325,000
エクセディ	28,800	1,968	56,678,400
ミツバ	41,000	478	19,598,000
豊田合成	67,300	2,277	153,242,100
愛三工業	24,700	725	17,907,500
ヨ ロ ズ	14,600	1,139	16,629,400
エフ・シー・シー	31,200	1,775	55,380,000
新家工業	60,000	123	7,380,000
シマノ	91,300	3,915	357,439,500
タカタ	36,300	2,046	74,269,800
テイ・エス テック	45,300	1,506	68,221,800
小 野 建	19,000	593	11,267,000
はるやま商事	11,900	380	4,522,000
佐鳥電機	16,500	479	7,903,500
カップクリエイト	15,550	1,777	27,632,350
エコートレーディング	5,700	885	5,044,500
伯東	14,800	856	12,668,800
中山福	15,200	584	8,876,800
ライトオン	17,700	668	11,823,600
ナガイレーベン	14,300	2,015	28,814,500
ジーンズメイト	8,000	366	2,928,000
菱食	22,900	2,220	50,838,000
良品計画	24,900	3,770	93,873,000
三城ホールディングス	29,700	745	22,126,500

松田産業	15,100	1,535	23,178,500
メディバルHD	235,100	1,039	244,268,900
アドヴァン	15,000	605	9,075,000
S P K	4,100	1,238	5,075,800
アズワン	14,000	1,602	22,428,000
スズデン	6,100	481	2,934,100
尾家産業	5,800	785	4,553,000
シモジマ	16,500	1,250	20,625,000
ドウシシャ	11,300	2,120	23,956,000
コナカ	28,000	326	9,128,000
高速	14,700	649	9,540,300
ハウス ローゼ	2,000	1,288	2,576,000
G - 7ホールディングス	7,300	555	4,051,500
イオン北海道	16,500	271	4,471,500
コジマ	31,600	692	21,867,200
コーナン商事	20,600	999	20,579,400
黒田電気	31,500	1,237	38,965,500
ネットワンシステムズ	449	92,600	41,577,400
エコス	8,600	593	5,099,800
ワタミ	24,700	1,612	39,816,400
マルシェ	7,000	707	4,949,000
ドン・キホーテ	37,200	2,213	82,323,600
丸文	18,900	499	9,431,100
メガネトップ	20,100	649	13,044,900
西松屋チェーン	51,300	839	43,040,700
ゼンショー	88,000	664	58,432,000
ハピネット	6,500	1,060	6,890,000
幸楽苑	14,000	1,226	17,164,000
トーマンエレクトロニクス	7,400	1,021	7,555,400
ユニマットライフ	9,900	895	8,860,500
ハークスレイ	6,100	630	3,843,000
サイゼリヤ	34,800	1,581	55,018,800
エクセル	10,300	1,041	10,722,300
マルカキカイ	8,000	530	4,240,000
アルゴグラフィックス	9,100	974	8,863,400
ガリバーインターナショナル	5,540	3,755	20,802,700
日本エム・ディ・エム	20,000	243	4,860,000
ポブラ	7,500	512	3,840,000

ユナイテッドアローズ	25,300	972	24,591,600	
進和	13,300	1,049	13,951,700	
エスケイジャパン	5,400	323	1,744,200	
ダイトエレクトロン	10,800	454	4,903,200	
ハイデイ日高	9,900	990	9,801,000	
シークス	14,900	1,074	16,002,600	
京都きもの友禅	14,000	819	11,466,000	
コロワイド	53,500	543	29,050,500	
田中商事	8,000	329	2,632,000	
オーハシテクニカ	14,400	512	7,372,800	
壱番屋	8,600	2,144	18,438,400	
マクニカ	9,500	1,477	14,031,500	
白銅	8,300	590	4,897,000	
トップカルチャー	8,200	341	2,796,200	
スギホールディングス	32,800	2,122	69,601,600	
島津製作所	263,000	654	172,002,000	
J M S	35,000	363	12,705,000	
アロカ	13,000	616	8,008,000	
クボテック	55	21,550	1,185,250	
モリテックス	4,800	237	1,137,600	
長野計器	14,300	607	8,680,100	
スター精密	45,300	858	38,867,400	
東京計器	84,000	124	10,416,000	
愛知時計	7,000	255	1,785,000	
日本電産トーソク	7,200	1,400	10,080,000	
東京精密	45,800	1,264	57,891,200	
ニコン	415,300	1,968	817,310,400	
トプコン	48,100	420	20,202,000	
オリンパス	261,000	2,734	713,574,000	
理研計器	20,100	570	11,457,000	
大日本スクリーン	244,000	409	99,796,000	
キヤノン電子	21,600	1,863	40,240,800	
タムロン	21,000	1,301	27,321,000	
HOYA	515,200	2,264	1,166,412,800	
ノーリツ鋼機	19,100	562	10,734,200	
エー・アンド・デイ	18,500	339	6,271,500	
キヤノン	1,382,100	3,720	5,141,412,000	
リコー	662,000	1,239	820,218,000	



日本電産コパル	23,500	1,200	28,200,000
日本電産サンキョー	57,000	741	42,237,000
シチズンホールディングス	259,300	562	145,726,600
リズム時計	116,000	142	16,472,000
S R Iスポーツ	133	83,700	11,132,100
バンダイナムコH L D G S	259,200	819	212,284,800
共立印刷	22,500	123	2,767,500
フランスベッドH L D G S	161,000	130	20,930,000
パイロットコーポレーション	209	107,500	22,467,500
エイベックス・グループH D	34,600	815	28,199,000
トッパン・フォームズ	42,600	918	39,106,800
フジシールインターナショナル	22,300	1,863	41,544,900
タカラトミー	71,200	673	47,917,600
廣済堂	18,900	186	3,515,400
アーク	73,800	55	4,059,000
レック	7,200	1,628	11,721,600
アロン化成	14,000	371	5,194,000
タカノ	10,100	466	4,706,600
プロネクサス	26,800	545	14,606,000
ホクシン	18,100	131	2,371,100
ウッドワン	45,000	243	10,935,000
大建工業	98,000	255	24,990,000
きもと	20,200	742	14,988,400
凸版印刷	673,000	770	518,210,000
大日本印刷	674,000	1,188	800,712,000
図書印刷	38,000	158	6,004,000
共同印刷	75,000	250	18,750,000
日本写真印刷	36,600	3,070	112,362,000
光村印刷	3,000	301	903,000
藤森工業	16,700	1,316	21,977,200
宝印刷	10,500	690	7,245,000
前澤化成工業	18,500	794	14,689,000
コンビ	13,500	620	8,370,000
アシックス	207,000	844	174,708,000
ツツミ	10,400	1,795	18,668,000
ジェイエスピー	16,200	1,098	17,787,600
ニチハ	27,700	639	17,700,300
ローランド	17,100	865	14,791,500

エフピコ	11,100	4,235	47,008,500
小松ウオール工業	8,600	974	8,376,400
ヤマハ	160,600	1,037	166,542,200
河合楽器	90,000	141	12,690,000
クリナップ	25,800	700	18,060,000
ビジョン	13,500	3,440	46,440,000
天馬	18,000	989	17,802,000
パラマウントベッド	23,600	1,789	42,220,400
兼松日産農林	38,000	103	3,914,000
キングジム	19,000	680	12,920,000
リンテック	50,900	1,691	86,071,900
田崎真珠	42,000	90	3,780,000
信越ポリマー	43,000	615	26,445,000
東リ	63,000	166	10,458,000
イトーキ	50,900	186	9,467,400
任天堂	125,800	24,060	3,026,748,000
三菱鉛筆	20,200	1,205	24,341,000
タカラスタンダ-ド	111,000	511	56,721,000
コクヨ	124,000	676	83,824,000
ナカバヤシ	52,000	186	9,672,000
ニフコ	51,700	1,967	101,693,900
グローブライド	122,000	104	12,688,000
サンウエーブ	33,000	327	10,791,000
岡村製作所	91,000	460	41,860,000
日本バルカー	98,000	171	16,758,000
MUTOHホールディングス	29,000	138	4,002,000
伊藤忠	1,525,000	705	1,075,125,000
丸紅	1,801,000	519	934,719,000
スクロール	23,900	319	7,624,100
高島	42,000	137	5,754,000
F & A アクアホールディングス	19,000	906	17,214,000
三陽商会	113,000	328	37,064,000
長瀬産業	123,000	1,003	123,369,000
ナイガイ	71,000	40	2,840,000
蝶理	159,000	101	16,059,000
豊田通商	209,800	1,273	267,075,400
オンワ-ドホールディングス	154,000	574	88,396,000
三共生興	40,800	281	11,464,800

兼松	500,000	70	35,000,000	
美津濃	118,000	408	48,144,000	
ツカモトコーポレーション	41,000	70	2,870,000	
ファミリーマート	72,200	2,817	203,387,400	
ルック	40,000	79	3,160,000	
三井物産	1,895,400	1,360	2,577,744,000	
日本紙パルプ	123,000	312	38,376,000	
東京エレクトロン	187,100	5,480	1,025,308,000	
日立ハイテクノロジーズ	71,300	1,786	127,341,800	
カメイ	22,000	426	9,372,000	
東都水産	40,000	147	5,880,000	
スターゼン	82,000	247	20,254,000	
セイコーHD	83,000	170	14,110,000	
山善	90,900	327	29,724,300	
椿本興業	27,000	180	4,860,000	
住友商事	1,203,400	947	1,139,619,800	
日本ユニシス	56,500	535	30,227,500	
内田洋行	52,000	272	14,144,000	
三菱商事	1,757,800	2,210	3,884,738,000	
第一実業	53,000	221	11,713,000	
キヤノンマーケティングJPN	78,100	1,141	89,112,100	
西華産業	92,000	195	17,940,000	
佐藤商事	22,500	461	10,372,500	
菱洋エレクトロ	26,900	814	21,896,600	
東京産業	24,000	244	5,856,000	
ユアサ商事	246,000	71	17,466,000	
神鋼商事	61,000	153	9,333,000	
阪和興業	236,000	351	82,836,000	
カナデン	2,000	431	862,000	
菱電商事	36,000	427	15,372,000	
ニプロ	47,500	1,775	84,312,500	
フルサト工業	13,900	548	7,617,200	
岩谷産業	245,000	252	61,740,000	
すてきナイスグループ	104,000	185	19,240,000	
昭光通商	94,000	110	10,340,000	
ニチモウ	40,000	142	5,680,000	
極東貿易	34,000	120	4,080,000	
イワキ	26,000	226	5,876,000	

兼松エレクトロニクス	13,600	803	10,920,800	
三愛石油	57,000	342	19,494,000	
稲畑産業	58,300	349	20,346,700	
G S Iクレオス	62,000	102	6,324,000	
明和産業	20,300	170	3,451,000	
ゴ - ルドウイン	55,000	167	9,185,000	
東京スタイル	83,000	615	51,045,000	
ユニ・チャ - ム	45,900	8,570	393,363,000	
デサント	69,000	475	32,775,000	
ヤマトインタ - ナショナル	17,000	332	5,644,000	
東邦ホールディングス	60,800	1,206	73,324,800	
サンゲツ	40,900	2,035	83,231,500	
ミツウロコ	39,100	624	24,398,400	
シナネン	58,000	378	21,924,000	
伊藤忠エネクス	51,800	434	22,481,200	
ザ・トーカイ	57,000	491	27,987,000	
サンリオ	65,400	744	48,657,600	
サンワ テクノス	11,800	401	4,731,800	
リョーサン	36,100	2,103	75,918,300	
新光商事	22,500	810	18,225,000	
トーホー	49,000	336	16,464,000	
三信電気	25,000	685	17,125,000	
東陽テクニカ	37,000	711	26,307,000	
モスフード サービス	31,300	1,516	47,450,800	
加賀電子	23,700	897	21,258,900	
三益半導体	18,500	1,074	19,869,000	
ソーダニツカ	2,000	340	680,000	
立花エレテック	14,500	655	9,497,500	
木曽路	25,200	1,888	47,577,600	
千 趣 会	42,300	511	21,615,300	
タカキュー	19,500	165	3,217,500	
ケーヨー	44,500	446	19,847,000	
アデランスホールディングス	26,800	1,050	28,140,000	
上新電機	51,000	802	40,902,000	
日本瓦斯	25,500	1,162	29,631,000	
ベスト電器	73,000	212	15,476,000	
マルエツ	48,000	375	18,000,000	
ロイヤルホールディングス	36,600	894	32,720,400	

東天紅	14,000	140	1,960,000	
いなげや	26,000	957	24,882,000	
島忠	53,200	1,871	99,537,200	
チヨダ	30,800	1,088	33,510,400	
鈴丹	6,200	212	1,314,400	
ライフコーポレーション	15,000	1,496	22,440,000	
カスミ	49,000	452	22,148,000	
リンガーハット	16,500	1,263	20,839,500	
さが美	19,000	133	2,527,000	

[前へ](#) [次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
MR MAX	24,500	395	9,677,500	
テンアライド	12,000	317	3,804,000	
AOKIホールディングス	21,900	1,053	23,060,700	
オークワ	30,000	861	25,830,000	
コメリ	28,100	2,375	66,737,500	
青山商事	54,800	1,420	77,816,000	
しまむら	24,600	7,670	188,682,000	
CFSコーポレーション	19,000	460	8,740,000	
高島屋	294,000	682	200,508,000	
松屋	43,200	752	32,486,400	
エイチ・ツー・オーリテイリング	122,000	573	69,906,000	
丸栄	34,000	114	3,876,000	
ニッセンHD	46,500	362	16,833,000	
パルコ	60,800	697	42,377,600	
丸井グループ	259,600	604	156,798,400	
クレディセゾン	164,600	1,125	185,175,000	
原信ナルスHLDGS	13,300	1,034	13,752,200	
セディナ	180,200	161	29,012,200	
井筒屋	120,000	33	3,960,000	
ダイエー	99,400	297	29,521,800	
イズミヤ	76,000	402	30,552,000	
イオン	769,800	888	683,582,400	
ユニー	176,500	688	121,432,000	
イズミ	63,500	1,117	70,929,500	
東武ストア	33,000	270	8,910,000	
平和堂	43,200	1,131	48,859,200	
フジ	26,400	1,714	45,249,600	
ヤオコー	10,400	2,694	28,017,600	
ゼビオ	24,700	1,669	41,224,300	
ケーズホールディングス	37,600	2,595	97,572,000	
OLYMPIC	16,700	595	9,936,500	
東日カーライフグループ	35,000	101	3,535,000	
新生銀行	1,068,000	101	107,868,000	
あおぞら銀行	733,000	111	81,363,000	
三菱UFJフィナンシャルG	16,756,100	451	7,557,001,100	

りそなホールディングス	629,400	1,083	681,640,200	
中央三井トラストHD	1,229,000	319	392,051,000	
三井住友フィナンシャルG	1,631,700	2,853	4,655,240,100	
第四銀行	307,000	300	92,100,000	
北越銀行	248,000	147	36,456,000	
西日本シティ銀行	766,000	241	184,606,000	
札幌北洋ホール	324,700	392	127,282,400	
千葉銀行	862,000	540	465,480,000	
横浜銀行	1,511,000	442	667,862,000	
常陽銀行	851,000	355	302,105,000	
群馬銀行	549,000	493	270,657,000	
武蔵野銀行	35,700	2,458	87,750,600	
千葉興業銀行	44,900	665	29,858,500	
関東つくば銀行	71,200	272	19,366,400	
東京都民銀行	41,600	1,130	47,008,000	
七十七銀行	369,000	478	176,382,000	
青森銀行	165,000	212	34,980,000	
秋田銀行	161,000	352	56,672,000	
山形銀行	136,000	388	52,768,000	
岩手銀行	15,900	4,995	79,420,500	
東邦銀行	200,000	293	58,600,000	
東北銀行	128,000	137	17,536,000	
みちのく銀行	119,000	174	20,706,000	
ふくおかフィナンシャルG	890,000	322	286,580,000	
静岡銀行	683,000	784	535,472,000	
十六銀行	288,000	350	100,800,000	
スルガ銀行	229,000	811	185,719,000	
八十二銀行	444,000	493	218,892,000	
山梨中央銀行	149,000	367	54,683,000	
大垣共立銀行	314,000	307	96,398,000	
福井銀行	203,000	292	59,276,000	
北國銀行	252,000	320	80,640,000	
清水銀行	8,100	3,435	27,823,500	
滋賀銀行	220,000	545	119,900,000	
南都銀行	221,000	478	105,638,000	
百五銀行	217,000	407	88,319,000	
京都銀行	392,000	759	297,528,000	
三重銀行	98,000	235	23,030,000	

ほくほくフィナンシャルG	1,544,000	188	290,272,000	
広島銀行	648,000	369	239,112,000	
山陰合同銀行	142,000	696	98,832,000	
中国銀行	193,000	1,155	222,915,000	
鳥取銀行	79,000	235	18,565,000	
伊予銀行	268,000	784	210,112,000	
百十四銀行	257,000	334	85,838,000	
四国銀行	172,000	284	48,848,000	
阿波銀行	196,000	490	96,040,000	
鹿児島銀行	153,000	619	94,707,000	
大分銀行	152,000	320	48,640,000	
宮崎銀行	146,000	278	40,588,000	
肥後銀行	186,000	476	88,536,000	
佐賀銀行	137,000	248	33,976,000	
十八銀行	150,000	255	38,250,000	
沖縄銀行	18,100	3,425	61,992,500	
琉球銀行	46,600	999	46,553,400	
住友信託	1,984,000	497	986,048,000	
みずほ信託銀行	1,863,000	87	162,081,000	
八千代銀行	12,400	2,040	25,296,000	
みずほフィナンシャルG	19,295,700	172	3,318,860,400	
紀陽ホールディングス	879,000	114	100,206,000	
山口フィナンシャルG	219,000	966	211,554,000	
フィデック	120	8,770	1,052,400	
芙蓉総合リース	20,200	2,453	49,550,600	
興銀リース	32,800	1,606	52,676,800	
東京センチュリーリース	55,100	1,233	67,938,300	
S B Iホールディングス	21,099	16,030	338,216,970	
日本証券金融	97,100	639	62,046,900	
大阪証券金融	29,300	180	5,274,000	
アイフル	175,650	133	23,361,450	
日本アジア投資	149,000	45	6,705,000	
ポケットカード	23,700	250	5,925,000	
長野銀行	85,000	175	14,875,000	
名古屋銀行	212,000	339	71,868,000	
愛知銀行	8,600	6,450	55,470,000	
第三銀行	145,000	245	35,525,000	
中京銀行	98,000	257	25,186,000	



東日本銀行	122,000	174	21,228,000	
愛媛銀行	149,000	246	36,654,000	
トマト銀行	94,000	177	16,638,000	
みなと銀行	243,000	115	27,945,000	
京葉銀行	194,000	418	81,092,000	
関西アーバン銀行	234,000	145	33,930,000	
栃木銀行	119,000	369	43,911,000	
北日本銀行	7,400	2,463	18,226,200	
香川銀行	78,000	297	23,166,000	
東和銀行	239,000	65	15,535,000	
徳島銀行	64,000	303	19,392,000	
福島銀行	294,000	51	14,994,000	
大東銀行	151,000	65	9,815,000	
武富士	138,800	397	55,103,600	
リコーリース	16,300	2,002	32,632,600	
イオン クレジットサービス	104,500	911	95,199,500	
N I Sグループ	141,600	20	2,832,000	
アコム	58,930	1,275	75,135,750	
プロミス	99,550	665	66,200,750	
ジャックス	143,000	194	27,742,000	
日立キャピタル	55,500	1,207	66,988,500	
オリックス	114,160	6,830	779,712,800	
三菱UFJリース	59,610	3,030	180,618,300	
ジャフコ	32,100	2,064	66,254,400	
大和証券G本社	2,071,000	432	894,672,000	
野村ホールディングス	4,404,100	646	2,845,048,600	
みずほ証券	601,000	260	156,260,000	
みずほインベストズ証	548,000	93	50,964,000	
岡三証券グループ	200,000	398	79,600,000	
丸三証券	73,200	504	36,892,800	
東洋証券	89,000	160	14,240,000	
東海東京HD	249,000	339	84,411,000	
光世証券	62,000	95	5,890,000	
水戸証券	64,000	204	13,056,000	
いちよし証券	50,000	568	28,400,000	
松井証券	139,800	595	83,181,000	
だいこう証券ビジ	12,500	373	4,662,500	
マネックスG	1,767	41,200	72,800,400	

カブドットコム証券	361	91,800	33,139,800	
極東証券	29,400	783	23,020,200	
岩井証券	21,000	525	11,025,000	
フィデアホール	114,100	147	16,772,700	
池田泉州HD	751,900	220	165,418,000	
三井住友海上HD	499,000	2,258	1,126,742,000	
SONY FH	739	261,300	193,100,700	
小林洋行	5,200	288	1,497,600	
日本興亜損害保険	785,000	548	430,180,000	
損害保険ジャパン	1,024,000	618	632,832,000	
ニッセイ同和損害保険	261,000	431	112,491,000	
あいおい損害保険	560,000	433	242,480,000	
富士火災	279,000	96	26,784,000	
東京海上HD	893,200	2,518	2,249,077,600	
アサックス	34	80,000	2,720,000	
NECキャピタルソリューション	8,100	1,220	9,882,000	
T&Dホールディングス	403,350	1,958	789,759,300	
三井不動産	979,000	1,490	1,458,710,000	
三菱地所	1,544,000	1,377	2,126,088,000	
平和不動産	167,000	275	45,925,000	
東京建物	448,000	308	137,984,000	
ダイビル	60,700	705	42,793,500	
サンケイビル	40,700	564	22,954,800	
東急不動産	434,000	320	138,880,000	
京阪神不動産	28,600	423	12,097,800	
住友不動産	528,000	1,566	826,848,000	
東宝不動産	25,400	480	12,192,000	
太平洋興発	79,000	66	5,214,000	
有楽土地	32,000	345	11,040,000	
大京	324,000	167	54,108,000	
テーオーシー	91,400	327	29,887,800	
東京楽天地	27,000	363	9,801,000	
レオパレス21	152,800	442	67,537,600	
フジ住宅	28,300	317	8,971,100	
空港施設	25,200	474	11,944,800	
明和地所	13,700	411	5,630,700	
住友不動産販売	8,480	3,810	32,308,800	
ゴールドクレスト	15,890	2,500	39,725,000	

東栄住宅	14,000	694	9,716,000
日本エスリード	9,100	712	6,479,200
東急リバブル	21,500	723	15,544,500
飯田産業	9,300	1,468	13,652,400
日神不動産	12,400	408	5,059,200
アーネストワン	38,800	857	33,251,600
タカラレーベン	10,400	513	5,335,200
サンヨーハウジ 名古屋	113	74,800	8,452,400
イオンモール	107,100	1,565	167,611,500
フージャースコーポレーション	288	19,200	5,529,600
サンシティ	537	2,080	1,116,960
ゼクス	81	1,015	82,215
タクトホーム	107	66,800	7,147,600
ランド	11,100	28	310,800
リサ・パートナーズ	306	51,200	15,667,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,459	70,600	103,005,400
サンフロンティア不動産	243	11,900	2,891,700
大和システム	10,000	183	1,830,000
ランドビジネス	159	15,420	2,451,780
東武鉄道	956,000	490	468,440,000
相鉄ホールディングス	338,000	390	131,820,000
東京急行	1,217,000	374	455,158,000
京浜急行	613,000	726	445,038,000
小田急電鉄	711,000	758	538,938,000
京王電鉄	620,000	597	370,140,000
京成電鉄	334,000	528	176,352,000
富士急行	67,000	442	29,614,000
新京成電鉄	23,000	364	8,372,000
東日本旅客鉄道	414,600	6,040	2,504,184,000
西日本旅客鉄道	1,928	309,000	595,752,000
東海旅客鉄道	1,911	667,000	1,274,637,000
アートコーポレーション	6,000	1,367	8,202,000
西日本鉄道	314,000	355	111,470,000
ハマキョウレックス	6,800	2,343	15,932,400
サカイ引越センター	4,300	1,988	8,548,400
近畿鉄道	2,027,000	283	573,641,000
阪急阪神HLDGS	1,506,000	420	632,520,000
南海電鉄	470,000	360	169,200,000

京阪電鉄	505,000	370	186,850,000	
名糖運輸	7,300	792	5,781,600	
名古屋鉄道	786,000	267	209,862,000	
日本通運	944,000	365	344,560,000	
ヤマトホールディングス	450,500	1,186	534,293,000	
山九	265,000	426	112,890,000	
日新	92,000	181	16,652,000	
丸運	14,600	222	3,241,200	
丸全昭和運輸	75,000	288	21,600,000	
センコー	76,000	314	23,864,000	
トナミホールディングス	56,000	188	10,528,000	
日本梱包運輸	66,000	984	64,944,000	
日石輸送	12,000	191	2,292,000	
福山通運	166,000	437	72,542,000	
セイノーホールディングス	169,000	626	105,794,000	
神奈川中央交通	5,000	506	2,530,000	
日立物流	41,600	1,214	50,502,400	
日本郵船	1,636,000	323	528,428,000	
商船三井	1,071,000	575	615,825,000	
川崎汽船	567,000	319	180,873,000	
新和海運	83,000	277	22,991,000	
乾汽船	26,200	677	17,737,400	
明治海運	21,600	423	9,136,800	
飯野海運	107,000	495	52,965,000	
共栄タンカー	18,000	205	3,690,000	
第一中央汽船	155,000	236	36,580,000	
全日本空輸	3,178,000	268	851,704,000	
パスコ	29,000	176	5,104,000	
国際航業HLDGS	12,000	225	2,700,000	
三菱倉庫	156,000	1,010	157,560,000	
三井倉庫	84,000	330	27,720,000	
住友倉庫	160,000	392	62,720,000	
渋沢倉庫	62,000	287	17,794,000	
ヤマタネ	110,000	125	13,750,000	
東陽倉庫	30,000	185	5,550,000	
日本トランスシティ	52,000	259	13,468,000	
ケイヒン	47,000	97	4,559,000	
安田倉庫	19,100	560	10,696,000	

東洋埠頭	74,000	154	11,396,000
宇徳	16,100	231	3,719,100
上組	264,000	689	181,896,000
サンリツ	1,700	533	906,100
キムラユニティー	4,300	713	3,065,900
キューソー流通システム	7,500	850	6,375,000
郵船航空サービス	18,900	1,236	23,360,400
近鉄エクスプレス	18,700	2,304	43,084,800
東海運	11,400	216	2,462,400
バンテック	111	118,700	13,175,700
東京放送HD	126,800	1,298	164,586,400
日本テレビ放送網	20,650	12,090	249,658,500
テレビ朝日	596	137,200	81,771,200
テレビ東京	9,100	1,850	16,835,000
スカパーJSATHD	1,792	39,100	70,067,200
アイ・ティー・シーネットワーク	56	194,800	10,908,800
イー・アクセス	1,177	72,200	84,979,400
NECモバイルリング	7,600	2,171	16,499,600
日本電信電話	927,000	3,885	3,601,395,000
KDDI	3,650	474,500	1,731,925,000
光通信	30,200	1,559	47,081,800
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,519	138,700	2,707,285,300
インボイス	12,982	1,373	17,824,286
GMOインターネット	66,800	339	22,645,200
学研ホールディングス	103,000	209	21,527,000
ゼンリン	31,200	1,028	32,073,600
昭文社	13,900	592	8,228,800
角川グループHLDGS	20,300	2,099	42,609,700
インプレスホールディングス	19,300	188	3,628,400
東京電力	1,402,000	2,460	3,448,920,000
中部電力	749,800	2,354	1,765,029,200
関西電力	910,800	2,105	1,917,234,000
中国電力	329,500	1,829	602,655,500
北陸電力	228,300	1,999	456,371,700
東北電力	558,400	1,933	1,079,387,200
四国電力	246,700	2,567	633,278,900
九州電力	491,400	1,989	977,394,600
北海道電力	207,300	1,759	364,640,700

沖縄電力	15,600	4,950	77,220,000	
電源開発	147,800	3,020	446,356,000	
東京瓦斯	2,817,000	392	1,104,264,000	
大阪瓦斯	2,398,000	324	776,952,000	
東邦瓦斯	621,000	487	302,427,000	
北海道瓦斯	45,000	241	10,845,000	
西部瓦斯	274,000	248	67,952,000	
静岡瓦斯	68,000	530	36,040,000	
アイネット	13,100	465	6,091,500	
松竹	131,000	795	104,145,000	
東宝	168,100	1,440	242,064,000	
エイチ・アイ・エス	22,800	1,640	37,392,000	
東映	88,000	453	39,864,000	
葵プロモーション	7,500	465	3,487,500	
ベンチャーリンク	84,000	10	840,000	
NTTデータ	1,452	274,400	398,428,800	
共立メンテナンス	10,200	1,290	13,158,000	
イチネンホールディングス	24,800	371	9,200,800	
建設技術研究所	13,200	461	6,085,200	
燦ホールディングス	5,500	1,451	7,980,500	
スバル興業	3,000	253	759,000	
東京テアトル	86,000	142	12,212,000	
ホリプロ	8,000	687	5,496,000	
よみうりランド	50,000	299	14,950,000	
東京都競馬	172,000	127	21,844,000	
常磐興産	76,000	136	10,336,000	
カナモト	30,000	394	11,820,000	
東京ドーム	171,000	244	41,724,000	
D T S	22,600	870	19,662,000	
スクウェア・エニックス・HD	59,700	1,767	105,489,900	
シーイーシー	12,900	462	5,959,800	
カプコン	50,100	1,505	75,400,500	
東海観光	96,000	25	2,400,000	
日本空港ビルデング	56,400	1,285	72,474,000	
トランス・コスモス	28,600	708	20,248,800	
乃村工藝社	50,000	223	11,150,000	
ジャステック	14,500	504	7,308,000	
住商情報システム	24,000	1,212	29,088,000	

藤田観光	64,000	347	22,208,000	
近畿日本ツーリスト	82,000	71	5,822,000	
日本管財	9,300	1,510	14,043,000	
白洋舎	5,000	255	1,275,000	
セコム	224,500	4,025	903,612,500	
C S Kホールディングス	89,000	385	34,265,000	
日本システムウエア	3,400	281	955,400	
セントラル警備保障	10,700	879	9,405,300	
アイネス	28,500	627	17,869,500	
丹青社	5,000	183	915,000	
メイテック	33,700	1,634	55,065,800	
T K C	21,900	1,628	35,653,200	
アサツー ディ・ケイ	43,500	1,753	76,255,500	
富士ソフト	29,100	1,495	43,504,500	
応用地質	26,100	717	18,713,700	
船井総合研究所	25,900	504	13,053,600	
日システム	49,400	999	49,350,600	
進学会	14,400	297	4,276,800	
丸紅建材リース	27,000	109	2,943,000	
コナミ	95,600	1,619	154,776,400	
ベネッセホールディングス	78,800	4,015	316,382,000	
イオンディライト	18,300	1,238	22,655,400	
ナック	6,400	838	5,363,200	
福井コンピュータ	1,500	307	460,500	
ニチイ学館	48,700	840	40,908,000	
ダイセキ	40,100	1,752	70,255,200	
元気寿司	7,600	1,188	9,028,800	
トラスコ中山	27,600	1,321	36,459,600	
ヤマダ電機	107,230	5,990	642,307,700	
オートバックスセブン	27,700	2,646	73,294,200	
アークランドサカモト	13,800	942	12,999,600	
ニトリ	42,300	6,990	295,677,000	
グルメ杵屋	1,000	509	509,000	
愛眼	18,000	486	8,748,000	
吉野家ホールディングス	640	99,300	63,552,000	
加藤産業	34,100	1,466	49,990,600	
イエローハット	22,300	615	13,714,500	
富士エレクトロニクス	13,800	819	11,302,200	

松屋フーズ	11,700	1,366	15,982,200	
J B C Cホールディングス	19,300	549	10,595,700	
J Kホールディングス	21,000	329	6,909,000	
ユニダックス	6,000	470	2,820,000	
サガミチェーン	26,000	520	13,520,000	
日 伝	9,700	2,196	21,301,200	
北沢産業	11,000	170	1,870,000	
杉本商事	12,900	733	9,455,700	
因幡電機産業	24,500	2,058	50,421,000	
住金物産	110,000	191	21,010,000	
ブレナス	26,400	1,250	33,000,000	
ミニストップ	17,500	1,023	17,902,500	
イマージュホールディングス	8,000	236	1,888,000	
アークス	27,900	1,211	33,786,900	
バ ロ ー	43,000	718	30,874,000	
ミスミグループ本社	79,100	1,646	130,198,600	
江守商事	5,200	705	3,666,000	
アルテック	11,400	265	3,021,000	
ベ ル ク	9,600	810	7,776,000	
大 庄	14,400	1,171	16,862,400	
タキヒヨー	37,000	446	16,502,000	
ファーストリテイリング	47,100	15,060	709,326,000	
ソフトバンク	961,400	2,310	2,220,834,000	
スズケン	83,500	2,928	244,488,000	
サンドラッグ	44,700	2,134	95,389,800	
ジェコス	18,300	388	7,100,400	
ヤマザワ	6,500	1,267	8,235,500	
や ま や	4,600	698	3,210,800	
ベルーナ	29,600	375	11,100,000	
合計	337,312,473		264,115,174,600	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。





## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		3,380,591,725	114,197,502
コール・ローン		372,825,880	5,168,290,967
株式		171,268,532,211	277,648,602,650
新株予約権証券		7,356,221	-
投資信託受益証券		328,930,584	854,478,026
投資証券		1,544,848,566	3,064,745,118
派生商品評価勘定		17,937,203	6,992,501
未収入金		3,467	-
未収配当金		542,989,830	567,125,416
差入委託証拠金		2,873,315,446	331,323,539
流動資産合計		180,337,331,133	287,755,755,719
資産合計		180,337,331,133	287,755,755,719
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		605,494,833	922,556
未払解約金		10,927,000	5,113,060,000
流動負債合計		616,421,833	5,113,982,556
負債合計		616,421,833	5,113,982,556
純資産の部			
元本等			
元本		208,410,395,741	230,889,417,193
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	28,689,486,441	51,752,355,970
元本等合計		179,720,909,300	282,641,773,163
純資産合計		179,720,909,300	282,641,773,163
負債純資産合計		180,337,331,133	287,755,755,719

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 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	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。  (2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	(1)先物取引 同左  (2)為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年2月17日から平成22年2月15日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月15日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	133,510,300,940円	208,410,395,741円
同期中追加設定元本額	99,636,002,199円	91,010,592,100円
同期中解約元本額	24,735,907,398円	68,531,570,648円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,145,738円	677,515,462円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	17,100,774,345円	23,857,437,556円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	181,531,329円	158,820,202円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,001,737,147円	938,309,051円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,235,592,642円	1,199,726,425円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	234,446,780円	198,061,463円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	556,068,624円	507,589,655円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	373,018,081円	367,497,733円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	102,179,342円	85,813,790円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	671,801,779円	656,835,118円
D I A M外国株式インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	618,882,309円	632,485,236円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	4,771,605,134円	6,243,813,848円
グローバル株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	7,475,111,162円	3,795,222,785円
D I A M為替リスクコントロール型グローバル株式私募ファンド（適格機関投資家限定）	19,939,204,295円	18,200,891,710円
D I A Mワールドバランス25 V A（適格機関投資家限定）	- 円	108,502,199円
D I A Mグローバル・バランスファンド25 V A（適格機関投資家限定）	14,710,345,684円	10,778,560,162円
D I A Mグローバル・バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	2,229,847,637円	1,737,582,071円
D I A M国際分散バランスファンド30 V A（適格機関投資家限定）	265,533,014円	203,406,461円

D I A M国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,405,342,566円	1,126,302,889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）	146,791,614円	105,164,165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）	251,901,352円	187,170,365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）	25,171,298,966円	19,264,687,870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）	12,076,182,215円	9,468,385,371円
D I A Mバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	4,630,340,495円	3,393,404,331円
D I A Mバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	3,919,879,000円	3,041,064,525円
D I A Mバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	10,408,536,371円	8,103,595,711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）	7,642,267,039円	5,894,936,107円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	9,928,974,393円	7,529,039,456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）	5,930,647,598円	5,170,935,060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）	5,520,885,905円	4,480,067,385円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	104,242,552円	76,419,333円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	641,347,098円	513,508,305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）	25,726,071,561円	20,252,789,539円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	4,546,930,022円	3,503,524,691円
D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定）	185,479,604円	139,785,636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）	15,949,490,916円	25,503,695,599円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,754,961,432円	2,705,303,163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）	- 円	4,726,016,367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）	- 円	15,595,707,695円

D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	- 円	173,270円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	- 円	266,674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)	- 円	19,759,158,004円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	- 円	81,315円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	- 円	163,440円
(合計)	208,410,395,741円	230,889,417,193円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	208,410,395,741口	230,889,417,193口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は28,689,486,441円でありませ	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	171,268,532,211	14,244,790,260	277,648,602,650	6,963,792,528
新株予約権証券	7,356,221	4,926,957	-	-
投資信託受益証券	328,930,584	46,884,107	854,478,026	7,686,858
投資証券	1,544,848,566	108,620,611	3,064,745,118	144,013,730
合計	173,149,667,582	14,405,221,935	281,567,825,794	7,115,493,116

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

区分	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成21年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	195,075,810	-	187,990,335	7,085,475
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	416,825,525	-	374,636,820	42,188,705
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,505,177,050	-	1,325,182,824	179,994,226
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	706,603,096	-	646,283,234	60,319,862
	米ドル S&P 500 FUTURE	3,729,172,590	-	3,420,483,456	308,689,134
	合計	6,552,854,071	-	5,954,576,669	598,277,402

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

## (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。

(通貨関連)

平成21年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	オーストラリアドル	15,366,550	-	15,749,000	382,450
	カナダドル	34,246,950	-	34,983,000	736,050
	ユーロ	139,008,222	-	142,956,500	3,948,278
	英ポンド	59,280,326	-	60,475,200	1,194,874
	米ドル	291,474,480	-	295,932,600	4,458,120
	合計	539,376,528	-	550,096,300	10,719,772

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

## (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。

(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21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
1口当たり純資産額	0.8623円	1.2241円
(1万口当たり純資産額)	(8,623円)	(12,241円)

[前へ](#) [次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株 式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	197,065	60.910	12,003,229.150	
	XL CAPITAL LTD-CLASS A	60,224	18.390	1,107,519.360	
	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD	1,385	340.600	471,731.000	
	EVEREST RE GROUP LTD	9,632	85.220	820,839.040	
	PARTNERRE LTD	11,741	79.150	929,300.150	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	25,348	31.620	801,503.760	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	11,956	55.370	662,003.720	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,318	74.100	468,163.800	
	BUNGE LTD	21,999	60.050	1,321,039.950	
	VALIDUS HOLDINGS LTD	13,905	27.580	383,499.900	
	INVESCO LTD	66,224	19.550	1,294,679.200	
	ULTRA PETROLEUM CORP	26,465	46.050	1,218,713.250	
	ACE LTD	56,987	50.330	2,868,155.710	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	77,769	35.270	2,742,912.630	
	WEATHERFORD INTL LTD	120,422	16.560	1,994,188.320	
	NOBLE CORP	43,725	42.440	1,855,689.000	
	TRANSOCEAN LTD	52,023	79.850	4,154,036.550	
	FOSTER WHEELER AG	21,365	26.710	570,659.150	
	TYCO ELECTRONICS LTD	78,928	26.330	2,078,174.240	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	27,142	44.900	1,218,675.800	
	INGERSOLL-RAND PLC	53,396	32.400	1,730,030.400	
	ACCENTURE PLC-CL A	100,880	40.280	4,063,446.400	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	28,704	29.390	843,610.560	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	17,625	26.190	461,598.750	
	COVIDIEN PLC	83,544	50.160	4,190,567.040	
	SEAGATE TECHNOLOGY	78,988	19.510	1,541,055.880	
	GARMIN LTD	20,035	32.450	650,135.750	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	23,836	27.710	660,495.560	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	74,117	35.800	2,653,388.600	
	MCDERMOTT INTERNATIONAL INC	40,655	22.910	931,406.050	
	FLEXTRONICS INTL LTD	124,958	7.130	890,950.540	

	AMAZON.COM INC	57,184	119.660	6,842,637.440	
	ABBOTT LABORATORIES	256,992	54.330	13,962,375.360	
	AES CORP	107,013	11.800	1,262,753.400	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,529	35.850	520,864.650	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	217,386	127.590	27,736,279.740	
	ADVANCED MICRO DEVICES	98,835	8.050	795,621.750	
	ADOBE SYSTEMS INC	87,091	34.540	3,008,123.140	
	AGCO CORP	14,077	33.420	470,453.340	
	AIRGAS INC	12,495	63.350	791,558.250	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	35,055	69.870	2,449,292.850	
	ENERGEN CORP	11,608	44.730	519,225.840	
	ALLERGAN INC	50,108	58.820	2,947,352.560	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	147,917	33.980	5,026,219.660	
	POLO RALPH LAUREN CORP	9,262	80.150	742,349.300	
	ALLSTATE CORP	84,092	31.280	2,630,397.760	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	115,663	40.580	4,693,604.540	
	ALTERA CORPORATION	48,418	24.150	1,169,294.700	
	ALCOA INC	162,535	13.060	2,122,707.100	
	AMGEN INC	167,632	56.740	9,511,439.680	
	HESS CORP	47,649	59.000	2,811,291.000	
	ALLEGHENY ENERGY INC	32,630	23.010	750,816.300	
	FORTUNE BRANDS INC	26,648	43.610	1,162,119.280	
	AMERICAN EXPRESS CO	175,897	38.410	6,756,203.770	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	74,470	33.910	2,525,277.700	
	AFLAC INC	78,390	49.070	3,846,597.300	
	AMERICAN INTL GROUP	19,154	27.990	536,120.460	
	ANALOG DEVICES	50,197	29.490	1,480,309.530	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	82,574	69.640	5,750,453.360	
	QWEST COMMUNICATIONS INTL	252,980	4.510	1,140,939.800	
	NABORS INDUSTRIES LTD	48,028	21.920	1,052,773.760	
	ARCH COAL INC	26,204	21.250	556,835.000	
	TIME WARNER	192,249	28.680	5,513,701.320	
	VALERO ENERGY CORP	97,566	17.600	1,717,161.600	
	APOLLO GROUP INC	20,538	59.540	1,222,832.520	
	APACHE CORP	57,219	102.270	5,851,787.130	
	APPLE INC	148,448	200.550	29,771,246.400	
	APPLIED MATERIALS INC	220,283	12.270	2,702,872.410	
	ARCHER-DANIELS-MIDLANDCO	95,247	29.570	2,816,453.790	

	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	32,880	16.900	555,672.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	19,196	37.640	722,537.440	
	AMEREN CORP	37,141	25.140	933,724.740	
	ARROW ELECTRONICS INC	18,235	28.480	519,332.800	
	AUTODESK INC	39,911	27.890	1,113,117.790	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	82,180	42.240	3,471,283.200	
	AUTOZONE INC	5,222	164.960	861,421.120	
	AVERY DENNISON CORP	19,175	31.730	608,422.750	
	AVNET INC	23,051	27.430	632,288.930	
	AVON PRODUCTS INC	69,281	30.850	2,137,318.850	
	BMC SOFTWARE INC	30,045	37.080	1,114,068.600	
	BJ SERVICES CO	49,086	21.820	1,071,056.520	
	BAKER HUGHES INC	52,639	47.910	2,521,934.490	
	BALL CORP	14,325	53.020	759,511.500	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	92,824	79.680	7,396,216.320	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	29,902	34.750	1,039,094.500	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	196,863	28.630	5,636,187.690	
	CR BARD INC	16,155	82.990	1,340,703.450	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	97,499	57.600	5,615,942.400	
	BED BATH & BEYOND INC	44,685	41.690	1,862,917.650	
	BECKMAN COULTER INC	10,806	65.960	712,763.760	
	BECTON DICKINSON & CO	37,142	78.820	2,927,532.440	
	AMETEK INC	19,800	38.200	756,360.000	
	NII HOLDINGS INC	29,467	37.450	1,103,539.150	
	VERIZON COMM INC	470,886	28.960	13,636,858.560	
	WR BERKLEY CORP	27,431	25.770	706,896.870	
	BEST BUY CO INC	59,442	36.940	2,195,787.480	
	YUM! BRANDS INC	76,666	33.710	2,584,410.860	
	FIRSTENERGY CORP	52,359	39.120	2,048,284.080	
	BLACK & DECKER CORP	10,677	71.190	760,095.630	
	SLM CORP	83,617	11.110	928,984.870	
	H&R BLOCK INC	55,766	17.320	965,867.120	
	BOEING CO	112,517	63.480	7,142,579.160	
	ROBERT HALF INTL INC	22,574	27.680	624,848.320	
	BORGWARNER INC	21,884	38.140	834,655.760	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	250,640	7.800	1,954,992.000	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	28,620	53.680	1,536,321.600	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	278,576	24.710	6,883,612.960	

	ONEOK INC	18,558	43.910	814,881.780	
	SEMPRA ENERGY	39,007	48.530	1,893,009.710	
	FEDEX CORP	48,514	83.080	4,030,543.120	
	VERISIGN INC	32,898	24.650	810,935.700	
	AMPHENOL CORP	29,960	41.630	1,247,234.800	
	BROWN-FORMAN CORP	14,952	53.220	795,745.440	
	QUANTA SERVICES INC	33,320	19.160	638,411.200	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	265,983	1.530	406,953.990	
	CSX CORP	63,568	47.280	3,005,495.040	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	40,115	22.830	915,825.450	
	CABOT OIL & GAS CORP	19,209	40.160	771,433.440	
	CAMPBELL SOUP CO	34,722	33.150	1,151,034.300	
	CONSTELLATION BRANDS INC	31,178	15.020	468,293.560	
	CARDINAL HEALTH INC	59,104	33.260	1,965,799.040	
	CATERPILLAR INC	101,177	56.960	5,763,041.920	
	CELGENE CORP	75,937	59.490	4,517,492.130	
	CITRIX SYSTEMS INC	28,981	43.750	1,267,918.750	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	103,335	26.540	2,742,510.900	
	CENTURYTEL INC	50,817	35.280	1,792,823.760	
	CEPHALON INC	12,443	68.070	846,995.010	
	CERNER CORP	10,884	82.530	898,256.520	
	JPMORGAN CHASE & CO	651,611	40.850	26,618,309.350	
	CHUBB CORP	57,803	51.170	2,957,779.510	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	13,342	67.360	898,717.120	
	CIGNA CORP	44,187	33.930	1,499,264.910	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	28,773	26.920	774,569.160	
	CINTAS CORP	23,420	24.650	577,303.000	
	CISCO SYSTEMS INC	954,486	24.340	23,232,189.240	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	21,675	53.950	1,169,366.250	
	CLOROX COMPANY	21,128	61.000	1,288,808.000	
	COCA-COLA CO/THE	346,469	55.160	19,111,230.040	
	COCA-COLA ENTERPRISES INC	45,581	19.180	874,243.580	
	COLGATE-PALMOLIVECO	81,466	82.960	6,758,419.360	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	48,195	27.260	1,313,795.700	
	AON CORP	42,423	40.740	1,728,313.020	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	128,519	15.510	1,993,329.690	
	COMERICA INC	26,646	36.020	959,788.920	

	NRG ENERGY, INC.	46,401	21.860	1,014,325.860	
	COMCAST CORP-CL A	324,353	16.430	5,329,119.790	
	CA INC	70,789	22.560	1,596,999.840	
	COMPUTER SCIENCES CORP	24,670	51.900	1,280,373.000	
	CONAGRA FOODS INC	71,068	24.530	1,743,298.040	
	CONSOLIDATED EDISON INC	46,836	42.880	2,008,327.680	
	SARA LEE CORP	113,910	13.900	1,583,349.000	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	39,251	40.990	1,608,898.490	
	MOLSON COORS BREWING CO	24,258	40.980	994,092.840	
	CORNING INC	257,516	17.500	4,506,530.000	
	DIRECTV	148,261	33.590	4,980,086.990	
	COVANCE INC	9,828	57.260	562,751.280	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	27,954	22.560	630,642.240	
	SEALED AIR CORP	27,699	20.310	562,566.690	
	BROADCOM CORP-CL A	72,524	31.650	2,295,384.600	
	XTO ENERGY INC	92,987	45.960	4,273,682.520	
	CUMMINS INC	31,016	55.950	1,735,345.200	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	19,971	91.330	1,823,951.430	
	DR HORTON INC	49,200	12.340	607,128.000	
	DANAHER CORP	44,325	74.520	3,303,099.000	
	MOODY'S CORP	33,649	27.020	909,195.980	
	AMERICAN TOWER CORP	66,490	42.620	2,833,803.800	
	IMS HEALTH INC	28,888	21.970	634,669.360	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	49,763	48.170	2,397,083.710	
	TARGET CORP	116,942	50.990	5,962,872.580	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	11,626	87.350	1,015,531.100	
	DEERE & CO	68,952	56.180	3,873,723.360	
	DELL INC	289,808	13.390	3,880,529.120	
	MORGAN STANLEY	201,698	27.830	5,613,255.340	
	REPUBLIC SERVICES INC	60,513	28.060	1,697,994.780	
	DEVRY INC	11,829	62.570	740,140.530	
	THE WALT DISNEY CO	301,179	31.390	9,454,008.810	
	DOLLAR TREE INC	16,468	55.780	918,585.040	
	RR DONNELLEY & SONS CO	31,238	20.780	649,125.640	
	DOVER CORP	27,623	44.700	1,234,748.100	
	DOW CHEMICAL	186,056	29.000	5,395,624.000	
	OMNICOM GROUP	50,903	36.880	1,877,302.640	

	DTE ENERGY CO	27,197	44.260	1,203,739.220	
	DST SYSTEMS INC	6,910	38.320	264,791.200	
	DUKE ENERGY CORP	209,509	16.450	3,446,423.050	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	46,567	37.850	1,762,560.950	
	FLOWSERVE CORP	9,213	96.690	890,804.970	
	DARDEN RESTAURANTS INC	22,329	40.990	915,265.710	
	EBAY INC	176,043	23.260	4,094,760.180	
	EMC CORP/MASS	334,039	17.390	5,808,938.210	
	BANK OF AMERICA CORP	1,432,958	16.330	23,400,204.140	
	EL PASO CORP	121,499	10.110	1,228,354.890	
	CITIGROUP INC	3,510,959	3.450	12,112,808.550	
	EASTMAN CHEMICAL CO	11,841	59.570	705,368.370	
	EATON CORP	26,458	66.810	1,767,658.980	
	EATON VANCE CORP	16,415	30.460	500,000.900	
	DISH NETWORK CORP	31,646	19.960	631,654.160	
	ECOLAB INC	38,559	42.010	1,619,863.590	
	ELECTRONIC ARTS INC	50,822	16.520	839,579.440	
	SALESFORCE.COM INC	19,232	69.440	1,335,470.080	
	EMERSON ELECTRIC CO	123,476	48.160	5,946,604.160	
	ENTERGY CORP	33,291	76.730	2,554,418.430	
	EOG RESOURCES INC	42,366	92.680	3,926,480.880	
	EQUIFAX INC	19,838	32.300	640,767.400	
	EQT CORP	22,638	44.050	997,203.900	
	ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,316	60.010	1,159,153.160	
	EXPEDITORS INTERNATIONAL	37,325	36.590	1,365,721.750	
	EXPRESS SCRIPTS INC	42,695	87.750	3,746,486.250	
	EXXON MOBIL CORP	796,174	65.550	52,189,205.700	
	FMC CORP	11,880	56.320	669,081.600	
	FPL GROUP INC	65,185	47.060	3,067,606.100	
	FAMILY DOLLAR STORES	22,967	33.000	757,911.000	
	ASSURANT INC	17,619	30.950	545,308.050	
	FASTENAL CO	22,642	44.180	1,000,323.560	
	FIFTH THIRD BANCORP	127,711	12.690	1,620,652.590	
	M&T BANK CORP	12,661	78.200	990,090.200	
	FISERV INC	24,628	47.690	1,174,509.320	
	FLIR SYSTEMS INC	25,251	26.790	676,474.290	
	MACY'S INC	65,836	19.520	1,285,118.720	



	FORD MOTOR CO	465,457	11.730	5,459,810.610	
	FOREST LABORATORIES INC	51,599	29.640	1,529,394.360	
	FRANKLIN RESOURCES INC	27,132	101.650	2,757,967.800	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	66,427	72.680	4,827,914.360	
	FIRST AMERICAN CORP	14,232	33.310	474,067.920	
	GAP INC/THE	77,544	20.290	1,573,367.760	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	24,710	33.000	815,430.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	53,169	72.600	3,860,069.400	
	GENERAL MILLS INC	52,531	71.920	3,778,029.520	
	GENUINE PARTS CO	28,644	40.380	1,156,644.720	
	GENZYME CORP-GENL DIVISION	44,920	56.500	2,537,980.000	
	GILEAD SCIENCES INC	147,507	47.560	7,015,432.920	
	STARWOOD HOTELS&RESORTS	33,350	38.050	1,268,967.500	
	GOODRICH CORP	20,936	64.900	1,358,746.400	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	13.070	479,420.670	
	MCKESSON CORP	42,983	59.270	2,547,602.410	
	NVIDIA CORP	88,942	16.550	1,471,990.100	
	GENERAL ELECTRIC CO	1,759,706	16.120	28,366,460.720	
	WW GRAINGER INC	10,949	103.510	1,133,330.990	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	27,938	50.260	1,404,163.880	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	33,979	14.470	491,676.130	
	HALLIBURTON CO	146,729	30.010	4,403,337.290	
	HANSEN NATURAL CORP	12,038	40.130	483,084.940	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	80,483	158.330	12,742,873.390	
	HARLEY-DAVIDSON INC	38,884	24.530	953,824.520	
	HARRIS CORP	22,272	46.090	1,026,516.480	
	HARSCO CORP	13,902	30.130	418,867.260	
	JEFFERIES GROUP INC NPR	14,558	25.230	367,298.340	
	CONSOL ENERGY INC	28,594	48.180	1,377,658.920	
	HASBRO INC	18,941	35.480	672,026.680	
	HENRY SCHEIN INC	15,366	57.100	877,398.600	
	DENBURY RESOURCES INC	40,999	13.880	569,066.120	
	HJ HEINZ CO	52,448	45.920	2,408,412.160	
	HELMERICH & PAYNE INC	19,453	41.230	802,047.190	
	HERSHEY FOODS CORP	25,565	39.640	1,013,396.600	
	HEWLETT-PACKARD CO	395,694	50.790	20,097,298.260	
	CROWN HOLDINGS INC NPR	26,712	26.560	709,470.720	
	REYNOLDS AMERICAN INC	28,566	53.370	1,524,567.420	

	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,350	34.890	535,561.500	
	JUNIPER NETWORKS INC	89,454	27.950	2,500,239.300	
	HOLOGIC INC	48,116	16.570	797,282.120	
	UNUM GROUP	56,315	20.930	1,178,672.950	
	HOME DEPOT INC	281,608	31.360	8,831,226.880	
	HORMEL FOODS CORP	12,265	41.430	508,138.950	
	HUDSON CITY BANCORP INC	77,279	13.310	1,028,583.490	
	CENTERPOINT ENERGY INC	66,922	14.210	950,961.620	
	HUMANA INC	27,533	46.910	1,291,573.030	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,239	34.210	521,326.190	
	RED HAD INC	31,656	28.280	895,231.680	
	ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	5,620	106.920	600,890.400	
	BIOGEN IDEC INC	46,554	55.290	2,573,970.660	
	ILLINOIS TOOL WORKS	70,189	45.430	3,188,686.270	
	INTUIT INC	50,471	32.270	1,628,699.170	
	INTEL CORP	929,150	20.700	19,233,405.000	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,788	41.900	577,717.200	
	INTL GAME TECH	49,124	17.570	863,108.680	
	INTERNATIONAL PAPER CO	65,538	23.900	1,566,358.200	
	ITT CORP	29,372	51.240	1,505,021.280	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	74,501	6.820	508,096.820	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	20,536	39.470	810,555.920	
	RAYONIER INC	13,728	41.810	573,967.680	
	JOHNSON & JOHNSON	457,315	63.450	29,016,636.750	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	66,788	24.330	1,624,952.040	
	JOHNSON CONTROLS INC	111,557	30.800	3,435,955.600	
	KLA-TENCOR CORP	30,514	29.090	887,652.260	
	DEVON ENERGY CORP	71,509	68.390	4,890,500.510	
	NSTAR	18,750	34.140	640,125.000	
	KELLOGG CO	45,177	52.400	2,367,274.800	
	KEYCORP	150,758	7.110	1,071,889.380	
	KIMBERLY-CLARK CORP	68,075	60.300	4,104,922.500	
	BLACKROCK INC/NEW YORK	3,899	218.360	851,385.640	
	KOHL'S CORP	48,296	51.590	2,491,590.640	
	KROGER CO	104,233	21.890	2,281,660.370	
	LSI CORP	110,142	5.510	606,882.420	

	LAM RESEARCH CORP	20,796	33.720	701,241.120	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	26,381	25.760	679,574.560	
	LEGG MASON INC	21,861	25.720	562,264.920	
	LEGGETT & PLATT INC	29,104	19.330	562,580.320	
	PACTIV CORP	25,543	23.990	612,776.570	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	35,130	23.060	810,097.800	
	ELI LILLY & CO	167,471	34.040	5,700,712.840	
	LIMITED BRANDS	42,170	21.540	908,341.800	
	LINCOLN NATIONAL CORP	52,075	25.340	1,319,580.500	
	LINEAR TECH CORP	37,048	27.610	1,022,895.280	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	115,521	58.760	6,788,013.960	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	56,715	31.230	1,771,209.450	
	LOCKHEED MARTIN CORP	52,996	77.560	4,110,369.760	
	LOEWS CORP	59,393	36.620	2,174,971.660	
	RANGE RESOURCES CORP	26,908	50.430	1,356,970.440	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,568	42.990	626,278.320	
	LOWE'S COS INC	242,321	23.640	5,728,468.440	
	LUBRIZOL CORP	12,354	78.440	969,047.760	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	99,875	38.530	3,848,183.750	
	IRON MOUNTAIN INC	34,295	24.300	833,368.500	
	SCANA CORP	20,246	36.430	737,561.780	
	MDU RESOURCES GROUP INC	27,660	20.500	567,030.000	
	MGM MIRAGE	39,867	10.440	416,211.480	
	MCCORMICK & CO INC	20,286	37.260	755,856.360	
	MCDONALD'S CORPORATION	181,193	65.260	11,824,655.180	
	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	51,301	34.600	1,775,014.600	
	MCAFFEE INC	28,426	40.330	1,146,420.580	
	MANPOWER INC	13,462	52.030	700,427.860	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	9,159	91.010	833,560.590	
	MARSH & MCLENNAN COS	88,957	23.080	2,053,127.560	
	MARSHALL & ILSLEY CORP	82,632	6.940	573,466.080	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	10,852	56.650	614,765.800	
	MASCO CORP	61,569	13.310	819,483.390	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,811	81.870	639,486.570	
	MATTEL INC	58,664	22.000	1,290,608.000	
	METLIFE INC	133,670	35.590	4,757,315.300	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	54,201	18.690	1,013,016.690	
	MEDTRONIC INC	182,305	43.590	7,946,674.950	

	ACTIVISION BLIZZARD INC	91,222	10.710	976,987.620	
	CVS CAREMARK CORP	237,630	34.510	8,200,611.300	
	MERCK & CO. INC.	506,482	36.930	18,704,380.260	
	MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	33,006	12.090	399,042.540	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	17,498	73.500	1,286,103.000	
	MICROSOFT CORP	1,328,655	28.630	38,039,392.650	
	MICRON TECH INC	135,376	9.090	1,230,567.840	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,390	27.290	747,473.100	
	MILLIPORE CORP	10,426	93.840	978,375.840	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	83,500	19.280	1,609,880.000	
	3M CO	109,016	80.070	8,728,911.120	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	47.340	424,071.720	
	PROGRESS ENERGY INC	47,049	38.610	1,816,561.890	
	CHARLES RIVER LABORATORIES INT	11,470	37.730	432,763.100	
	MOTOROLA INC	391,909	6.790	2,661,062.110	
	MURPHY OIL CORPORATION	29,304	51.900	1,520,877.600	
	MYLAN LABORATORIES	49,968	19.420	970,378.560	
	ILLUMINA INC	19,512	36.140	705,163.680	
	MYRIAD GENETICS INC	15,704	22.340	350,827.360	
	XCEL ENERGY INC	79,653	21.030	1,675,102.590	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	68,773	43.490	2,990,937.770	
	NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	37,397	14.650	547,866.050	
	NETAPP INC	57,303	29.830	1,709,348.490	
	SEARS HOLDINGS CORP	9,671	95.520	923,773.920	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	23,027	49.180	1,132,467.860	
	NEWELL RUBBERMAID INC	41,919	13.650	572,194.350	
	DUN & BRADSTREET CORP	9,215	70.760	652,053.400	
	NEWMONT MINING CORP	79,896	46.480	3,713,566.080	
	NIKE INC-CL B	60,809	64.930	3,948,328.370	
	NOBLE ENERGY INC	30,606	70.990	2,172,719.940	
	NORDSTROM INC	26,079	36.590	954,230.610	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	61,127	51.110	3,124,200.970	
	NORTHEAST UTILITIES	31,993	26.260	840,136.180	
	NISOURCE INC	51,373	15.010	771,108.730	
	COACH INC	51,124	37.180	1,900,790.320	
	NORTHERN TRUST CORP	36,679	53.560	1,964,527.240	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	48,788	61.690	3,009,731.720	

	WELLS FARGO & CO	804,471	27.660	22,251,667.860	
	NUCOR CORP	52,663	42.090	2,216,585.670	
	MONSANTO CO	89,494	74.040	6,626,135.760	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	74,562	37.640	2,806,513.680	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	133,419	79.550	10,613,481.450	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	23,232	39.290	912,785.280	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	43,795	11.150	488,314.250	
	OMNICARE INC	22,831	25.520	582,647.120	
	ORACLE CORP	664,871	24.770	16,468,854.670	
	OWENS-ILLINOIS INC	30,726	28.660	880,607.160	
	PACCAR INC	58,279	35.710	2,081,143.090	
	PALL CORP	19,989	39.130	782,169.570	
	EXELON CORP	107,006	44.010	4,709,334.060	
	PARKER HANNIFIN CORP	27,265	58.870	1,605,090.550	
	PATTERSON-UTI ENERGY INC	26,675	15.100	402,792.500	
	PATTERSON COS INC	16,119	30.090	485,020.710	
	PAYCHEX INC	52,389	30.310	1,587,910.590	
	JC PENNEY CO INC HOLDING CO	34,075	28.240	962,278.000	
	PPL CORPORATION	60,425	28.900	1,746,282.500	
	PEPSICO INC	270,373	62.080	16,784,755.840	
	PENTAIR INC	15,263	32.400	494,521.200	
	PERRIGO CO	13,437	48.710	654,516.270	
	PFIZER INC	1,337,685	17.810	23,824,169.850	
	CONOCOPHILLIPS	232,818	48.350	11,256,750.300	
	PETSMART INC	22,122	27.270	603,266.940	
	PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	15,778	21.240	335,124.720	
	PG&E CORP	61,360	42.010	2,577,733.600	
	PITNEY BOWES INC	34,886	22.930	799,935.980	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	21,734	46.300	1,006,284.200	
	ALTRIA GROUP INC	337,572	20.260	6,839,208.720	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	85,894	53.780	4,619,379.320	
	AETNA INC	70,950	29.560	2,097,282.000	
	FLUOR CORP (NEW)	29,967	45.280	1,356,905.760	
	PPG INDUSTRIES INC	26,457	62.100	1,642,979.700	
	PRAXAIR INC	50,280	76.000	3,821,280.000	
	PRECISION CASTPARTS CORP	23,695	112.450	2,664,502.750	
	COSTCO WHOLESALE CORP	71,130	60.860	4,328,971.800	

	T ROWE PRICE GROUP INC	43,261	50.630	2,190,304.430	
	QUEST DIAGNOSTICS	25,363	56.820	1,441,125.660	
	PROCTER & GAMBLE CO	485,063	63.890	30,990,675.070	
	PROGRESSIVE CORP	103,358	17.230	1,780,858.340	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	84,141	30.170	2,538,533.970	
	PULTE HOMES INC	52,991	10.810	572,832.710	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	59,066	15.570	919,657.620	
	QUALCOMM INC	274,950	37.870	10,412,356.500	
	QUESTAR CORP	28,600	41.640	1,190,904.000	
	AUTONATION INC	16,132	18.130	292,473.160	
	US BANCORP	315,158	24.780	7,809,615.240	
	RALCORP HOLDINGS INC	9,036	66.700	602,701.200	
	ROSS STORES INC	20,294	48.140	976,953.160	
	ROPER INDUSTRIES INC	13,904	55.060	765,554.240	
	ROWAN COS INC	17,226	24.780	426,860.280	
	PEABODY ENERGY CORP	43,044	45.300	1,949,893.200	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	23,234	53.780	1,249,524.520	
	RAYTHEON COMPANY	64,946	56.170	3,648,016.820	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,692	57.200	783,182.400	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	9,721	56.390	548,167.190	
	FMC TECHNOLOGIES INC	21,469	56.050	1,203,337.450	
	KRAFT FOODS INC-A	284,889	29.050	8,276,025.450	
	SANDISK CORP	35,570	28.230	1,004,141.100	
	SAFEWAY INC	68,425	23.500	1,607,987.500	
	ROCKWELL COLLINS INC	25,877	54.930	1,421,423.610	
	ST JUDE MEDICAL INC	57,964	38.660	2,240,888.240	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	91,501	52.790	4,830,337.790	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	49,548	22.880	1,133,658.240	
	PRICELINE.COM INC	6,427	225.020	1,446,203.540	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	167,525	18.430	3,087,485.750	
	JOY GLOBAL INC	18,631	49.520	922,607.120	
	ZIMMER HOLDINGS INC	36,394	57.440	2,090,471.360	
	SPX CORP	8,540	61.220	522,818.800	
	SEI INVESTMENTS CO	23,592	17.730	418,286.160	
	WELLPOINT INC	78,915	60.140	4,745,948.100	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	48,364	27.890	1,348,871.960	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	29,280	28.140	823,939.200	

	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	50,242	23.200	1,165,614.400	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16,066	64.390	1,034,489.740	
	SIGMA-ALDRICH	19,608	47.600	933,340.800	
	SMITH INTERNATIONAL INC	43,535	40.850	1,778,404.750	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	75,804	51.900	3,934,227.600	
	ADVANCE AUTO PARTS	14,592	40.460	590,392.320	
	UNITED STATES STEEL CORP	23,198	52.120	1,209,079.760	

[前](#) [次](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	57,599	42.740	2,461,781.260	
	EDISON INTERNATIONAL	50,049	33.180	1,660,625.820	
	SOUTHERN CO	128,019	32.130	4,113,250.470	
	BB&T CORP	115,162	28.480	3,279,813.760	
	SOUTHWEST AIRLINES	35,573	12.440	442,528.120	
	AT&T INC	977,648	24.910	24,353,211.680	
	CHEVRON CORP	332,123	72.340	24,025,777.820	
	MEADWESTVACO CORP	28,338	23.590	668,493.420	
	STANLEY WORKS/THE	13,400	56.140	752,276.000	
	STAPLES INC	117,509	25.690	3,018,806.210	
	STATE STREET CORP	81,047	45.380	3,677,912.860	
	STARBUCKS CORP	122,956	23.080	2,837,824.480	
	STRYKER CORP	50,350	52.890	2,663,011.500	
	DEAN FOODS CO	28,635	14.800	423,798.000	
	SUNOCO INC	17,359	26.540	460,707.860	
	STERICYCLE INC	12,347	54.830	676,986.010	
	SUNTRUST BANKS INC	85,909	23.770	2,042,056.930	
	SYMANTEC CORP	138,162	16.520	2,282,436.240	
	SUPERVALU INC	36,635	15.270	559,416.450	
	SYNOPSIS INC	22,150	22.040	488,186.000	
	SYSCO CORP	97,013	28.970	2,810,466.610	
	INTUITIVE SURGICAL INC	6,471	344.210	2,227,382.910	
	TELEPHONE & DATA SYSTEMS INC	10,241	31.370	321,260.170	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	206,469	24.750	5,110,107.750	
	TEXTRON INC	42,770	19.590	837,864.300	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	69,016	48.390	3,339,684.240	
	TIFFANY & CO	21,556	43.690	941,781.640	
	TOLL BROTHERS INC	19,860	18.780	372,970.800	
	TORCHMARK CORP	14,060	45.840	644,510.400	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	25,113	14.500	364,138.500	
	DAVITA INC	16,373	61.670	1,009,722.910	
	TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	8,657	50.290	435,360.530	
	TYSON FOODS INC	50,331	16.670	839,017.770	
	URS CORP	15,202	46.620	708,717.240	
	MARATHON OIL CORP	118,303	29.170	3,450,898.510	



	UNION PACIFIC CORP	82,149	66.880	5,494,125.120	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	147,530	68.620	10,123,508.600	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	191,410	33.620	6,435,204.200	
	SPRINT NEXTEL CORP	492,322	3.280	1,614,816.160	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22,644	48.840	1,105,932.960	
	VF CORP	14,427	76.670	1,106,118.090	
	CBS CORP	95,580	13.200	1,261,656.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31,042	40.360	1,252,855.120	
	VULCAN MATERIALS CO	21,465	44.880	963,349.200	
	URBAN OUTFITTERS INC	20,008	31.790	636,054.320	
	WALGREEN CO	161,204	35.500	5,722,742.000	
	WAL-MART STORES INC	388,872	53.920	20,967,978.240	
	WASTE MANAGEMENT INC	73,725	32.920	2,427,027.000	
	WATERS CORP	15,070	59.310	893,801.700	
	WASHINGTON POST	984	420.300	413,575.200	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	18,684	39.610	740,073.240	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	21,209	58.670	1,244,332.030	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	76,353	62.060	4,738,467.180	
	WESTERN DIGITAL CORP	36,106	38.990	1,407,772.940	
	WEYERHAEUSER CO	33,344	42.040	1,401,781.760	
	WHIRLPOOL CORP	13,286	83.550	1,110,045.300	
	WYNN RESORTS LTD	13,470	63.350	853,324.500	
	WHOLE FOODS MARKET INC	24,228	34.620	838,773.360	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	26,208	18.600	487,468.800	
	CME GROUP INC	10,189	290.570	2,960,617.730	
	WILLIAMS COS INC	100,750	21.600	2,176,200.000	
	PEPCO HOLDINGS INC	41,153	17.060	702,070.180	
	ALLIANT ENERGY CORP	21,376	32.020	684,459.520	
	WISCONSIN ENERGY CORP	19,790	48.880	967,335.200	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,496	32.080	753,751.680	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	13,393	44.950	602,015.350	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	42,570	17.450	742,846.500	
	CARMAX INC	36,834	20.420	752,150.280	
	XEROX CORP	224,467	9.250	2,076,319.750	
	XILINX INC	45,536	25.910	1,179,837.760	
	YAHOO! INC	218,523	15.590	3,406,773.570	
	CIMAREX ENERGY CO	15,308	57.300	877,148.400	
	TJX COMPANIES INC	69,982	40.510	2,834,970.820	

	HOSPIRA INC	25,465	51.680	1,316,031.200	
	GENWORTH FINANCIAL INC	74,988	15.770	1,182,560.760	
	PETROHAWK ENERGY CORP	55,464	21.180	1,174,727.520	
	LIBERTY GLOBAL INC	23,697	26.500	627,970.500	
	REGIONS FINANCIAL CORP	210,030	6.640	1,394,599.200	
	GOOGLE INC	40,131	531.470	21,328,422.570	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	34,193	6.240	213,364.320	
	LAS VEGAS SANDS CORP	53,688	16.090	863,839.920	
	MOSAIC CO/THE	25,147	57.620	1,448,970.140	
	NEWS CORP CLASS B	77,650	15.920	1,236,188.000	
	NEWS CORP INC CLASS A	301,513	13.490	4,067,410.370	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	9,826	52.500	515,865.000	
	CELANESE CORP	26,654	30.970	825,474.380	
	WINDSTREAM CORP	70,959	10.200	723,781.800	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	21,632	44.840	969,978.880	
	IHS INC-CLASS A	8,935	51.610	461,135.350	
	DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	18,504	32.000	592,128.000	
	EXPEDIA INC	33,017	22.630	747,174.710	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,225	100.790	828,997.750	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	40,959	40.650	1,664,983.350	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	18,684	26.300	491,389.200	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	39,979	14.360	574,098.440	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	22,845	18.860	430,856.700	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,182	104.200	1,060,964.400	
	SUNPOWER CORP-CLASS A	7,319	18.730	137,084.870	
	VIACOM INC-CLASS B	90,706	29.450	2,671,291.700	
	MIRANT CORP	24,904	13.110	326,491.440	
	NYSE EURONEXT	42,731	26.030	1,112,287.930	
	VIRGIN MEDIA INC	51,631	15.470	798,731.570	
	MASTERCARD INC	16,123	221.750	3,575,275.250	
	LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	88,253	11.460	1,011,379.380	
	WESTERN UNION CO	120,281	16.000	1,924,496.000	
	SAIC INC	34,008	19.480	662,475.840	
	KBR INC	27,411	20.310	556,717.410	
	FIRST SOLAR INC	7,294	105.130	766,818.220	
	SPECTRA ENERGY CORP	108,353	21.720	2,353,427.160	
	TIME WARNER CABLE INC	58,676	46.240	2,713,178.240	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	56,524	15.730	889,122.520	

	TFS FINANCIAL CORP	14,755	12.980	191,519.900	
	DELTA AIR LINES INC	36,277	12.750	462,531.750	
	DISCOVER FINANCIAL	85,989	13.630	1,172,030.070	
	VMWARE INC	10,364	48.800	505,763.200	
	TERADATA CORP	31,125	30.110	937,173.750	
	CALPINE CORP NPR	60,758	11.240	682,919.920	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	321,186	49.830	16,004,698.380	
	VISA INC	74,791	85.630	6,404,353.330	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41,476	28.650	1,188,287.400	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	22.260	639,418.500	
	LORILLARD INC	28,287	75.740	2,142,457.380	
	SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	16,589	39.640	657,587.960	
	LENDER PROCESSING SERVICES	16,352	38.060	622,357.120	
	SUNPOWER CORP-CLASS B	9,542	16.260	155,152.920	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	26,102	28.130	734,249.260	
	CAREFUSION CORP	33,218	25.840	858,353.120	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	32,314	46.300	1,496,138.200	
	MADISON SQUARE GARDEN INC	10,028	18.970	190,231.160	
米ドル小計	銘柄数 : 577	52,689,840		1,691,793,252.970	
	組入時価比率 : 54.01%			(152,650,505,215)	
	合計時価比率 : 54.21%				
英ポンド	XSTRATA PLC	312,381	10.500	3,280,000.500	
	AMEC PLC	51,473	7.880	405,607.240	
	ANTOFAGASTA PLC	60,925	8.795	535,835.370	
	SEVERN TRENT PLC	37,248	11.450	426,489.600	
	BHP BILLITON PLC	364,916	20.035	7,311,092.060	
	BARCLAYS PLC	1,886,290	3.100	5,847,499.000	
	BALFOUR BEATTY PLC	107,252	2.692	288,722.380	
	AUTONOMY CORP PLC	35,740	15.390	550,038.600	
	BRITISH AIRWAYS PLC	81,025	2.096	169,828.400	
	BT GROUP PLC	1,278,130	1.161	1,483,908.930	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	182,526	5.385	982,902.510	
	TULLOW OIL PLC	146,552	12.010	1,760,089.520	
	BUNZL PLC	57,272	6.765	387,445.080	
	CABLE & WIRELESS PLC	429,358	1.373	589,508.530	
	CAPITA GROUP PLC	100,129	7.440	744,959.760	
	AVIVA PLC	455,850	3.759	1,713,540.150	

	DIAGEO PLC	407,490	10.660	4,343,843.400	
	SCHRODERS PLC	22,471	12.000	269,652.000	
	NATIONAL GRID PLC	393,308	6.445	2,534,870.060	
	LONMIN	22,925	18.230	417,922.750	
	KINGFISHER PLC	377,279	2.140	807,377.060	
	BAE SYSTEMS PLC	581,640	3.720	2,163,700.800	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	330,329	22.310	7,369,639.990	
	MAN GROUP PLC	271,583	2.284	620,295.570	
	COBHAM PLC	206,151	2.396	493,937.790	
	FIRSTGROUP PLC	95,476	3.589	342,663.360	
	NEXT PLC	35,239	18.500	651,921.500	
	REXAM PLC	145,186	2.798	406,230.420	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	165,386	20.440	3,380,489.840	
	JOHNSON MATTHEY PLC	39,333	15.600	613,594.800	
	SABMILLER PLC	155,398	17.330	2,693,047.340	
	ANGLO AMERICAN PLC	216,704	23.850	5,168,390.400	
	COMPASS GROUP PLC	316,020	4.841	1,529,852.820	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,880,336	7.178	20,675,051.800	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	926,531	0.766	709,722.740	
	CENTRICA PLC	862,217	2.721	2,346,092.450	
	UNILEVER PLC	209,328	19.370	4,054,683.360	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	338,051	2.994	1,012,124.690	
	INTL POWER PLC	230,321	3.263	751,537.420	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,002	5.355	615,835.710	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	533,353	1.318	702,959.250	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	60,197	9.460	569,463.620	
	PEARSON PLC	138,760	8.965	1,243,983.400	
	PRUDENTIAL PLC	413,667	6.100	2,523,368.700	
	RIO TINTO PLC	227,135	33.625	7,637,414.370	
	VODAFONE GROUP PLC	8,750,577	1.410	12,338,313.570	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	98,809	34.270	3,386,184.430	
	REED ELSEVIER PLC	195,942	4.861	952,474.060	
	OLD MUTUAL PLC	851,180	1.116	949,916.880	
	ROLLS ROYCE GROUP	316,259	5.375	1,699,892.120	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,962,159	0.361	1,069,339.390	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	153,236	11.280	1,728,502.080	
	SERCO GROUP PLC	91,299	5.300	483,884.700	
	BP PLC	3,114,930	5.763	17,951,341.590	

	SAGE GROUP PLC(THE)	235,928	2.336	551,127.800	
	INVENSYS PLC	136,685	3.199	437,255.310	
	SMITHS GROUP PLC	60,962	10.300	627,908.600	
	STANDARD CHARTERED PLC	330,970	15.575	5,154,857.750	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,295,165	0.534	3,361,618.110	
	BG GROUP PLC	552,667	11.640	6,433,043.880	
	CARPHONE WAREHOUSE GROUP PLC	85,912	1.871	160,741.350	
	TESCO PLC	1,309,848	4.224	5,532,797.950	
	3I GROUP PLC	144,594	2.693	389,391.640	
	TOMKINS PLC	145,057	1.880	272,707.160	
	SMITH & NEPHEW PLC	149,155	6.735	1,004,558.920	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	864,970	12.065	10,435,863.050	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	27,822	6.610	183,903.420	
	WOLSELEY PLC	47,674	15.790	752,772.460	
	ASTRAZENECA PLC	239,910	28.175	6,759,464.250	
	WHITBREAD PLC	27,936	14.090	393,618.240	
	CARNIVAL PLC	28,280	24.290	686,921.200	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	275,075	3.282	902,796.150	
	BURBERRY GROUP PLC	78,187	6.275	490,623.420	
	INVESTEC PLC	64,219	4.469	286,994.710	
	CAIRN ENERGY	243,410	3.392	825,646.720	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	42,614	9.085	387,148.190	
	VEDANTA RESOURCES PLC	22,500	25.350	570,375.000	
	ICAP PLC	101,626	3.245	329,776.370	
	SAINSBURY (J) PLC	188,748	3.323	627,209.600	
	G4S PLC	185,918	2.702	502,350.430	
	ADMIRAL GROUP PLC	28,516	12.100	345,043.600	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	589,459	17.880	10,539,526.920	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	447,693	17.210	7,704,796.530	
	INMARSAT PLC	67,257	7.215	485,259.250	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	13.320	454,664.880	
	DRAX GROUP PLC	53,749	3.985	214,189.760	
	STANDARD LIFE PLC	351,379	1.933	679,215.600	
	HOME RETAIL GROUP	142,584	2.576	367,296.380	
	EXPERIAN PLC	179,126	6.215	1,113,268.090	
	THOMAS COOK GROUP PLC	129,781	2.288	296,938.920	
	TUI TRAVEL PLC	96,617	2.607	251,880.510	

	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	44,279	10.310	456,516.490	
	FRESNILLO PLC NPR	32,309	7.570	244,579.130	
	RESOLUTION LTD	382,893	0.735	281,426.350	
	SHIRE PLC	92,078	13.650	1,256,864.700	
	WPP PLC	207,213	5.940	1,230,845.220	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	13,898	45.780	636,250.440	
	PETROFAC LTD	34,869	10.310	359,499.390	
英ポンド小計	銘柄数 : 98	47,651,940		218,666,517.700	
	組入時価比率 : 10.75%			(30,379,339,304)	
	合計時価比率 : 10.79%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	24,850	58.530	1,454,470.500	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	19,964	19.650	392,292.600	
	BARRICK GOLD CORP	162,330	38.710	6,283,794.300	
	TMX GROUP INC	12,123	29.150	353,385.450	
	TALISMAN ENERGY INC	177,246	18.890	3,348,176.940	
	BANK OF MONTREAL	90,894	54.450	4,949,178.300	
	BANK OF NOVA SCOTIA	167,008	47.220	7,886,117.760	
	NATIONAL BANK OF CANADA	26,121	58.610	1,530,951.810	
	BCE INC	42,327	29.170	1,234,678.590	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	85,684	24.040	2,059,843.360	
	BIOVAIL CORP	28,909	15.290	442,018.610	
	BOMBARDIER INC 'B'	260,129	5.480	1,425,506.920	
	SAPUTO INC	24,714	29.690	733,758.660	
	RESEARCH IN MOTION LTD	84,601	73.970	6,257,935.970	
	CGI GROUP INC	52,356	14.860	778,010.160	
	CAE INC	50,233	8.940	449,083.020	
	CAMECO CORP	69,110	29.770	2,057,404.700	
	ROGERS COMM-CL B	79,061	34.250	2,707,839.250	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	63,806	67.820	4,327,322.920	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	94,308	71.300	6,724,160.400	
	NEXEN INC	80,732	23.320	1,882,670.240	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	13,933	52.760	735,105.080	
	CANADIAN UTILITIES LTD	14,386	44.230	636,292.780	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	78,224	55.410	4,334,391.840	
	GERDAU AMERISTEEL CORP	34,333	7.890	270,887.370	
	AGRIUM INC	25,945	66.570	1,727,158.650	
	YAMANA GOLD INC	130,637	10.640	1,389,977.680	

	GILDAN ACTIVEWEAR INC	22,071	24.750	546,257.250	
	OPEN TEXT CORP	11,415	50.610	577,713.150	
	ELDORADO GOLD CORP	94,338	12.650	1,193,375.700	
	EMPIRE CO LTD	5,722	48.580	277,974.760	
	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	20,103	14.800	297,524.400	
	KINROSS GOLD CORP	111,239	18.510	2,059,033.890	
	FINNING INTERNATIONAL INC	35,231	17.460	615,133.260	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	16,791	21.910	367,890.810	
	FORTIS INC	31,331	27.380	857,842.780	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,428	78.640	977,337.920	
	TELUS CORP-NON VOTE	32,914	32.730	1,077,275.220	
	GREAT WEST LIFECO INC	47,008	27.180	1,277,677.440	
	IAMGOLD CORP	55,305	14.660	810,771.300	
	IMPERIAL OIL LTD	49,642	39.270	1,949,441.340	
	ENBRIDGE INC	59,958	46.270	2,774,256.660	
	IGM FINANCIAL INC	19,491	42.510	828,562.410	
	IVANHOE MINES LTD/CA	43,340	16.480	714,243.200	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	290,565	19.410	5,639,866.650	
	LOBLAW CO LTD	18,293	37.310	682,511.830	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	13,259	33.300	441,524.700	
	MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	18,156	60.410	1,096,803.960	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	94,665	30.250	2,863,616.250	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,249	369.000	1,198,881.000	
	INMET MINING CORPORATION	9,308	59.050	549,637.400	
	METRO INC	19,905	41.010	816,304.050	
	HUSKY ENERGY INC	43,719	27.150	1,186,970.850	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,121	38.720	1,398,605.120	
	NIKO RESOURCES LTD	8,304	99.840	829,071.360	
	ONEX CORP	17,569	25.250	443,617.250	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	15,209	21.650	329,274.850	
	GOLDCORP INC	122,145	38.360	4,685,482.200	
	PETROBANK ENERGY & RESOURCES LTD	15,008	54.100	811,932.800	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	48,911	114.200	5,585,636.200	
	POWER CORP OF CANADA	61,603	29.600	1,823,448.800	
	POWER FINANCIAL CORP	43,069	31.400	1,352,366.600	
	ROYAL BANK OF CANADA	236,798	56.070	13,277,263.860	

	SNC-LAVALIN GROUP INC	25,493	50.020	1,275,159.860	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	27,956	51.170	1,430,508.520	
	SHAW COMM INC-B	57,931	19.860	1,150,509.660	
	SHERRITT INTERNATIONAL CORP	56,295	6.910	388,998.450	
	SINO-FOREST CORP	38,059	19.750	751,665.250	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	37,326	44.620	1,665,486.120	
	SUNCOR ENERGY INC	259,019	30.700	7,951,883.300	
	TRICAN WELL SERVICE LTD	21,775	13.800	300,495.000	
	ENCANA CORP	131,214	34.010	4,462,588.140	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	82,322	38.330	3,155,402.260	
	THOMSON REUTERS CORP	65,577	36.380	2,385,691.260	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	144,045	66.250	9,542,981.250	
	TRANSCANADA CORP	114,737	35.190	4,037,595.030	
	TRANSALTA CORP	36,501	23.210	847,188.210	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,625	70.510	678,658.750	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	33,251	12.320	409,652.320	
	INTACT FINANCIAL CORP	21,394	42.000	898,548.000	
	SILVER WHEATON CORP	49,901	15.380	767,477.380	
	VITERRA INC NPR	69,224	9.610	665,242.640	
	GROUPE AEROPLAN INC	40,881	11.640	475,854.840	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,995	27.060	541,064.700	
	CI FINANCIAL CORP	26,566	21.300	565,855.800	
	PETROBAKKEN ENERGY LTD	14,658	27.720	406,319.760	
	TIM HORTONS INC	30,037	32.020	961,784.740	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	128,348	25.560	3,280,574.880	
カナダドル小計	銘柄数 : 88	5,320,277		177,584,727.200	
	組入時価比率 : 5.38%			(15,219,011,121)	
	合計時価比率 : 5.41%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	33,938	11.980	406,577.240	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	184,496	47.500	8,763,560.000	
	SYNGENTA AG	15,289	281.500	4,303,853.500	
	LOGITECH INTL-REG	27,879	16.860	470,039.940	
	SYNTHES INC	10,626	126.500	1,344,189.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	575,869	53.500	30,808,991.500	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	86,402	35.860	3,098,375.720	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	116,462	179.400	20,893,282.800	



	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12,366	85.000	1,051,110.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	916	1,422.000	1,302,552.000	
	SWISS RE-REG	55,749	48.200	2,687,101.800	
	NOVARTIS AG-REG SHS	349,839	59.100	20,675,484.900	
	BALOISE HOLDING AG -R	7,799	91.100	710,488.900	
	SWISSCOM AG-REG	3,688	371.600	1,370,460.800	
	ABB LTD	361,556	21.510	7,777,069.560	
	ADECCO SA-REG	18,811	53.500	1,006,388.500	
	GEBERIT AG	6,735	183.400	1,235,199.000	
	LONZA GROUP AG-REG	7,731	82.250	635,874.750	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	2,169.000	297,153.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	19	24,655.000	468,445.000	
	UBS AG-REGISTERED	583,232	14.730	8,591,007.360	
	GIVAUDAN-REG	1,340	862.000	1,155,080.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	24,233	256.400	6,213,341.200	
	HOLCIM LTD-REG	40,369	71.200	2,874,272.800	
	ACTELION	18,422	55.000	1,013,210.000	
	SONOVA HOLDING AG	7,380	133.700	986,706.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	9,745	97.750	952,573.750	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,476	264.000	389,664.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,702	298.200	1,402,136.400	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	8,840	56.800	502,112.000	
	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	21,408	28.360	607,130.880	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,952	135.900	672,976.800	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	4,757	85.750	407,912.750	
	ARYZTA AG	13,689	40.450	553,720.050	
	JULIUS BAER GROUP LTD	33,938	33.950	1,152,195.100	
スイスフラン小計	銘柄数 : 35	2,654,790		136,780,237.000	
	組入時価比率 : 4.04%			(11,407,471,766)	
	合計時価比率 : 4.05%				
スウェーデンクローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	13,640	600.000	8,184,000.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	103,093	100.300	10,340,227.900	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	77,819	91.800	7,143,784.200	
	ERICSSON LM-B SHS	486,681	71.150	34,627,353.150	
	GETINGE AB-B SHS	31,028	165.300	5,128,928.400	
	SKF AB-B SHS	60,871	113.000	6,878,423.000	
	SANDVIK AB	164,125	77.650	12,744,306.250	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	261,948	42.120	11,033,249.760	
	SKANSKA AB-B SHS	63,818	117.600	7,504,996.800	
	SWEDBANK AB	99,558	65.900	6,560,872.200	
	SSAB AB-B	17,621	108.800	1,917,164.800	
	SSAB AB-A	31,558	119.800	3,780,648.400	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	89,328	105.800	9,450,902.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	81,573	192.100	15,670,173.300	
	VOLVO AB-A SHS	87,842	59.900	5,261,735.800	
	VOLVO AB-B SHS	153,836	60.400	9,291,694.400	
	HOLMEN AB-B SHS	6,883	177.000	1,218,291.000	
	SCANIA AB	54,641	98.400	5,376,674.400	
	SWEDISH MATCH AB	42,045	160.800	6,760,836.000	
	TELE2 AB-B SHS	46,212	106.500	4,921,578.000	
	NORDEA AB	533,890	69.200	36,945,188.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	151.100	5,830,042.400	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	76.350	4,050,749.250	
	INVESTOR AB-B SHS	73,072	125.400	9,163,228.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	86,214	431.800	37,227,205.200	
	ASSA ABLOY AB-B	51,680	135.000	6,976,800.000	
	TELIASONERA AB	379,136	49.600	18,805,145.600	
	LUNDIN PETROLEUM AB	49,159	54.000	2,654,586.000	
	ALFA LAVAL AB	58,635	100.900	5,916,271.500	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,130	47.100	3,444,423.000	
スウェーデンク ローネ小計	銘柄数 : 30	3,370,675		304,809,479.910	
	組入時価比率 : 1.35%			(3,813,166,594)	
	合計時価比率 : 1.35%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	53,424	9.920	529,966.080	
	OMV AG	25,270	29.320	740,916.400	
	OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	12,240	29.800	364,752.000	
	VOEST-ALPINE AG	19,157	26.540	508,426.780	
	ERSTE GROUP BANK AG	32,181	28.150	905,895.150	
	IMMOEAST AG	63,435	3.560	225,828.600	
	RAIFFEISEN INT'L BANK	9,099	33.300	302,996.700	
	VIENNA INSURANCE GROUP	8,483	35.430	300,552.690	
	UMICORE	19,625	22.260	436,852.500	
	DELHAIZE GROUP	17,375	57.330	996,108.750	

	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	28,558	32.990	942,128.420	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	119,921	37.020	4,439,475.420	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.005	197.040	
	SOLVAY SA	9,576	70.590	675,969.840	
	MOBISTAR SA	4,634	43.000	199,262.000	
	FORTIS	354,785	2.530	897,606.050	
	UCB SA	18,616	32.550	605,950.800	
	COLRUYT NV	2,444	181.600	443,830.400	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,906	65.100	840,180.600	
	GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.010	5.160	
	DEXIA	78,609	4.033	317,030.090	
	BELGACOM SA	25,126	26.395	663,200.770	
	NATIONALE A PORTEFEUILLE	6,077	36.705	223,056.280	
	BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD NPR	93,131	4.400	409,776.400	
	ADIDAS AG	31,057	36.300	1,127,369.100	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	60,576	29.485	1,786,083.360	
	COMMERZBANK AG	113,034	5.480	619,426.320	
	FRESENIUS AG	4,536	46.990	213,146.640	
	UNITED INTERNET	16,729	11.310	189,204.990	
	MAN SE	16,568	52.970	877,606.960	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	10,621	32.780	348,156.380	
	GEA GROUP AG	23,382	13.720	320,801.040	
	FRESENIUS SE	12,538	51.180	641,694.840	
	DEUTSCHE POST AG-REG	141,215	12.065	1,703,758.970	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	14,421	36.550	527,087.550	
	MERCK KGAA	10,090	58.750	592,787.500	
	RWE AG	69,108	63.310	4,375,227.480	
	RWE AG-N VTG PFD	6,189	58.800	363,913.200	
	SAP AG	141,784	32.700	4,636,336.800	
	E.ON AG	315,512	26.475	8,353,180.200	
	HENKEL AG & CO KGAA	24,609	31.660	779,120.940	
	METRO AG	18,358	38.360	704,212.880	
	SIEMENS AG-REG	136,699	64.170	8,771,974.830	
	PUMA AG	738	207.250	152,950.500	
	BAYER AG	137,231	50.000	6,861,550.000	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,890	36.350	1,013,801.500	
	DAIMLER AG	149,030	30.945	4,611,733.350	

	BASF SE	151,675	40.655	6,166,347.120	
	CELESIO AG	13,447	21.150	284,404.050	
	BEIERSDORF AG	14,698	44.435	653,105.630	
	HOCHTIEF AG	7,332	52.330	383,683.560	
	HEIDELBERGCEMENT AG	24,275	38.500	934,587.500	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	33,246	38.680	1,285,955.280	
	ALLIANZ SE	75,059	82.080	6,160,842.720	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,098	10.920	405,110.160	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	32,262	113.100	3,648,832.200	
	SALZGITTER	6,089	64.870	394,993.430	
	VOLKSWAGEN AG	6,940	65.200	452,488.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	18,171	61.660	1,120,423.860	
	THYSSENKRUPP AG	54,246	23.040	1,249,827.840	
	TUI AG	18,532	7.065	130,928.580	
	LINDE AG	25,854	82.210	2,125,457.340	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	97,674	46.540	4,545,747.960	
	K & S	27,554	44.555	1,227,668.470	
	SUEDZUCKER AG	13,153	17.495	230,111.730	
	SOLARWORLD AG	14,050	10.745	150,967.250	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	469,952	9.520	4,473,943.040	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	188,391	4.037	760,534.460	
	DEUTSCHE BOERSE AG	32,729	51.160	1,674,415.640	
	FRAPORT AG	5,722	37.130	212,457.860	
	DEUTSCHE POSTBANK AG	14,493	22.730	329,425.890	
	WACKER-CHEMIE GMBH	2,443	90.400	220,847.200	
	IBERIA	112,063	2.249	252,029.680	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	45,228	13.720	620,528.160	
	IBERDROLA SA	596,568	5.900	3,519,751.200	
	INDRA SISTEMAS SA	18,259	14.515	265,029.380	
	GAMESA	26,875	9.881	265,551.870	
	REPSOL YPF SA	122,266	16.600	2,029,615.600	
	TELEFONICA S.A	699,330	17.000	11,888,610.000	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,259	33.195	772,082.500	
	BANKINTER S.A.	41,581	5.966	248,072.240	
	ACERINOX SA	23,563	12.890	303,727.070	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	580,041	9.580	5,556,792.780	
	SACYR VALLEHERMOSO	15,197	6.050	91,941.850	

	ACCIONA S.A.	4,945	80.680	398,962.600	
	GAS NATURAL SDG SA	37,078	13.380	496,103.640	
	BANCO DEVALENCIA	42,034	4.700	197,559.800	
	BANCO SANTANDER SA	1,348,688	9.350	12,610,232.800	
	RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	19,902	36.125	718,959.750	
	ZARDOYA OTIS	21,819	13.580	296,302.020	
	FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA	5,160	24.445	126,136.200	
	BANCO POPULAR ESPANOL	152,469	4.776	728,191.940	
	BANCO SABADELL	141,789	3.561	504,910.620	
	INDITEX	36,513	42.985	1,569,511.300	
	MAPFRE SA	108,217	2.630	284,610.710	
	ENAGAS	28,703	15.085	432,984.750	
	GESTEVISION TELECINCO SA	14,976	9.650	144,518.400	
	GRIFOLS SA	22,114	11.000	243,254.000	
	FERROVIAL SA	76,251	6.705	511,262.950	
	CRITERIA CAIXACORP SA	149,185	3.269	487,685.760	
	IBERDROLA RENOVABLES	129,546	3.080	399,001.680	
	EDP RENOVAVEIS SA	38,800	5.980	232,024.000	
	KESKO OYJ-B	13,710	26.490	363,177.900	

[前](#) [次](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	WARTSILA OYJ	14,464	34.940	505,372.160	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	19,134	18.370	351,491.580	
	OUTOKUMPU OYJ	16,671	12.850	214,222.350	
	RAUTARUUKKI OYJ	14,482	14.070	203,761.740	
	UPM-KYMMENE OYJ	89,535	7.890	706,431.150	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	98,362	4.613	453,743.900	
	SAMPO OYJ-A SHS	66,956	17.530	1,173,738.680	
	FORTUM OYJ	70,769	19.080	1,350,272.520	
	NOKIA OYJ	623,566	9.835	6,132,771.610	
	POHJOLA BANK PLC	23,199	8.040	186,519.960	
	ELISA CORP	25,436	15.300	389,170.800	
	METSO OYJ	21,922	22.910	502,233.020	
	SANOMA OYJ	12,269	15.040	184,525.760	
	NESTE OIL OYJ	24,686	10.810	266,855.660	
	KONE OYJ	24,473	30.970	757,928.810	
	ORION OYJ	13,200	16.340	215,688.000	
	AIR LIQUIDE	41,281	84.450	3,486,180.450	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	66,904	14.735	985,830.440	
	ERAMET	710	222.750	158,152.500	
	AXA	279,448	14.900	4,163,775.200	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	64,229	24.265	1,558,516.680	
	DANONE	89,548	43.200	3,868,473.600	
	SAFRAN SA	30,548	15.050	459,747.400	
	ACCOR SA	25,726	37.100	954,434.600	
	BOUYGUES	38,533	34.235	1,319,177.250	
	BNP PARIBAS	157,105	52.900	8,310,854.500	
	THALES SA	14,934	29.000	433,086.000	
	CAP GEMINI SA	22,923	34.115	782,018.140	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	9,379	59.400	557,112.600	
	CHRISTIAN DIOR	10,461	72.250	755,807.250	
	COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	24,734	18.260	451,642.840	
	ALCATEL-LUCENT	364,152	2.221	808,781.590	
	NATIXIS	145,960	3.627	529,396.920	
	EIFFAGE	6,803	36.490	248,241.470	

	PUBLICIS GROUPE	19,130	28.475	544,726.750	
	IMERYSA SA	5,944	37.700	224,088.800	
	LAFARGE SA	33,257	47.945	1,594,506.860	
	L'OREAL	40,036	76.020	3,043,536.720	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	40,290	78.700	3,170,823.000	
	LAGARDERE S.C.A.	21,365	26.700	570,445.500	
	MICHELIN(CGDE)-B	24,430	51.200	1,250,816.000	
	PERNOD-RICARD	33,184	56.660	1,880,205.440	
	PEUGEOT SA	25,815	19.490	503,134.350	
	RENAULT SA	29,814	30.900	921,252.600	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	64,737	33.105	2,143,118.380	
	SOCIETE GENERALE-A	103,748	40.240	4,174,819.520	
	VINCI S.A.	70,324	38.280	2,692,002.720	
	SODEXO	15,581	43.060	670,917.860	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	37,959	79.280	3,009,389.520	
	VIVENDI SA	199,165	18.550	3,694,510.750	
	TECHNIP-COFLEXIPS.A.	17,197	52.610	904,734.170	
	TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	21,519	11.570	248,974.830	
	TOTAL SA	352,177	41.795	14,719,237.710	
	AIR FRANCE	24,369	9.936	242,130.380	
	VALLOUREC	9,277	139.000	1,289,503.000	
	FRANCE TELECOM SA	306,567	16.845	5,164,121.110	
	HERMES INTL	8,835	97.860	864,593.100	
	BIC	4,918	52.930	260,309.740	
	DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	41.935	413,562.970	
	PPR	12,233	81.550	997,601.150	
	CNP ASSURANCES	5,609	66.480	372,886.320	
	NEOPOST SA	4,710	58.020	273,274.200	
	CARREFOUR SA	103,478	33.825	3,500,143.350	
	ATOS ORIGIN	6,851	34.020	233,071.020	
	SANOFI-AVENTIS	175,275	53.920	9,450,828.000	
	STMICROELECTRONICS NV	109,561	6.334	693,959.370	
	M6-METROPOLE TELEVISION	9,651	18.490	178,446.990	
	EURAZEO	5,778	47.700	275,610.600	
	JC DECAUX INTERNATIONAL	9,237	18.330	169,314.210	
	ESSILOR INTL	34,399	44.020	1,514,243.980	
	CREDIT AGRICOLE SA	157,307	10.520	1,654,869.640	
	ILIAD SA	2,768	78.210	216,485.280	

	BIOMERIEUX	2,078	79.570	165,346.460	
	PAGESJAUNES GROUPE SA	24,382	8.250	201,151.500	
	GDF SUEZ	206,494	27.470	5,672,390.180	
	ALSTOM	34,001	47.800	1,625,247.800	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	24.805	432,847.250	
	ELECTRICITE DE FRANCE	38,661	37.605	1,453,846.900	
	IPSEN SA	4,885	38.250	186,851.250	
	LEGRAND SA	18,550	22.605	419,322.750	
	ADP	5,321	57.640	306,702.440	
	SCOR SE	26,944	17.690	476,639.360	
	BUREAU VERITAS SA	9,960	37.120	369,715.200	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	43,144	16.115	695,265.560	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	BANK OF PIRAEUS	45,431	6.100	277,129.100	
	ALPHA BANK A.E.	86,513	6.850	592,614.050	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	33,763	17.750	599,293.250	
	NATIONAL BANK OF GREECE	104,112	13.900	1,447,156.800	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	8,042	17.800	143,147.600	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	43,132	8.900	383,874.800	
	EFG EUROBANK ERGASIAS	54,995	5.840	321,170.800	
	GREEK ORGANIZATION OF FOOTBALL	37,174	15.450	574,338.300	
	PUBLIC POWER CORP	21,485	11.150	239,557.750	
	MARFIN INVESTMENT GROUP SA	94,560	1.780	168,316.800	
	MARFIN INVESTMENT GROUP SA RTS	94,560	0.010	945.600	
	CRH PLC	119,080	17.280	2,057,702.400	
	KERRY GROUP PLC-A	26,668	23.530	627,498.040	
	ELAN CORPORATION PLC	92,721	5.000	463,605.000	
	ANGLO IRISH BANK CORP	91,316	0.130	11,871.080	
	ASSICURAZIONI GENERALI	192,352	16.740	3,219,972.480	
	BANCA POPOLARE DI MILANO	60,971	4.352	265,345.790	
	INTESA SANPAOLO	1,266,969	2.610	3,306,789.090	
	INTESA SANPAOLO-RNC	137,310	2.000	274,620.000	
	UNICREDIT SPA	2,693,548	1.895	5,104,273.460	
	ENI SPA	430,992	16.820	7,249,285.440	
	MEDIOBANCA SPA	72,798	7.815	568,916.370	
	PIRELLI & C	587,589	0.386	226,809.350	



	SAIPEM	45,289	24.380	1,104,145.820	
	LUXOTTICA GROUP SPA	20,352	18.940	385,466.880	
	MEDIASET SPA	130,650	5.660	739,479.000	
	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA	83,831	0.827	69,328.230	
	AUTOGRILL SPA	17,657	9.250	163,327.250	
	A2A SPA	238,091	1.278	304,280.290	
	MEDIOLANUM SPA	32,441	4.135	134,143.530	
	FIAT SPA	122,538	7.900	968,050.200	
	ENEL SPA	1,079,856	3.982	4,299,986.590	
	FINMECCANICA SPA	72,617	9.530	692,040.010	
	ITALCEMENTI SPA	14,012	8.085	113,287.020	
	FONDIARIA - SAI ORD	7,966	10.850	86,431.100	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	336,391	1.094	368,011.750	
	SNAM RETE GAS	240,728	3.445	829,307.960	
	BANCA CARIGE SPA	120,506	1.868	225,105.200	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	99,133	9.105	902,605.960	
	TELECOM ITALIA SPA	1,629,855	1.090	1,776,541.950	
	TELECOM ITALIA-RNC	1,024,637	0.812	832,005.240	
	ATLANTIA SPA	42,404	17.210	729,772.840	
	TERNA SPA	239,939	2.995	718,617.300	
	EXOR SPA	8,976	11.320	101,608.320	
	PARMALAT SPA	273,300	1.813	495,492.900	
	PRYSMIAN SPA	18,375	12.870	236,486.250	
	BANCO POPOLARE SPA	102,590	4.622	474,170.980	
	ARCELOR MITTAL (NL)	141,513	28.385	4,016,846.500	
	TENARIS SA	79,290	17.040	1,351,101.600	
	SES FDR	46,821	17.550	821,708.550	
	<i>BOSKALIS WESTMINSTER CT</i>	12,092	23.920	289,240.640	
	REED ELSEVIER NV	119,718	8.405	1,006,229.790	
	KONINKLIJKE DSM NV	25,452	30.975	788,375.700	
	SBM OFFSHORE NV	31,787	13.465	428,011.950	
	ING GROEP NV-CVA	599,014	6.760	4,049,334.640	
	RANDSTAD HOLDINGS	16,507	30.780	508,085.460	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	198,756	8.950	1,778,866.200	
	HEINEKEN NV	39,572	35.785	1,416,084.020	
	AKZO NOBEL	39,244	37.910	1,487,740.040	
	ASML HOLDING NV	73,668	22.840	1,682,577.120	

	AEGON NV	249,086	4.401	1,096,227.480	
	TNT NV	64,713	19.020	1,230,841.260	
	UNILEVER NV-CVA	270,129	22.555	6,092,759.590	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	158,774	21.700	3,445,395.800	
	WOLTERS KLUWER-CVA	45,768	14.600	668,212.800	
	QIAGEN N.V.	38,295	15.850	606,975.750	
	VOPAK (KON.)	6,484	53.100	344,300.400	
	KONINKLIJKE KPN NV	275,732	11.650	3,212,277.800	
	HEINEKEN HOLDING NV-A	18,770	29.610	555,779.700	
	FUGRO CERT	11,731	43.050	505,019.550	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	83,470	3.668	306,167.960	
	CIMPOR-CIMENTOS	36,205	5.550	200,937.750	
	JERONIMO MARTINS	29,781	6.981	207,901.160	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	103,431	7.714	797,866.730	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	288,478	2.748	792,737.540	
	BRISA	33,394	6.000	200,364.000	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	395,217	0.724	286,137.100	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	31,159	11.820	368,299.380	
ユーロ小計	銘柄数 : 266	29,724,038		365,897,133.030	
	組入時価比率 : 15.80%			(44,646,768,172)	
	合計時価比率 : 15.86%				
デンマーククローネ	CARLSBERG AS-B	18,542	411.100	7,622,616.200	
	A P MOLLER A/S	202	43,100.000	8,706,200.000	
	AP MOLLER MAERSK A	108	41,030.000	4,431,240.000	
	DANSKE BANK A/S	78,631	125.400	9,860,327.400	
	NOVOZYMES-B SHS	7,782	559.500	4,354,029.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	70,873	391.000	27,711,343.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	32,544	283.200	9,216,460.800	
	TOPDANMARK A/S	2,455	649.000	1,593,295.000	
	COLOPLAST-B	4,546	622.000	2,827,612.000	
	DSV A/S	32,958	86.450	2,849,219.100	
	WILLIAM DEMANT	3,754	390.000	1,464,060.000	
	H LUNDBECK A/S	11,034	98.800	1,090,159.200	
	TRYGVESTA AS	4,588	320.900	1,472,289.200	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 13	268,017		83,198,850.900	
	組入時価比率 : 0.48%			(1,364,461,155)	

	合計時価比率： 0.48%				
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	48,702	129.000	6,282,558.000	
	DNB HOLDING ASA	145,088	64.550	9,365,430.400	
	NORSK HYDRO ASA	124,675	40.770	5,082,999.750	
	TELENOR ASA	141,077	74.450	10,503,182.650	
	ORKLA ASA	132,943	46.290	6,153,931.470	
	STATOIL ASA	179,562	135.400	24,312,694.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	31,516	244.300	7,699,358.800	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	55,856	20.860	1,165,156.160	
ノルウェークローネ小計	銘柄数： 8	859,419		70,565,312.030	
	組入時価比率： 0.38%			(1,071,887,090)	
	合計時価比率： 0.38%				
香港ドル	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	99,000	12.340	1,221,660.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	121,000	23.750	2,873,750.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	46,000	56.600	2,603,600.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	591,000	3.550	2,098,050.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	303,000	8.600	2,605,800.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	340,000	28.950	9,843,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	239,860	27.850	6,680,101.000	
	CLP HOLDINGS LTD	346,000	53.500	18,511,000.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	113,500	22.450	2,548,075.000	
	PCCW LTD	893,000	2.130	1,902,090.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	227,000	14.080	3,196,160.000	
	LI & FUNG LTD	358,200	35.750	12,805,650.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	230,000	94.600	21,758,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	75,000	30.050	2,253,750.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	168,200	130.600	21,966,920.000	
	MTR CORP	246,000	26.950	6,629,700.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	188,237	55.750	10,494,212.750	
	HANG LUNG GROUP LTD	137,000	38.050	5,212,850.000	
	HANG SENG BANK LTD	122,900	112.500	13,826,250.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	190,000	52.150	9,908,500.000	
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	237,500	43.650	10,366,875.000	
	(THE) WHARF HOLDINDS LTD	237,750	39.550	9,403,012.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	650,943	17.400	11,326,408.200	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	363,000	55.900	20,291,700.000	

	HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	20.800	1,830,400.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	106,000	36.550	3,874,300.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	603,000	17.940	10,817,820.000	
	NWS HOLDINGS LTD	112,000	13.340	1,494,080.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	463,800	13.980	6,483,924.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	13.000	2,990,000.000	
	SINO LANDCO	244,000	13.920	3,396,480.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	235,000	107.200	25,192,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	125,500	86.350	10,836,925.000	
	TELEVISION BROADCASTS LTD	40,000	35.900	1,436,000.000	
	WING HANG BANK LTD	26,500	67.200	1,780,800.000	
	WHEELOCK & CO LTD	154,000	21.650	3,334,100.000	
	ASM PACIFIC TECH	26,400	69.250	1,828,200.000	
	SANDS CHINA LTD	320,000	10.600	3,392,000.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 38	9,298,290		289,014,143.450	
	組入時価比率 : 1.19%			(3,358,344,347)	
	合計時価比率 : 1.19%				
シンガポール・ドル	GENTING SINGAPORE PLC	716,400	0.940	673,416.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,214,640	0.550	668,052.000	
	SINGAPORE TECH ENG	231,000	3.100	716,100.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	201,000	3.640	731,640.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.720	970,920.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	285,000	14.040	4,001,400.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	94,000	10.320	970,080.000	
	SEMBCORP MARINE	123,000	3.730	458,790.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	244,000	1.240	302,560.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	23,000	25.240	580,520.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	155,000	7.740	1,199,700.000	
	CAPITALAND LTD	416,000	3.790	1,576,640.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	169,500	4.140	701,730.000	
	KEPPEL CORP LTD	219,000	8.390	1,837,410.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	287,000	1.560	447,720.000	
	NEPTUNE ORIENT	127,750	1.800	229,950.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	284,200	3.110	883,862.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	397,200	8.570	3,404,004.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,350,867	3.040	4,106,635.680	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	92,400	14.940	1,380,456.000	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	206,000	18.600	3,831,600.000	
	STARHUB LTD	86,000	2.150	184,900.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	164,800	2.510	413,648.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	213,000	6.500	1,384,500.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	278,000	1.140	316,920.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	215,000	2.260	485,900.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 26	8,054,757		32,459,053.680	
	組入時価比率 : 0.74%			(2,078,028,617)	
	合計時価比率 : 0.74%				
オーストラリアドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	413,323	22.520	9,308,033.960	
	AMCOR LTD	203,274	6.040	1,227,774.960	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	488,273	25.760	12,577,912.480	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	208,898	4.700	981,820.600	
	TELSTRA CORP LTD	696,226	2.960	2,060,828.960	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	54,360	10.030	545,230.800	
	AMP LTD	325,294	5.990	1,948,511.060	
	ASX LTD	28,239	36.610	1,033,829.790	
	BHP BILLITON LTD	556,721	40.880	22,758,754.480	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	21,232	10.190	216,354.080	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	72,412	3.710	268,648.520	
	COMPUTERSHARE LT	76,498	11.930	912,621.140	
	CSL LIMITED	100,221	34.590	3,466,644.390	
	TRANSURBAN GROUP	194,024	5.270	1,022,506.480	
	COCA-COLA AMATIL LTD	90,830	11.020	1,000,946.600	
	COCHLEAR LTD	8,540	64.220	548,438.800	
	ORIGIN ENERGY LTD	150,239	16.800	2,524,015.200	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	252,366	54.000	13,627,764.000	
	BORAL LIMITED	87,034	5.460	475,205.640	
	RIO TINTO LIMITED	71,951	70.400	5,065,350.400	
	CSR LIMITED	224,708	1.650	370,768.200	
	ARISTOCRAT LEISU	57,018	4.200	239,475.600	
	ARROW ENERGY LTD/AUSTRALIA NPR	116,718	3.480	406,178.640	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,313	3.950	1,423,236.350	
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	37,106	10.500	389,613.000	

	ONESTEEL LIMITED	200,304	3.490	699,060.960	
	ENERGY RESOURCES OF AUST	9,075	18.520	168,069.000	
	NUFARM LTD	33,483	10.210	341,861.430	
	FOSTER'S GROUP LTD	327,064	5.460	1,785,769.440	
	OZ MINERALS LTD	460,007	1.050	483,007.350	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	82,788	7.740	640,779.120	
	INTOLL GROUP	385,989	1.120	432,307.680	
	ORICA LTD	63,935	25.200	1,611,162.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	362,918	1.700	616,960.600	
	LEIGHTON HLDGS LTD	25,030	37.790	945,883.700	
	BLUESCOPE STEEL LTD	305,105	2.440	744,456.200	
	MAP GROUP	111,121	3.080	342,252.680	
	MACQUARIE GROUP LTD	55,929	46.330	2,591,190.570	
	WORLEYPARSONS LTD	24,901	24.690	614,805.690	
	SUNCORP-METWAY LTD	203,413	8.620	1,753,420.060	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	176,202	6.400	1,127,692.800	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	346,102	24.610	8,517,570.220	
	NEWCREST MINING LTD	81,000	32.260	2,613,060.000	
	PALADIN ENERGY LTD	117,788	3.710	436,993.480	
	INCITEC PIVOT LTD	263,697	3.360	886,021.920	
	TOLL HOLDINGS LTD	112,768	8.650	975,443.200	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,039	2.640	472,662.960	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	168,904	23.240	3,925,328.960	
	SANTOS LTD	149,662	13.270	1,986,014.740	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	31,094	19.150	595,450.100	
	SONIC HEALTHCARE	60,146	13.800	830,014.800	
	TABCORP HOLDINGS LTD	102,257	6.900	705,573.300	
	WESFARMERS LTD	161,379	31.750	5,123,783.250	
	ALUMINA LIMITED	430,569	1.570	675,993.330	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	92,927	43.320	4,025,597.640	
	WOOLWORTHS LTD	198,726	25.850	5,137,067.100	
	METCASH LTD	118,626	4.130	489,925.380	
	TATTS GROUP LTD	244,141	2.380	581,055.580	
	GOODMAN FIELDER LTD	180,002	1.545	278,103.090	
	AGL ENERGY LTD	70,357	13.770	968,815.890	
	BRAMBLES LTD	245,567	7.190	1,765,626.730	
	ASCIANO GROUP	502,336	1.850	929,321.600	
	WESFARMERS LTD-PPS	28,470	31.750	903,922.500	

	CROWN LTD	74,398	7.850	584,024.300	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 64	11,683,037		142,706,513.480	
	組入時価比率 : 4.08%			(11,522,123,898)	
	合計時価比率 : 4.09%				
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	168,249	1.850	311,260.650	
	FLETCHER BUILDING LTD	103,959	7.970	828,553.230	
	SKY CITY ENTERTA	120,149	3.190	383,275.310	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	290,074	2.320	672,971.680	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 4	682,431		2,196,060.870	
	組入時価比率 : 0.05%			(137,495,371)	
	合計時価比率 : 0.05%				
合計				277,648,602,650	
				(277,648,602,650)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	345,800.00	612,066.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	283,906.00	550,777.640	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	629,706.00	1,162,843.640	
	組入時価比率 : 0.03%		(74,445,250)	
	合計時価比率 : 0.03%			
	MIRVAC GROUP	428,782.00	671,043.830	
	CFS RETAIL PROPERTY	264,580.00	510,639.400	
	GPT GROUP	1,461,184.00	862,098.560	
	LEND LEASE GROUP	73,201.00	707,853.670	
	STOCKLAND	398,740.00	1,630,846.600	
	WESTFIELD GROUP	339,601.00	4,051,439.930	
	DEXUS PROPERTY GROUP	832,859.00	678,780.080	
	GOODMAN GROUP	906,352.00	548,342.960	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 8	4,705,299.00	9,661,045.030	
	組入時価比率 : 0.28%		(780,032,776)	
	合計時価比率 : 0.28%			
投資信託受益証券計			854,478,026	
			(854,478,026)	
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	24,356.00	1,624,788.760	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	88,695.00	1,615,135.950	
	AMB PROPERTY CORP	26,008.00	622,111.360	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,758.00	1,030,463.660	
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	428,053.910	
	EQUITY RESIDENTIAL	45,075.00	1,627,658.250	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,826.00	605,640.120	
	HCP INC	47,144.00	1,385,090.720	
	HEALTH CARE REIT INC	21,706.00	917,295.560	
	KIMCO REALTY	71,262.00	983,415.600	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,813.00	522,043.650	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	101,106.00	1,175,862.780	
	PLUM CREEK TIMBER CO	26,545.00	962,787.150	
	REGENCY	14,052.00	480,999.960	
	PROLOGIS	74,000.00	921,300.000	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,466.00	3,602,508.980	
	PUBLIC STORAGE	20,726.00	1,689,790.780	
	VENTAS INC	28,147.00	1,263,800.300	
	VORNADO REALTY TRUST	26,039.00	1,700,607.090	
米ドル小計	銘柄数 : 19	737,841.00	23,159,354.580	
	組入時価比率 : 0.74%		(2,089,668,564)	
	合計時価比率 : 0.74%			
	BRITISH LAND CO PLC	136,395.00	606,957.750	



	HAMMERSON PLC	125,070.00	486,147.090	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	119,364.00	759,751.860	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	94,173.00	447,227.570	
	SEGRO PLC	122,102.00	396,831.500	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	597,104.00	2,696,915.770	
	組入時価比率 : 0.13%		(374,682,508)	
	合計時価比率 : 0.13%			
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	46,036.00	656,473.360	
カナダドル小計	銘柄数 : 1	46,036.00	656,473.360	
	組入時価比率 : 0.02%		(56,259,767)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	GECINA SA	3,258.00	247,608.000	
	ICADE EMGP	3,628.00	265,859.840	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	14,396.00	2,120,530.800	
	KLEPIERRE	17,275.00	478,172.000	
	FONCIERE DES REGIONS	3,284.00	238,122.840	
	CORIO NV	9,364.00	426,296.100	
ユーロ小計	銘柄数 : 6	51,205.00	3,776,589.580	
	組入時価比率 : 0.16%		(460,819,461)	
	合計時価比率 : 0.16%			
	LINK REIT/THE	371,500.00	7,169,950.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	371,500.00	7,169,950.000	
	組入時価比率 : 0.03%		(83,314,819)	
	合計時価比率 : 0.03%			
投資証券計			3,064,745,118	
			(3,064,745,118)	
合計			3,919,223,144	
			(3,919,223,144)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

## 有価証券明細表注記

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 577銘柄	54.01%	54.21%
米ドル	投資証券 19銘柄	0.74%	0.74%
英ポンド	株式 98銘柄	10.75%	10.79%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.13%	0.13%
カナダドル	株式 88銘柄	5.38%	5.41%
カナダドル	投資証券 1銘柄	0.02%	0.02%
スイスフラン	株式 35銘柄	4.04%	4.05%
スウェーデンクローネ	株式 30銘柄	1.35%	1.35%
ユーロ	株式 266銘柄	15.80%	15.86%
ユーロ	投資証券 6銘柄	0.16%	0.16%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	0.48%	0.48%
ノルウェークローネ	株式 8銘柄	0.38%	0.38%
香港ドル	株式 38銘柄	1.19%	1.19%
香港ドル	投資証券 1銘柄	0.03%	0.03%
シンガポール・ドル	株式 26銘柄	0.74%	0.74%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.03%	0.03%
オーストラリアドル	株式 64銘柄	4.08%	4.09%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 8銘柄	0.28%	0.28%
ニュージーランドドル	株式 4銘柄	0.05%	0.05%

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,374,700,790	2,779,186,182
国債証券		177,480,634,200	321,574,589,300
地方債証券		14,894,047,926	27,899,995,610
特殊債券		24,727,780,405	41,200,911,930
社債券		19,267,444,520	34,866,334,710
未収入金		2,006,845,000	-
未収利息		937,376,941	1,662,199,894
前払費用		58,134,376	109,466,705
流動資産合計		241,746,964,158	430,092,684,331
資産合計		241,746,964,158	430,092,684,331
負債の部			
流動負債			
未払解約金		2,870,912,000	82,019,000
流動負債合計		2,870,912,000	82,019,000
負債合計		2,870,912,000	82,019,000
純資産の部			
元本等			
元本		222,300,832,660	392,786,689,803
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		16,575,219,498	37,223,975,528
元本等合計		238,876,052,158	430,010,665,331
純資産合計		238,876,052,158	430,010,665,331
負債純資産合計		241,746,964,158	430,092,684,331

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年2月17日から平成22年2月15日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月14日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	201,248,544,342円	222,300,832,660円
同期中追加設定元本額	115,396,184,498円	212,387,672,120円
同期中解約元本額	94,343,896,180円	41,901,814,977円
同期末における元本の内訳		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	931,099円	1,715,863,494円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	5,277,930,073円	6,344,293,028円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	1,988,513,802円	2,313,742,985円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,028,167,385円	3,780,584,562円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,193,523,289円	1,568,658,901円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,051,410,918円	1,157,999,209円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,028,989,133円	1,151,600,710円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	145,033,745円	143,751,648円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	248,397,332円	229,563,479円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,625,908,036円	1,787,952,654円
みずほエマージングボンドオープン	29,420,418円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	15,566,824,769円	12,151,309,479円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	- 円	952,466,087円

D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA（適格機関投資家限定）	14,397,302,602円	14,726,546,826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）	713,830,599円	786,018,791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）	502,093,729円	540,386,061円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA（適格機関投資家 限定）	1,119,397,045円	1,275,821,028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）	591,696,789円	600,718,376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）	398,637,952円	425,842,616円
D I A M世界バランスファンド 40VA（適格機関投資家限 定）	30,335,366,733円	32,844,060,504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）	9,622,027,166円	10,722,175,553円
D I A Mバランスファンド25 VA（適格機関投資家限定）	15,033,377,364円	15,510,236,223円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA（適格機関投資家限 定）	5,405,547,182円	5,932,816,297円
D I A Mバランスファンド50 VA（適格機関投資家限定）	8,285,519,921円	9,196,957,380円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA（適格機関投資 家限定）	1,781,225,835円	1,981,430,713円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA2（適格機関投 資家限定）	6,577,794,013円	7,069,601,768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）	7,012,669,484円	8,843,750,816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）	13,242,172,132円	15,339,330,521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）	596,188,311円	808,679,409円

D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,046,385,372円	1,140,302,159円
D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	13,423,438,513円	15,222,808,224円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	7,447,766,564円	8,243,521,450円
D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,571,973,945円	1,605,135,810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）	49,783,038,697円	116,203,038,255円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,199,147,743円	3,056,833,163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）	- 円	10,701,408,645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）	- 円	35,545,534,118円
D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	- 円	2,387,258,932円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	- 円	241,024円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	- 円	147,578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）	- 円	37,702,891,597円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	- 円	147,183,120円
D I A M国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	- 円	92,509,929円
D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定）	- 円	795,186,117円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	- 円	317,604円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	- 円	226,079円
（合計）	222,300,832,660円	392,786,689,803円

*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	222,300,832,660口	392,786,689,803口

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日		自平成21年2月26日 至平成22年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	177,480,634,200	168,963,800	321,574,589,300	392,746,500
地方債証券	14,894,047,926	9,304,315	27,899,995,610	27,248,534
特殊債券	24,727,780,405	2,470,383	41,200,911,930	37,890,917
社債券	19,267,444,520	21,448,210	34,866,334,710	27,821,730
合計	236,369,907,051	183,578,078	425,541,831,550	485,707,681

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.0746円	1.0948円
（1万口当たり純資産額）	（10,746円）	（10,948円）

[前へ](#) [次へ](#)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	278回 利付国庫債券(2年)	2,300,000,000	2,306,762,000	
	279回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,009,390,000	
	280回 利付国庫債券(2年)	3,300,000,000	3,311,088,000	
	281回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,010,770,000	
	282回 利付国庫債券(2年)	3,100,000,000	3,107,409,000	
	283回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,007,830,000	
	284回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,008,040,000	
	285回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,003,390,000	
	286回 利付国庫債券(2年)	3,700,000,000	3,710,360,000	
	287回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,008,550,000	
	54回 利付国庫債券(5年)	3,900,000,000	3,940,053,000	
	57回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,083,150,000	
	60回 利付国庫債券(5年)	6,300,000,000	6,404,958,000	
	61回 利付国庫債券(5年)	6,300,000,000	6,420,078,000	
	63回 利付国庫債券(5年)	7,500,000,000	7,660,875,000	
	64回 利付国庫債券(5年)	6,200,000,000	6,388,976,000	
	66回 利付国庫債券(5年)	5,800,000,000	5,934,096,000	
	68回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,049,020,000	
	69回 利付国庫債券(5年)	3,800,000,000	3,871,972,000	
	70回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,372,197,000	
	72回 利付国庫債券(5年)	5,600,000,000	5,822,488,000	
	75回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,651,690,000	
	78回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,082,560,000	
	81回 利付国庫債券(5年)	7,500,000,000	7,624,050,000	
	83回 利付国庫債券(5年)	6,500,000,000	6,631,820,000	
	85回 利付国庫債券(5年)	7,400,000,000	7,480,808,000	
	87回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,000,920,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	579,900,000	
	229回 利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,114,850,000	
	232回 利付国庫債券(10年)	1,150,000,000	1,166,134,500	
	235回 利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,738,505,000	
	237回 利付国庫債券(10年)	1,540,000,000	1,582,627,200	
	240回 利付国庫債券(10年)	300,000,000	307,806,000	
	243回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,432,368,000	
	246回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,930,951,000	
	247回 利付国庫債券(10年)	700,000,000	711,753,000	

250回	利付国庫債券(10年)	2,060,000,000	2,074,481,800	
254回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,426,423,000	
256回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,598,975,000	
258回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,555,020,000	
260回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,940,196,000	
263回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,838,537,000	
266回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,485,674,000	
269回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,076,740,000	
270回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,115,890,000	
272回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,923,508,000	
274回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,147,870,000	
277回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,321,638,000	
280回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,543,243,000	
282回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,502,356,000	
284回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,455,360,000	
285回	利付国庫債券(10年)	5,900,000,000	6,256,419,000	
286回	利付国庫債券(10年)	5,200,000,000	5,545,280,000	
288回	利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	5,078,736,000	
289回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,478,278,000	
290回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,333,224,000	
293回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,835,005,000	
296回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,653,450,000	
297回	利付国庫債券(10年)	5,200,000,000	5,320,900,000	
299回	利付国庫債券(10年)	6,600,000,000	6,675,636,000	
301回	利付国庫債券(10年)	6,400,000,000	6,563,392,000	
303回	利付国庫債券(10年)	7,100,000,000	7,193,933,000	
305回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,000,430,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	110,777,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	104,148,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	204,804,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	224,558,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	200,870,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	207,248,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	305,388,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	464,070,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	361,940,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	292,845,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	286,818,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	514,510,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	209,500,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	418,796,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	205,428,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	825,904,000	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	201,286,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	313,440,000	

21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	502,845,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	490,501,400	
23回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	417,212,000	
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	625,974,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	601,494,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,227,168,000	
27回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,251,024,000	
28回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,355,887,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,738,284,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	1,901,653,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,469,715,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	694,584,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	448,344,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	790,012,800	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	896,176,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	986,996,200	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	991,512,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	540,650,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,026,028,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	554,220,000	
50回	利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,024,452,800	
51回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	842,320,000	
52回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	797,062,500	
54回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	857,440,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	849,163,500	
57回	利付国庫債券(20年)	830,000,000	859,124,700	
58回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	929,682,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	961,290,000	
61回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	827,406,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	891,720,000	
64回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,022,590,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,326,091,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,425,284,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,564,956,000	
72回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,507,115,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,423,318,300	
75回	利付国庫債券(20年)	1,540,000,000	1,592,806,600	
78回	利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,558,308,000	
81回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,727,659,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,850,490,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,850,000,000	1,896,657,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,995,817,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,862,136,000	
92回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,035,380,000	
93回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,001,270,000	

	9 4 回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	812,752,000	
	9 5 回 利付国庫債券（20年）	2,000,000,000	2,085,160,000	
	9 7 回 利付国庫債券（20年）	2,000,000,000	2,051,960,000	
	9 9 回 利付国庫債券（20年）	2,000,000,000	2,018,300,000	
	1 0 0 回 利付国庫債券（20年）	2,000,000,000	2,044,900,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券（20年）	2,100,000,000	2,206,617,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券（20年）	2,300,000,000	2,306,141,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券（20年）	2,400,000,000	2,403,216,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券（20年）	2,400,000,000	2,323,608,000	
	1 1 1 回 利付国庫債券（20年）	2,700,000,000	2,737,071,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券（20年）	2,800,000,000	2,788,380,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	795,544,000	
国債証券計			321,574,589,300	
地方債証券	5 8 2 回 東京都公募公債	100,000,000	102,504,000	
	5 8 3 回 東京都公募公債	200,000,000	205,192,000	
	5 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	205,078,000	
	5 9 5 回 東京都公募公債	300,000,000	304,251,000	
	6 0 0 回 東京都公募公債	400,000,000	406,948,000	
	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	153,259,920	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	211,188,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	169,717,120	
	6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	208,420,000	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,935,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	207,776,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	209,086,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	207,318,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,240,028	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	206,750,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,501,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	104,881,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	514,110,740	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,757,255	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	107,162,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	213,004,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	213,458,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	158,982,000	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	106,181,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	211,479,235	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	307,950,000	
	1 3 年度 1 回 北海道公募公債	100,000,000	101,571,000	
	1 3 年度 2 回 北海道公募公債	100,000,000	101,724,000	
	1 5 年度 2 回 北海道公募公債	203,000,000	206,986,920	
	1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	100,000,000	102,749,000	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	203,076,810	

	18年度6回 北海道公募公債	100,000,000	107,217,000	
	19年度4回 北海道公募公債	300,000,000	318,906,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	202,344,000	
	27回1号 宮城県公募公債	125,820,000	128,560,359	
	118回 神奈川県公募公債	145,090,000	148,177,515	
	125回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,632,000	
	126回 神奈川県公募公債	178,870,000	186,124,967	
	127回 神奈川県公募公債	100,000,000	105,444,000	
	128回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,210,000	
	130回 神奈川県公募公債	156,200,000	162,135,600	
	135回 神奈川県公募公債	200,000,000	209,760,000	
	136回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,314,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	300,135,000	
	246回 大阪府公募公債	100,000,000	101,684,000	
	251回 大阪府公募公債	110,100,000	112,194,102	
	252回 大阪府公募公債	100,000,000	101,114,000	
	261回 大阪府公募公債	129,000,000	133,671,090	
	278回 大阪府公募公債	200,000,000	205,632,000	
	285回 大阪府公募公債	100,000,000	103,785,000	
	286回 大阪府公募公債	200,000,000	207,538,000	
	289回 大阪府公募公債	200,000,000	211,076,000	
	293回 大阪府公募公債	200,000,000	214,692,000	
	301回 大阪府公募公債	100,000,000	105,480,000	
	310回 大阪府公募公債	240,000,000	248,205,600	
	25回 大阪府公募公債 5年	200,000,000	203,742,000	
	26回 大阪府公募公債 5年	120,000,000	122,122,800	
	15年度3回 京都府公募公債	219,300,000	227,918,490	
	16年度2回 京都府公募公債	100,000,000	104,195,000	
	18年度1回 京都府公募公債	100,000,000	105,312,000	
	14年度5回 兵庫県公募公債	100,000,000	101,173,000	
	15年度1回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,847,000	
	16年度8回 兵庫県公募公債	111,500,000	117,818,705	
	17年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	206,836,000	
	17年度9回 兵庫県公募公債	306,000,000	319,656,780	
	17年度13回 兵庫県公募公債	105,000,000	110,314,050	
	18年度1回 兵庫県公募公債	120,000,000	126,794,400	
	18年度2回 兵庫県公募公債 5年	200,000,000	202,752,000	
	14年度3回 静岡県公募公債	147,610,000	151,472,953	
	15年度1回 静岡県公募公債	268,500,000	269,415,585	
	15年度3回 静岡県公募公債	116,130,000	120,179,453	
	18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	138,030,618	
	15年度1回 愛知県公募公債	303,600,000	314,186,532	
	16年度2回 愛知県公募公債	200,000,000	209,366,000	
	18年度2回 愛知県公募公債	160,300,000	172,001,900	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	103,278,000	

	13年度1回 広島県公募公債	100,000,000	102,181,000	
	16年度2回 広島県公募公債	200,000,000	208,458,000	
	14年度2回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,431,000	
	15年度3回 埼玉県公募公債	100,000,000	104,148,000	
	17年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	206,566,000	
	18年度1回 埼玉県公募公債	200,000,000	212,194,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	444,989,600	
	16年度3回 福岡県公募公債	131,040,000	135,359,078	
	17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	103,785,000	
	17年度5回 福岡県公募公債	100,000,000	104,294,000	
	18年度1回 福岡県公募公債	104,000,000	112,259,680	
	15年度4回 千葉県公募公債	100,000,000	103,572,000	
	16年度3回 千葉県公募公債	100,000,000	105,945,000	
	16年度8回 千葉県公募公債	200,000,000	206,594,000	
	17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	206,510,000	
	19年度5回 千葉県公募公債	300,000,000	318,042,000	
	21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	200,936,000	
	13年度1回 新潟県公募公債	110,000,000	111,949,200	
	13年度1回 長野県公募公債	121,500,000	123,697,935	
	2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,696,000	
	3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,341,000	
	8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	417,028,000	
	9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	218,219,400	
	11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,591,000	
	12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,702,100	
	18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,644,000	
	19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	136,077,500	
	20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,250,000	
	21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,337,000	
	23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,297,000	
	25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	315,552,000	
	28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,504,000	
	29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,566,000	
	31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,650,000	
	32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,770,000	
	33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,598,000	
	35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,808,000	
	36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,911,000	
	37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	159,138,000	
	38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	182,404,900	
	39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	155,765,940	
	40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,892,000	
	47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	171,215,200	
	55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,028,000	
	57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,840,000	

	6 1 回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,185,000	
	6 5 回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,560,000	
	7 5 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,160,000	
	8 0 回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	709,891,000	
	1 4 年度 3 回 大阪市公募公債	146,500,000	149,677,585	
	1 4 年度 6 回 大阪市公募公債	116,800,000	119,520,272	
	1 7 年度 3 回 大阪市公募公債	100,000,000	102,669,000	
	1 7 年度 8 回 大阪市公募公債	200,000,000	208,506,000	
	1 7 年度 1 1 回 大阪市公募公債	100,000,000	104,242,000	
	1 8 年度 2 回 大阪市公募公債	100,000,000	106,612,000	
	1 8 年度 3 回 大阪市公募公債	150,000,000	160,822,500	
	1 9 年度 5 回 大阪市公募公債	135,000,000	143,561,700	
	1 2 回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,699,000	
	1 2 回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	206,494,000	
	1 2 回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	373,135,835	
	1 7 年度 1 回 京都市公募公債	100,000,000	103,673,000	
	1 8 年度 3 回 京都市公募公債	101,700,000	108,286,092	
	1 3 年度 7 回 神戸市公募公債	129,300,000	132,392,856	
	1 7 年度 1 3 回 神戸市公募公債	103,000,000	107,736,970	
	1 3 年度 3 回 横浜市公募公債	100,000,000	101,719,000	
	1 4 年度 1 回 横浜市公募公債	100,000,000	102,592,000	
	1 4 年度 3 回 横浜市公募公債	153,500,000	156,411,895	
	1 4 年度 5 回 横浜市公募公債	281,100,000	284,908,905	
	1 6 年度 1 回 横浜市公募公債	200,000,000	208,842,000	
	1 7 年度 1 回 横浜市公募公債	300,000,000	309,861,000	
	1 4 年度 5 回 札幌市公募公債	106,000,000	107,429,940	
	1 4 年度 7 回 札幌市公募公債	100,000,000	101,035,000	
	1 6 年度 7 回 札幌市公募公債	100,000,000	104,305,000	
	2 回 川崎市公募公債 1 5 年	100,000,000	101,616,000	
	1 9 回 川崎市公募公債 5 年	100,000,000	103,333,000	
	1 4 年度 2 回 北九州市公募公債	100,000,000	101,841,000	
	1 4 年度 1 回 福岡市公募公債	200,000,000	205,126,000	
	1 8 年度 4 回 福岡市公募公債	100,000,000	105,828,000	
	1 6 年度 1 回 広島市公募公債	100,000,000	103,631,000	
	1 4 年度 1 回 仙台市公募公債	100,000,000	102,522,000	
	1 6 年度 2 回 千葉市公募公債	100,000,000	103,749,000	
地方債証券計			27,899,995,610	
特殊債券	8 回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	107,883,360	
	1 3 回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	130,286,750	
	1 6 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,156,000	
	7 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,422,000	
	9 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,968,000	
	1 3 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,257,000	
	2 7 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,722,000	

46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	208,358,000	
12回	日本道路・機構承継債	100,000,000	102,704,000	
34回	日本道路・機構承継債	200,000,000	209,212,000	
313回	政保道路債	220,000,000	225,979,600	
314回	政保道路債	200,000,000	204,136,000	
315回	政保道路債	300,000,000	303,726,000	
319回	政保道路債	132,000,000	134,500,080	
322回	政保道路債	106,000,000	110,375,680	
323回	政保道路債	200,000,000	208,346,000	
324回	政保道路債	200,000,000	207,662,000	
328回	政保道路債	200,000,000	208,706,000	
329回	政保道路債	100,000,000	104,799,000	
333回	政保道路債	300,000,000	314,916,000	
335回	政保道路債	237,000,000	246,645,900	
338回	政保道路債	264,000,000	276,125,520	
339回	政保道路債	301,000,000	313,325,950	
342回	政保道路債	100,000,000	101,328,000	
15回	高速道路機構債	400,000,000	429,184,000	
25回	高速道路機構債	300,000,000	316,422,000	
35回	高速道路機構債	400,000,000	415,532,000	
48回	高速道路機構債	700,000,000	722,701,000	
3回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,965,000	
5回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	220,012,210	
8回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,697,000	
9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,953,000	
10回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,426,000	
16回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	324,240,210	
17回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	131,385,460	
19回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,427,000	
21回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	399,052,500	
23回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,205,000	
29回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,512,000	
30回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,040,000	
33回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	313,724,070	
36回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	368,110,960	
40回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	353,792,660	
47回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,500,000	
56回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,386,000	
66回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	166,766,040	
67回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	415,744,770	
71回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	611,064,000	
82回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,094,000	
16回	日本道路・機構承継債	430,000,000	437,679,800	



[前へ](#) [次へ](#)

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
	2 6 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	208,876,000	
	4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	312,408,000	
	5 回 公営企業債券	100,000,000	101,245,000	
	8 1 2 回 政保公営企業債券	230,000,000	235,993,800	
	8 1 5 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,408,040	
	8 1 6 回 政保公営企業債券	365,000,000	374,979,100	
	8 1 8 回 政保公営企業債券	107,000,000	109,835,500	
	8 2 0 回 政保公営企業債券	200,000,000	205,588,000	
	8 2 1 回 政保公営企業債券	405,000,000	414,347,400	
	8 2 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	203,078,000	
	8 2 4 回 政保公営企業債券	300,000,000	304,650,000	
	8 2 8 回 政保公営企業債券	210,000,000	211,167,600	
	8 2 9 回 政保公営企業債券	400,000,000	410,228,000	
	8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	309,085,600	
	8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	215,662,950	
	8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	448,869,600	
	8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	625,782,000	
	8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	104,488,000	
	8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,192,000	
	8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,194,000	
	8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	273,008,610	
	8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	310,746,000	
	8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	210,228,120	
	8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	316,543,040	
	8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	209,318,000	
	8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	216,677,250	
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	254,422,670	
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	215,374,000	
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	212,814,000	
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,480,160	
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	108,553,500	
	8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	509,059,480	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	665,335,020	
	3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,922,030	
	4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,932,000	
	6 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	201,670,000	
	1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	312,846,000	
	1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,981,000	
	1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,116,000	
	1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,670,000	
	2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	215,096,000	
	2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	320,550,000	

191回	政保首都高速道路債券	113,000,000	119,456,820	
142回	政保阪神高速道路債	100,000,000	104,054,000	
148回	政保阪神高速道路債	107,000,000	110,783,520	
5回	阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	105,011,000	
171回	政保中小企業債券	161,000,000	164,319,820	
173回	政保中小企業債券	100,000,000	101,541,000	
176回	政保中小企業債券	100,000,000	104,357,000	
180回	政保中小企業債券	142,000,000	150,079,800	
185回	政保中小企業債券	200,000,000	201,864,000	
186回	政保中小企業債券	104,000,000	107,679,520	
26回	中小企業債券	400,000,000	420,716,000	
15回	国際協力銀行債券	200,000,000	210,074,000	
8回	国際協力銀行債券	300,000,000	302,544,000	
12回	国際協力銀行債券	200,000,000	208,676,000	
2回	都市再生債券	100,000,000	106,563,000	
19回	都市再生機構債券	200,000,000	213,212,000	
23回	都市再生機構債券	200,000,000	205,626,000	
2回	本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	105,037,000	
36回	政保関西国際空港債	100,000,000	101,464,000	
4回	政保中部国際空港債券	300,000,000	308,001,000	
6回	政保中部国際空港債券	100,000,000	103,869,000	
108回	政保預金保険機構債券	100,000,000	101,835,000	
121回	政保預金保険機構債券	200,000,000	202,942,000	
125回	政保預金保険機構債券	200,000,000	202,728,000	
140回	政保預金保険機構債券	300,000,000	304,113,000	
143回	政保預金保険機構債券	280,000,000	284,606,000	
11回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,220,000	
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	195,609,000	201,801,980	
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	134,068,000	137,454,557	
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	202,560,000	208,231,680	
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	221,547,000	228,915,653	
4回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	130,209,000	131,552,756	
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	78,727,000	81,221,858	
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	315,168,000	325,612,667	
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	247,428,000	253,779,476	
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	420,125,000	431,619,620	
29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	493,700,000	498,138,363	
8回	政保国民生活債券	300,000,000	304,641,000	
14回	政保国民生活債券	132,000,000	137,881,920	
27回	国民生活金融公庫債券	200,000,000	204,618,000	
8回	日本学生支援機構債	200,000,000	203,836,000	
673号	利附商工債	100,000,000	101,768,000	
674号	利附商工債	200,000,000	204,304,000	
676号	利附商工債	100,000,000	101,847,000	
678号	利附商工債	200,000,000	204,034,000	

	680号 利附商工債	110,000,000	112,531,100	
	683号 利附商工債	100,000,000	102,239,000	
	685号 利附商工債	100,000,000	102,850,000	
	691号 利附商工債	200,000,000	205,838,000	
	692号 利附商工債	200,000,000	204,758,000	
	704号 利附商工債	200,000,000	206,456,000	
	706号 利付商工債	300,000,000	309,771,000	
	671号 利附農林債	300,000,000	304,218,000	
	672号 利附農林債	300,000,000	304,701,000	
	673号 利附農林債	100,000,000	101,541,000	
	675号 利附農林債	100,000,000	101,856,000	
	677号 利附農林債	200,000,000	203,466,000	
	681号 利附農林債	300,000,000	306,027,000	
	684号 利附農林債	250,000,000	255,282,500	
	688号 利附農林債	200,000,000	204,710,000	
	694号 利附農林債	400,000,000	408,084,000	
	695号 利附農林債	200,000,000	204,060,000	
	698号 利附農林債	300,000,000	309,747,000	
	701号 利附農林債	200,000,000	206,426,000	
	709号 利附農林債	300,000,000	306,387,000	
	713号 利附農林債	300,000,000	301,629,000	
	200回 利附しんきん中金債	100,000,000	102,052,000	
	203回 利附しんきん中金債	100,000,000	101,900,000	
	204回 利附信金中金債	100,000,000	101,894,000	
	208回 利附信金中金債	150,000,000	152,961,000	
	210回 利附信金中金債	100,000,000	102,227,000	
	215回 利附信金中金債	200,000,000	205,868,000	
	217回 利附信金中金債	200,000,000	205,326,000	
	222回 利附信金中金債	200,000,000	206,036,000	
	226回 利附信金中金債	300,000,000	308,931,000	
	229回 利附信金中金債	200,000,000	206,540,000	
	233回 利附信金中金債	300,000,000	309,534,000	
	236回 利附信金中金債	300,000,000	303,801,000	
	108号 利附商工債（3年）	200,000,000	203,074,000	
	1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	106,257,050	
	2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,665,190	
	4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,916,500	
	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	183,035,600	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	314,811,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	209,694,000	
	1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	211,462,050	
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	275,464,630	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	124,421,310	
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	317,253,000	
特殊債券計			41,200,911,930	

社債券	3 4 5 回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,600,000	
	1 1 回 メリルリンチ円貨社債	100,000,000	99,526,000	
	1 2 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	96,274,000	
	4 回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	102,244,000	
	1 5 回 シティグループ円貨社債	100,000,000	96,425,000	
	2 2 回 シティグループ円貨社債	200,000,000	193,732,000	
	7 回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	100,547,000	
	1 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,969,000	
	2 5 回 住友化学工業社債	100,000,000	103,698,000	
	3 3 回 住友化学社債	100,000,000	102,157,000	
	2 5 回 三菱化学社債	100,000,000	103,419,000	
	3 4 回 三井化学社債	100,000,000	103,118,000	
	2 回 花王社債	100,000,000	104,675,000	
	1 9 回 新日本石油社債	100,000,000	102,709,000	
	8 回 旭硝子社債	100,000,000	100,524,000	
	4 8 回 新日本製鐵社債	100,000,000	102,083,000	
	5 2 回 新日本製鐵社債	100,000,000	104,158,000	
	4 回 神戸製鋼所社債	100,000,000	105,105,000	
	1 1 回 豊田自動織機社債	100,000,000	101,891,000	
	1 2 回 日立製作所社債	100,000,000	100,471,000	
	7 回 パナソニック社債	100,000,000	103,145,000	
	1 6 回 ソニー社債	100,000,000	101,828,000	
	1 7 回 ソニー社債	100,000,000	103,937,000	
	1 9 回 ソニー社債	100,000,000	103,122,000	
	4 回 デンソー社債	100,000,000	101,753,000	
	1 5 回 三菱重工業社債	100,000,000	101,693,000	
	1 9 回 三菱重工業社債	100,000,000	106,572,000	
	6 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,676,000	
	7 回 トヨタ自動車社債	300,000,000	308,685,000	
	4 5 回 三井物産社債	100,000,000	100,902,000	
	2 9 回 住友商事社債	100,000,000	102,826,000	
	1 6 回 三菱商事社債	100,000,000	109,251,000	
	1 4 回 クレディセゾン社債	100,000,000	94,676,000	
	1 回 みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	209,220,000	
	3 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,610,000	
	6 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,674,000	
	7 回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	106,335,000	
	9 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,224,000	
	1 1 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,662,000	
	1 3 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,686,000	
	1 4 回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	103,442,000	
	1 5 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,464,000	
	2 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,856,000	
	8 2 回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	101,418,000	

84回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,556,000	
92回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	205,920,000	
100回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	206,130,000	
106回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	304,239,000	
3回2号	三菱東京UFJ銀行社債（劣後）	200,000,000	204,364,000	
3回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	208,728,000	
6回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	104,100,000	
8回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,484,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	100,000,000	107,043,000	
5回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,865,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,967,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,796,000	
37回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,738,000	
41回	三井住友銀行社債	100,000,000	102,533,000	
45回	三井住友銀行社債	200,000,000	205,420,000	
6回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,549,000	
7回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,884,000	
8回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,995,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,978,000	
1回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,102,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,894,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,612,000	
14回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,485,000	
18回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	202,996,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,396,000	
23回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	105,945,000	
26回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,121,000	
39回	アコム社債	100,000,000	96,613,000	
115回	オリックス社債	100,000,000	98,121,000	
118回	オリックス社債	100,000,000	95,603,000	
6回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,503,000	
7回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,096,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,109,000	
9回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,580,000	
13回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,230,000	
15回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,351,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	103,890,000	
53回	三菱地所社債	100,000,000	102,577,000	
60回	三菱地所社債	100,000,000	102,098,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	107,687,000	
18回	京王電鉄社債	100,000,000	105,844,000	
2回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	241,794,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,314,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,595,000	
25回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	303,906,000	

3 1 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,339,000	
3 5 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	202,724,000	
4 1 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,659,000	
3 回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,669,000	
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,568,000	
1 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	116,296,000	
2 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	237,610,000	
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,936,000	
1 0 回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	195,415,000	
1 9 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,890,000	
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,972,000	
4 4 回	日本電信電話社債	100,000,000	102,232,000	
4 7 回	日本電信電話社債	400,000,000	406,064,000	
4 8 回	日本電信電話社債	400,000,000	418,504,000	
5 0 回	日本電信電話社債	100,000,000	104,710,000	
5 1 回	日本電信電話社債	200,000,000	215,086,000	
2 回	K D D I 社債	100,000,000	101,819,000	
1 6 回	N T T ドコモ社債	200,000,000	205,490,000	
4 4 1 回	東京電力社債	200,000,000	229,766,000	
4 5 5 回	東京電力社債	200,000,000	214,230,000	
4 5 7 回	東京電力社債	100,000,000	106,839,000	
4 7 3 回	東京電力社債	300,000,000	312,264,000	
4 8 7 回	東京電力社債	500,000,000	509,780,000	
4 8 9 回	東京電力社債	300,000,000	305,754,000	
4 9 1 回	東京電力社債	217,000,000	222,064,780	
4 9 3 回	東京電力社債	500,000,000	512,960,000	
4 9 5 回	東京電力社債	200,000,000	205,204,000	
4 9 6 回	東京電力社債	300,000,000	308,187,000	
4 9 8 回	東京電力社債	300,000,000	306,312,000	
5 0 1 回	東京電力社債	200,000,000	203,352,000	
5 0 2 回	東京電力社債	200,000,000	203,598,000	
5 0 5 回	東京電力社債	100,000,000	101,239,000	
5 0 7 回	東京電力社債	300,000,000	311,109,000	
5 1 0 回	東京電力社債	200,000,000	207,104,000	
5 1 1 回	東京電力社債	100,000,000	104,571,000	
5 1 4 回	東京電力社債	300,000,000	313,587,000	
5 1 5 回	東京電力社債	200,000,000	207,940,000	
5 1 6 回	東京電力社債	100,000,000	103,906,000	
5 1 7 回	東京電力社債	100,000,000	103,546,000	
5 1 8 回	東京電力社債	300,000,000	310,722,000	
5 1 9 回	東京電力社債	372,000,000	389,922,960	
5 2 2 回	東京電力社債	300,000,000	322,896,000	
5 2 7 回	東京電力社債	500,000,000	520,380,000	
5 3 5 回	東京電力社債	500,000,000	526,485,000	
5 3 6 回	東京電力社債	200,000,000	208,878,000	

541回	東京電力社債	500,000,000	511,175,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	518,535,000	
407回	中部電力社債	100,000,000	114,234,000	
409回	中部電力社債	300,000,000	356,409,000	
457回	中部電力社債	100,000,000	101,928,000	
460回	中部電力社債	200,000,000	204,362,000	
462回	中部電力社債	100,000,000	101,629,000	
463回	中部電力社債	200,000,000	202,758,000	
467回	中部電力社債	100,000,000	104,461,000	
468回	中部電力社債	100,000,000	103,953,000	
471回	中部電力社債	300,000,000	309,759,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	107,696,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	106,542,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	211,684,000	
484回	中部電力社債	200,000,000	207,592,000	
487回	中部電力社債	140,000,000	143,862,600	
410回	関西電力社債	300,000,000	319,239,000	
427回	関西電力社債	100,000,000	103,609,000	
429回	関西電力社債	200,000,000	205,362,000	
431回	関西電力社債	100,000,000	102,631,000	
432回	関西電力社債	300,000,000	307,863,000	
433回	関西電力社債	200,000,000	206,604,000	
441回	関西電力社債	200,000,000	208,198,000	
446回	関西電力社債	200,000,000	211,814,000	
298回	中国電力社債	200,000,000	235,120,000	
310回	中国電力社債	200,000,000	231,406,000	
334回	中国電力社債	112,000,000	114,162,720	
337回	中国電力社債	219,000,000	224,770,650	
341回	中国電力社債	100,000,000	104,315,000	
350回	中国電力社債	200,000,000	209,078,000	
245回	北陸電力社債	200,000,000	232,290,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	108,296,000	
264回	北陸電力社債	100,000,000	101,451,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	213,316,000	
368回	東北電力社債	300,000,000	352,464,000	
375回	東北電力社債	100,000,000	115,630,000	
380回	東北電力社債	300,000,000	351,669,000	
408回	東北電力社債	100,000,000	102,609,000	
411回	東北電力社債	200,000,000	204,762,000	
420回	東北電力社債	100,000,000	103,392,000	
427回	東北電力社債	200,000,000	207,786,000	
432回	東北電力社債	500,000,000	538,840,000	
249回	四国電力社債	200,000,000	205,136,000	
257回	四国電力社債	200,000,000	207,468,000	
369回	九州電力社債	300,000,000	306,624,000	



	374回 九州電力社債	300,000,000	311,265,000	
	382回 九州電力社債	100,000,000	104,001,000	
	383回 九州電力社債	100,000,000	104,099,000	
	387回 九州電力社債	200,000,000	210,746,000	
	257回 北海道電力社債	200,000,000	236,364,000	
	282回 北海道電力社債	200,000,000	207,298,000	
	284回 北海道電力社債	500,000,000	520,625,000	
	286回 北海道電力社債	100,000,000	104,357,000	
	7回 沖縄電力社債	100,000,000	102,811,000	
	2回 電源開発社債	100,000,000	103,798,000	
	4回 電源開発社債	200,000,000	206,016,000	
	6回 電源開発社債	100,000,000	104,173,000	
	14回 電源開発社債	100,000,000	104,329,000	
	17回 電源開発社債	100,000,000	107,322,000	
	24回 東京瓦斯社債	200,000,000	206,958,000	
	9回 大阪ガス社債	100,000,000	113,742,000	
	24回 大阪瓦斯社債	100,000,000	104,582,000	
	20回 NTTデータ社債	100,000,000	102,051,000	
社債券計			34,866,334,710	
合計			425,541,831,550	

## 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。

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		6,030,515,906	5,478,697,498
コール・ローン		274,156,677	252,476,623
国債証券		305,555,179,314	402,153,180,827
派生商品評価勘定		30,365	53,865
未収入金		7,277,306,174	-
未収利息		4,104,822,705	4,958,987,407
前払費用		333,070,602	485,852,153

流動資産合計		323,575,081,743	413,329,248,373
資産合計		323,575,081,743	413,329,248,373
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		273,323,634	133,569
未払解約金		8,217,577,000	105,012,000
流動負債合計		8,490,900,634	105,145,569
負債合計		8,490,900,634	105,145,569
純資産の部			
元本等			
元本		261,176,061,856	340,044,873,488
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		53,908,119,253	73,179,229,316
元本等合計		315,084,181,109	413,224,102,804
純資産合計		315,084,181,109	413,224,102,804
負債純資産合計		323,575,081,743	413,329,248,373

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年2月24日から平成22年2月22日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	244,091,594,672円	261,176,061,856円
同期中追加設定元本額	109,536,158,729円	117,650,377,551円
同期中解約元本額	92,451,691,545円	38,781,565,919円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	903,180円	1,418,161,055円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金>	2,520,234,271円	2,968,326,212円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	232,267,664円	252,478,515円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	789,685,767円	931,799,463円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	816,689,945円	999,582,493円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	285,763,112円	292,448,604円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	547,267,495円	573,220,319円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	338,827,864円	367,672,743円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	218,842,239円	192,266,231円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,433,968,911円	1,490,290,122円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	19,011,806,920円	14,789,578,578円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	4,126,244,945円	3,775,534,976円
D I A M外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	6,447,219,040円	7,769,155,834円
D I A M外国債券パッシブファンド2（適格機関投資家向け）	2,066,624,626円	2,004,335,773円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	1,315,642,351円	948,875,990円
D I A Mワールドバランス25 V A（適格機関投資家限定）	- 円	257,816,113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)	53,782,603,121円	52,576,046,897円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資家 限定)	2,694,334,155円	2,808,919,682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)	467,569,998円	482,515,571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)	701,058,286円	758,725,567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)	220,343,972円	214,130,120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)	95,068,979円	94,829,816円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	28,559,102,066円	29,293,250,512円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	6,022,090,367円	6,381,624,019円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	12,248,872,485円	12,093,729,741円
D I A Mバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	5,479,866,543円	5,729,433,392円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	7,809,193,022円	8,198,212,279円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA(適格機関投資家限 定)	2,855,565,097円	2,949,481,282円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA2(適格機関投資家 限定)	8,755,330,667円	8,832,264,377円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30VA(適格機 関投資家限定)	8,830,724,277円	10,521,193,612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)	46,897,662,140円	50,164,155,552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)	227,161,418円	286,126,637円
D I A M為替フルヘッジ型グロー バルアセット私募ファンド(適格 機関投資家向け)	1,012,454,243円	1,018,932,796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）	6,594,152,763円	6,794,980,312円
D I A Mアイエヌジー世界バラン スファンド 3 5 V A（適格機関投 資家限定）	15,891,043,966円	16,078,241,526円
D I A Mグローバル分散ファンド V A（適格機関投資家限定）	294,193,522円	281,671,446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）	11,585,682,439円	25,906,978,059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）	- 円	31,722,542,216円
D I A Mバランス 3 0 V A（適格 機関投資家限定）	- 円	798,019,553円
D I A Mバランス 5 0 V A（適格 機関投資家限定）	- 円	214,723円
D I A Mバランス 7 0 V A（適格 機関投資家限定）	- 円	131,359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）	- 円	26,774,474,180円
D I A M世界バランス 2 5 V A （適格機関投資家限定）	- 円	39,656,511円
D I A Mバランス 2 0 V A（適格 機関投資家限定）	- 円	212,526,144円
D I A Mバランス 4 0 V A（適格 機関投資家限定）	- 円	201,433円
D I A Mバランス 6 0 V A（適格 機関投資家限定）	- 円	121,153円
（合 計）	261,176,061,856円	340,044,873,488円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日に おける受益権の総数	261,176,061,856口	340,044,873,488口

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
--	----------------------------	----------------------------

種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	305,555,179,314	139,787,344	402,153,180,827	2,103,579,838
合計	305,555,179,314	139,787,344	402,153,180,827	2,103,579,838

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

区分	自平成20年2月26日 至平成21年2月25日	自平成21年2月26日 至平成22年2月25日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左



## 取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

平成21年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	カナダドル	243,367,308	-	251,333,420	7,966,112
	スイスフラン	42,376,344	-	42,377,360	1,016
	デンマーククローネ	38,111,966	-	38,097,120	14,846
	ノルウェークローネ	80,957,734	-	83,808,400	2,850,666
	ポーランドズロチ	121,075,840	-	125,314,560	4,238,720
	ユーロ	4,188,196,138	-	4,348,736,730	160,540,592
	英ポンド	853,875,858	-	878,859,360	24,983,502
	米ドル	2,970,929,613	-	3,043,657,120	72,727,507
合計		8,538,890,801	-	8,812,184,070	273,293,269

平成22年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	13,537,425	-	13,533,000	4,425
	買建				
	カナダドル	152,115,725	-	152,099,750	15,975
	ポーランドズロチ	50,610,080	-	50,659,520	49,440
	ユーロ	893,903,868	-	893,845,260	58,608
米ドル	591,360,866	-	591,301,880	58,986	
合計		1,701,527,964	-	1,701,439,410	79,704

## (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。

（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21年2月25日現在	平成22年2月25日現在
1口当たり純資産額	1,2064円	1,2152円
（1万口当たり純資産額）	（12,064円）	（12,152円）

[前](#) [次](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株 式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 0.875 02/28/11	20,000,000.00	20,102,200.000	
	US T N/B 0.875 03/31/11	30,000,000.00	30,156,900.000	
	US T N/B 4.875 04/30/11	40,000,000.00	42,095,200.000	
	US T N/B 0.875 05/31/11	25,000,000.00	25,134,750.000	
	US T N/B 1.125 06/30/11	35,000,000.00	35,299,250.000	
	US T N/B 5.0 08/15/11	36,000,000.00	38,365,200.000	
	US T N/B 1.0 09/30/11	35,000,000.00	35,198,100.000	
	US T N/B 4.5 11/30/11	28,000,000.00	29,859,200.000	
	US T N/B 4.75 01/31/12	15,000,000.00	16,132,500.000	
	US T N/B 1.125 01/15/12	27,000,000.00	27,156,060.000	
	US T N/B 4.875 02/15/12	25,000,000.00	26,970,500.000	
	US T N/B 4.5 03/31/12	32,000,000.00	34,373,440.000	
	US T N/B 4.5 04/30/12	20,000,000.00	21,517,800.000	
	US T N/B 1.875 06/15/12	25,000,000.00	25,480,250.000	
	US T N/B 4.375 08/15/12	35,000,000.00	37,838,150.000	
	US T N/B 1.375 09/15/12	33,000,000.00	33,154,440.000	
	US T N/B 4.0 11/15/12	44,000,000.00	47,248,080.000	
	US T N/B 1.125 12/15/12	35,000,000.00	34,812,400.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	34,347,200.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	30,921,250.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	38,097,850.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	43,602,800.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	43,265,600.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	38,896,200.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	30,658,500.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,609,600.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	28,210,840.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	32,721,000.000	
	US T N/B 2.125 11/30/14	25,000,000.00	24,825,000.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	17,000,000.00	18,324,130.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	13,000,000.00	14,072,500.000	

	US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.00	16,297,200.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	10,000,000.00	10,996,800.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	21,000,000.00	23,022,720.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	19,460,800.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	15,000,000.00	18,753,450.000	
	US T N/B 3.25 06/30/16	20,000,000.00	20,379,600.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	18,000,000.00	20,086,740.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	19,950,000.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	17,806,180.000	
	US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.00	19,596,800.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	13,171,800.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,535,260.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	12,000,000.00	13,227,120.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	14,000,000.00	14,893,480.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	18,000,000.00	18,165,780.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	15,000,000.00	15,468,750.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	10,000,000.00	10,375,000.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	17,000,000.00	17,256,190.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	7,000,000.00	9,867,200.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	25,000,000.00	23,386,500.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	25,000,000.00	24,019,500.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	7,000,000.00	9,518,320.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	22,000,000.00	21,927,620.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	25,000,000.00	24,359,250.000	
	US T N/B 8.5 02/15/20	2,000,000.00	2,798,280.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	7,000,000.00	10,000,130.000	
	US T N/B 7.875 02/15/21	3,000,000.00	4,074,360.000	
	US T N/B 8.125 05/15/21	5,000,000.00	6,914,800.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	12,000,000.00	16,507,440.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	3,930,210.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	4,000,000.00	5,194,680.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	8,000,000.00	9,674,320.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	3,000,000.00	4,057,020.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	3,000,000.00	4,101,780.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	6,000,000.00	7,715,100.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	5,000,000.00	5,929,250.000	
	US T N/B 6.75 08/15/26	3,000,000.00	3,835,050.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	3,744,360.000	

	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,265,230.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	3,000,000.00	3,710,610.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	8,000,000.00	9,648,080.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	3,383,880.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	4,000,000.00	4,384,360.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	4,000,000.00	4,386,560.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	4,000,000.00	4,854,680.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	6,000,000.00	7,401,540.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	7,000,000.00	7,812,070.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	10,000,000.00	9,891,400.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	6,000,000.00	6,159,360.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	6,000,000.00	6,397,020.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	6,000,000.00	5,779,200.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	9,000,000.00	8,841,780.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	10,000,000.00	8,200,000.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	15,000,000.00	14,078,850.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	15,000,000.00	14,682,300.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	17,000,000.00	16,291,950.000	
米ドル小計	銘柄数 : 87	1,512,000,000.00	1,606,614,600.000	
	組入時価比率 : 35.08%		(144,964,835,358)	
	合計時価比率 : 36.05%			
	UK TREASURY 4.25 03/07/11	8,500,000.00	8,813,650.000	
	UK TREASURY 9.0 07/12/11	3,000,000.00	3,335,100.000	
	UK TREASURY 3.25 12/07/11	6,500,000.00	6,756,100.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	11,000,000.00	11,825,000.000	
	UK TREASURY 5.25 06/07/12	9,000,000.00	9,760,500.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	10,000,000.00	10,752,000.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,613,500.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	9,925,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	8,500,000.00	9,364,450.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	8,734,400.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	2,500,000.00	3,156,750.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	9,000,000.00	9,344,700.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,013,100.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	4,500,000.00	4,890,150.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	9,000,000.00	9,357,300.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	8,000,000.00	7,799,200.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	4,000,000.00	4,214,400.000	

	UK TREASURY 8.0 06/07/21	5,000,000.00	6,735,500.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	3,000,000.00	2,910,000.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	6,500,000.00	6,832,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	5,000,000.00	4,807,000.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,500,000.00	5,329,800.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,000,000.00	6,082,800.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	7,000,000.00	6,638,800.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,500,000.00	2,442,000.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	7,700,000.00	7,251,090.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	7,500,000.00	7,670,250.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	3,500,000.00	3,293,500.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	8,000,000.00	7,885,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	6,700,000.00	6,340,880.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	6,000,000.00	5,677,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,500,000.00	6,180,200.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,500,000.00	2,250,500.000	
英債券小計	銘柄数 : 33	205,400,000.00	213,983,820.000	
	組入時価比率 : 7.19%		(29,728,772,113)	
	合計時価比率 : 7.39%			
	CANADA 6.0 06/01/11	7,000,000.00	7,453,320.000	
	CANADA 3.75 09/01/11	7,000,000.00	7,285,110.000	
	CANADA 1.25 12/01/11	3,000,000.00	3,002,880.000	
	CANADA 5.25 06/01/12	9,500,000.00	10,292,775.000	
	CANADA 2.0 09/01/12	7,500,000.00	7,563,600.000	
	CANADA 5.25 06/01/13	10,000,000.00	11,013,800.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	11,047,100.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,000,000.00	6,828,850.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	5,500,000.00	5,990,325.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	5,000,000.00	5,308,000.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	5,000,000.00	5,283,850.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	4,500,000.00	4,805,415.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	8,000,000.00	8,184,400.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,500,000.00	2,478,325.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	2,700,000.00	3,852,036.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,700,000.00	2,667,861.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	2,500,000.00	3,717,000.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	5,000,000.00	6,107,900.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	5,800,000.00	7,209,632.000	

	CANADA 5.0 06/01/37	6,000,000.00	6,928,800.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	4,000,000.00	3,975,240.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 21	119,200,000.00	130,996,219.000	
	組入時価比率 : 2.72%		(11,226,375,968)	
	合計時価比率 : 2.79%			
	SWEDEN 5.25 03/15/11	13,000,000.00	13,645,450.000	
	SWEDEN 5.5 10/08/12	26,000,000.00	28,542,800.000	
	SWEDEN 6.75 05/05/14	36,000,000.00	42,427,080.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	23,000,000.00	25,259,750.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	18,252,540.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	23,000,000.00	24,240,620.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	35,000,000.00	38,117,450.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	23,000,000.00	26,724,160.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	15,532,800.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 9	213,000,000.00	232,742,650.000	
	組入時価比率 : 0.70%		(2,911,610,552)	
	合計時価比率 : 0.72%			
	AUSTRIA 5.0 07/15/12	5,000,000.00	5,425,100.000	
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,000,000.00	2,126,000.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	7,000,000.00	7,606,200.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,133,500.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	4,000,000.00	4,174,000.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	5,000,000.00	5,327,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	3,000,000.00	3,234,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	5,000,000.00	5,490,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	5,000,000.00	5,330,000.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	4,000,000.00	4,096,000.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,000,000.00	3,910,000.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,500,000.00	2,740,250.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	3,000,000.00	3,808,230.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,300,000.00	3,253,800.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/11	9,000,000.00	9,558,900.000	
	BELGIUM 2.0 03/28/12	1,000,000.00	1,016,600.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/12	9,000,000.00	9,813,600.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	7,000,000.00	7,476,000.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	7,000,000.00	7,490,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	2,000,000.00	2,145,800.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	9,000,000.00	9,750,600.000	

	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	5,235,000.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,284,500.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	5,098,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	4,000,000.00	4,234,000.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	4,000,000.00	4,616,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	4,201,200.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	4,000,000.00	4,161,600.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	1,500,000.00	1,507,500.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	5,000,000.00	5,102,500.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	6,000,000.00	7,018,800.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	6,000,000.00	6,682,800.000	
	BUNDESOBL 3.5 04/08/11	13,000,000.00	13,417,300.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/11	17,000,000.00	17,977,500.000	
	BUNDESOBL 3.5 10/14/11	7,000,000.00	7,303,800.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 01/04/12	17,000,000.00	18,263,100.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/12	16,000,000.00	17,422,400.000	
	BUNDESOBL 4.25 10/12/12	10,000,000.00	10,780,500.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	18,000,000.00	19,566,900.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	18,000,000.00	19,278,900.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	16,000,000.00	17,456,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	19,000,000.00	20,789,800.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	15,000,000.00	16,094,250.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	12,000,000.00	12,585,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	10,000,000.00	10,585,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	12,000,000.00	13,029,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	9,000,000.00	9,609,750.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	8,000,000.00	8,772,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	9,000,000.00	9,702,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	10,000,000.00	10,940,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	10,000,000.00	10,535,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	11,000,000.00	11,352,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	5,000,000.00	5,045,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	4,000,000.00	5,164,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	5,000,000.00	6,693,500.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	6,500,000.00	7,978,750.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	5,000,000.00	5,606,500.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	4,000,000.00	5,300,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	7,500,000.00	9,177,750.000	



	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	8,500,000.00	9,575,250.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	10,000,000.00	10,152,600.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	6,000,000.00	6,390,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,000,000.00	4,605,600.000	
	SPAIN 5.4 07/30/11	10,000,000.00	10,588,700.000	
	SPAIN 5.35 10/31/11	9,500,000.00	10,129,755.000	
	SPAIN 5.0 07/30/12	11,000,000.00	11,851,070.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	11,000,000.00	12,315,930.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	9,000,000.00	9,603,990.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	7,000,000.00	7,481,950.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	6,500,000.00	7,074,275.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	3,000,000.00	3,078,600.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	7,420,000.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	7,000,000.00	7,032,200.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	5,000,000.00	5,115,000.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	8,000,000.00	9,053,440.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	6,187,200.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	6,000,000.00	6,375,300.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	6,000,000.00	6,222,900.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,000,000.00	2,017,600.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	6,500,000.00	6,864,975.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	7,000,000.00	8,251,250.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	6,000,000.00	6,904,320.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	6,000,000.00	5,561,160.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	5,000,000.00	5,177,500.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,000,000.00	1,995,200.000	
	FINLAND 5.75 02/23/11	2,000,000.00	2,101,000.000	
	FINLAND 4.25 09/15/12	3,000,000.00	3,213,000.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	3,000,000.00	3,362,400.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,567,275.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	3,000,000.00	3,271,800.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	3,000,000.00	3,172,500.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,175,800.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	1,800,000.00	1,838,700.000	
	FRANCE OAT 6.5 04/25/11	10,000,000.00	10,664,000.000	
	FR TREASURY 1.5 09/12/11	8,000,000.00	8,085,200.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/11	14,000,000.00	14,946,400.000	
	FRANCE OAT 5.0 04/25/12	16,000,000.00	17,320,000.000	

	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	18,000,000.00	19,584,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	17,000,000.00	18,252,900.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	13,000,000.00	13,978,900.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,151,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	12,000,000.00	12,934,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	11,000,000.00	11,860,200.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	9,000,000.00	9,486,900.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	11,000,000.00	11,276,100.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	12,000,000.00	12,382,800.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,328,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	10,000,000.00	10,542,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,675,200.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	10,000,000.00	10,650,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	7,000,000.00	7,561,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	13,000,000.00	14,001,000.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,000,000.00	5,715,600.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	8,000,000.00	8,256,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	10,000,000.00	10,207,000.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	5,991,600.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	9,000,000.00	9,491,400.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.00	7,521,600.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,000,000.00	9,610,400.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,000,000.00	10,029,600.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,500,000.00	7,204,600.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	10,000,000.00	9,923,000.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,000,000.00	5,372,250.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	6,000,000.00	5,879,400.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.8 03/20/11	5,000,000.00	4,940,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.9 08/20/11	8,000,000.00	7,832,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 5.25 05/18/12	5,000,000.00	4,960,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.1 08/20/12	5,000,000.00	4,810,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.6 05/20/13	6,000,000.00	5,799,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.5 05/20/14	5,000,000.00	4,792,000.000	

	HELLENICREPUBLIC 5.5 08/20/14	4,000,000.00	3,887,600.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.7 07/20/15	2,000,000.00	1,781,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.6 07/20/16	3,000,000.00	2,634,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.3 07/20/17	7,000,000.00	6,253,100.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.6 07/20/18	4,000,000.00	3,602,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 6.0 07/19/19	6,000,000.00	5,792,700.000	
	HELLENICREPUBLIC 6.5 10/22/19	4,000,000.00	4,000,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 5.9 10/22/22	4,000,000.00	3,896,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.7 03/20/24	4,000,000.00	3,368,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 5.3 03/20/26	3,000,000.00	2,612,700.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.5 09/20/37	4,000,000.00	2,952,400.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.6 09/20/40	3,000,000.00	2,249,700.000	
	IRISH 4.0 11/11/11	1,500,000.00	1,554,105.000	
	IRISH 3.9 03/05/12	2,000,000.00	2,080,060.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	3,000,000.00	3,220,470.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	3,118,380.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	3,147,600.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	3,023,070.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,964,450.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	3,000,000.00	3,307,560.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,962,770.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	3,074,550.000	
	ITALY BTPS 3.5 03/15/11	8,000,000.00	8,207,840.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/11	10,000,000.00	10,560,700.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/11	15,000,000.00	15,655,650.000	
	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	18,000,000.00	19,202,040.000	
	ITALY BTPS 4.0 04/15/12	10,000,000.00	10,502,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 10/15/12	17,000,000.00	18,050,600.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	12,000,000.00	12,955,200.000	

	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	15,000,000.00	16,005,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	15,000,000.00	15,750,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	17,000,000.00	18,215,500.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	11,000,000.00	11,770,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	11,000,000.00	11,486,200.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.00	14,554,400.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	10,000,000.00	10,493,000.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,000,000.00	9,004,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	11,000,000.00	11,784,300.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	8,000,000.00	8,516,800.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	10,000,000.00	10,429,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	10,000,000.00	10,577,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	10,000,000.00	10,326,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	9,000,000.00	9,431,100.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	6,000,000.00	6,132,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	11,000,000.00	10,728,300.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,000,000.00	7,304,500.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	5,000,000.00	7,369,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,000,000.00	4,238,560.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	4,000,000.00	5,247,200.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	11,000,000.00	13,475,000.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	12,000,000.00	12,882,000.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	13,000,000.00	15,203,500.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	7,000,000.00	7,956,900.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,500,000.00	8,831,500.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	10,000,000.00	8,948,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	8,000,000.00	8,316,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	4,000,000.00	4,128,000.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/11	5,000,000.00	5,287,500.000	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/12	6,000,000.00	6,169,800.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/12	6,000,000.00	6,541,800.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	7,000,000.00	7,590,100.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,483,000.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	2,000,000.00	2,041,400.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,251,400.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,374,000.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.00	5,508,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	5,000,000.00	5,309,000.000	

	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	6,000,000.00	6,339,600.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,302,700.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	5,411,700.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	5,000,000.00	5,012,500.000	
	PORTUGUESE 5.15 06/15/11	4,000,000.00	4,180,880.000	
	PORTUGUESE 5.0 06/15/12	3,000,000.00	3,189,900.000	
	PORTUGUESE 5.45 09/23/13	3,000,000.00	3,266,370.000	

[前](#) [次](#)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
	PORTUGUESE 4.375 06/16/14	4,000,000.00	4,180,400.000	
	PORTUGUESE 3.35 10/15/15	2,000,000.00	1,977,960.000	
	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	5,100,000.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	2,030,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	3,070,500.000	
	PORTUGUESE 4.75 06/14/19	2,000,000.00	2,059,700.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	2,821,650.000	
	PORTUGUESE 4.95 10/25/23	2,000,000.00	2,054,600.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	2,700,000.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 213	1,520,100,000.00	1,623,192,535.000	
	組入時価比率 : 47.93%		(198,061,953,121)	
	合計時価比率 : 49.25%			
	DENMARK 6.0 11/15/11	27,000,000.00	29,162,700.000	
	DENMARK 4.0 11/15/12	13,000,000.00	13,796,250.000	
	DENMARK 5.0 11/15/13	31,000,000.00	34,208,500.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	30,000,000.00	31,983,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	25,000,000.00	26,480,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	23,000,000.00	24,092,500.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	11,000,000.00	14,982,000.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	37,000,000.00	40,466,160.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 8	197,000,000.00	215,171,110.000	
	組入時価比率 : 0.85%		(3,528,806,204)	
	合計時価比率 : 0.88%			
	NORWAY 6.0 05/16/11	16,000,000.00	16,750,400.000	
	NORWAY 6.5 05/15/13	27,000,000.00	30,091,500.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	18,000,000.00	19,566,000.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	17,000,000.00	17,884,000.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	9,000,000.00	9,575,550.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 5	87,000,000.00	93,867,450.000	
	組入時価比率 : 0.35%		(1,425,846,566)	
	合計時価比率 : 0.35%			
	POLAND 4.25 05/24/11	10,000,000.00	10,015,000.000	
	POLAND 01/25/12	10,000,000.00	9,165,600.000	
	POLAND 4.75 04/25/12	19,000,000.00	18,990,500.000	
	POLAND 5.25 04/25/13	14,000,000.00	14,062,720.000	

	POLAND 5.0 10/24/13	10,000,000.00	9,965,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/14	12,000,000.00	12,162,000.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	15,000,000.00	15,420,000.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	11,628,000.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.00	8,577,180.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	10,500,000.00	10,183,950.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数 : 10	121,500,000.00	120,169,950.000	
	組入時価比率 : 0.89%		(3,695,225,963)	
	合計時価比率 : 0.92%			
	SINGAPORE 3.625 07/01/11	3,000,000.00	3,128,220.000	
	SINGAPORE 2.625 04/01/12	4,000,000.00	4,166,680.000	
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	2,000,000.00	2,089,900.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,414,520.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	2,000,000.00	2,199,020.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,769,725.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	2,872,548.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,000,000.00	996,030.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,518,240.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 9	22,800,000.00	24,154,883.000	
	組入時価比率 : 0.37%		(1,546,395,610)	
	合計時価比率 : 0.38%			
	MALAYSIA 3.756 04/28/11	10,000,000.00	10,150,700.000	
	MALAYSIA 3.718 06/15/12	22,500,000.00	22,856,400.000	
	MALAYSIA 3.702 02/25/13	2,000,000.00	2,021,580.000	
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,709,540.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,095,200.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	6,887,580.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,040,460.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	1,000,000.00	1,007,990.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,333,900.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,132,400.000	
マレーシアリングット小計	銘柄数 : 10	76,500,000.00	77,235,750.000	
	組入時価比率 : 0.50%		(2,047,519,733)	
	合計時価比率 : 0.51%			
	AUSTRALIAN 5.75 04/15/12	7,000,000.00	7,161,630.000	
	AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	7,000,000.00	7,336,700.000	
	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	5,000,000.00	5,221,250.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	4,000,000.00	4,187,840.000	

	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	5,000,000.00	5,165,000.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	3,500,000.00	3,427,165.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,000,000.00	1,828,540.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,000,000.00	3,024,360.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 8	36,500,000.00	37,352,485.000	
	組入時価比率 : 0.73%		(3,015,839,639)	
	合計時価比率 : 0.75%			
合計			402,153,180,827	
			(402,153,180,827)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

#### 有価証券明細表注記

##### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 87銘柄	35.08%	36.05%
英ポンド	国債証券 33銘柄	7.19%	7.39%
カナダドル	国債証券 21銘柄	2.72%	2.79%
スウェーデンクローネ	国債証券 9銘柄	0.70%	0.72%
ユーロ	国債証券 213銘柄	47.93%	49.25%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	0.85%	0.88%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	0.35%	0.35%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.89%	0.92%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.37%	0.38%
マレーシアリングット	国債証券 10銘柄	0.50%	0.51%
オーストラリアドル	国債証券 8銘柄	0.73%	0.75%

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

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#)



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成22年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,469,974,039円
負債総額	537,482円
純資産総額（ - ）	2,469,436,557円
発行済数量	2,737,210,689口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9022円

## D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成22年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	4,315,266,939円
負債総額	1,783,175円
純資産総額（ - ）	4,313,483,764円
発行済数量	5,355,438,183口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8054円

## D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成22年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,364,708,332円
負債総額	1,296,608円
純資産総額（ - ）	2,363,411,724円
発行済数量	3,310,784,503口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7139円

## （参考）マザーファンドの現況

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成22年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	285,351,500,542円
負債総額	217,168,627円
純資産総額（ - ）	285,134,331,915円
発行済数量	234,210,819,461口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2174円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	309,558,754,225円
負債総額	124,452,010円
純資産総額（ - ）	309,434,302,215円
発行済数量	235,345,479,589口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3148円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	428,082,082,346円
負債総額	222,175,000円
純資産総額（ - ）	427,859,907,346円
発行済数量	390,889,893,684口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0946円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	420,542,258,990円
負債総額	446,999,285円
純資産総額（ - ）	420,095,259,705円
発行済数量	341,682,168,607口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2295円

**第5【設定及び解約の実績】**

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

**D I A M D C バランス30インデックスファンド**

	設定口数	解約口数
第1期	3,100,768,537	345,452,038
第2期	229,578,698	339,107,428
第3期	243,751,371	153,541,357

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

**D I A M D C バランス50インデックスファンド**

	設定口数	解約口数
第1期	5,407,868,136	346,621,435
第2期	439,067,605	427,745,782
第3期	495,694,818	241,797,536

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

**D I A M D C バランス70インデックスファンド**

	設定口数	解約口数
第1期	3,243,343,171	329,317,247
第2期	362,375,624	238,812,098
第3期	443,121,260	190,773,589

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## 第四部【特別情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

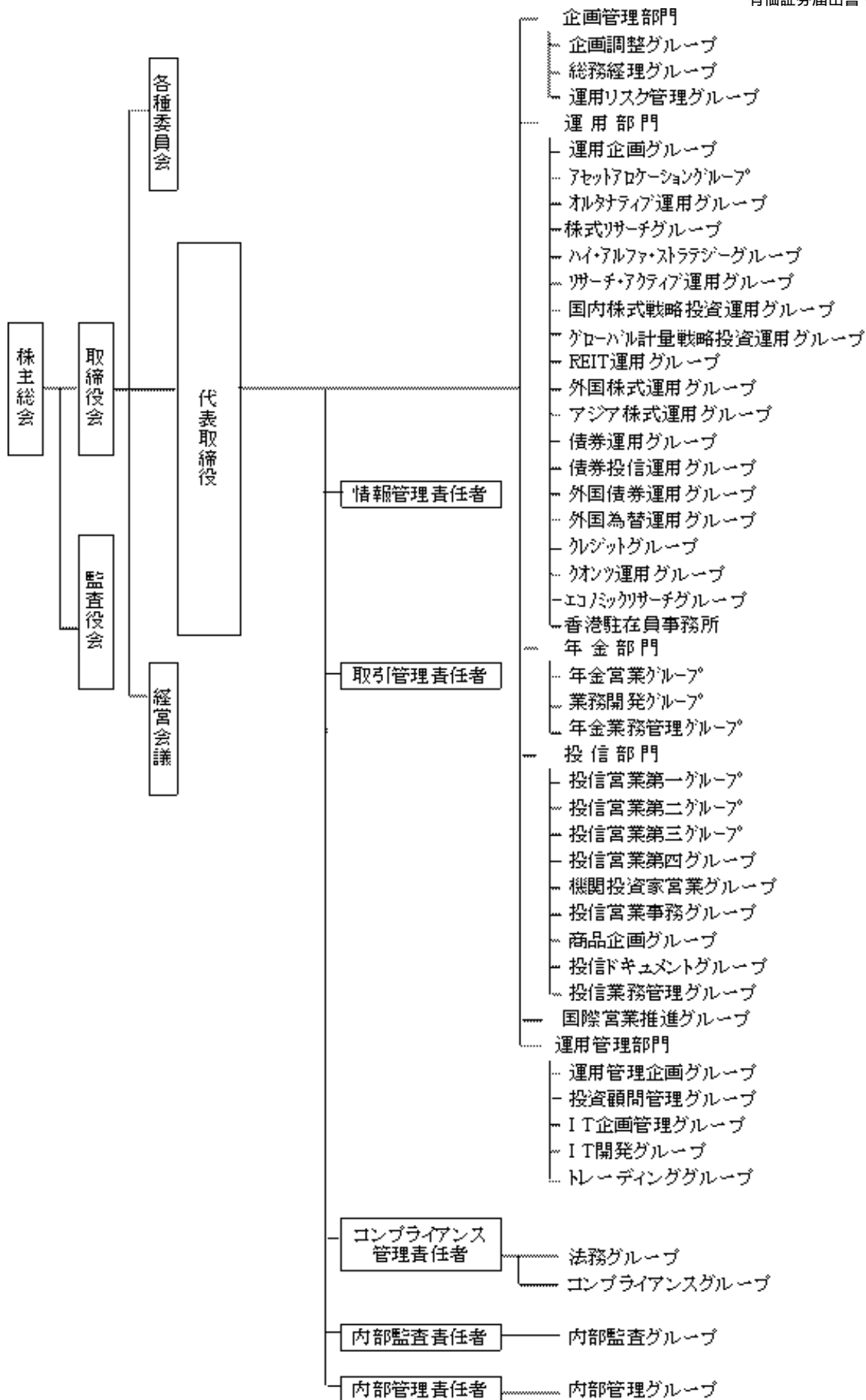
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

##### 直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成22年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 会社の意思決定機構

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

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

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

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決します。

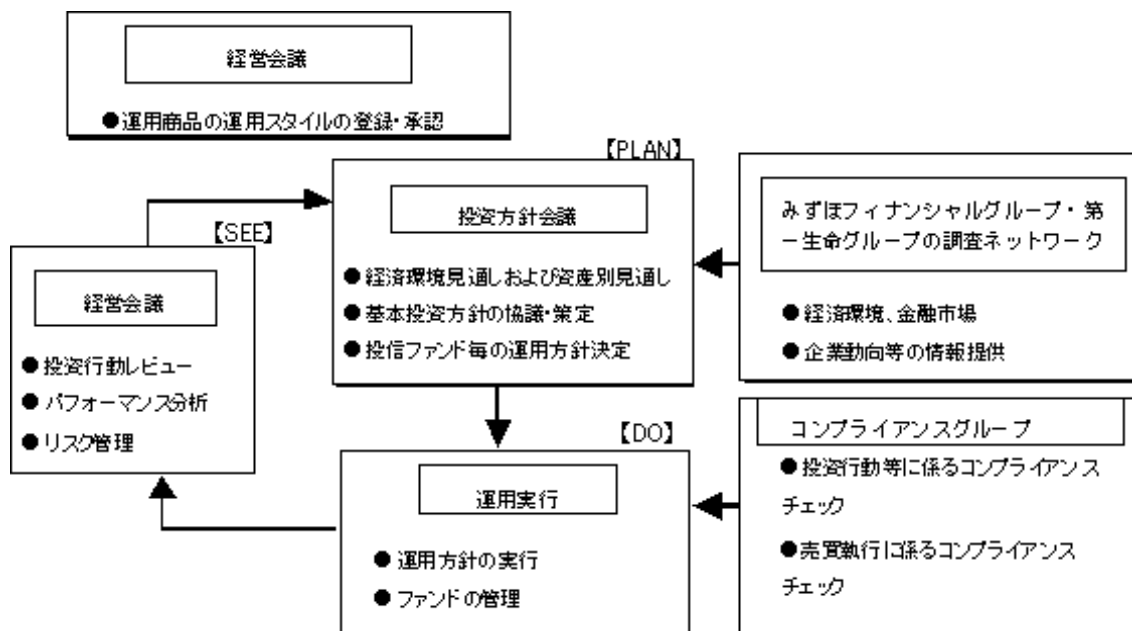
## 投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成22年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成22年3月31日現在、委託会社の運用する投資信託は278本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	19	94,731,146,368
追加型株式投資信託	245	4,048,323,873,721
単位型公社債投資信託	13	114,890,228,300
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	1,577,337,223
合計	278	4,259,522,585,612

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成20年8月7日内閣府令第50号）附則第2条により改正前の財務諸表等規則に基づき作成しております。

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

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第23期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）の財務諸表について、新日本監査法人の監査を受け、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）の財務諸表および第25期中間会計期間（自平成21年4月1日至平成21年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査および中間監査を受けております。

なお、新日本有限責任監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成20年7月1日をもって新日本監査法人から名称変更しております。



## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第23期 (平成20年3月31日現在)		第24期 (平成21年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金・預金		13,267,152		12,558,999
前払費用		64,301		54,242
未収委託者報酬		3,423,783		2,254,741
未収運用受託報酬		-		1,046,291
未収投資助言報酬		-	2	252,337
未収収益	2	1,933,135		197,045
未収消費税等		-		98,402
繰延税金資産		553,910		369,826
その他		43,115		23,865
流動資産計		19,285,400		16,855,752
固定資産				
有形固定資産		488,486		501,481
建物	1	335,163	1	283,511
器具備品	1	153,323	1	201,169
建設仮勘定		-		16,799
無形固定資産		616,621		721,812
商標権	1	2,104	1	1,335
ソフトウェア	1	606,677	1	555,121
ソフトウェア仮勘定		-		157,595
電話加入権		7,148		7,148
電話施設利用権	1	691	1	611
投資その他の資産		5,842,772		4,051,090
投資有価証券		3,097,362		498,041
関係会社株式		1,261,144		1,661,144
繰延税金資産		233,849		442,390
長期差入保証金		1,194,310		1,169,961
その他		83,032		306,478
貸倒引当金		26,925		26,925
固定資産計		6,947,880		5,274,384
資産合計		26,233,280		22,130,137

（単位：千円）

	第23期 （平成20年3月31日現在）	第24期 （平成21年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	162,809	37,445
未払金	2,186,170	1,293,636
未払収益分配金	8,470	8,201
未払償還金	50,930	48,993
未払手数料	1,527,000	931,529
その他未払金	599,769	304,912
未払費用	2 1,653,424	2 1,040,620
未払法人税等	2,575,999	179,557
未払消費税等	316,821	-
賞与引当金	687,832	618,303
その他	-	20,741
流動負債計	7,583,058	3,190,304
固定負債		
役員退職慰労引当金	179,237	145,732
退職給付引当金	334,280	404,437
固定負債計	513,518	550,169
負債合計	8,096,577	3,740,474
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	13,718,238	13,962,732
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	7,040,000	10,040,000
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	6,054,944	3,299,438
株主資本合計	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	10,012	1,547
評価・換算差額等合計	10,012	1,547
純資産合計	18,136,703	18,389,662
負債・純資産合計	26,233,280	22,130,137

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	32,833,957		24,552,133	
顧問料	6,804,888		-	
運用受託報酬	-		4,509,994	
投資助言報酬	-		1,228,096	
その他営業収益	863,734		697,007	
営業収益計		40,502,581		30,987,232
営業費用				
支払手数料	14,748,737		10,967,681	
広告宣伝費	830,858		488,151	
公告費	3,293		-	
受益証券発行費	2,167		-	
調査費	6,268,709		5,076,631	
調査費	2,415,829		2,506,175	
委託調査費	3,852,880		2,570,455	
委託計算費	345,695		325,174	
営業雑経費	1,143,457		812,013	
通信費	33,290		35,872	
印刷費	1,041,499		732,985	
協会費	22,173		25,313	
諸会費	41		41	
支払販売手数料	46,452		17,800	
営業費用計		23,342,919		17,669,652
一般管理費				
給料	4,082,147		4,587,983	
役員報酬	1 223,147		1 234,353	
給料・手当	3,258,097		3,647,502	
賞与	600,902		706,127	
交際費	44,264		44,085	
寄付金	4,010		4,462	
旅費交通費	309,129		308,237	
租税公課	103,549		82,762	
不動産賃借料	754,728		801,086	
退職給付費用	88,449		106,223	
固定資産減価償却費	337,808		330,412	
福利厚生費	23,757		22,556	
修繕費	16,394		6,755	
賞与引当金繰入	687,832		618,303	
役員退職慰労引当金繰入	60,123		42,570	
役員退職金	528		13,175	
機器リース料	1,207		973	
事務委託費	279,797		247,087	
消耗品費	76,448		84,099	
器具備品費	10,563		6,094	
諸経費	204,099		177,386	
一般管理費計		7,084,837		7,484,253
営業利益		10,074,823		5,833,325

（単位：千円）

	第23期 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）		第24期 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		92,575		4,558
受取利息		59,127		59,458
時効成立分配金		298		164
為替差益		14,223		-
雑収入		7,064		5,482
先物利益		-		180,422
営業外収益計		173,289		250,086
営業外費用				
為替差損		-		24,553
時効成立後支払分配金		557		517
投資信託解約損		109,677		38,254
営業外費用計		110,234		63,325
経常利益		10,137,878		6,020,086
特別利益				
関係会社株式売却益		39,215		-
貸倒引当金戻入益		123		-
特別利益計		39,338		-
特別損失				
固定資産除却損	2	10,466	2	14,476
ゴルフ会員権売却損		5,200		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,000
投資有価証券評価損		-		484,009
退職給付費用		106,395		-
特別損失計		122,062		504,485
税引前当期純利益		10,055,154		5,515,600
法人税、住民税及び事業税		4,252,414		2,301,373
法人税等調整額		172,622		30,266
法人税等合計		4,079,792		2,271,106
当期純利益		5,975,362		3,244,494

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	前期末残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	前期末残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	前期末残高	4,640,000	7,040,000
	当期変動額	2,400,000	3,000,000
	当期末残高	7,040,000	10,040,000
	研究開発積立金		
	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	前期末残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	前期末残高	4,843,582	6,054,944
	当期変動額		
	剰余金の配当	2,364,000	3,000,000
	別途積立金の積立	2,400,000	3,000,000
	当期純利益	5,975,362	3,244,494
	当期末残高	6,054,944	3,299,438
	株主資本合計		
	前期末残高	14,535,353	18,146,716
	当期変動額	3,611,362	244,494
	当期末残高	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	992	10,012
	当期変動額(純額)	11,004	8,464
	当期末残高	10,012	1,547
純資産合計			
	前期末残高	14,536,346	18,136,703
	当期変動額	3,600,357	252,958
	当期末残高	18,136,703	18,389,662

[次へ](#)

## 重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正法人税法に規定する方法により減価償却費を計上しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(追加情報) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年3月31日以前に取得した有形固定資産については、償却可能限度額まで償却が終了した翌事業年度から、残存簿価を5年間で均等償却しております。 なお、これにより営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p>

<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更)</p> <p>従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用していましたが、当事業年度末から原則法に変更いたしました。</p> <p>この変更は、従業員数の増加に伴い、退職給付債務の数理計算に用いられる基礎率の推定について一定の有効性が確保されることによって、原則法による計算の結果に一定の高い水準の信頼性が得られたことから、退職給付費用の期間損益計算をより適正化するために行ったものであります。</p> <p>この変更に伴い、当事業年度末における簡便法と原則法により計算した退職給付債務の差額106,395千円を特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法によった場合と比較して、税引前当期純利益は106,395千円減少しております。</p> <p>なお、上記に記載の通り退職給付債務の算定方法の変更が当事業年度末に行われたため、当中間会計期間は従来の方によっております。したがって、当中間会計期間は、当事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>税抜方式によっております。</p>	<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>(3) 同左</p> <p>(4) 同左</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>同左</p>

## 会計方針の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>

## 表示方法の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
<p>金融商品取引業等に関する内閣府令が制定されたことに伴い、以下のとおり表示方法を変更しております。</p> <p>（貸借対照表） 前事業年度において区分掲記していた「現金」および「預金」は、当事業年度から「現金・預金」として表示しております。なお、当事業年度末における「現金」および「預金」の金額はそれぞれ1,205千円、13,265,946千円であります。</p> <p>（損益計算書） 前事業年度において区分掲記していた「法人税等」は当事業年度から「法人税、住民税及び事業税」として表示しております。</p>	<p>（貸借対照表）</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>前事業年度において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当事業年度から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。</li> <li>前事業年度において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。</li> </ol> <p>（損益計算書） 前事業年度において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。</p>



## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第23期（平成20年3月31日現在）			第24期（平成21年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物	373,021千円		建物	426,679千円	
器具備品	229,532千円		器具備品	290,397千円	
商標権	5,582千円		商標権	6,351千円	
ソフトウェア	653,371千円		ソフトウェア	648,713千円	
電話施設利用権	905千円		電話施設利用権	985千円	
2. 関係会社項目 関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			2. 関係会社項目 関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収収益	379,257千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円
流動負債	未払費用	641,087千円	流動負債	未払費用	345,744千円

## （損益計算書関係）

第23期 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	第24期 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
1. 役員報酬の限度額	1. 役員報酬の限度額
取締役 年額250,000千円	同左
監査役 年額 50,000千円	
2. 固定資産除却損の内訳	2. 固定資産除却損の内訳
建物 3,634千円	建物 2,251千円
器具備品 5,271千円	器具備品 9,818千円
ソフトウェア 1,560千円	ソフトウェア 2,406千円

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## （1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29日

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

## 第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

## (リース取引関係)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)				第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)			
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額 相当額	29,608千円	-	29,608千円	減価償却累計額 相当額	52,335千円	-	52,335千円
期末残高相当額	60,993千円	-	60,993千円	期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	22,595千円	39,602千円	62,197千円	未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払 利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払 利息相当額			
支払リース料		25,173千円		支払リース料		24,096千円	
減価償却費相当額		20,191千円		減価償却費相当額		22,727千円	
支払利息相当額		1,754千円		支払利息相当額		1,501千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定 額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との 差額を利息相当額とし、各期への配分方法について は、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2.オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2.オペレーティング・リース取引 同左			

(有価証券関係)

## 第23期（平成20年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,031,000	3,014,115	16,884
小計	3,031,000	3,014,115	16,884
合計	3,031,000	3,014,115	16,884

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
574,322	3,196	112,873

## 7. 時価のない主な有価証券の内容

## 貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 83,246千円

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

該当事項はありません。

## 第24期（平成21年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 4. その他有価証券で時価のあるもの

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

## 7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 82,746千円

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

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

## 第23期（平成20年3月31日現在）

## 1．取引の状況に関する事項

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 2．取引の時価等に関する事項

区分	種類	第23期(平成20年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	523,028	-	508,267	14,760
	合計	523,028	-	508,267	14,760

## （注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## 第24期（平成21年3月31日現在）

## 1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引及び株価指数先物取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスク及び株価変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 2. 取引の時価等に関する事項

## (1) 通貨関連

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

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (2) 株式関連

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

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## （退職給付関係）

## 第23期（平成20年3月31日現在）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2．退職給付債務に関する事項

当社は、当事業年度末から原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成20年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		334,280
	退職給付引当金		334,280
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		165,213
	確定拠出年金	拠出額	29,631
	退職給付費用		194,844

## 3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第23期 (平成20年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準

## 第24期（平成21年3月31日現在）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2．退職給付債務に関する事項

当社は、原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成21年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		431,448
	未認識数理計算上の差異		27,011
	退職給付引当金		404,437
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		71,958
	確定拠出年金	拠出額	34,264
	退職給付費用		106,223

## 3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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



(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	197,866	19,218
未払事業所税	5,714	6,269
賞与引当金	279,947	251,649
未払法定福利費	27,884	27,146
未払確定拠出年金掛金	2,610	2,667
減価償却超過額	-	7,579
減価償却超過額（一括償却資産）	10,139	8,559
繰延資産償却超過額（税法上）	27,940	46,274
その他（未払金等）	1,807	461
退職給付引当金	136,052	164,605
役員退職慰労引当金	72,949	59,313
ゴルフ会員権評価損	3,135	5,577
投資有価証券評価損	-	196,991
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	6,871	1,062
繰延税金資産合計	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	<u>-</u>	<u>-</u>
差引繰延税金資産の純額	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>

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

第23期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第24期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（関連当事者との取引）

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

## (1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名， 出向3名， 転籍2名	資産の運用および 助言、当社 設定投信の 販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	833,702	未収 収益	219,740
								販売手数料 の支払	46,452	-	-
								保険料の支 払	5,707	-	-

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注2）支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	（所有）直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	1,096,514	未払費用	456,913
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	（所有）直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	466,450	未払費用	184,052

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を助案した個別契約により決定しております。
- （注2）上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
兄弟会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	2,104,660	未払手数料	145,839
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	10,709億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	739,368	未払手数料	137,112
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	-	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払 業務委託料の支払	340,983 16,800	未払費用 -	153,240 -

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## 第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

## （追加情報）

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

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

## (1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名， 出向3名， 転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投資の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	718,870	未収投資助言報酬	172,117
								販売手数料の支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注2) 支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

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

## 取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
兄弟会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,531,236	未払手数料	96,917
								預金の引出(純額)	300,370	現金・預金	322,365
								受取利息	894	未収収益	-
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	10,709億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	701,162	未払手数料	91,628
								預金の引出(純額)	1,034,219	現金・預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収収益	4,158
みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	-	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	299,054	未払費用	117,438	
							業務委託料の支払	17,550	未払費用	2,677	

## 取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

## (1株当たり情報)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
1株当たり純資産額 755,695円99銭 1株当たり当期純利益金額 248,973円42銭	1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

## (重要な後発事象)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
平成20年3月28日開催の取締役会の決議により、平成20年4月1日付にて100%出資の子会社DIAM SINGAPORE PTE. LTD. を設立し、その後、平成20年4月14日付にて株主割当増資を実施いたしました。 (出資の総額400,000千円、資本金400,000千円)	平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management (HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。 当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。  <子会社の概要> 商 号： DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容： 資産運用業務 設 立 年 月 日： 平成21年3月19日 資 本 金： 500,000千円 発行済株式総数： 500,000株 出 資 の 総 額： 500,000千円 出 資 比 率： 当社100%

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)
(資産の部)	
流動資産	
現金・預金	10,803,774
前払費用	87,625
未収委託者報酬	3,140,781
未収運用受託報酬	1,453,060
未収投資助言報酬	261,117
未収収益	235,649
繰延税金資産	453,470
その他	54,240
流動資産計	16,489,720
固定資産	
有形固定資産	704,558
建物	1 260,612
器具備品	1 330,061
建設仮勘定	113,884
無形固定資産	848,262
商標権	1 951
ソフトウェア	1 561,904
ソフトウェア仮勘定	277,687
電話加入権	7,148
電話施設利用権	1 571
投資その他の資産	6,281,022
投資有価証券	2,046,821
関係会社株式	2,161,144
繰延税金資産	275,421
長期差入保証金	1,171,581
その他	652,978
貸倒引当金	26,925
固定資産計	7,833,843
資産合計	24,323,563

（単位：千円）

	第25期中間会計期間末 （平成21年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	104,759
未払金	2,018,968
未払収益分配金	534,811
未払償還金	50,425
未払手数料	1,275,982
その他未払金	157,750
未払費用	1,571,027
未払法人税等	985,116
未払消費税等	78,006
前受収益	4,749
賞与引当金	613,388
その他	15,176
流動負債計	5,391,192
固定負債	
退職給付引当金	448,442
役員退職慰労引当金	137,263
固定負債計	585,706
負債合計	5,976,898
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	13,655,387
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	11,650,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,382,093
株主資本計	18,083,865
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	262,800
評価・換算差額等計	262,800
純資産合計	18,346,665
負債・純資産合計	24,323,563

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	14,018,274	
運用受託報酬	2,081,446	
投資助言報酬	507,261	
その他営業収益	345,980	
	営業収益計	16,952,963
営業費用		
支払手数料	7,634,536	
広告宣伝費	69,199	
公告費	1,531	
調査費	2,406,583	
調査費	1,289,713	
委託調査費	1,116,870	
委託計算費	178,892	
営業雑経費	352,091	
通信費	16,109	
印刷費	318,417	
協会費	10,612	
諸会費	18	
支払販売手数料	6,933	
	営業費用計	10,642,834
一般管理費		
給料	2,035,715	
役員報酬	121,117	
給料・手当	1,914,598	
交際費	22,193	
寄付金	3,450	
旅費交通費	125,038	
租税公課	42,954	
不動産賃借料	397,351	
退職給付費用	65,809	
固定資産減価償却費	1	183,213
福利厚生費	13,579	
修繕費	2,400	
賞与引当金繰入	613,388	
役員退職慰労引当金繰入	27,176	
役員退職金	1,854	
機器リース料	1,349	
事務委託費	130,563	
消耗品費	41,117	
器具備品費	1,672	
諸経費	50,382	
	一般管理費計	3,759,211
営業利益		2,550,918



（単位：千円）

	第25期中間会計期間 （自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	2,126	
受取利息	9,892	
雑収入	2,506	
投資信託解約益	313,059	
営業外収益計		327,583
営業外費用		
為替差損	4,492	
時効成立後支払分配金	255	
先物損失	627,442	
営業外費用計		632,189
経常利益		2,246,312
特別損失		
固定資産除却損	3,566	
特別損失計		3,566
税引前中間純利益		2,242,746
法人税、住民税及び事業税		1,022,198
法人税等調整額		98,107
法人税等合計		924,091
中間純利益		1,318,654

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第25期中間会計期間 (自 平成21年4月 1日 至 平成21年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	前期末残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	前期末残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	前期末残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	前期末残高	10,040,000
	当中間期変動額	1,610,000
	当中間期末残高	11,650,000
	研究開発積立金	
	前期末残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	前期末残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	前期末残高	3,299,438
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	1,626,000
	別途積立金の積立	1,610,000
	中間純利益	1,318,654
	当中間期末残高	1,382,093
	株主資本合計	
	前期末残高	18,391,210
	当中間期変動額	307,345
	当中間期末残高	18,083,865
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	前期末残高	1,547
	当中間期変動額（純額）	264,347
	当中間期末残高	262,800
純資産合計		
	前期末残高	18,389,662
	当中間期変動額	42,997
	当中間期末残高	18,346,665

[前](#) [次](#)

## 中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

項目	第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)
1. 有価証券の評価基準および評価方法	(1)子会社株式および関連会社株式 ：移動平均法による原価法  (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年  (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。  (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
4. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。  (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。  (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。  (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
5. 外貨建ての資産および負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)
1. 固定資産の減価償却累計額	建物 … 450,639千円 器具備品 … 333,347千円 商標権 … 6,735千円 ソフトウェア … 587,503千円 電話施設利用権 … 1,025千円

(中間損益計算書関係)

項目	第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産 ...
	無形固定資産 ...	105,587千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第25期中間会計期間(自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通株式	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

(リース取引関係)

第25期中間会計期間(自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)		
1. ファイナンス・リース取引		
(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)		
リース資産の内容 該当事項はありません。		
リース資産の減価償却の方法 中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項「3. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。		
(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)		
リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および中間期末残高相当額		
	器具備品	
取得価額相当額	90,601千円	
減価償却累計額相当額	63,699千円	
中間期末残高相当額	26,901千円	
未経過リース料中間期末残高相当額		
	1年以内	1年超
	21,658千円	6,401千円
	合計	
	28,059千円	
当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額		
支払リース料	12,048千円	
減価償却費相当額	11,363千円	
支払利息相当額	506千円	

第25期中間会計期間(自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)

## 減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

## 利息相当額の算定方法

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

## 2. オペレーティング・リース取引

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

1年以内	1年超	合計
1,609千円	2,279千円	3,888千円

## (有価証券関係)

## 第25期中間会計期間末(平成21年9月30日現在)

- 満期保有目的の債券で時価のあるもの  
該当事項はありません。
- 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの  
該当事項はありません。
- その他有価証券で時価のあるもの

区分	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額(千円)	差額 (千円)
株式	146,101	244,571	98,469
債券	-	-	-
その他(投資信託)	1,374,802	1,719,503	344,700
合計	1,520,904	1,964,075	443,170

- 時価評価されていない有価証券  
その他有価証券

非上場株式(店頭売買株式を除く) 中間貸借対照表計上額  
82,746千円

## (デリバティブ取引関係)

デリバティブ取引の契約額等、時価および評価損益の状況

## 1. 通貨関連

対象物の種類	取引の種類	第25期中間会計期間末(平成21年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
通貨	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	225,100	-	217,745	7,355
	ユーロ	100,785	-	101,717	931
	英ポンド	32,363	-	30,779	1,583
	香港ドル	25,341	-	25,414	72
	豪ドル	92,700	-	94,588	1,888
シンガポールドル	14,175	-	14,295	120	
	合計	490,466	-	484,540	5,926

## 2. 株式関連

対象物の種類	取引の種類	第25期中間会計期間末(平成21年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
株式	株価指数先物取引				
	売建				
		1,478,223	-	1,474,023	4,199
	合計	1,478,223	-	1,474,023	4,199

## 3. 不動産投資信託関連

対象物の種類	取引の種類	第25期中間会計期間末（平成21年9月30日現在）			
		契約額等 （千円）	契約額のうち 1年超（千円）	時価 （千円）	評価損益 （千円）
不動産 投資信託	REIT指数先物取引 売建	114,492	-	112,752	1,740
	合計	114,492	-	112,752	1,740

## （持分法損益等）

第25期中間会計期間（自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）
該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第25期中間会計期間（自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）	
1株当たり純資産額	764,444円38銭
1株当たり中間純利益金額	54,943円95銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	

## （注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第25期中間会計期間 （自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）
中間純利益	1,318,654千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,318,654千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第25期中間会計期間（自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己又はその取締役若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、若しくは取引の公正を害し、又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、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）又は子法人等（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又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又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、運用財産の額若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又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、若しくは取引の公正を害し、又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

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社受託会社

##### b. 資本金の額

平成21年3月末日現在 247,231百万円

##### c. 事業の内容

日本において信託銀行業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

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

(平成22年4月1日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
第一生命保険株式会社	210,200	日本において保険業務を営んでおります。

### 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)信託契約の一部解約事務
- (3)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (4)受益者に対する収益分配金の再投資
- (5)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
- (6)その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

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



### 第3【その他】

- 1 交付目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載するほか、届出書本文第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」の主要内容を要約し、「ファンドの概要」として、冒頭に記載します。また、目論見書の表紙裏に金融商品の販売等に関する法律に係る重要事項を記載することがあります。
- 2 交付目論見書の巻末に用語説明を掲載します。  
なお、交付目論見書の巻末に信託約款を掲載し、届出書本文第二部「ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」の詳細な内容については、当該約款を参照することで、届出書の内容の記載とすることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成22年4月7日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス30インデックスファンドの平成21年2月26日から平成22年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス30インデックスファンドの平成22年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年4月7日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス50インデックスファンドの平成21年2月26日から平成22年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス50インデックスファンドの平成22年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年4月7日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス70インデックスファンドの平成21年2月26日から平成22年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス70インデックスファンドの平成22年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

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

## 独立監査人の監査報告書

平成21年6月29日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山本禎良 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山内正彦 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[ファンド監査報告書3へ](#) [委託会社の監査報告書（中間）へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成21年12月24日

D I A Mアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 浅野 功 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 近藤 敏弘 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21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21年4月1日から平成21年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

---

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年4月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 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 D C バランス30インデックスファンドの平成20年2月26日から平成21年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討している。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス30インデックスファンドの平成21年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)



独立監査人の監査報告書

平成21年4月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 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 D C バランス50インデックスファンドの平成20年2月26日から平成21年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討している。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス50インデックスファンドの平成21年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)



独立監査人の監査報告書

平成21年4月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 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 D C バランス70インデックスファンドの平成20年2月26日から平成21年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス70インデックスファンドの平成21年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

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

## 独立監査人の監査報告書

平成20年6月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印  
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

[ファンド監査報告書3へ](#)