

【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26年5月23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】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	D I A M 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」、「ファンド」、「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また各々、「D I A M 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の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関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、公表されません。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（ 5 ） 【 申込手数料 】

ありません。

（ 6 ） 【 申込単位 】

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

（ 7 ） 【 申込期間 】

継続申込期間：平成26年5月24日から平成27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いずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

（ 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します。

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

（ 1 0 ） 【 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します。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ）【その他】

お申込みに際しては、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。

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。委託会社は、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。

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せん。

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

ファンドの特色

1

●ライフサイクルにあわせた分散投資

- 主としてマザーファンド*を通じて実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券の4つのアセット(資産)に投資します。
*国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 個々のアセット(資産)において、数多くの銘柄に分散して投資することにより、より一層の分散投資効果を追求します。
- 基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス(注)に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。
- 運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

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

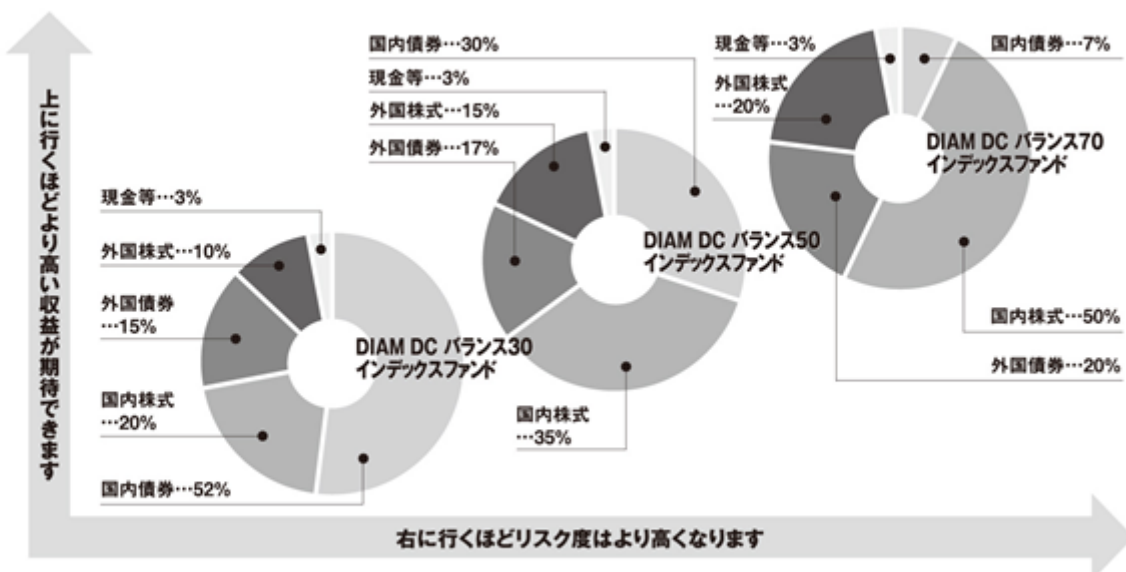
2

●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

3ファンドの基本アロケーション

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



各ファンドは、同一のマザーファンドに投資を行うため、値動きの大きい株式・外国証券への投資割合が高いほど、リスク・リターンともより高くなります。

- 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。
- 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。
- DIAM DC バランス70インデックスファンド
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

分配方針

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

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

商品分類表

DIAM 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

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

補足分類

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

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

対象インデックス

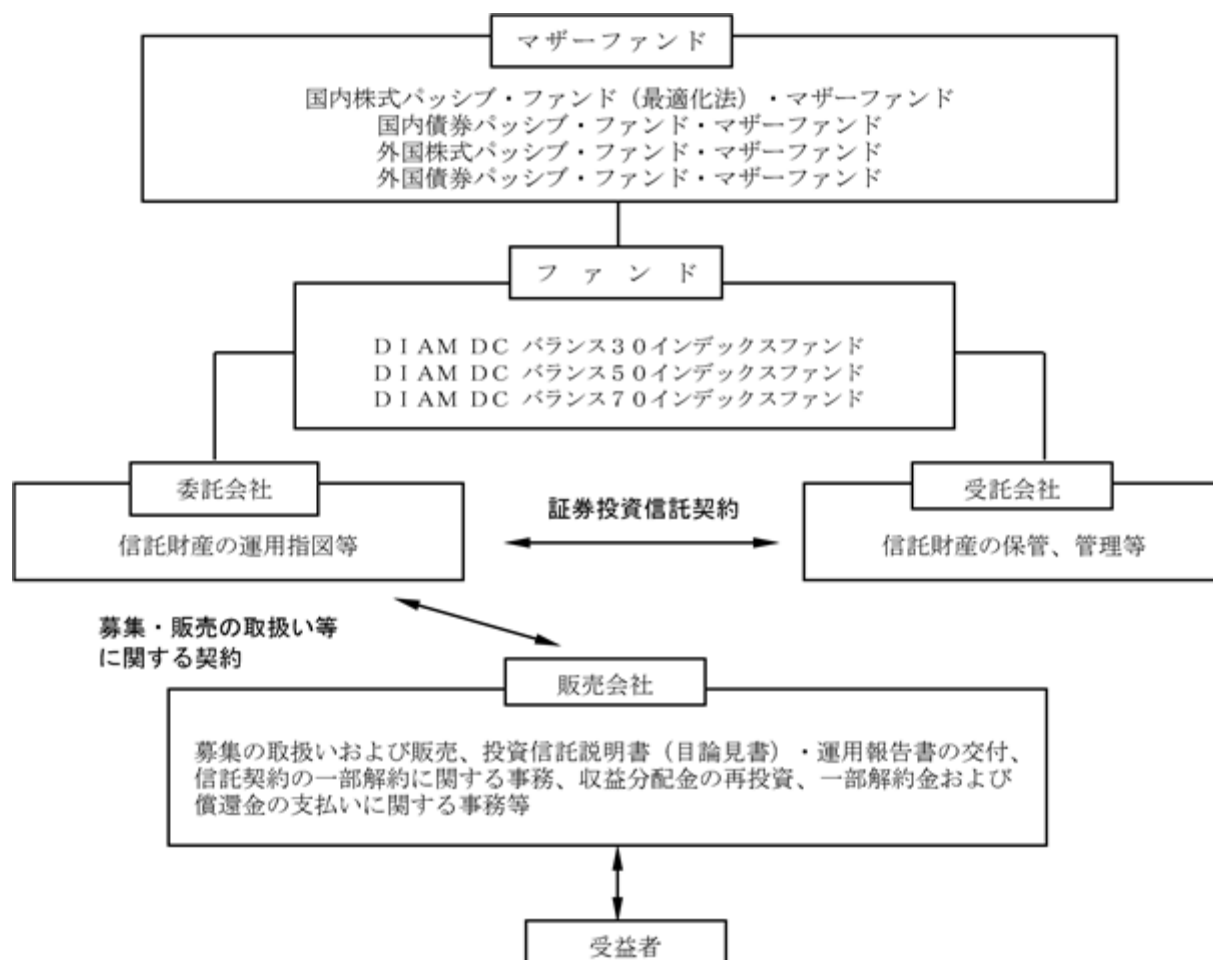
「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（2）【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

(3) 【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

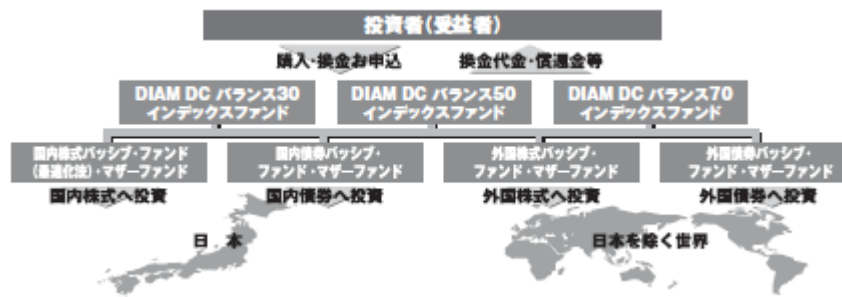
当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、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。

「ファミリーファンド方式」とは

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成26年2月28日現在）

委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日	会社設立
平成10年 3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月 1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月 1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

(平成26年2月28日現在)

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

当ファンドは、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、安定的な運用を行います。

<投資対象>

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

<投資態度>

(1)主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、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)「D I A M D C バランス30インデックスファンド」

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。

「D I A M D C バランス50インデックスファンド」

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。

「D I A M D C バランス70インデックスファンド」

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。

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

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

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

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

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

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、**株**東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

(注2)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毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

(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。

(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せん。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第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、(5)～(15)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(25)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3. 金融商品の指図範囲(約款第17条第2項)

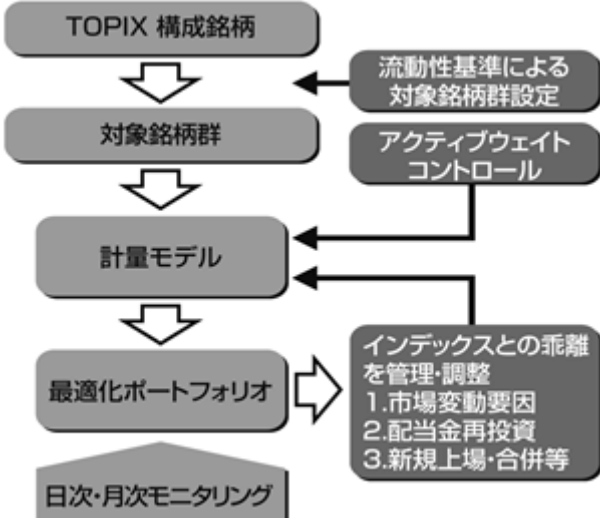
委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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

- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3.の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。（約款第17条第3項）

（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

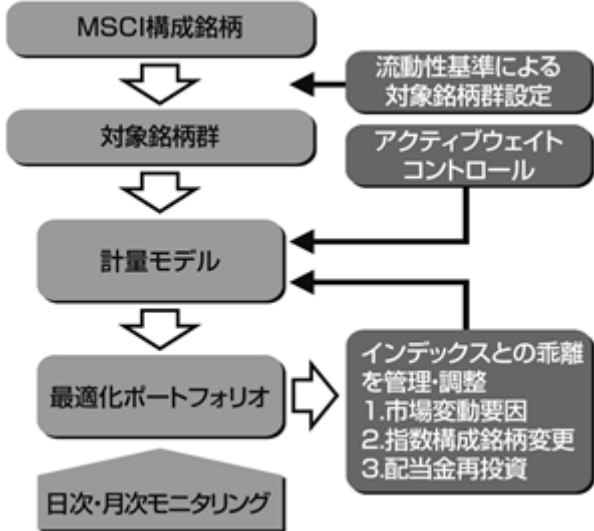
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p>

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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>

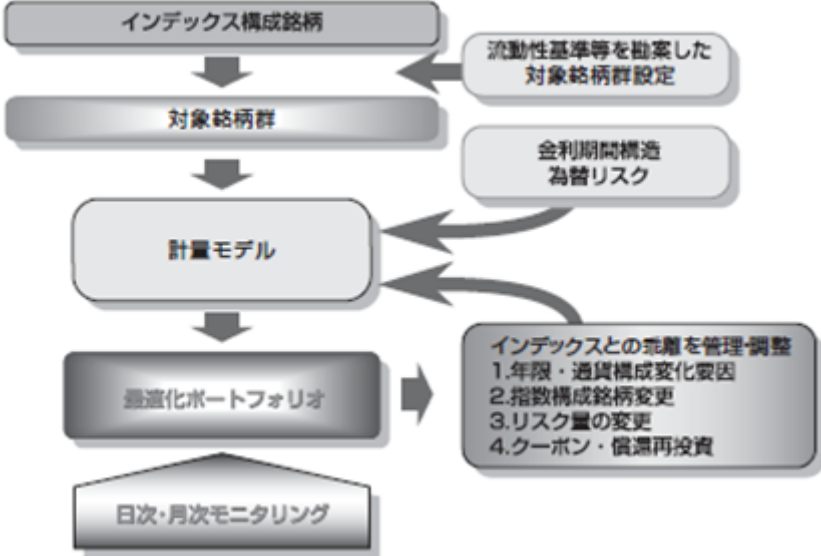
運用プロセス	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因、 が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資
主な投資制限	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p>

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-----------------------

基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] D --> F[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B D --> G[アクティブウェイトコントロール] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> C </pre>

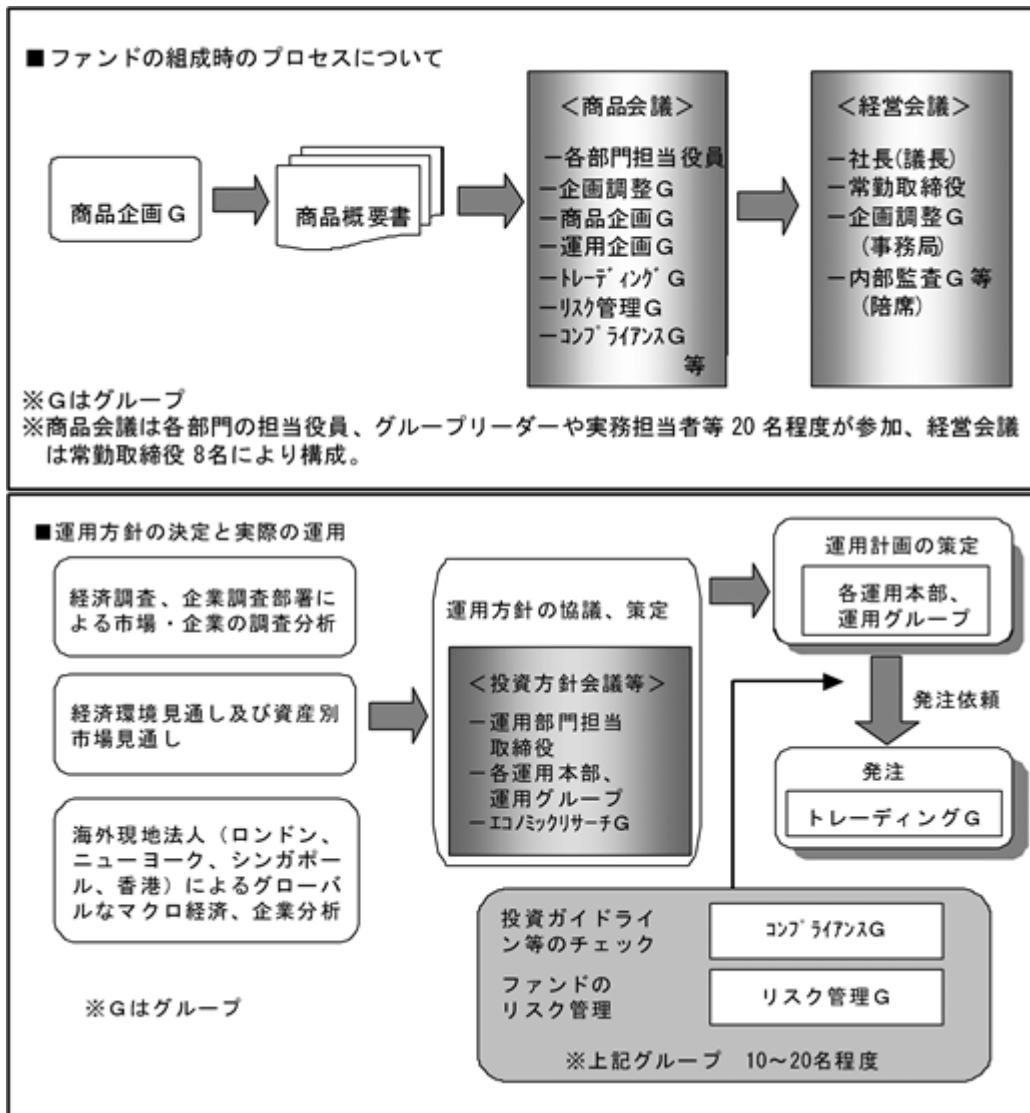
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資割合には、制限を設けません。2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
--------	--

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none">1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「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。2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 
主な投資制限	<p>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ません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

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

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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

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

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

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

上記体制は平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則毎年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. 上記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再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、別に定める契約に基づき、決算日において振替機関等の振

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

（５）【投資制限】

「D I A M 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「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の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「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の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「運用の基本方針」2．運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

共通

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

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

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

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

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

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

(6)同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限（約款第21条）

(a)委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の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。

(b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、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に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(7)同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第22条）

(a)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。

(b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、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当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(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との指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

1)信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2)株式分割により取得する株券

3)有償増資により取得する株券

4)売出しにより取得する株券

5)信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6)信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（(5)に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(9)先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第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号八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上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
 - 3)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引に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上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用してい

るものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額(「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。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に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。

(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。）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。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に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。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (f)上記(e)においてマザーファンドの信託財産に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1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

- 1)株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価総額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2)公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b)上記(a)1)～2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- (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)上記(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、上記(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)上記(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、上記(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)上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- (15)特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第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)上記(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)上記(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)上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(17)資金の借入れ（約款第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 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(1) 株式投資リスク

各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、各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

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

(2) 債券投資リスク

各ファンドでは実質的に債券に投資します。債券では、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、各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

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

(3) 為替リスク

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

各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。

この資産配分が各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、各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。

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

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

各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各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、資金変動が起これ、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、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

資金動向、市場動向等によっては、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は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

各ファンドは、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。

注意事項

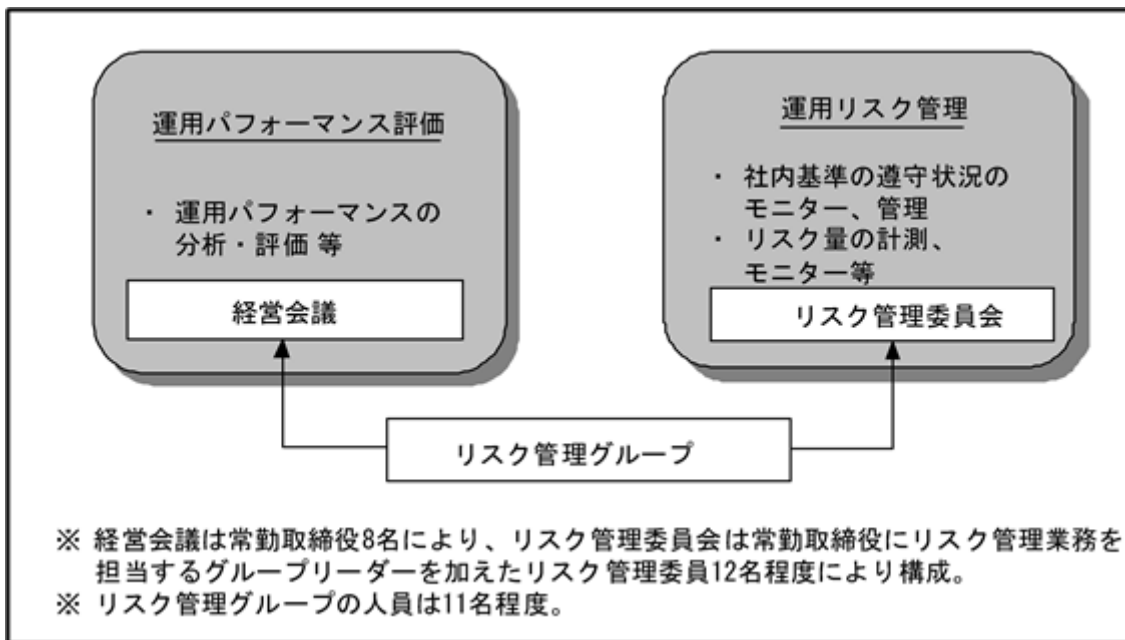
イ．当ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

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

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

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

<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

上記体制は平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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】

DC バランス30 インデックスファンド	ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.2592%（税抜0.24%）	信託報酬の配分（税抜）	
		委託会社	年率0.09%
		販売会社	年率0.12%
		受託会社	年率0.03%
DC バランス50 インデックスファンド	ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.2916%（税抜0.27%）	信託報酬の配分（税抜）	
		委託会社	年率0.105%
		販売会社	年率0.135%
		受託会社	年率0.030%
DC バランス70 インデックスファンド	ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.324%（税抜0.30%）	信託報酬の配分（税抜）	
		委託会社	年率0.12%
		販売会社	年率0.15%
		受託会社	年率0.03%

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、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、上記内容が変更になることがあります。

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、平成26年2月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	3,234,045,330	97.00
内 日本	3,234,045,330	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	100,189,795	3.00
純資産総額	3,334,235,125	100.00

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

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

D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	6,088,349,585	96.99
内 日本	6,088,349,585	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	188,948,636	3.01
純資産総額	6,277,298,221	100.00

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

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

D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	3,650,819,585	96.98
内 日本	3,650,819,585	96.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	113,501,425	3.02
純資産総額	3,764,321,010	100.00

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

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	307,137,036,070	96.06
内 日本	307,137,036,070	96.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,599,751,304	3.94
純資産総額	319,736,787,374	100.00

その他資産の投資状況

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	12,679,170,000	3.97
内 日本	12,679,170,000	3.97

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	354,644,410,400	79.89
内 日本	354,644,410,400	79.89
地方債証券	28,762,102,750	6.48
内 日本	28,762,102,750	6.48
特殊債券	29,888,355,879	6.73
内 日本	29,888,355,879	6.73
社債券	27,526,212,620	6.20
内 日本	26,910,238,620	6.06
内 アメリカ	514,724,000	0.12
内 オーストラリア	101,250,000	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,090,508,546	0.70
純資産総額	443,911,590,195	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	300,007,583,894	96.47
内 アメリカ	170,043,254,027	54.68
内 イギリス	28,360,458,243	9.12
内 スイス	13,969,207,697	4.49
内 カナダ	13,468,576,421	4.33
内 フランス	12,954,493,958	4.17
内 ドイツ	12,901,196,549	4.15
内 オーストラリア	9,685,247,998	3.11
内 オランダ	5,183,192,884	1.67
内 スペイン	4,690,905,905	1.51
内 スウェーデン	4,453,182,014	1.43
内 香港	3,154,310,422	1.01
内 イタリア	3,121,211,861	1.00
内 アイルランド	2,928,827,193	0.94
内 シンガポール	1,934,745,110	0.62
内 ジャージー	1,934,289,389	0.62
内 デンマーク	1,905,595,241	0.61
内 ベルギー	1,660,936,624	0.53
内 オランダ領キュラソー	1,269,890,787	0.41
内 フィンランド	1,256,490,705	0.40
内 パミュダ	1,136,493,030	0.37
内 ノルウェー	924,646,668	0.30
内 イスラエル	674,098,055	0.22
内 ルクセンブルグ	538,514,358	0.17
内 ケイマン諸島	410,687,374	0.13
内 オーストリア	393,072,849	0.13
内 ポルトガル	264,883,156	0.09
内 イギリス領バージン諸島	194,965,102	0.06
内 ニューゼaland	169,376,493	0.05
内 パナマ	156,514,664	0.05
内 リベリア	88,739,006	0.03
内 ガーンジー	78,364,493	0.03
内 マン島	63,808,239	0.02
内 モーリシャス	37,407,379	0.01
投資信託受益証券	853,414,165	0.27
内 オーストラリア	732,225,476	0.24
内 シンガポール	121,188,689	0.04
投資証券	5,346,014,485	1.72
内 アメリカ	4,285,627,373	1.38
内 イギリス	423,524,759	0.14
内 フランス	381,905,163	0.12
内 香港	112,976,077	0.04
内 カナダ	105,971,983	0.03
内 オランダ	36,009,130	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,765,084,639	1.53

純資産総額	310,972,097,183	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	651,052,000	0.21
-	651,052,000	0.21
為替予約取引(売建)	174,838,000	0.06
-	174,838,000	0.06
株価指数先物取引(買建)	4,320,383,436	1.39
内 アメリカ	2,645,811,924	0.85
内 ドイツ	895,182,600	0.29
内 イギリス	427,474,197	0.14
内 カナダ	179,296,675	0.06
内 オーストラリア	172,618,040	0.06

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

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	374,749,927,176	97.51
内 アメリカ	145,584,404,600	37.88
内 イタリア	39,427,955,939	10.26
内 フランス	39,129,296,070	10.18
内 ドイツ	33,797,415,859	8.79
内 イギリス	29,781,906,441	7.75
内 スペイン	21,123,345,676	5.50
内 ベルギー	10,649,705,274	2.77
内 オランダ	10,296,900,601	2.68
内 カナダ	8,768,472,482	2.28
内 オーストリア	6,569,755,245	1.71
内 オーストラリア	5,686,030,234	1.48
内 メキシコ	3,702,734,820	0.96
内 アイルランド	3,249,465,321	0.85
内 ポーランド	3,215,151,519	0.84
内 デンマーク	3,048,788,597	0.79
内 フィンランド	2,408,025,189	0.63
内 スウェーデン	2,104,833,430	0.55
内 マレーシア	1,920,994,183	0.50
内 南アフリカ	1,728,932,434	0.45
内 シンガポール	1,296,871,597	0.34
内 ノルウェー	1,258,941,665	0.33
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,581,067,215	2.49
純資産総額	384,330,994,391	100.00

その他資産の投資状況

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	591,100,200	0.15
-	591,100,200	0.15
為替予約取引（売建）	392,430,500	0.10
-	392,430,500	0.10

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,452,109,156	1.1945 1,734,687,042	1.1949 1,735,125,230	- -	52.04%
2	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	389,943,987	1.7170 669,566,535	1.6873 657,952,489	- -	19.73%
3	外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	305,504,835	1.6432 502,036,095	1.6413 501,425,085	- -	15.04%
4	外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	147,409,276	2.3160 341,414,624	2.3034 339,542,526	- -	10.18%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,284,050,931	1.7170 2,204,731,925	1.6873 2,166,579,135	- -	34.51%
2	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,576,398,413	1.1945 1,883,165,544	1.1949 1,883,638,463	- -	30.01%
3	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	656,719,484	1.6432 1,079,187,128	1.6413 1,077,873,689	- -	17.17%
4	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	416,887,340	2.3160 965,552,768	2.3034 960,258,298	- -	15.30%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.99%
合計	96.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,098,486,292	1.7170 1,886,203,654	1.6873 1,853,475,920	- -	49.24%
2	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	335,014,623	2.3160 775,927,368	2.3034 771,672,682	- -	20.50%
3	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	461,916,251	1.6432 759,066,975	1.6413 758,143,142	- -	20.14%
4	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	223,891,406	1.1945 267,460,673	1.1949 267,527,841	- -	7.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.98%
合計	96.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還 日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,484,000	5,900.00 14,655,600,000	5,839.00 14,504,076,000	- -	4.54%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	13,343,300	602.00 8,032,666,600	587.00 7,832,517,100	- -	2.45%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	865,000	7,375.00 6,379,375,000	7,668.00 6,632,820,000	- -	2.07%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,332,100	4,764.00 6,346,124,400	4,540.00 6,047,734,000	- -	1.89%
5	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,606,200	3,680.00 5,910,816,000	3,647.00 5,857,811,400	- -	1.83%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	22,803,700	214.00 4,879,991,800	209.00 4,765,973,300	- -	1.49%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	692,100	5,494.00 3,802,397,400	5,701.00 3,945,662,100	- -	1.23%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,108,300	3,186.00 3,531,043,800	3,232.00 3,582,025,600	- -	1.12%
9	ファナック 日本	株式 電気機器	199,100	16,360.00 3,257,276,000	17,655.00 3,515,110,500	- -	1.10%
10	日立 日本	株式 電気機器	4,286,000	780.00 3,343,080,000	803.00 3,441,658,000	- -	1.08%
11	武田薬品 日本	株式 医薬品	700,200	4,665.00 3,266,433,000	4,872.00 3,411,374,400	- -	1.07%
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	546,800	5,681.00 3,106,370,800	6,201.00 3,390,706,800	- -	1.06%
13	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,034,600	2,981.00 3,084,142,600	3,162.00 3,271,405,200	- -	1.02%
14	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,233,000	2,570.00 3,168,810,000	2,403.00 2,962,899,000	- -	0.93%
15	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	430,500	6,178.00 2,659,629,000	6,594.00 2,838,717,000	- -	0.89%
16	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	736,800	3,845.00 2,832,996,000	3,813.00 2,809,418,400	- -	0.88%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,374,500	1,955.00 2,687,147,500	1,947.00 2,676,151,500	- -	0.84%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	328,300	7,583.00 2,489,498,900	7,942.00 2,607,358,600	- -	0.82%
19	パナソニック 日本	株式 電気機器	2,039,100	1,192.00 2,430,607,200	1,276.00 2,601,891,600	- -	0.81%
20	三井物産 日本	株式 卸売業	1,621,900	1,489.00 2,415,009,100	1,564.00 2,536,651,600	- -	0.79%
21	三井不動産 日本	株式 不動産業	830,000	3,230.00 2,680,900,000	3,027.00 2,512,410,000	- -	0.79%

22	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	3,600,900	693.00 2,495,423,700	687.00 2,473,818,300	- -	0.77%
23	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,451,300	1,606.00 2,330,787,800	1,701.00 2,468,661,300	- -	0.77%
24	デンソー 日本	株式 輸送用機器	441,000	5,180.00 2,284,380,000	5,440.00 2,399,040,000	- -	0.75%
25	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	7,899,000	304.00 2,401,296,000	297.00 2,346,003,000	- -	0.73%
26	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,505,100	884.00 2,214,508,400	911.00 2,282,146,100	- -	0.71%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,785,000	1,188.00 2,120,580,000	1,205.00 2,150,925,000	- -	0.67%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	585,800	3,591.00 2,103,607,800	3,667.00 2,148,128,600	- -	0.67%
29	東京海上HD 日本	株式 保険業	682,300	2,997.00 2,044,853,100	3,012.00 2,055,087,600	- -	0.64%
30	三菱重工業 日本	株式 機械	3,178,000	638.00 2,027,564,000	625.00 1,986,250,000	- -	0.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
株式	96.06%
合計	96.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.18%
輸送用機器		11.27%
銀行業		9.00%
情報・通信業		7.08%
化学		5.18%
機械		5.05%
医薬品		4.51%
卸売業		4.49%
小売業		3.91%
食料品		3.73%
陸運業		3.62%
不動産業		3.10%
建設業		2.44%
サービス業		2.34%
電気・ガス業		2.16%
保険業		2.09%
証券、商品先物取引業		1.63%
鉄鋼		1.58%
その他製品		1.39%
精密機器		1.36%

その他金融業	1.24%
非鉄金属	0.99%
ガラス・土石製品	0.96%
ゴム製品	0.89%
繊維製品	0.70%
金属製品	0.69%
石油・石炭製品	0.59%
空運業	0.49%
鉱業	0.45%
海運業	0.37%
パルプ・紙	0.29%
倉庫・運輸関連業	0.22%
水産・農林業	0.07%
合計	96.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.13 5,507,615,000	100.18 5,510,175,000	0.600000 2023/12/20	1.24%
2	116回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.09 5,505,495,000	100.11 5,506,490,000	0.200000 2018/12/20	1.24%
3	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	102.31 5,115,500,000	102.34 5,117,300,000	0.800000 2023/6/20	1.15%
4	97回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.74 5,037,250,000	100.73 5,036,650,000	0.400000 2016/6/20	1.13%
5	328回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.60 5,030,300,000	100.69 5,034,550,000	0.600000 2023/3/20	1.13%
6	106回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.26 5,013,350,000	100.28 5,014,100,000	0.200000 2017/9/20	1.13%
7	325回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,700,000,000	102.64 4,824,504,000	102.71 4,827,417,000	0.800000 2022/9/20	1.09%
8	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,700,000,000	102.18 4,802,601,000	102.22 4,804,387,000	0.800000 2023/9/20	1.08%
9	103回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.59 4,526,955,000	100.60 4,527,270,000	0.300000 2017/3/20	1.02%
10	105回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.28 4,512,690,000	100.29 4,513,275,000	0.200000 2017/6/20	1.02%
11	293回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	107.08 4,497,444,000	107.06 4,496,730,000	1.800000 2018/6/20	1.01%
12	305回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	106.28 4,357,783,000	106.30 4,358,423,000	1.300000 2019/12/20	0.98%
13	89回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.43 4,318,877,000	100.42 4,318,361,000	0.400000 2015/6/20	0.97%
14	107回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.25 4,310,856,000	100.26 4,311,352,000	0.200000 2017/12/20	0.97%
15	296回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.10 4,244,000,000	106.07 4,242,960,000	1.500000 2018/9/20	0.96%

16	297回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	105.87 4,234,920,000	105.85 4,234,080,000	1.400000 2018/12/20	0.95%
17	321回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	104.37 4,174,800,000	104.47 4,178,880,000	1.000000 2022/3/20	0.94%
18	289回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	105.22 4,103,892,000	105.19 4,102,644,000	1.500000 2017/12/20	0.92%
19	326回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.64 4,065,960,000	101.72 4,069,120,000	0.700000 2022/12/20	0.92%
20	306回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	107.01 4,066,646,000	107.07 4,068,660,000	1.400000 2020/3/20	0.92%
21	313回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	106.63 4,052,282,000	106.67 4,053,726,000	1.300000 2021/3/20	0.91%
22	114回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.59 4,023,640,000	100.60 4,024,360,000	0.300000 2018/9/20	0.91%
23	92回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.36 4,014,560,000	100.35 4,014,200,000	0.300000 2015/9/20	0.90%
24	315回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	105.92 3,707,410,000	105.97 3,708,985,000	1.200000 2021/6/20	0.84%
25	301回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	106.97 3,637,116,000	106.92 3,635,416,000	1.500000 2019/6/20	0.82%
26	282回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	104.16 3,541,678,000	104.11 3,540,046,000	1.700000 2016/9/20	0.80%
27	93回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.78 3,527,580,000	100.77 3,526,985,000	0.500000 2015/12/20	0.79%
28	113回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.60 3,521,070,000	100.64 3,522,400,000	0.300000 2018/6/20	0.79%
29	102回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.58 3,520,305,000	100.58 3,520,475,000	0.300000 2016/12/20	0.79%
30	285回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	104.91 3,462,228,000	104.88 3,461,271,000	1.700000 2017/3/20	0.78%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	79.89%
地方債証券	6.48%
特殊債券	6.73%
社債券	6.20%
合計	99.30%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還 日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・ 周辺機器	92,754	55,454.34 5,143,611,908	53,790.67 4,989,300,714	- -	1.60%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	449,640	9,593.57 4,313,654,343	9,769.92 4,392,951,145	- -	1.41%
3	GOOGLE INC アメリカ	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	27,917	122,613.43 3,422,999,181	124,286.26 3,469,699,727	- -	1.12%
4	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	807,386	3,834.98 3,096,311,422	3,859.44 3,116,064,605	- -	1.00%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	1,039,570	2,623.93 2,727,764,731	2,599.46 2,702,331,027	- -	0.87%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	287,687	9,455.95 2,720,355,153	9,313.23 2,679,297,615	- -	0.86%
7	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	328,388	7,568.42 2,485,378,963	7,631.53 2,506,106,157	- -	0.81%
8	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	515,521	4,702.49 2,424,233,481	4,694.33 2,420,029,304	- -	0.78%
9	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	197,149	11,568.15 2,280,649,440	11,793.43 2,325,064,626	- -	0.75%
10	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN スイス	株式 医薬品	71,471	30,181.87 2,157,129,145	31,295.05 2,236,688,661	- -	0.72%
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	279,844	8,094.03 2,265,067,410	7,970.68 2,230,549,380	- -	0.72%
12	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	676,001	3,255.96 2,201,034,649	3,285.52 2,221,018,996	- -	0.71%
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	383,778	5,927.81 2,274,963,449	5,778.97 2,217,844,849	- -	0.71%
14	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,903,533	1,085.49 2,066,272,127	1,081.92 2,059,470,917	- -	0.66%
15	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	106,042	18,725.35 1,985,674,476	18,886.42 2,002,754,152	- -	0.64%
16	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	234,010	8,480.76 1,984,583,583	8,423.38 1,971,156,089	- -	0.63%
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	1,093,077	1,702.39 1,860,852,098	1,680.99 1,837,452,162	- -	0.59%
18	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	542,288	3,379.31 1,832,559,803	3,285.52 1,781,701,431	- -	0.57%
19	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	298,696	5,651.55 1,688,096,454	5,775.92 1,725,244,319	- -	0.55%
20	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,922,200	827.56 1,590,737,677	856.31 1,646,007,962	- -	0.53%

21	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	406,611	3,968.52 1,613,645,593	3,880.85 1,577,998,657	- -	0.51%
22	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融サービス	308,990	5,048.06 1,559,802,778	4,963.45 1,533,659,072	- -	0.49%
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	397,909	3,612.07 1,437,276,037	3,712.45 1,477,219,177	- -	0.48%
24	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	499,201	2,831.98 1,413,727,396	2,866.00 1,430,714,208	- -	0.46%
25	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	172,342	8,076.70 1,391,955,699	8,204.13 1,413,916,379	- -	0.45%
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	291,965	4,741.22 1,384,273,041	4,842.14 1,413,738,324	- -	0.45%
27	TOTAL SA フランス	株式 石油・ガス・消耗燃料	217,116	6,210.48 1,348,396,746	6,476.01 1,406,046,472	- -	0.45%
28	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	353,534	3,871.68 1,368,770,941	3,970.56 1,403,729,019	- -	0.45%
29	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・ カタログ販売	37,169	36,428.25 1,354,001,958	36,711.65 1,364,535,400	- -	0.44%
30	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	164,815	8,194.95 1,350,651,772	8,234.71 1,357,204,256	- -	0.44%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
株式	96.47%
投資信託受益証券	0.27%
投資証券	1.72%
合計	98.47%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
石油・ガス・消耗燃料	外国	8.49%
商業銀行		7.77%
医薬品		7.15%
保険		4.16%
各種金融サービス		3.09%
メディア		3.01%
化学		2.84%
各種電気通信サービス		2.73%
ソフトウェア		2.54%
食品		2.53%
情報技術サービス		2.27%
コンピュータ・周辺機器		2.21%
食品・生活必需品小売り		2.17%
金属・鉱業		2.16%

航空宇宙・防衛	2.14%
飲料	2.12%
資本市場	2.12%
インターネットソフトウェア・サービス	2.07%
コングロマリット	1.96%
バイオテクノロジー	1.78%
ホテル・レストラン・レジャー	1.72%
機械	1.67%
専門小売り	1.61%
電力	1.52%
家庭用品	1.49%
半導体・半導体製造装置	1.49%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.47%
ヘルスケア機器・用品	1.45%
エネルギー設備・サービス	1.40%
総合公益事業	1.31%
タバコ	1.30%
通信機器	1.26%
繊維・アパレル・贅沢品	1.20%
自動車	1.18%
陸運・鉄道	0.90%
電気設備	0.90%
インターネット販売・カタログ販売	0.87%
無線通信サービス	0.63%
自動車部品	0.62%
消費者金融	0.57%
不動産管理・開発	0.56%
航空貨物・物流サービス	0.55%
複合小売り	0.55%
専門サービス	0.48%
建設・土木	0.45%
商業サービス・用品	0.42%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.39%
電子装置・機器・部品	0.36%
建設資材	0.33%
家庭用耐久財	0.30%
商社・流通業	0.28%
パーソナル用品	0.27%
容器・包装	0.21%
建設関連製品	0.21%
運送インフラ	0.17%
旅客航空輸送業	0.15%
ガス	0.14%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13%
紙製品・林産品	0.12%
海運業	0.10%
レジャー用品	0.09%
水道	0.09%
販売	0.08%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.08%

ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
各種消費者サービス	0.03%
合計	96.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16 アメリカ	国債証券	3,873,720,000	100.32 3,886,270,852	100.41 3,889,602,252	0.625000 2016/7/15	1.01%
2	US T N/B 2.5 03/31/15 アメリカ	国債証券	3,058,200,000	102.59 3,137,621,454	102.55 3,136,428,756	2.500000 2015/3/31	0.82%
3	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	3,058,200,000	101.55 3,105,724,428	101.58 3,106,580,724	1.250000 2015/8/31	0.81%
4	US T N/B 3.25 06/30/16 アメリカ	国債証券	2,548,500,000	106.51 2,714,636,715	106.57 2,716,038,390	3.250000 2016/6/30	0.71%
5	US T N/B 2.375 02/28/15 アメリカ	国債証券	2,344,620,000	102.26 2,397,819,427	102.23 2,397,092,595	2.375000 2015/2/28	0.62%
6	US T N/B 1.25 09/30/15 アメリカ	国債証券	2,344,620,000	101.62 2,382,720,075	101.63 2,382,977,983	1.250000 2015/9/30	0.62%
7	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 フランス	国債証券	2,166,125,000	106.47 2,306,446,577	106.53 2,307,724,591	3.250000 2016/4/25	0.60%
8	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 フランス	国債証券	2,166,125,000	104.66 2,267,283,037	104.68 2,267,499,650	3.000000 2015/10/25	0.59%
9	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	107.29 2,187,550,848	107.37 2,189,161,500	3.250000 2016/12/31	0.57%
10	ITALY BTPS 3.75 08/01/15 イタリア	国債証券	2,096,250,000	104.24 2,185,256,775	104.27 2,185,759,875	3.750000 2015/8/1	0.57%
11	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	106.69 2,175,297,660	106.77 2,176,887,924	3.000000 2017/2/28	0.57%
12	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	106.26 2,166,449,268	106.33 2,168,039,532	3.000000 2016/9/30	0.56%
13	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	2,089,770,000	102.96 2,151,794,373	103.01 2,152,692,974	1.750000 2016/5/31	0.56%
14	US T N/B 2.375 03/31/16 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	104.18 2,124,083,004	104.24 2,125,285,896	2.375000 2016/3/31	0.55%
15	US T N/B 4.0 02/15/15 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	103.79 2,116,192,848	103.73 2,114,847,240	4.000000 2015/2/15	0.55%
16	US T N/B 2.5 04/30/15 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	102.78 2,095,580,580	102.76 2,095,254,372	2.500000 2015/4/30	0.55%
17	ITALY BTPS 3.75 08/01/16 イタリア	国債証券	1,956,500,000	106.01 2,074,085,650	106.21 2,077,998,650	3.750000 2016/8/1	0.54%
18	US T N/B 0.375 06/15/15 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	100.26 2,044,121,268	100.28 2,044,610,580	0.375000 2015/6/15	0.53%
19	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,858,675,000	109.52 2,035,620,860	110.00 2,044,542,500	4.500000 2018/2/1	0.53%
20	US T N/B 1.375 11/30/18 アメリカ	国債証券	2,038,800,000	99.48 2,028,279,792	99.89 2,036,720,424	1.375000 2018/11/30	0.53%
21	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,834,920,000	110.00 2,018,540,444	110.51 2,027,861,838	3.625000 2020/2/15	0.53%
22	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	1,802,775,000	110.32 1,988,947,574	110.55 1,993,039,873	3.750000 2017/4/25	0.52%
23	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	1,834,920,000	107.23 1,967,658,112	107.39 1,970,520,588	3.125000 2017/4/30	0.51%

24	US T N/B 4.5 11/15/15 アメリカ	国債証券	1,834,920,000	107.33 1,969,456,334	107.26 1,968,226,938	4.500000 2015/11/15	0.51%
25	BUNDESSCHAT 12/11/15 ドイツ	国債証券	1,956,500,000	99.80 1,952,763,085	99.85 1,953,702,205	- 2015/12/11	0.51%
26	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16 ドイツ	国債証券	1,816,750,000	106.31 1,931,477,762	106.30 1,931,350,590	3.500000 2016/1/4	0.50%
27	US T N/B 4.125 05/15/15 アメリカ	国債証券	1,834,920,000	104.85 1,924,078,762	104.79 1,922,922,763	4.125000 2015/5/15	0.50%
28	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	1,732,980,000	110.72 1,918,790,115	110.74 1,919,206,030	4.875000 2016/8/15	0.50%
29	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,936,860,000	98.55 1,908,930,478	98.85 1,914,605,478	0.750000 2017/12/31	0.50%
30	US T N/B 2.0 04/30/16 アメリカ	国債証券	1,834,920,000	103.46 1,898,408,232	103.49 1,899,068,803	2.000000 2016/4/30	0.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	97.51%
合計	97.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

D I A M D C バランス30インデックスファンド
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
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
該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先 物取引	東京証券 取引所	T O P I X 先物 2 6 0 3 月	買建	1,047	12,503,985,745	12,679,170,000	3.97%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円売 2014年03月	買建	3,900,000	399,317,100	397,527,000	0.13%
		ユーロ買/円売 2014年03月	買建	1,000,000	140,138,800	139,740,000	0.04%
		イギリス・ポンド買/円売 2014年03月	買建	400,000	68,253,000	68,052,000	0.02%
		オーストラリア・ドル買/ 円売2014年03月	買建	300,000	27,424,350	27,411,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2014年03月	買建	200,000	18,396,100	18,322,000	0.01%
		アメリカ・ドル売/円買 2014年03月	売建	1,000,000	101,938,300	101,930,000	0.03%
		ユーロ売/円買 2014年03月	売建	400,000	55,898,600	55,896,000	0.02%
		イギリス・ポンド売/円買 2014年03月	売建	100,000	17,013,250	17,012,000	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商 品取引所	S & P 500 FUTU RE Mar 14	買建	56	2,620,788,202	2,645,811,924	0.85%
	EURE X取引所	DJ EURO STOX X 50 Mar 14	買建	204	889,933,590	895,182,600	0.29%
	NYS E L I F F E	FTSE 100 IND EX FUTURE Ma r 14	買建	37	418,505,267	427,474,197	0.14%
	モントリ オール取 引所	S & P / TSE 60 I X FUT Mar 14	買建	12	177,156,432	179,296,675	0.06%
	シドニー 先物取引 所	S P I 200 FUTU RES Mar 14	買建	14	170,102,255	172,618,040	0.06%

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売 2014年03月	買建	4,230,000	592,787,124	591,100,200	0.15%
		アメリカ・ドル売/円買 2014年03月	売建	3,850,000	392,462,455	392,430,500	0.10%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成26年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

D I A M D C バランス30インデックスファンド

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	2,675	2,675	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	2,141	2,141	0.8095	0.8095
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	2,414	2,414	0.8824	0.8824
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	2,558	2,558	0.9041	0.9041
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	2,647	2,647	0.9088	0.9088
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	2,911	2,911	1.0079	1.0079
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	3,332	3,332	1.1304	1.1304
平成25年2月末日	2,914	-	1.0043	-
3月末日	2,988	-	1.0307	-
4月末日	3,084	-	1.0736	-
5月末日	3,060	-	1.0730	-
6月末日	3,001	-	1.0589	-
7月末日	3,029	-	1.0660	-
8月末日	3,041	-	1.0615	-
9月末日	3,167	-	1.0892	-
10月末日	3,192	-	1.1019	-
11月末日	3,333	-	1.1257	-
12月末日	3,362	-	1.1400	-
平成26年1月末日	3,320	-	1.1211	-
2月末日	3,334	-	1.1257	-

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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	4,722	4,722	0.9331	0.9331
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	3,473	3,473	0.6847	0.6847
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	4,138	4,138	0.7770	0.7770
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	4,500	4,500	0.8051	0.8051
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	4,695	4,695	0.7945	0.7945
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	5,529	5,529	0.9153	0.9153
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	6,284	6,284	1.0798	1.0798
平成25年2月末日	5,520	-	0.9095	-
3月末日	5,710	-	0.9432	-
4月末日	6,022	-	1.0063	-
5月末日	5,969	-	1.0079	-
6月末日	5,850	-	0.9905	-
7月末日	5,881	-	0.9986	-
8月末日	5,839	-	0.9894	-
9月末日	6,074	-	1.0291	-
10月末日	6,136	-	1.0429	-
11月末日	6,341	-	1.0773	-
12月末日	6,429	-	1.1010	-
平成26年1月末日	6,245	-	1.0674	-
2月末日	6,277	-	1.0721	-

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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	2,611	2,611	0.8961	0.8961
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	1,747	1,747	0.5753	0.5753
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	2,234	2,234	0.6792	0.6792
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	2,479	2,479	0.7105	0.7105
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	2,553	2,553	0.6888	0.6888
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	3,149	3,149	0.8234	0.8234
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	3,784	3,784	1.0149	1.0149
平成25年2月末日	3,140	-	0.8160	-
3月末日	3,278	-	0.8540	-
4月末日	3,529	-	0.9305	-
5月末日	3,500	-	0.9318	-
6月末日	3,435	-	0.9114	-
7月末日	3,455	-	0.9201	-
8月末日	3,424	-	0.9071	-
9月末日	3,632	-	0.9565	-
10月末日	3,635	-	0.9711	-
11月末日	3,798	-	1.0145	-
12月末日	3,891	-	1.0465	-
平成26年1月末日	3,743	-	1.0000	-
2月末日	3,764	-	1.0048	-

【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口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

D I A M D C バランス50インデックスファンド

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

D I A M D C バランス70インデックスファンド

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

【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計算期間	2.9
第2計算期間	16.6
第3計算期間	9.0
第4計算期間	2.5
第5計算期間	0.5
第6計算期間	10.9
第7計算期間	12.2

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M D C バランス50インデックスファンド

	収益率(%)
第1計算期間	6.7
第2計算期間	26.6
第3計算期間	13.5
第4計算期間	3.6
第5計算期間	1.3
第6計算期間	15.2
第7計算期間	18.0

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M D C バランス70インデックスファンド

	収益率(%)
第1計算期間	10.4
第2計算期間	35.8
第3計算期間	18.1
第4計算期間	4.6
第5計算期間	3.1
第6計算期間	19.5
第7計算期間	23.3

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A M 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計算期間	3,100,768,537	345,452,038
第2計算期間	229,578,698	339,107,428
第3計算期間	243,751,371	153,541,357
第4計算期間	235,972,752	141,593,022
第5計算期間	285,646,931	203,029,716
第6計算期間	225,648,685	250,182,940
第7計算期間	462,391,895	402,339,311

(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計算期間	5,407,868,136	346,621,435
第2計算期間	439,067,605	427,745,782
第3計算期間	495,694,818	241,797,536
第4計算期間	487,922,998	224,206,853
第5計算期間	613,641,679	293,757,615
第6計算期間	463,334,274	332,253,908
第7計算期間	634,765,225	855,483,167

(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計算期間	3,243,343,171	329,317,247
第2計算期間	362,375,624	238,812,098
第3計算期間	443,121,260	190,773,589
第4計算期間	402,406,730	203,211,017
第5計算期間	407,822,179	190,193,682
第6計算期間	402,795,344	284,007,685
第7計算期間	570,595,111	667,503,750

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

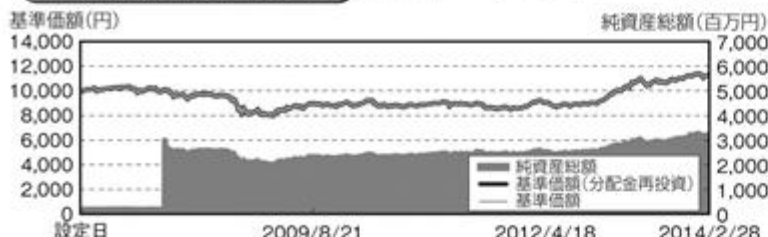
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2014年2月28日

DIAM DC バランス30インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (設定日(2006年12月27日)~2014年2月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2006年12月27日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	52.04%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.73%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.04%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.18%

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

年間収益率の推移



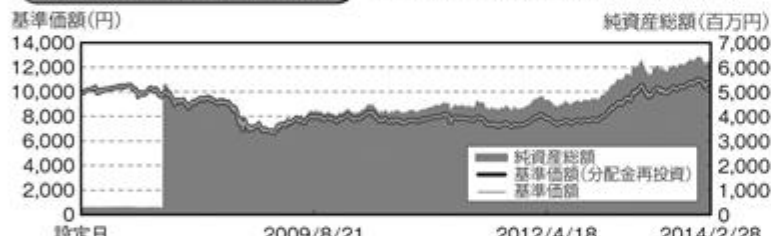
※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出してあります。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※2005年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは、当社が独自に指数化した合成インデックスです。国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当ファンドの基本アロケーション(国内株式:20.0%、国内債券:52.0%、外国株式:10.0%、外国債券:15.0%、短期金融資産:3.0%)に基づいて合成したものです。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (設定日(2006年12月27日)~2014年2月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2006年12月27日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

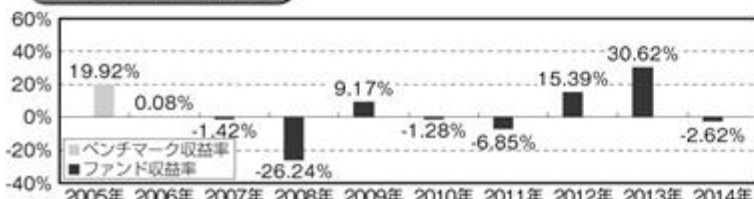
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	34.51%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	30.01%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.17%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.30%

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出してあります。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※2005年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは、当社が独自に指数化した合成インデックスです。国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当ファンドの基本アロケーション(国内株式:35.0%、国内債券:30.0%、外国株式:15.0%、外国債券:17.0%、短期金融資産:3.0%)に基づいて合成したものです。

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

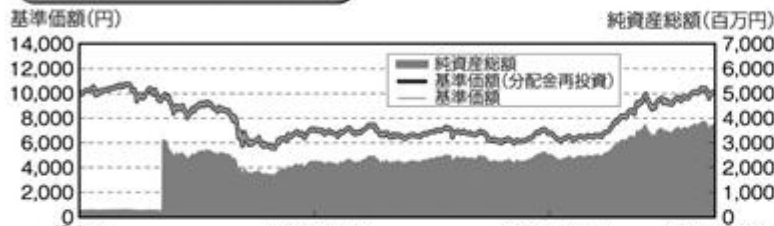
○当該ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2014年2月28日

DIAM DC バランス70インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (設定日(2006年12月27日)~2014年2月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2006年12月27日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第3期	(2010.02.25)	0円
第4期	(2011.02.25)	0円
第5期	(2012.02.27)	0円
第6期	(2013.02.25)	0円
第7期	(2014.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

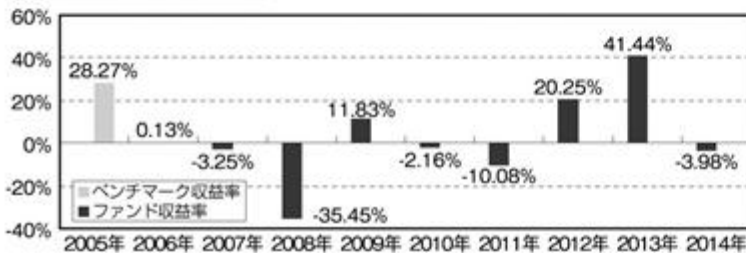
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	49.24%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.50%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.14%
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.11%

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出してあります。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※2005年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは、当社が独自に指数化した合成インデックスです。国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコールローンのオーバーナイト物レートを、当ファンドの基本アロケーション(国内株式:50.0%、国内債券:7.0%、外国株式:20.0%、外国債券:20.0%、短期金融資産:3.0%)に基づいて合成したものです。

各マザーファンドの主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	96.06
内 日本	96.06
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.94
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.97

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.18%
2	輸送用機器	11.27%
3	銀行業	9.00%
4	情報・通信業	7.08%
5	化学	5.18%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.54%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.45%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	2.07%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.89%
5	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.83%
6	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.49%
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.23%
8	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.12%
9	ファナック	株式	日本	電気機器	1.10%
10	日立	株式	日本	電気機器	1.08%

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

○当該ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2014年2月28日

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	96.47
内 アメリカ	54.68
内 イギリス	9.12
内 スイス	4.49
内 カナダ	4.33
内 フランス	4.17
内 その他	19.68
投資信託受益証券	0.27
内 オーストラリア	0.24
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.72
内 アメリカ	1.38
内 イギリス	0.14
内 フランス	0.12
内 香港	0.04
内 カナダ	0.03
内 オランダ	0.01
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.53
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	1.60%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.41%
3	GOOGLE INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア	1.12%
4	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.00%
5	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.87%
6	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.86%
7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.81%
8	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.78%
9	CHEVRON CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	0.75%
10	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	0.72%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	石油・ガス・消耗燃料	8.49%
2	商業銀行	7.77%
3	医薬品	7.15%
4	保険	4.16%
5	各種金融サービス	3.09%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.21
為替予約取引(売建)	△0.06
株価指数先物取引(買建)	1.39

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	79.89
内 日本	79.89
地方債証券	6.48
内 日本	6.48
特殊債券	6.73
内 日本	6.73
社債券	6.20
内 日本	6.06
内 アメリカ	0.12
内 オーストラリア	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.70
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	332回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/12/20	1.24%
2	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.24%
3	329回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2023/6/20	1.15%
4	97回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.400000	2016/6/20	1.13%
5	328回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/3/20	1.13%
6	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.13%
7	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/9/20	1.09%
8	330回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2023/9/20	1.08%
9	103回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2017/3/20	1.02%
10	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.02%

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.51
内 アメリカ	37.88
内 イタリア	10.26
内 フランス	10.18
内 ドイツ	8.79
内 イギリス	7.75
内 その他	22.65
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.49
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16	国債証券	アメリカ	0.625000	2016/7/15	1.01%
2	US T N/B 2.5 03/31/15	国債証券	アメリカ	2.500000	2015/3/31	0.82%
3	US T N/B 1.25 08/31/15	国債証券	アメリカ	1.250000	2015/8/31	0.81%
4	US T N/B 3.25 06/30/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/6/30	0.71%
5	US T N/B 2.375 02/28/15	国債証券	アメリカ	2.375000	2015/2/28	0.62%
6	US T N/B 1.25 09/30/15	国債証券	アメリカ	1.250000	2015/9/30	0.62%
7	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	国債証券	フランス	3.250000	2016/4/25	0.60%
8	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	国債証券	フランス	3.000000	2015/10/25	0.59%
9	US T N/B 3.25 12/31/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/12/31	0.57%
10	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	国債証券	イタリア	3.750000	2015/8/1	0.57%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.15
為替予約取引(売建)	△0.10

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

○当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みの際は、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。

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

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に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（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・ お申込単位

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。

- ・ 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。解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解
約の受付に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、
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、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとしま
す。

・ 解約代金

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

・解約価額の照会方法等

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に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、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

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

（３）【信託期間】

信託期間は平成18年12月27日から無期限です。

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】**イ．償還規定**

a. 委託会社は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、信託期間中において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. 委託会社は上記a. b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

d. 上記a. b.につき、上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。

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

f. 上記c. ~ e.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記

「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および買取請求の手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

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

八. 関係法人との契約の更改

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

二. 公告

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

委託会社は、各計算期間末日（原則として毎年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/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

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

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間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、）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、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとし、

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成25年2月26日から平成26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6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	91,471,000	103,531,349
親投資信託受益証券	2,824,481,597	3,233,554,296
未収入金	6,200,000	-
流動資産合計	2,922,152,597	3,337,085,645
資産合計	2,922,152,597	3,337,085,645
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,465,734	1,377
未払受託者報酬	428,132	510,683
未払委託者報酬	2,997,309	3,575,017
その他未払費用	67,711	80,775
流動負債合計	10,958,886	4,167,852
負債合計	10,958,886	4,167,852
純資産の部		
元本等		
元本	1,288,460,473	1,294,513,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,733,238	384,404,736
（分配準備積立金）	206,386,774	455,351,726
元本等合計	2,911,193,711	3,332,917,793
純資産合計	2,911,193,711	3,332,917,793
負債純資産合計	2,922,152,597	3,337,085,645

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期		第7期	
	自	平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自	平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
営業収益				
受取利息		62,283		58,912
有価証券売買等損益		297,830,806		361,418,699
営業収益合計		297,893,089		361,477,611
営業費用				
受託者報酬		837,385		987,471
委託者報酬		5,862,304		6,912,818
その他費用		132,420		156,188
営業費用合計		6,832,109		8,056,477
営業利益又は営業損失（ ）		291,060,980		353,421,134
経常利益又は経常損失（ ）		291,060,980		353,421,134
当期純利益又は当期純損失（ ）		291,060,980		353,421,134
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		5,737,520		26,793,749
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		265,721,826		22,733,238
剰余金増加額又は欠損金減少額		22,881,453		39,725,328
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		22,881,453		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		39,725,328
剰余金減少額又は欠損金増加額		19,749,849		4,681,215
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		4,681,215
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		19,749,849		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,733,238		384,404,736

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	2,912,994,728円	2,888,460,473円
期中追加設定元本額	225,648,685円	462,391,895円
期中一部解約元本額	250,182,940円	402,339,311円
2 . 受益権の総数	2,888,460,473口	2,948,513,057口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（49,460,530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（43,768,866円）及び分配準備積立金（156,926,244円）より分配対象収益は250,155,640円（1万口当たり866.05円）であります。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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（54,221,997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（221,652,519円）、信託約款に規定される収益調整金（76,317,177円）及び分配準備積立金（179,477,210円）より分配対象収益は531,668,903円（1万口当たり1,803.18円）であります。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。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期	第7期
	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期	第7期
	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期	第7期
	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	287,001,956	311,887,270
合計	287,001,956	311,887,270

(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6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.0079円	1.1304円
(1万口当たり純資産額)	(10,079円)	(11,304円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化 法)・マザーファンド	386,095,927	663,042,535	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザー ファンド	1,445,723,290	1,727,061,042	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザー ファンド	147,409,276	341,414,624	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザー ファンド	305,504,835	502,036,095	
親投資信託受益証券 合計		2,284,733,328	3,233,554,296	
合計		2,284,733,328	3,233,554,296	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

D I A M D C バランス50インデックスファンド

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成25年2月26日から平成26年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

【D I A M 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6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	175,255,415	189,979,490
親投資信託受益証券	5,366,234,751	6,104,091,365
未収入金	6,500,000	-
流動資産合計	5,547,990,166	6,294,070,855
資産合計	5,547,990,166	6,294,070,855
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,357,791	502,980
未払受託者報酬	773,706	976,206
未払委託者報酬	6,190,041	7,809,967
その他未払費用	122,421	154,475
流動負債合計	18,443,959	9,443,628
負債合計	18,443,959	9,443,628
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,041,146,381	1 5,820,428,439
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 511,600,174	2 464,198,788
（分配準備積立金）	414,732,686	964,520,597
元本等合計	5,529,546,207	6,284,627,227
純資産合計	5,529,546,207	6,284,627,227
負債純資産合計	5,547,990,166	6,294,070,855

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期		第7期	
	自	平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自	平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
営業収益				
受取利息		110,133		113,000
有価証券売買等損益		751,651,108		1,000,016,614
営業収益合計		751,761,241		1,000,129,614
営業費用				
受託者報酬		1,494,444		1,902,080
委託者報酬		11,956,185		15,217,315
その他費用		236,452		300,988
営業費用合計		13,687,081		17,420,383
営業利益又は営業損失（ ）		738,074,160		982,709,231
経常利益又は経常損失（ ）		738,074,160		982,709,231
当期純利益又は当期純損失（ ）		738,074,160		982,709,231
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（ ）		6,906,232		86,927,908
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,214,415,525		511,600,174
剰余金増加額又は欠損金減少額		68,516,505		80,017,639
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		68,516,505		69,178,464
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		10,839,175
剰余金減少額又は欠損金増加額		96,869,082		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		96,869,082		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		511,600,174		464,198,788

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	5,910,066,015円	6,041,146,381円
期中追加設定元本額	463,334,274円	634,765,225円
期中一部解約元本額	332,253,908円	855,483,167円
2 . 受益権の総数	6,041,146,381口	5,820,428,439口
3 . 2 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511,600,174円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期 自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	第7期 自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（101,603,194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（91,401,641円）及び分配準備積立金（313,129,492円）より分配対象収益は506,134,327円（1万口当たり837.81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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（114,335,199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（491,335,446円）、信託約款に規定される収益調整金（129,417,987円）及び分配準備積立金（358,849,952円）より分配対象収益は1,093,938,584円（1万口当たり1,879.48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。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第6期	第7期
	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期	第7期
	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期	第7期
	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	741,337,821	868,114,974
合計	741,337,821	868,114,974

(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6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
1口当たり純資産額	0.9153円	1.0798円
(1万口当たり純資産額)	(9,153円)	(10,798円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化 法）・マザーファンド	1,267,213,606	2,176,185,925	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザー ファンド	1,576,398,413	1,883,165,544	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザー ファンド	416,887,340	965,552,768	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザー ファンド	656,719,484	1,079,187,128	
親投資信託受益証券 合計		3,917,218,843	6,104,091,365	
合計		3,917,218,843	6,104,091,365	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

D I A M D C バランス70インデックスファンド

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成25年2月26日から平成26年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

【D I A M 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6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	100,856,255	117,607,933
親投資信託受益証券	3,056,180,290	3,673,086,670
未収入金	6,000,000	560,000
流動資産合計	3,163,036,545	3,791,254,603
資産合計	3,163,036,545	3,791,254,603
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,956,967	978,441
未払受託者報酬	422,078	583,130
未払委託者報酬	3,799,077	5,248,581
その他未払費用	66,740	92,253
流動負債合計	13,244,862	6,902,405
負債合計	13,244,862	6,902,405
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,825,548,990	1 3,728,640,351
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 675,757,307	2 55,711,847
（分配準備積立金）	243,303,300	620,801,638
元本等合計	3,149,791,683	3,784,352,198
純資産合計	3,149,791,683	3,784,352,198
負債純資産合計	3,163,036,545	3,791,254,603

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自	平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自	平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
営業収益				
受取利息		60,072		67,472
有価証券売買等損益		525,152,265		740,879,380
営業収益合計		525,212,337		740,946,852
営業費用				
受託者報酬		809,790		1,124,416
委託者報酬		7,288,877		10,120,488
その他費用		128,051		177,870
営業費用合計		8,226,718		11,422,774
営業利益又は営業損失()		516,985,619		729,524,078
経常利益又は経常損失()		516,985,619		729,524,078
当期純利益又は当期純損失()		516,985,619		729,524,078
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		2,984,274		81,144,480
期首剰余金又は期首欠損金()		1,153,538,922		675,757,307
剰余金増加額又は欠損金減少額		88,705,501		113,603,081
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		88,705,501		113,603,081
剰余金減少額又は欠損金増加額		124,925,231		30,513,525
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		124,925,231		30,513,525
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		675,757,307		55,711,847

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	3,706,761,331円	3,825,548,990円
期中追加設定元本額	402,795,344円	570,595,111円
期中一部解約元本額	284,007,685円	667,503,750円
2 . 受益権の総数	3,825,548,990口	3,728,640,351口
3 . 2 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675,757,307円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（61,681,798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（70,225,929円）及び分配準備積立金（181,621,502円）より分配対象収益は313,529,229円（1万口当たり819.57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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（74,571,659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（342,479,122円）、信託約款に規定される収益調整金（102,440,492円）及び分配準備積立金（203,750,857円）より分配対象収益は723,242,130円（1万口当たり1,939.69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。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第6期	第7期
	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	521,143,566	672,365,544
合計	521,143,566	672,365,544

(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6期 平成25年2月25日現在	第7期 平成26年2月25日現在
1口当たり純資産額	0.8234円	1.0149円
(1万口当たり純資産額)	(8,234円)	(10,149円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化 法)・マザーファンド	1,088,127,674	1,868,641,654	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザー ファンド	223,891,406	267,460,673	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザー ファンド	335,873,826	777,917,368	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザー ファンド	461,916,251	759,066,975	
親投資信託受益証券 合計		2,109,809,157	3,673,086,670	
合計		2,109,809,157	3,673,086,670	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,805,324,901	11,300,638,260
株式	2	294,421,001,496	312,658,405,390
派生商品評価勘定		242,592,947	280,076,705
未収入金		10,057,187,944	-
未収配当金		341,683,757	296,589,336
差入委託証拠金		-	222,510,905
流動資産合計		306,867,791,045	324,758,220,596
資産合計		306,867,791,045	324,758,220,596
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	154,187,644
前受金		203,775,000	276,030,905
未払金		-	1,908,676
未払解約金		291,784,000	90,566,000
流動負債合計		495,559,000	522,693,225
負債合計		495,559,000	522,693,225
純資産の部			
元本等			
元本	1	228,600,317,852	188,809,272,100
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		77,771,914,193	135,426,255,271
元本等合計		306,372,232,045	324,235,527,371
純資産合計		306,372,232,045	324,235,527,371
負債純資産合計		306,867,791,045	324,758,220,596

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	239,247,265,270円	228,600,317,852円
	同期中追加設定元本額	51,049,849,962円	38,039,433,917円
	同期中一部解約元本額	61,696,797,380円	77,830,479,669円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M D C 国内株式インデックスファンド	3,456,975,976円	4,033,737,176円
	D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,151,210,058円	1,372,061,781円
	D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	37,549,409,912円	37,734,354,972円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	865,861,188円	757,481,705円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	3,315,109,536円	2,859,610,081円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,533,843,376円	3,039,958,422円
	D I A M D C バランス3 0インデックスファンド	464,254,047円	386,095,927円
	D I A M D C バランス5 0インデックスファンド	1,524,327,539円	1,267,213,606円
	D I A M D C バランス7 0インデックスファンド	1,194,405,874円	1,088,127,674円
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	122,412,799円	111,502,908円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,501,925,367円	1,364,450,473円
	マネックス資産設計ファンドエボリューション	19,969,187円	20,448,323円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国1 0)	43,570円	8,307,168円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国2 0)	69,532円	11,558,016円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国3 0)	97,297円	27,609,029円
	投資のソムリエ	2,916,326円	120,681,929円
	クルーズコントロール	5,652,798円	21,759,643円
	投資のソムリエ< D C年金>	- 円	545,733円
	D I A M 8 資産バランスファンドN< D C年金>	- 円	580,728円
	D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	207,330,889円	155,568,450円
	D I A Mグローバル・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	9,398,270,669円	4,890,060,568円

D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投資 家限定)	1,686,442,938円	965,282,970円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	196,321,988円	123,456,284円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	744,123,545円	412,806,035円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	191,888,966円	109,050,843円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	275,573,071円	181,178,060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)	18,671,813,615円	14,929,403,132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)	6,207,828,007円	4,948,236,931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)	4,566,354,699円	3,568,706,610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)	3,032,053,949円	2,412,090,211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)	7,100,790,355円	5,811,787,943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)	1,050,886,793円	674,290,940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)	2,276,598,286円	1,720,122,396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)	2,273,910,810円	1,580,270,828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)	12,801,038,647円	8,198,833,798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)	183,644,962円	87,280,606円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	4,175,799,167円	3,029,796,482円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	8,789,640,440円	7,515,993,196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)	414,645,939円	291,570,512円

	D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	37,108,196,273円	28,248,047,481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)	2,281,809,841円	1,430,352,903円
	D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	4,445,247,518円	3,349,426,242円
	D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	22,842,815,835円	17,435,869,317円
	D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	197,711,053円	14,639,429円
	D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	71,957,769円	84,011,222円
	D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	158,048円	85,761,418円
	D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	19,991,378,870円	15,490,002,989円
	D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	254,958,570円	191,093,460円
	D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	79,538,627円	57,997,307円
	D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	186,444,630円	122,532,453円
	D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	91,104円	84,697円
	D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	141,970円	126,520円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	1,292,493,310円	935,035,848円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	893,932,317円	2,351,917,037円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	- 円	3,056,002,530円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	- 円	124,499,158円
	計	228,600,317,852円	188,809,272,100円
2 .	受益権の総数	228,600,317,852口	188,809,272,100口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 2,397,500,000円	株式 2,995,000,000円

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	3,488,503,668	11,283,961,250
合計	3,488,503,668	11,283,961,250

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成25年2月25日 現在				平成26年2月25日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	8,561,173,000	-	8,804,055,000	242,882,000	11,384,830,000	-	11,511,045,000	126,215,000
合計	8,561,173,000	-	8,804,055,000	242,882,000	11,384,830,000	-	11,511,045,000	126,215,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.3402円	1.7173円
（1万口当たり純資産額）	（13,402円）	（17,173円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	81,000	271	21,951,000	
日本水産	246,700	230	56,741,000	
マルハニチロホールディングス	386,000	177	68,322,000	
ハウスイ	15,000	136	2,040,000	
サカタのタネ	29,700	1,358	40,332,600	
ホクト	22,400	1,967	44,060,800	
ショーボンドHD	17,800	4,750	84,550,000	
ミライト・ホールディングス	56,800	961	54,584,800	
タマホーム	8,500	869	7,386,500	
住石ホールディングス	56,800	127	7,213,600	
日鉄鉱業	51,000	443	22,593,000	
三井松島	132,000	159	20,988,000	
国際石油開発帝石	972,300	1,317	1,280,519,100	
日本海洋掘削	5,000	4,940	24,700,000	
石油資源開発	28,500	3,805	108,442,500	
K&Oエナジーグループ	10,500	1,333	13,996,500	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,641	2,789,700	
安藤・間	130,500	378	49,329,000	
東急建設	71,200	416	29,619,200	
コムシスホールディングス	97,200	1,687	163,976,400	
ミサワホーム	21,500	1,335	28,702,500	
高松コンストラクションGP	15,200	1,785	27,132,000	
東建コーポレーション	7,460	4,715	35,173,900	
ヤマウラ	10,100	275	2,777,500	
大成建設	1,011,000	458	463,038,000	
大林組	600,000	612	367,200,000	
清水建設	612,000	557	340,884,000	
飛島建設	123,300	155	19,111,500	
長谷工コーポレーション	266,900	695	185,495,500	
松井建設	2,000	424	848,000	
銭高組	22,000	296	6,512,000	
鹿島建設	879,000	365	320,835,000	
不動テトラ	142,400	181	25,774,400	
大末建設	77,000	113	8,701,000	
鉄建建設	122,000	267	32,574,000	
日鉄住金テックスエンジ	33,000	370	12,210,000	
西松建設	262,000	356	93,272,000	
三井住友建設	538,100	110	59,191,000	
大豊建設	57,000	346	19,722,000	
前田建設	123,000	632	77,736,000	
佐田建設	69,000	126	8,694,000	
ナカノフドー建設	15,900	233	3,704,700	
奥村組	177,000	457	80,889,000	

大和小田急建設	11,500	255	2,932,500
東鉄工業	24,100	2,087	50,296,700
イチケン	23,000	177	4,071,000
浅沼組	61,000	142	8,662,000
戸田建設	233,000	330	76,890,000
熊谷組	191,000	257	49,087,000
青木あすなる建設	12,400	571	7,080,400
北野建設	43,000	269	11,567,000
植木組	25,000	200	5,000,000
三井ホーム	26,000	479	12,454,000
矢作建設	27,300	960	26,208,000
ピーエス三菱	15,500	468	7,254,000
大東建託	75,900	9,768	741,391,200
新日本建設	24,100	312	7,519,200
N I P P O	46,000	1,534	70,564,000
東亜道路	38,000	456	17,328,000
前田道路	63,000	1,635	103,005,000
日本道路	54,000	507	27,378,000
東亜建設	175,000	216	37,800,000
若築建設	109,000	136	14,824,000
東洋建設	62,300	346	21,555,800
五洋建設	238,000	381	90,678,000
大林道路	24,000	561	13,464,000
世紀東急	104,000	120	12,480,000
福田組	30,000	414	12,420,000
住友林業	137,700	1,079	148,578,300
日本基礎技術	22,400	345	7,728,000
日成ビルド工業	52,000	239	12,428,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	91,000	118	10,738,000
巴コーポレーション	25,300	423	10,701,900
パナホーム	75,000	702	52,650,000
大和ハウス	549,000	1,915	1,051,335,000
ライト工業	41,900	863	36,159,700
積水ハウス	525,200	1,335	701,142,000
日特建設	24,600	376	9,249,600
北陸電気工事	10,000	487	4,870,000
ユアテック	32,000	350	11,200,000
西部電気工業	17,000	466	7,922,000
四電工	6,000	363	2,178,000
中電工	29,000	1,689	48,981,000
関電工	91,000	539	49,049,000
きんでん	133,000	1,062	141,246,000
東京エネシス	21,000	467	9,807,000
トーエネック	29,000	592	17,168,000
住友電設	13,900	1,424	19,793,600
日本電設工業	33,000	1,335	44,055,000
協和エクシオ	78,400	1,484	116,345,600
新日本空調	17,300	648	11,210,400
日本工営	63,000	455	28,665,000
N D S	31,000	292	9,052,000

九電工	37,000	771	28,527,000
三機工業	43,000	605	26,015,000
日 揮	201,000	3,775	758,775,000
中外炉工業	60,000	228	13,680,000
ヤマト	16,000	345	5,520,000
太平電業	29,000	673	19,517,000
高砂熱学	57,200	1,055	60,346,000
三晃金属	23,000	269	6,187,000
N E C ネットエスアイ	19,400	2,305	44,717,000
朝日工業社	24,000	383	9,192,000
明星工業	29,000	446	12,934,000
アタカ大機	12,000	386	4,632,000
大 氣 社	26,600	2,096	55,753,600
ダイダン	25,000	549	13,725,000
日比谷総合設備	24,600	1,215	29,889,000
東芝プラントシステム	32,000	1,386	44,352,000
日本製粉	123,000	517	63,591,000
日清製粉G本社	199,500	1,082	215,859,000
日東富士製粉	8,000	324	2,592,000
昭和産業	83,000	348	28,884,000
鳥越製粉	16,800	736	12,364,800
協同飼料	73,000	110	8,030,000
中部飼料	19,700	626	12,332,200
日本配合飼料	65,000	125	8,125,000
東洋精糖	34,000	102	3,468,000
日本甜菜糖	105,000	200	21,000,000
三井製糖	79,000	436	34,444,000
ネクスト	15,700	880	13,816,000
日本M & A センター	9,600	8,750	84,000,000
ノバレーゼ	5,000	932	4,660,000
アコーディア・ゴルフ	76,000	1,332	101,232,000
タケエイ	12,900	967	12,474,300
パソナグループ	18,600	670	12,462,000
リンクアンドモチベーション	243	22,870	5,557,410
G C A サヴィアン	11,100	836	9,279,600
エス・エム・エス	10,500	2,355	24,727,500
テンプホールディングス	40,800	3,140	128,112,000
リニカル	3,600	915	3,294,000
クックパッド	9,200	2,937	27,020,400
エスクリ	6,500	973	6,324,500
アイ・ケイ・ケイ	4,400	801	3,524,400
森永製菓	197,000	225	44,325,000
中 村 屋	48,000	406	19,488,000
江崎グリコ	72,000	1,412	101,664,000
名糖産業	9,300	1,049	9,755,700
不 二 家	116,000	191	22,156,000
山崎製パン	147,000	1,178	173,166,000
第一屋製パン	29,000	130	3,770,000
モロゾフ	33,000	317	10,461,000
亀田製菓	11,200	2,958	33,129,600

カルビー	73,300	2,548	186,768,400
森永乳業	170,000	323	54,910,000
六甲バター	9,600	773	7,420,800
ヤクルト	117,000	5,080	594,360,000
明治ホールディングス	59,200	6,470	383,024,000
雪印メグミルク	43,200	1,319	56,980,800
プリマハム	101,000	192	19,392,000
日本ハム	139,000	1,632	226,848,000
伊藤ハム	110,000	440	48,400,000
林兼産業	67,000	79	5,293,000
丸大食品	97,000	311	30,167,000
米 久	7,000	900	6,300,000
S Foods	13,000	1,057	13,741,000
学情	6,100	788	4,806,800
スタジオアリス	7,700	1,382	10,641,400
シミックホールディングス	7,100	1,448	10,280,800
システナ	17,200	770	13,244,000
NECフィールドディング	15,100	1,577	23,812,700
デジタルアーツ	4,800	768	3,686,400
新日鉄住金SOL	14,700	2,733	40,175,100
総合警備保障	67,900	2,061	139,941,900
日本駐車場開発	193,500	119	23,026,500
コア	6,700	754	5,051,800
カカクコム	113,100	1,759	198,942,900
アイロムホールディングス	4,200	809	3,397,800
ルネサンス	8,600	832	7,155,200
SBSホールディングス	3,800	1,698	6,452,400
オプト	7,600	859	6,528,400
新日本科学	13,600	1,232	16,755,200
ツクイ	20,200	1,022	20,644,400
総合臨床HLDGS	5,600	525	2,940,000
キャリアデザインセンター	39	115,300	4,496,700
エムスリー	617	340,500	210,088,500
ベストブライダル	11,000	648	7,128,000
アウトソーシング	5,900	1,042	6,147,800
ディー・エヌ・エー	100,300	2,211	221,763,300
博報堂DYHLDGS	258,400	790	204,136,000
ぐるなび	13,000	3,725	48,425,000
一休	133	132,200	17,582,600
ジャパンベストレスキューS	118	47,600	5,616,800
ジェイコムホールディングス	3,500	740	2,590,000
PGMホールディングス	26,400	950	25,080,000
バリューコマース	11,500	1,152	13,248,000
サッポロホールディングス	328,000	381	124,968,000
アサヒグループホールディン	402,100	2,806	1,128,292,600
キリンHD	856,000	1,371	1,173,576,000
宝ホールディングス	157,000	801	125,757,000
オエノンホールディングス	49,000	227	11,123,000
養 命 酒	3,000	865	2,595,000
コカ・コーラウエスト	61,700	1,863	114,947,100

コカ・コーライーストジャパン	41,400	2,327	96,337,800
サントリー食品インター	102,700	3,535	363,044,500
ダイトードリンク	9,300	4,160	38,688,000
伊藤園	54,500	2,280	124,260,000
キーコーヒー	19,200	1,595	30,624,000
ユニカフェ	6,100	657	4,007,700
ジャパンフーズ	2,800	1,249	3,497,200
日清オイリオグループ	87,000	338	29,406,000
不二製油	48,700	1,377	67,059,900
J-オイルミルズ	85,000	275	23,375,000
ローソン	72,200	7,340	529,948,000
サンエー	13,300	3,015	40,099,500
キリン堂	6,600	643	4,243,800
ダイユーエイト	3,600	659	2,372,400
カワチ薬品	12,300	1,884	23,173,200
エービーシー・マート	25,000	4,365	109,125,000
ハードオフコーポレーション	8,600	884	7,602,400
高千穂交易	7,600	1,073	8,154,800
アスクル	18,200	3,615	65,793,000
ゲオホールディングス	30,100	940	28,294,000
アダストリアホールディング	13,500	2,490	33,615,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	23,000	210	4,830,000
伊藤忠食品	4,500	3,505	15,772,500
くらコーポレーション	10,400	1,745	18,148,000
キャンドウ	8,500	1,554	13,209,000
エレマテック	8,300	1,914	15,886,200
パル	10,300	1,936	19,940,800
JALUX	5,400	1,186	6,404,400
エディオン	80,700	555	44,788,500
あらた	39,000	339	13,221,000
サーラコーポレーション	15,400	506	7,792,400
トーメンデバイス	2,800	1,769	4,953,200
J Pホールディングス	31,500	477	15,025,500
あみやき亭	3,100	3,180	9,858,000
東京エレクトロンデバイス	3,700	1,579	5,842,300
ひらまつ	18,400	749	13,781,600
双日	1,181,600	184	217,414,400
ゲンキー	1,600	2,225	3,560,000
アルフレッサホールディングス	52,100	6,110	318,331,000
大黒天物産	3,600	2,747	9,889,200
ハニーズ	13,930	907	12,634,510
キッコーマン	163,000	1,925	313,775,000
味の素	477,000	1,569	748,413,000
キューピー	101,800	1,463	148,933,400
ハウス食品G本社	70,500	1,640	115,620,000
カゴメ	77,500	1,752	135,780,000
焼津水産化工	10,000	945	9,450,000
アリアケジャパン	18,300	2,479	45,365,700
ニチレイ	213,000	442	94,146,000
横浜冷凍	44,000	820	36,080,000

東洋水産	98,000	3,465	339,570,000
日清食品HD	78,200	4,640	362,848,000
永谷園	7,000	990	6,930,000
フジッコ	20,000	1,214	24,280,000
ロックフィールド	10,700	1,834	19,623,800
日本たばこ産業	1,108,300	3,360	3,723,888,000
ケンコーマヨネーズ	7,200	890	6,408,000
わらべや日洋	11,900	1,967	23,407,300
なとり	9,900	1,160	11,484,000
片倉工業	21,500	1,185	25,477,500
グンゼ	152,000	269	40,888,000
ヒューリック	297,000	1,287	382,239,000
神栄	25,000	216	5,400,000
山下医科器械	1,500	1,688	2,532,000
ラサ商事	8,900	468	4,165,200
アルペン	13,400	1,754	23,503,600
クオール	12,900	613	7,907,700
アルコニックス	5,400	2,250	12,150,000
神戸物産	1,800	2,440	4,392,000
ジェイアイエヌ	9,000	2,600	23,400,000
ビックカメラ	668	58,400	39,011,200
DCMホールディングス	86,800	668	57,982,400
MonotaRO	27,300	2,253	61,506,900
あいホールディングス	28,200	1,661	46,840,200
J.フロントリテイリング	416,000	717	298,272,000
ドトール・日レスHD	30,900	1,695	52,375,500
マツモトキヨシHLDGS	36,300	3,310	120,153,000
broncoビリー	2,900	1,809	5,246,100
スタートトゥデイ	54,900	2,480	136,152,000
物語コーポレーション	2,600	3,135	8,151,000
ココカラファイン	18,300	2,655	48,586,500
三越伊勢丹HD	350,100	1,206	422,220,600
東洋紡	790,000	182	143,780,000
ユニチカ	516,000	63	32,508,000
富士紡ホールディングス	98,000	224	21,952,000
日清紡ホールディングス	119,000	898	106,862,000
倉敷紡績	193,000	185	35,705,000
ダイワボウHD	160,000	192	30,720,000
シキボウ	109,000	123	13,407,000
日東紡績	137,000	444	60,828,000
トヨタ紡織	62,500	1,088	68,000,000
ウエルシアHD	6,400	5,860	37,504,000
クリエイトSDH	7,400	3,465	25,641,000
バイタルKSKHD	33,100	690	22,839,000
八洲電機	14,200	460	6,532,000
UKCホールディングス	11,300	1,818	20,543,400
丸善CHIHD	15,400	324	4,989,600
TOKAIホールディングス	86,100	336	28,929,600
エー・ピーカンパニー	1,600	1,880	3,008,000
三洋貿易	6,300	928	5,846,400

日本毛織	59,000	729	43,011,000
大東紡織	30,000	74	2,220,000
トーア紡コーポレーション	82,000	74	6,068,000
ダイドーリミテッド	21,300	660	14,058,000
東京建物不動産販	9,500	406	3,857,000
三栄建築設計	5,400	860	4,644,000
野村不動産HLDGS	116,300	2,196	255,394,800
プレサンスコーポレーション	3,200	2,797	8,950,400
常和ホールディングス	6,200	3,380	20,956,000
フージャースHD	26,300	625	16,437,500
オープンハウス	7,000	2,050	14,350,000
東急不動産HD	390,600	841	328,494,600
飯田GHD	77,200	1,651	127,457,200
帝国繊維	19,600	1,435	28,126,000
ブックオフコーポレーション	9,700	727	7,051,900
日本コークス工業	151,900	133	20,202,700
ミタチ産業	3,800	513	1,949,400
あさひ	10,200	1,397	14,249,400
日本調剤	2,260	2,807	6,343,820
コスモス薬品	10,000	12,690	126,900,000
シップヘルスケアHD	25,200	3,700	93,240,000
トーエル	9,300	555	5,161,500
一六堂	2,800	453	1,268,400
ソフトクリエイトHD	5,800	971	5,631,800
セブン&アイ・HLDGS	736,800	4,038	2,975,198,400
クリエイト・レストランツ・ホール	2,200	2,998	6,595,600
ツルハホールディングス	17,300	9,710	167,983,000
サンマルクホールディングス	5,700	4,800	27,360,000
フェリシモ	5,000	1,002	5,010,000
トリドール	15,200	960	14,592,000
クスリのアオキ	2,600	5,640	14,664,000
帝人	765,000	242	185,130,000
東レ	1,356,000	711	964,116,000
クラレ	297,100	1,155	343,150,500
旭化成	1,166,000	739	861,674,000
サカイオーベックス	50,000	188	9,400,000
稲葉製作所	8,000	1,231	9,848,000
宮地エンジニアリングG	62,000	243	15,066,000
トーカロ	11,400	1,692	19,288,800
アルファCO	6,600	1,006	6,639,600
SUMCO	114,300	787	89,954,100
川田テクノロジーズ	3,900	2,760	10,764,000
住江織物	52,000	302	15,704,000
日本フェルト	11,000	480	5,280,000
イチカワ	13,000	299	3,887,000
日本バイリーン	20,000	614	12,280,000
エコナックホールディングス	56,000	49	2,744,000
日東製網	23,000	177	4,071,000
芦森工業	42,000	126	5,292,000

アツギ	160,000	117	18,720,000
ダイニック	36,000	180	6,480,000
共和レザー	12,800	514	6,579,200
セーレン	50,300	841	42,302,300
東海染工	28,000	122	3,416,000
小松精練	32,000	480	15,360,000
ワコールホールディングス	112,000	1,100	123,200,000
ホギメディカル	11,800	5,490	64,782,000
レナウン	46,600	127	5,918,200
クラウディア	2,400	1,142	2,740,800
T S Iホールディングス	90,000	628	56,520,000
I Tホールディングス	63,200	1,776	112,243,200
ネオス	3,500	1,215	4,252,500
電算システム	4,200	1,102	4,628,400
グリー	104,700	1,177	123,231,900
コーエーテクモHD	34,800	1,242	43,221,600
三菱総合研究所	6,800	2,147	14,599,600
ボルテージ	2,600	1,686	4,383,600
電算	1,300	1,907	2,479,100
ヒト・コミュニケーションズ	1,900	1,865	3,543,500
ブレインパッド	1,400	1,543	2,160,200
K L a b	11,800	718	8,472,400
ポルトウウィン・ピットクル	10,800	1,727	18,651,600
イーブックイニシアティブ	2,500	1,804	4,510,000
ネクソン	146,000	922	134,612,000
アイスタイル	5,000	561	2,805,000
エムアップ	3,200	744	2,380,800
エイチーム	1,600	7,670	12,272,000
e n i s h	2,500	2,208	5,520,000
モバイルクリエイト	1,400	3,525	4,935,000
ブロードリーフ	17,400	1,396	24,290,400
ハーツユナイテッドグループ	4,000	3,260	13,040,000
特種東海製紙	108,000	217	23,436,000
ダウンゴ	15,900	2,758	43,852,200
ベリサーブ	1,100	1,665	1,831,500
ティーガイア	17,500	1,065	18,637,500
豆蔵ホールディングス	10,400	408	4,243,200
テクマトリックス	5,800	588	3,410,400
GMOペイメントゲートウェイ	6,700	5,580	37,386,000
ザッパラス	9,900	713	7,058,700
インターネットイニシアティブ	25,900	2,004	51,903,600
ビットアイル	13,300	753	10,014,900
S R Aホールディングス	8,500	1,366	11,611,000
朝日ネット	16,300	500	8,150,000
王子ホールディングス	826,000	505	417,130,000
日本製紙	96,600	2,071	200,058,600
三菱製紙	266,000	93	24,738,000
北越紀州製紙	127,500	469	59,797,500
中越パルプ	71,000	217	15,407,000
巴川製紙	29,000	204	5,916,000

大王製紙	64,000	1,017	65,088,000
レンゴー	150,000	598	89,700,000
トーモク	59,000	325	19,175,000
ザ・バック	13,300	1,900	25,270,000
コープケミカル	29,000	130	3,770,000
昭和電工	1,245,000	151	187,995,000
住友化学	1,376,000	434	597,184,000
日本化成	37,000	138	5,106,000
住友精化	39,000	790	30,810,000
日産化学	128,200	1,558	199,735,600
ラサ工業	71,000	154	10,934,000
クレハ	131,000	488	63,928,000
多木化学	8,000	617	4,936,000
テイカ	32,000	296	9,472,000
石原産業	337,000	111	37,407,000
片倉チツカリン	13,000	277	3,601,000
日本曹達	120,000	567	68,040,000
東ソー	500,000	411	205,500,000
トクヤマ	291,000	381	110,871,000
セントラル硝子	179,000	343	61,397,000
東亜合成	220,000	431	94,820,000
ダイソー	75,000	347	26,025,000
関東電化	45,000	282	12,690,000
電気化学	374,000	401	149,974,000
イビデン	108,700	2,022	219,791,400
信越化学	335,200	5,776	1,936,115,200
日本カーバイド	55,000	236	12,980,000
堺化学	76,000	317	24,092,000
エア・ウォーター	154,000	1,550	238,700,000
大陽日酸	240,000	777	186,480,000
日本化学工業	70,000	144	10,080,000
日本パーカラライジング	44,000	2,286	100,584,000
高压ガス	28,000	588	16,464,000
チタン工業	22,000	247	5,434,000
四国化成	27,000	754	20,358,000
戸田工業	34,000	259	8,806,000
ステラケミファ	9,600	1,407	13,507,200
保土谷化学	57,000	191	10,887,000
日本触媒	158,000	1,219	192,602,000
大日精化	72,000	453	32,616,000
カネカ	233,000	668	155,644,000
協和発酵キリン	224,000	1,107	247,968,000
三菱瓦斯化学	295,000	691	203,845,000
三井化学	850,000	274	232,900,000
J S R	171,500	1,739	298,238,500
東京応化工業	36,200	2,161	78,228,200
大阪有機化学	12,700	474	6,019,800
三菱ケミカルH L D G S	1,168,500	471	550,363,500
日本合成化学	38,000	878	33,364,000
ダイセル	243,000	899	218,457,000

住友ベークライト	146,000	395	57,670,000
積水化学	384,000	1,174	450,816,000
日本ゼオン	148,000	1,044	154,512,000
アイカ工業	52,600	2,145	112,827,000
宇部興産	942,000	190	178,980,000
積水樹脂	26,400	1,391	36,722,400
タキロン	44,000	449	19,756,000
旭有機材	66,000	238	15,708,000
日立化成	80,800	1,462	118,129,600
ニチバン	19,000	360	6,840,000
リケンテクノス	30,000	547	16,410,000
大倉工業	45,000	325	14,625,000
積水化成品	53,000	264	13,992,000
群栄化学	50,000	413	20,650,000
タイガース ポリマー	9,400	442	4,154,800
ミライアル	4,700	1,422	6,683,400
日本化薬	132,000	1,380	182,160,000
カーリットホールディングス	15,100	473	7,142,300
イーピーエス	200	115,900	23,180,000
パナソニック インフォシス	3,600	2,725	9,810,000
プレステージ・インター	12,600	973	12,259,800
フェイス	5,300	1,039	5,506,700
アミューズ	5,200	1,871	9,729,200
野村総合研究所	99,700	3,500	348,950,000
ドリームインキュベータ	49	166,700	8,168,300
サイバネットシステム	15,100	385	5,813,500
T A C	11,600	377	4,373,200
ケネディクス	220,100	378	83,197,800
電通	175,800	4,010	704,958,000
インテージホールディングス	9,600	1,372	13,171,200
テイクアンドギヴニーズ	8,000	2,255	18,040,000
ぴあ	5,600	1,908	10,684,800
イオンファンタジー	6,100	1,487	9,070,700
ソースネクスト	9,000	682	6,138,000
ネクシィーズ	6,800	1,098	7,466,400
メディカルシステムネットワーク	14,500	474	6,873,000
日本精化	15,800	653	10,317,400
A D E K A	80,600	1,158	93,334,800
日油	155,000	715	110,825,000
ミヨシ油脂	71,000	143	10,153,000
新日本理化	22,800	243	5,540,400
ハリマ化成グループ	16,200	475	7,695,000
花 王	486,100	3,449	1,676,558,900
第一工業製薬	35,000	364	12,740,000
三洋化成	59,000	700	41,300,000
武田薬品	700,200	4,901	3,431,680,200
アステラス製薬	430,500	6,415	2,761,657,500
大日本住友製薬	132,400	1,814	240,173,600
塩野義製薬	291,900	2,133	622,622,700
田辺三菱製薬	155,600	1,529	237,912,400

わかもと製薬	7,000	288	2,016,000
あすか製薬	22,000	979	21,538,000
日本新薬	43,000	1,953	83,979,000
バイオフェルミン製薬	3,100	2,786	8,636,600
中外製薬	186,100	2,516	468,227,600
科研製薬	68,000	1,586	107,848,000
エーザイ	230,100	3,970	913,497,000
ロート製薬	79,000	1,722	136,038,000
小野薬品	84,900	9,980	847,302,000
久光製薬	58,000	4,880	283,040,000
有機合成薬品	13,000	281	3,653,000
持田製薬	13,800	6,910	95,358,000
参天製薬	68,700	4,710	323,577,000
扶桑薬品	63,000	343	21,609,000
日本ケミファ	26,000	538	13,988,000
ツムラ	54,900	2,774	152,292,600
日医工	43,800	1,583	69,335,400
テルモ	136,800	4,385	599,868,000
みらかホールディングス	49,000	4,770	233,730,000
キッセイ薬品工業	34,700	2,769	96,084,300
生化学工業	39,100	1,400	54,740,000
栄研化学	14,600	1,808	26,396,800
日水製薬	7,900	1,074	8,484,600
鳥居薬品	12,800	3,470	44,416,000
JCRファーマ	10,800	2,426	26,200,800
東和薬品	9,500	4,900	46,550,000
富士製薬工業	5,400	1,898	10,249,200
沢井製薬	29,300	6,350	186,055,000
ゼリア新薬工業	29,500	2,427	71,596,500
第一三共	589,400	1,759	1,036,754,600
キョーリン製薬HD	49,900	2,247	112,125,300
大幸薬品	8,900	2,229	19,838,100
ダイト	6,200	1,531	9,492,200
大塚ホールディングス	370,900	3,145	1,166,480,500
大正製薬HD	45,000	7,730	347,850,000
大日本塗料	108,000	165	17,820,000
日本ペイント	162,000	1,556	252,072,000
関西ペイント	227,000	1,383	313,941,000
神東塗料	11,000	219	2,409,000
中国塗料	54,000	583	31,482,000
日本特殊塗料	14,700	700	10,290,000
藤倉化成	23,800	645	15,351,000
太陽ホールディングス	15,300	3,405	52,096,500
DIC	663,000	287	190,281,000
サカタインクス	38,300	916	35,082,800
東洋インキSCホールディング	168,000	489	82,152,000
T&K TOKA	6,800	2,247	15,279,600
アルプス技研	7,800	983	7,667,400
サニックス	27,200	1,095	29,784,000
ダイオーズ	3,600	854	3,074,400

日本空調サービス	4,700	1,257	5,907,900
オリエンタルランド	50,400	15,650	788,760,000
ダスキン	50,500	1,919	96,909,500
パーク24	92,000	2,181	200,652,000
明光ネットワークジャパン	18,600	1,139	21,185,400
ファルコSDホールディングス	9,600	1,367	13,123,200
クレスコ	4,200	1,046	4,393,200
フジ・メディア・HD	170,300	1,953	332,595,900
秀英予備校	4,000	333	1,332,000
田谷	3,700	747	2,763,900
ラウンドワン	53,000	833	44,149,000
リゾートトラスト	63,100	1,750	110,425,000
オービック	60,700	3,350	203,345,000
TDCソフトウェアエンジニア	4,100	820	3,362,000
ヤフー	1,275,000	654	833,850,000
ビー・エム・エル	12,200	3,590	43,798,000
ワタベウェディング	6,400	660	4,224,000
トレンドマイクロ	77,700	3,445	267,676,500
もしもしホットライン	34,700	993	34,457,100
リソー教育	21,000	337	7,077,000
日本オラクル	28,200	4,380	123,516,000
アルファシステムズ	5,800	1,398	8,108,400
フューチャーアーキテクト	21,300	624	13,291,200
シーエーシー	11,000	963	10,593,000
ソフトバンク・テクノ	4,200	1,555	6,531,000
トーセ	4,400	767	3,374,800
ユー・エス・エス	225,800	1,424	321,539,200
オービックビジネスC	8,900	3,640	32,396,000
伊藤忠テクノソリューションズ	19,900	4,640	92,336,000
アイティフォー	19,800	477	9,444,600
東京個別指導学院	9,700	391	3,792,700
東計電算	3,300	1,440	4,752,000
楽天	605,200	1,534	928,376,800
エクスネット	1,800	1,362	2,451,600
テー・オー・ダブリュー	6,600	687	4,534,200
大塚商会	15,800	13,130	207,454,000
総合メディカル	4,300	3,975	17,092,500
サイボウズ	26,500	373	9,884,500
ソフトブレーン	24,700	139	3,433,300
アグレックス	4,200	1,085	4,557,000
セントラルスポーツ	5,900	1,518	8,956,200
パラカ	4,600	736	3,385,600
電通国際情報S	10,900	1,101	12,000,900
イーエムシステムズ	2,400	2,347	5,632,800
ウェザーニューズ	4,600	2,603	11,973,800
C I J	16,800	406	6,820,800
WOWOW	5,400	3,500	18,900,000
フルキャストホールディングス	18,000	304	5,472,000
富士フイルムHLDGS	427,800	2,980	1,274,844,000
コニカミノルタ	471,500	1,075	506,862,500

資 生 堂	332,500	1,791	595,507,500
ライオン	216,000	565	122,040,000
高砂香料	67,000	610	40,870,000
マンダム	18,700	3,540	66,198,000
ミルボン	11,900	3,500	41,650,000
ファンケル	43,500	1,246	54,201,000
コーセー	30,200	3,355	101,321,000
ドクターシーラボ	12,700	3,130	39,751,000
シーボン	1,800	2,344	4,219,200
ポーラ・オルビスHD	19,100	4,180	79,838,000
ノエビアホールディングス	12,500	1,828	22,850,000
エステー	11,600	994	11,530,400
コ ニ シ	13,600	1,832	24,915,200
長谷川香料	23,800	1,545	36,771,000
星光PMC	8,200	1,324	10,856,800
小林製薬	30,600	5,810	177,786,000
荒川化学工業	15,800	918	14,504,400
メック	14,600	980	14,308,000
日本高純度化学	54	222,800	12,031,200
JCU	2,800	5,750	16,100,000
新田ゼラチン	11,300	970	10,961,000
アース製薬	13,500	3,610	48,735,000
イハラケミカル	29,000	772	22,388,000
北興化学	11,000	339	3,729,000
大成ラミック	4,900	2,660	13,034,000
クミアイ化学	39,000	583	22,737,000
日本農薬	43,000	1,456	62,608,000
昭和シエル石油	167,200	1,038	173,553,600
コスモ石油	516,000	198	102,168,000
富士興産	6,700	689	4,616,300
ニチレキ	23,000	1,057	24,311,000
東燃ゼネラル石油	282,000	932	262,824,000
ユシロ化学	10,200	1,055	10,761,000
ビーピー・カストロール	8,400	509	4,275,600
富士石油	47,700	303	14,453,100
MORESCO	4,500	1,696	7,632,000
出光興産	88,600	2,223	196,957,800
JXホールディングス	2,073,500	546	1,132,131,000
横浜ゴム	209,000	972	203,148,000
東洋ゴム	155,000	729	112,995,000
ブリヂストン	585,800	3,710	2,173,318,000
住友ゴム	145,900	1,377	200,904,300
藤倉ゴム	11,800	1,121	13,227,800
オカモト	65,000	346	22,490,000
アキレス	148,000	148	21,904,000
フ コ ク	8,100	1,021	8,270,100
ニッタ	18,500	2,337	43,234,500
クリエートメディック	6,100	924	5,636,400
東海ゴム工業	34,500	1,028	35,466,000
三ツ星ベルト	47,000	564	26,508,000

バンドー化学	68,000	400	27,200,000
鬼怒川ゴム	34,000	461	15,674,000
旭硝子	920,000	573	527,160,000
日本板硝子	902,000	144	129,888,000
石塚硝子	24,000	309	7,416,000
有沢製作所	31,200	612	19,094,400
日本山村硝子	74,000	172	12,728,000
日本電気硝子	386,000	462	178,332,000
オハラ	7,100	621	4,409,100
住友大阪セメント	355,000	394	139,870,000
太平洋セメント	1,098,000	365	400,770,000
デイ・シイ	19,300	570	11,001,000
リゾートソリューション	17,000	242	4,114,000
日本ヒューム	18,000	807	14,526,000
日本コンクリート	32,000	402	12,864,000
三谷セキサン	9,400	1,287	12,097,800
ジャパンパイル	15,300	893	13,662,900
東海カーボン	175,000	318	55,650,000
日本カーボン	99,000	194	19,206,000
東洋炭素	10,300	2,101	21,640,300
ノリタケ	106,000	248	26,288,000
TOTO	275,000	1,488	409,200,000
日本碍子	236,000	2,157	509,052,000
日本特殊陶業	161,000	2,317	373,037,000
ダントーホールディングス	26,000	118	3,068,000
MARUWA	4,800	3,955	18,984,000
品川リフラクトリーズ	47,000	235	11,045,000
黒崎播磨	40,000	239	9,560,000
ヨータイ	11,000	306	3,366,000
イソライト	7,400	184	1,361,600
東京窯業	23,000	214	4,922,000
ニッカトー	6,700	408	2,733,600
フジインコーポレーテッド	17,000	1,146	19,482,000
エーアンドエーマテリアル	39,000	129	5,031,000
ニチアス	90,000	710	63,900,000
新日鐵住金	7,899,000	301	2,377,599,000
神戸製鋼所	2,589,000	142	367,638,000
中山製鋼所	105,000	85	8,925,000
合同製鐵	95,000	170	16,150,000
JFEホールディングス	476,700	2,126	1,013,464,200
日新製鋼HD	79,100	1,051	83,134,100
東京製鐵	103,200	499	51,496,800
共英製鋼	17,400	2,011	34,991,400
大和工業	38,600	3,205	123,713,000
東京鐵鋼	39,000	406	15,834,000
大阪製鐵	9,400	1,804	16,957,600
淀川製鋼所	133,000	440	58,520,000
東洋鋼鈑	45,000	516	23,220,000
丸一鋼管	62,500	2,877	179,812,500
モリ工業	29,000	405	11,745,000

大同特殊鋼	313,000	500	156,500,000
日本高周波	74,000	101	7,474,000
日本冶金工	146,500	279	40,873,500
山陽特殊製鋼	102,000	428	43,656,000
愛知製鋼	99,000	421	41,679,000
日立金属	166,000	1,540	255,640,000
日本金属	49,000	129	6,321,000
大太平洋金属	130,000	344	44,720,000
日本電工	80,000	283	22,640,000
栗本鉄工所	97,000	247	23,959,000
虹 技	20,000	193	3,860,000
日本鑄鉄管	20,000	219	4,380,000
日本製鋼所	267,000	520	138,840,000
三菱製鋼	113,000	241	27,233,000
日亜鋼業	26,000	341	8,866,000
日本精線	14,000	430	6,020,000
大紀アルミニウム	29,000	252	7,308,000
日本軽金属HD	423,300	144	60,955,200
三井金属	476,000	274	130,424,000
東邦亜鉛	105,000	336	35,280,000
三菱マテリアル	1,166,000	327	381,282,000
住友鉱山	483,000	1,375	664,125,000
DOWAホールディングス	206,000	874	180,044,000
古河機金	314,000	187	58,718,000
エス・サイエンス	66,300	53	3,513,900
大阪チタニウム	20,400	1,618	33,007,200
東邦チタニウム	31,600	648	20,476,800
UACJ	237,000	416	98,592,000
古河電工	587,000	277	162,599,000
住友電工	704,000	1,598	1,124,992,000
フジクラ	300,000	487	146,100,000
昭和電線HLDGS	240,000	106	25,440,000
東京特殊電線	27,000	158	4,266,000
タツタ電線	27,300	624	17,035,200
沖 電 線	20,000	189	3,780,000
カナレ電気	2,800	1,445	4,046,000
平河ヒューテック	4,200	835	3,507,000
リョービ	114,000	362	41,268,000
アサヒHD	28,100	1,749	49,146,900
東洋製罐グループHD	132,700	1,855	246,158,500
ホッカンホールディングス	45,000	300	13,500,000
コロナ	9,800	1,084	10,623,200
横河ブリッジHLDGS	35,000	1,322	46,270,000
日本橋梁	41,400	175	7,245,000
駒井ハルテック	36,000	304	10,944,000
高田機工	17,000	212	3,604,000
三和ホールディングス	157,000	704	110,528,000
文化シャッター	44,000	621	27,324,000
三協立山	24,500	2,343	57,403,500
東洋シャッター	5,400	616	3,326,400

LIXILグループ	260,200	2,979	775,135,800
日本フィルコン	12,500	459	5,737,500
ノーリツ	36,700	2,104	77,216,800
長府製作所	20,000	2,508	50,160,000
リンナイ	28,900	8,780	253,742,000
ユニプレス	28,900	1,906	55,083,400
ダイニチ工業	9,500	726	6,897,000
日東精工	26,000	333	8,658,000
三洋工業	24,000	182	4,368,000
岡部	36,900	1,413	52,139,700
中国工業	3,000	768	2,304,000
東プレ	36,000	1,277	45,972,000
高周波熱錬	27,300	728	19,874,400
東京製綱	127,000	166	21,082,000
モリテックスチル	10,000	305	3,050,000
パイオラックス	8,700	3,765	32,755,500
日本発条	148,900	1,079	160,663,100
中央発條	24,000	308	7,392,000
アドバネクス	38,000	146	5,548,000
三浦工業	27,700	2,650	73,405,000
タクマ	58,000	884	51,272,000
リブセンス	9,300	1,666	15,493,800
E R Iホールディングス	3,700	1,170	4,329,000
ツガミ	58,000	634	36,772,000
オークマ	122,000	947	115,534,000
東芝機械	102,000	507	51,714,000
アマダ	286,000	858	245,388,000
アイダエンジニア	43,900	1,048	46,007,200
滝澤鉄工所	47,000	153	7,191,000
富士機械製造	56,800	900	51,120,000
牧野フライス	93,000	825	76,725,000
オーエスジー	76,800	1,915	147,072,000
ダイジェット	22,000	153	3,366,000
旭ダイヤモンド	48,000	1,249	59,952,000
D M G森精機	98,500	1,699	167,351,500
ディスコ	20,700	6,620	137,034,000
日東工器	10,800	1,870	20,196,000
豊田自動織機	162,500	4,880	793,000,000
豊和工業	10,600	802	8,501,200
大阪機工	73,000	138	10,074,000
石川製作所	43,000	112	4,816,000
東洋機械金属	14,100	633	8,925,300
津田駒工業	45,000	166	7,470,000
エンシュウ	46,000	137	6,302,000
島精機製作所	24,300	1,766	42,913,800
日阪製作所	24,000	924	22,176,000
やまびこ	7,300	3,725	27,192,500
ベガサスマシン製造	17,200	411	7,069,200
ナプテスコ	85,300	2,531	215,894,300
三井海洋開発	15,500	2,680	41,540,000

レオン自動機	17,000	594	10,098,000
S M C	53,400	25,965	1,386,531,000
新川	15,700	553	8,682,100
ホソカワミクロン	31,000	626	19,406,000
ユニオンツール	8,100	2,465	19,966,500
オイレス工業	17,700	2,278	40,320,600
日精エーエスピー	5,100	2,257	11,510,700
サトーホールディングス	19,500	2,500	48,750,000
日本エアーテック	5,800	500	2,900,000
日精樹脂工業	13,600	603	8,200,800
ワイエイシイ	7,800	572	4,461,600
小松製作所	871,600	2,135	1,860,866,000
住友重機械	511,000	472	241,192,000
日立建機	95,300	1,987	189,361,100
日 工	28,000	561	15,708,000
巴工業	6,400	1,656	10,598,400
井関農機	191,000	297	56,727,000
T O W A	15,300	515	7,879,500
丸山製作所	39,000	250	9,750,000
北川鉄工所	86,000	187	16,082,000
シンニッタン	17,700	389	6,885,300
クボタ	975,000	1,432	1,396,200,000
荏原実業	5,000	1,348	6,740,000
東洋エンジニア	107,000	482	51,574,000
三菱化工機	62,000	169	10,478,000
月島機械	30,000	1,111	33,330,000
帝国電機製作所	6,300	2,971	18,717,300
東京機械	66,000	101	6,666,000
新東工業	43,800	764	33,463,200
渋谷工業	11,700	2,090	24,453,000
アイチ コーポレーション	26,400	434	11,457,600
小森コーポレーション	45,400	1,386	62,924,400
鶴見製作所	14,000	1,326	18,564,000
住友精密	29,000	417	12,093,000
酒井重工業	36,000	395	14,220,000
荏原製作所	413,000	709	292,817,000
石井鉄工所	28,000	272	7,616,000
西島製作所	19,900	1,190	23,681,000
千代田化工建	159,000	1,572	249,948,000
ダイキン工業	243,700	5,924	1,443,678,800
オルガノ	29,000	475	13,775,000
トーヨーカネツ	100,000	293	29,300,000
栗田工業	112,200	2,193	246,054,600
椿本チエイン	95,000	843	80,085,000
大同工業	37,000	287	10,619,000
日本コンベヤ	59,000	145	8,555,000
日 機 装	58,000	1,328	77,024,000
木村化工機	17,200	518	8,909,600
新興プランテック	41,100	802	32,962,200
アネスト岩田	30,000	649	19,470,000

ダイフク	75,500	1,393	105,171,500
加藤製作所	42,000	622	26,124,000
油研工業	35,000	226	7,910,000
タダノ	79,000	1,336	105,544,000
フジテック	52,000	1,278	66,456,000
C K D	50,000	1,044	52,200,000
キトー	10,500	1,940	20,370,000
平和	38,600	1,743	67,279,800
理想科学工業	13,800	2,291	31,615,800
S A N K Y O	54,100	4,235	229,113,500
日本金銭機械	16,500	1,965	32,422,500
マースエンジニアリング	10,100	1,870	18,887,000
福島工業	9,800	1,590	15,582,000
オーイズミ	6,300	1,033	6,507,900
ダイコク電機	7,400	2,445	18,093,000
ア マ ノ	51,000	1,044	53,244,000
J U K I	115,000	220	25,300,000
サンデン	101,000	556	56,156,000
蛇の目ミシン	174,000	84	14,616,000
ブラザー工業	230,700	1,440	332,208,000
マックス	28,000	1,222	34,216,000
モリタホールディングス	31,000	833	25,823,000
グローリー	53,200	2,693	143,267,600
新晃工業	12,500	831	10,387,500
大和冷機工業	29,000	705	20,445,000
セガサミーホールディングス	191,800	2,463	472,403,400
日本ピストンリング	71,000	195	13,845,000
リ ケ ン	71,000	477	33,867,000
T P R	19,900	1,715	34,128,500
ホシザキ電機	39,000	3,735	145,665,000
大豊工業	12,900	1,003	12,938,700
日本精工	397,000	1,156	458,932,000
N T N	413,000	387	159,831,000
ジェイテクト	189,600	1,592	301,843,200
不 二 越	166,000	638	105,908,000
ミネベア	243,000	894	217,242,000
日本トムソン	57,000	546	31,122,000
T H K	111,300	2,382	265,116,600
ユーシン精機	7,900	2,557	20,200,300
前澤給装工業	7,000	1,304	9,128,000
イーグル工業	22,000	1,569	34,518,000
前澤工業	13,500	332	4,482,000
日本ピラー工業	19,000	737	14,003,000
キッツ	80,000	497	39,760,000
日 立	4,286,000	814	3,488,804,000
東 芝	3,522,000	438	1,542,636,000
三菱電機	1,785,000	1,203	2,147,355,000
富士電機	497,000	446	221,662,000
東洋電機製造	35,000	352	12,320,000
安川電機	196,000	1,553	304,388,000

シンフォニア テクノロジー	107,000	167	17,869,000
明電舎	164,000	426	69,864,000
オリジン電気	26,000	320	8,320,000
山洋電気	27,000	685	18,495,000
デンヨー	17,600	1,545	27,192,000
日立工機	47,600	767	36,509,200
三桜工業	23,200	677	15,706,400
マキタ	116,400	5,890	685,596,000
東芝テック	112,000	669	74,928,000
芝浦メカトロニクス	32,000	232	7,424,000
マブチモーター	25,200	6,740	169,848,000
日本電産	96,500	12,200	1,177,300,000
東光高岳HD	9,900	1,695	16,780,500
宮越ホールディングス	6,200	272	1,686,400
ダイヘン	105,000	424	44,520,000
ヤーマン	2,400	1,431	3,434,400
JVCケンウッド	123,300	234	28,852,200
第一精工	7,400	1,255	9,287,000
日新電機	36,000	556	20,016,000
大崎電気	28,000	638	17,864,000
オムロン	201,400	4,395	885,153,000
日東工業	26,200	2,103	55,098,600
I D E C	23,300	921	21,459,300
ジーエス・ユアサ コーポ	344,000	608	209,152,000
サクサホールディングス	45,000	153	6,885,000
メルコホールディングス	8,600	1,616	13,897,600
テクノメディカ	4,100	2,137	8,761,700
日本電気	2,453,000	329	807,037,000
富士通	1,721,000	634	1,091,114,000
沖電気	689,000	240	165,360,000
岩崎通信機	85,000	95	8,075,000
電気興業	51,000	687	35,037,000
サンケン電気	97,000	719	69,743,000
ナカヨ通信機	17,000	323	5,491,000
アイホン	10,400	1,544	16,057,600
ルネサスエレクトロニクス	92,400	744	68,745,600
セイコーエプソン	121,800	2,989	364,060,200
ワコム	140,500	638	89,639,000
アルバック	30,100	2,115	63,661,500
アクセル	9,000	1,668	15,012,000
ピクセラ	7,400	142	1,050,800
E I Z O	16,400	2,794	45,821,600
日本信号	45,000	915	41,175,000
京三製作所	42,000	342	14,364,000
能美防災	24,000	1,101	26,424,000
ホーチキ	13,000	564	7,332,000
エレコム	6,400	1,569	10,041,600
日本無線	46,000	348	16,008,000
パナソニック	2,039,100	1,196	2,438,763,600
シャープ	1,287,000	331	425,997,000

アンリツ	103,800	1,143	118,643,400
富士通ゼネラル	42,000	1,074	45,108,000
日立国際電気	35,000	1,392	48,720,000
ソ ニ ー	978,500	1,766	1,728,031,000
T D K	107,700	4,435	477,649,500
帝国通信工業	44,000	175	7,700,000
ミツミ電機	68,000	781	53,108,000
タムラ製作所	69,000	290	20,010,000
アルプス電気	130,900	1,316	172,264,400
池上通信機	57,000	106	6,042,000
パイオニア	247,800	229	56,746,200
日本電波工業	16,100	874	14,071,400
日本トリム	3,900	6,610	25,779,000
ローランド ディー . ジー .	7,900	3,610	28,519,000
日本コロムビア	8,800	719	6,327,200
フオスター電機	18,300	1,745	31,933,500
クラリオン	110,000	146	16,060,000
S M K	53,000	493	26,129,000
ヨコオ	15,300	549	8,399,700
東 光	84,000	386	32,424,000
ティアック	97,000	78	7,566,000
ホシデン	52,400	499	26,147,600
ヒロセ電機	31,000	14,980	464,380,000
日本航空電子	46,000	1,603	73,738,000
T O A	19,200	981	18,835,200
古野電気	17,300	698	12,075,400
ユニデン	56,000	286	16,016,000
アルパイン	38,700	1,429	55,302,300
スミダコーポレーション	14,800	521	7,710,800
アイコム	9,900	2,256	22,334,400
リオン	5,100	1,654	8,435,400
船井電機	18,000	1,144	20,592,000
横河電機	193,600	1,599	309,566,400
新電元工業	57,000	519	29,583,000
アズビル	54,100	2,526	136,656,600
日本光電工業	38,100	4,180	159,258,000
チ ノ ー	33,000	226	7,458,000
共和電業	21,000	416	8,736,000
日本電子材料	8,300	437	3,627,100
堀場製作所	33,000	4,060	133,980,000
アドバンテスト	121,700	1,134	138,007,800
小野測器	19,000	460	8,740,000
エスベック	18,500	807	14,929,500
パナソニックデバイス	15,900	468	7,441,200
キーエンス	40,400	44,300	1,789,720,000
日置電機	9,400	1,408	13,235,200
シスメックス	74,700	5,940	443,718,000
メガチップス	16,000	1,265	20,240,000
O B A R A G R O U P	11,600	3,990	46,284,000
日本電産コバル電子	18,600	751	13,968,600

澤藤電機	11,000	229	2,519,000
デンソー	441,000	5,448	2,402,568,000
コーセル	26,000	1,217	31,642,000
新日本無線	13,000	347	4,511,000
オプテックス	11,400	1,654	18,855,600
千代田インテグレ	7,900	1,832	14,472,800
レーザーテック	12,800	1,062	13,593,600
スタンレー電気	128,600	2,393	307,739,800
岩崎電気	65,000	255	16,575,000
ウシオ電機	108,300	1,289	139,598,700
岡谷電機	10,100	402	4,060,200
ヘリオステクノH	15,300	334	5,110,200
日本セラミック	10,300	1,705	17,561,500
遠藤照明	7,400	2,074	15,347,600
日本デジタル研究所	13,200	1,442	19,034,400
古河電池	13,000	760	9,880,000
双信電機	9,000	392	3,528,000
山一電機	19,900	520	10,348,000
図 研	11,700	807	9,441,900
日本電子	62,000	380	23,560,000
カ シ オ	185,600	1,170	217,152,000
ファナック	199,100	17,360	3,456,376,000
日本シイエムケイ	42,000	265	11,130,000
エンプラス	6,700	6,570	44,019,000
大真空	25,000	413	10,325,000
ロ - ム	94,300	5,410	510,163,000
浜松ホトニクス	69,600	4,325	301,020,000
三井ハイテック	23,600	712	16,803,200
新光電気工業	60,000	783	46,980,000
京 セ ラ	318,000	4,623	1,470,114,000
協栄産業	22,000	183	4,026,000
太陽誘電	86,900	1,284	111,579,600
村田製作所	187,200	9,775	1,829,880,000
ユーシン	25,100	638	16,013,800
双葉電子工業	33,100	1,423	47,101,300
日東電工	154,100	4,638	714,715,800
北陸電気工業	72,000	142	10,224,000
東海理化電機	47,200	1,867	88,122,400
ニチコン	56,200	875	49,175,000
日本ケミコン	113,000	345	38,985,000
K O A	22,500	1,120	25,200,000
三井造船	691,000	206	142,346,000
日立造船	132,400	594	78,645,600
佐世保重工業	126,000	153	19,278,000
三菱重工業	3,178,000	626	1,989,428,000
川崎重工業	1,390,000	420	583,800,000
I H I	1,220,000	473	577,060,000
名村造船所	26,200	1,097	28,741,400
サノヤスホールディングス	16,400	240	3,936,000
日本車輛	65,000	496	32,240,000

ニチユ三菱フォークリフト	21,000	745	15,645,000	
近畿車輛	31,000	327	10,137,000	
F P G	11,600	996	11,553,600	
島根銀行	4,100	1,322	5,420,200	
じもとホールディングス	126,200	197	24,861,400	
全国保証	21,000	4,595	96,495,000	
足利ホールディングス	69,200	494	34,184,800	
日産自動車	2,505,100	920	2,304,692,000	
いすゞ自動車	1,035,000	633	655,155,000	
トヨタ自動車	2,484,000	5,990	14,879,160,000	*
日野自動車	223,000	1,548	345,204,000	
三菱自動車工業	559,000	1,115	623,285,000	
エフテック	6,300	1,350	8,505,000	
G M B	1,900	1,340	2,546,000	
武蔵精密工業	19,100	1,971	37,646,100	
日産車体	87,000	1,426	124,062,000	
新明和工業	72,000	877	63,144,000	
極東開発工業	30,800	1,340	41,272,000	
日信工業	36,400	2,036	74,110,400	
トピー工業	147,000	182	26,754,000	
ティラド	70,000	288	20,160,000	
曙ブレーキ	83,200	479	39,852,800	
タチエス	26,400	1,463	38,623,200	
N O K	86,400	1,713	148,003,200	
フタバ産業	54,600	448	24,460,800	
カヤバ工業	152,000	496	75,392,000	
シロキ工業	41,000	216	8,856,000	
市光工業	44,000	139	6,116,000	
大同メタル工業	25,000	980	24,500,000	
プレス工業	70,000	417	29,190,000	
カルソニックカンセイ	121,000	544	65,824,000	
太平洋工業	36,600	652	23,863,200	
ケーヒン	41,200	1,564	64,436,800	
河西工業	24,000	722	17,328,000	
アイシン精機	163,300	3,575	583,797,500	
富士機工	21,000	340	7,140,000	
マ ッ ダ	2,660,000	495	1,316,700,000	
ダイハツ	189,400	1,650	312,510,000	
今仙電機製作所	13,300	1,378	18,327,400	
本田技研	1,606,200	3,710	5,959,002,000	
スズキ	373,100	2,718	1,014,085,800	
富士重工業	607,500	2,777	1,687,027,500	
ヤマハ発動機	271,500	1,534	416,481,000	
ショーワ	42,300	1,310	55,413,000	
小糸製作所	98,000	1,890	185,220,000	
T B K	20,000	538	10,760,000	
エクセディ	21,600	3,085	66,636,000	
ミツバ	32,900	1,675	55,107,500	
豊田合成	57,800	2,169	125,368,200	
愛三工業	22,000	863	18,986,000	

ヨロズ	13,200	2,141	28,261,200
エフ・シー・シー	29,300	1,818	53,267,400
新家工業	42,000	156	6,552,000
シマノ	77,100	9,180	707,778,000
タカタ	32,300	3,155	101,906,500
テイ・エス テック	37,800	3,405	128,709,000
小野建	15,400	1,306	20,112,400
はるやま商事	7,400	762	5,638,800
佐島電機	13,200	618	8,157,600
カッパ・クリエイトHD	12,950	1,957	25,343,150
エコートレーディング	4,700	714	3,355,800
伯東	10,800	1,025	11,070,000
コンドーテック	14,700	703	10,334,100
中山福	10,200	867	8,843,400
ライトオン	13,100	684	8,960,400
ナガイレーベン	23,500	1,838	43,193,000
ジーンズメイト	5,900	233	1,374,700
三菱食品	19,400	2,275	44,135,000
良品計画	18,700	10,050	187,935,000
三城ホールディングス	21,700	484	10,502,800
松田産業	13,200	1,284	16,948,800
メディバルHD	176,200	1,594	280,862,800
アドヴァン	9,100	1,151	10,474,100
S P K	4,400	1,846	8,122,400
アズワン	11,500	2,508	28,842,000
スズデン	6,500	647	4,205,500
尾家産業	6,400	837	5,356,800
シモジマ	12,100	1,015	12,281,500
ドウシシャ	19,100	1,473	28,134,300
コナカ	22,500	779	17,527,500
高速	10,500	927	9,733,500
ハウス ローゼ	2,300	1,406	3,233,800
G - 7ホールディングス	5,300	758	4,017,400
イオン北海道	11,200	697	7,806,400
コジマ	25,800	276	7,120,800
ヒマラヤ	4,200	1,062	4,460,400
コーナン商事	22,900	1,070	24,503,000
黒田電気	25,400	1,619	41,122,600
ネットワンシステムズ	69,000	681	46,989,000
エコス	6,300	678	4,271,400
ワタミ	20,700	1,530	31,671,000
マルシェ	4,800	835	4,008,000
ドンキホーテホールディング	60,700	5,920	359,344,000
丸文	15,700	575	9,027,500
西松屋チェーン	34,700	746	25,886,200
ゼンショーホールディングス	67,000	1,216	81,472,000
ハビネット	10,700	940	10,058,000
幸楽苑	10,900	1,354	14,758,600
トーメンエレクトロニクス	9,100	1,657	15,078,700
ハークスレイ	5,100	792	4,039,200

サイゼリヤ	26,000	1,229	31,954,000
エクセル	8,200	1,184	9,708,800
マルカキカイ	5,700	1,267	7,221,900
アルゴグラフィックス	6,600	1,725	11,385,000
ガリバーインターナショナル	59,700	790	47,163,000
日本エム・ディ・エム	15,000	299	4,485,000
ポブラ	4,900	541	2,650,900
ユナイテッドアローズ	23,100	3,520	81,312,000
進和	10,400	1,205	12,532,000
エスケイジャパン	5,100	290	1,479,000
ダイトエレクトロン	8,400	415	3,486,000
ハイデイ日高	9,300	2,577	23,966,100
シークス	11,200	1,648	18,457,600
京都きもの友禅	11,800	1,077	12,708,600
コロワイド	58,500	1,129	66,046,500
田中商事	6,000	579	3,474,000
オーハシテクニカ	9,500	874	8,303,000
壱番屋	7,100	3,910	27,761,000
マクニカ	9,100	2,993	27,236,300
白銅	5,800	944	5,475,200
トップカルチャー	6,600	460	3,036,000
P L A N T	3,500	955	3,342,500
スギホールディングス	31,600	3,970	125,452,000
島津製作所	230,000	876	201,480,000
J M S	33,000	296	9,768,000
クボテック	4,600	267	1,228,200
ショットモリテックス	4,000	283	1,132,000
長野計器	11,500	667	7,670,500
ブイ・テクノロジー	37	296,000	10,952,000
スター精密	33,900	1,209	40,985,100
東京計器	62,000	298	18,476,000
愛知時計	24,000	295	7,080,000
東京精密	32,100	2,008	64,456,800
マニー	5,400	3,810	20,574,000
ニコン	333,200	1,888	629,081,600
トプコン	48,000	1,545	74,160,000
オリンパス	265,900	3,315	881,458,500
理研計器	15,900	905	14,389,500
大日本スクリーン	169,000	527	89,063,000
キャノン電子	16,400	1,875	30,750,000
タムロン	13,700	2,491	34,126,700
H O Y A	433,900	2,930	1,271,327,000
ノーリツ鋼機	16,200	659	10,675,800
エー・アンド・デイ	16,300	525	8,557,500
キャノン	1,034,600	3,179	3,288,993,400
リ コ ー	537,000	1,294	694,878,000
シチズンホールディングス	219,800	854	187,709,200
リズム時計	81,000	136	11,016,000
大研医器	6,200	1,776	11,011,200
パラマウントベッドHD	17,100	3,180	54,378,000

SHOBI	5,600	410	2,296,000
前田工織	13,100	1,479	19,374,900
永大産業	24,000	601	14,424,000
アートネイチャー	5,700	2,565	14,620,500
ダンロップスポーツ	9,900	1,245	12,325,500
バンダイナムコHLDGS	196,800	2,394	471,139,200
共立印刷	33,000	280	9,240,000
フランスベッドHLDGS	112,000	191	21,392,000
マーベラスAQL	26,800	715	19,162,000
パイロットコーポレーション	15,600	3,510	54,756,000
エイベックス・グループHD	32,500	1,976	64,220,000
トッパン・フォームズ	31,900	887	28,295,300
フジシールインターナショナル	21,700	3,675	79,747,500
タカラトミー	58,600	458	26,838,800
廣済堂	16,700	489	8,166,300
アーク	53,100	303	16,089,300
レック	6,000	1,174	7,044,000
タカノ	8,000	531	4,248,000
プロネクサス	18,300	692	12,663,600
ホクシン	13,500	149	2,011,500
ウッドワン	30,000	329	9,870,000
大建工業	73,000	268	19,564,000
きもと	13,700	718	9,836,600
凸版印刷	504,000	764	385,056,000
大日本印刷	543,000	1,046	567,978,000
図書印刷	29,000	463	13,427,000
共同印刷	55,000	286	15,730,000
日本写真印刷	30,000	1,499	44,970,000
光村印刷	3,000	269	807,000
藤森工業	16,000	2,459	39,344,000
宝印刷	10,300	749	7,714,700
前澤化成工業	13,300	1,058	14,071,400
アシックス	177,300	1,962	347,862,600
ツツミ	8,900	2,325	20,692,500
ジェイエスピー	12,200	1,523	18,580,600
ニチハ	22,800	1,300	29,640,000
ローランド	17,200	1,422	24,458,400
エフピコ	9,200	5,960	54,832,000
小松ウオール工業	6,100	2,046	12,480,600
ヤマハ	131,200	1,426	187,091,200
河合楽器	62,000	181	11,222,000
クリナップ	18,400	833	15,327,200
ビジョン	29,200	4,655	135,926,000
天馬	14,900	1,352	20,144,800
兼松日産農林	28,000	166	4,648,000
キングジム	15,000	685	10,275,000
リンテック	42,400	2,021	85,690,400
TASAKI	3,800	573	2,177,400
信越ポリマー	37,000	378	13,986,000
東リ	49,000	208	10,192,000

イトーキ	37,600	631	23,725,600
任天堂	109,900	12,725	1,398,477,500
三菱鉛筆	14,700	2,480	36,456,000
松風	9,000	865	7,785,000
タカラスタンダード	74,000	770	56,980,000
コクヨ	92,700	730	67,671,000
ナカバヤシ	38,000	211	8,018,000
ニフコ	41,700	2,832	118,094,400
グローブライド	94,000	147	13,818,000
岡村製作所	69,000	853	58,857,000
日本バルカー	78,000	287	22,386,000
MUTOHホールディングス	24,000	528	12,672,000
伊藤忠	1,405,500	1,281	1,800,445,500
丸紅	1,541,000	728	1,121,848,000
スクロール	22,900	300	6,870,000
高島	33,000	242	7,986,000
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,570	21,195,000
三陽商会	100,000	291	29,100,000
長瀬産業	99,700	1,268	126,419,600
ナイガイ	70,000	84	5,880,000
蝶理	11,400	1,115	12,711,000
豊田通商	196,300	2,568	504,098,400
オンワードホールディングス	125,000	752	94,000,000
三共生興	30,900	369	11,402,100
兼松	376,000	165	62,040,000
美津濃	88,000	568	49,984,000
ツカモトコーポレーション	32,000	145	4,640,000
ファミリーマート	59,500	4,685	278,757,500
ルック	34,000	271	9,214,000
三井物産	1,621,900	1,568	2,543,139,200
日本紙パルプ	91,000	331	30,121,000
東京エレクトロン	160,200	5,797	928,679,400
日立ハイテクノロジーズ	53,400	2,483	132,592,200
カメイ	22,900	786	17,999,400
東都水産	32,000	232	7,424,000
OUGホールディングス	28,000	210	5,880,000
スターゼン	65,000	280	18,200,000
セイコーHD	115,000	438	50,370,000
山善	68,100	617	42,017,700
椿本興業	20,000	292	5,840,000
住友商事	1,039,700	1,341	1,394,237,700
日本ユニシス	42,600	1,160	49,416,000
内田洋行	41,000	291	11,931,000
三菱商事	1,374,500	2,002	2,751,749,000
第一実業	41,000	455	18,655,000
キャノンマーケティングJPN	50,200	1,350	67,770,000
西華産業	61,000	249	15,189,000
佐藤商事	15,800	703	11,107,400
菱洋エレクトロ	20,900	1,114	23,282,600
東京産業	17,700	399	7,062,300

ユアサ商事	182,000	212	38,584,000
神鋼商事	46,000	208	9,568,000
小林産業	11,900	299	3,558,100
阪和興業	176,000	478	84,128,000
カナデン	2,000	707	1,414,000
菱電商事	26,000	726	18,876,000
ニプロ	95,100	902	85,780,200
フルサト工業	9,700	1,138	11,038,600
岩谷産業	196,000	644	126,224,000
すてきナイスグループ	75,000	224	16,800,000
昭光通商	60,000	145	8,700,000
ニチモウ	29,000	188	5,452,000
極東貿易	22,000	217	4,774,000
イワキ	28,000	204	5,712,000
兼松エレクトロニクス	11,200	1,374	15,388,800
三愛石油	41,000	548	22,468,000
稲畑産業	43,600	1,050	45,780,000
G S Iクレオス	48,000	158	7,584,000
明和産業	16,900	372	6,286,800
ゴールドウイン	43,000	477	20,511,000
ユニ・チャーム	114,700	5,954	682,923,800
デサント	43,000	706	30,358,000
キング	10,000	454	4,540,000
ワキタ	26,000	1,213	31,538,000
ヤマトインターナショナル	12,400	444	5,505,600
東邦ホールディングス	56,400	2,077	117,142,800
サンゲツ	31,200	2,541	79,279,200
ミツウロコグループ	28,400	568	16,131,200
シナネン	38,000	410	15,580,000
伊藤忠エネクス	39,000	581	22,659,000
サンリオ	44,400	4,145	184,038,000
サンワテクノス	8,800	876	7,708,800
リョーサン	26,200	2,176	57,011,200
新光商事	19,400	924	17,925,600
トーヨー	38,000	368	13,984,000
三信電気	22,000	743	16,346,000
東陽テクニカ	24,200	1,026	24,829,200
モスフードサービス	23,100	2,116	48,879,600
加賀電子	16,000	1,266	20,256,000
三益半導体	15,900	862	13,705,800
ソーダニツカ	2,000	447	894,000
立花エレテック	10,700	1,287	13,770,900
木曽路	21,600	1,852	40,003,200
サトレストラシステムズ	16,600	767	12,732,200
千趣会	31,900	805	25,679,500
タカキュー	14,000	290	4,060,000
ケーヨー	29,600	457	13,527,200
アデランス	22,300	1,141	25,444,300
上新電機	38,000	799	30,362,000
日本瓦斯	26,300	1,197	31,481,100

ベスト電器	56,600	139	7,867,400
マルエツ	36,000	375	13,500,000
ロイヤルホールディングス	29,500	1,447	42,686,500
東天紅	13,000	198	2,574,000
いなげや	19,600	1,000	19,600,000
島忠	39,900	2,268	90,493,200
チヨダ	20,700	2,019	41,793,300
ライフコーポレーション	13,300	1,561	20,761,300
カスミ	36,200	687	24,869,400
リンガーハット	17,200	1,486	25,559,200
さが美	15,000	101	1,515,000
MR MAX	17,400	327	5,689,800
テンアライド	13,800	302	4,167,600
AOKIホールディングス	30,400	1,520	46,208,000
オークワ	27,000	867	23,409,000
コメリ	27,100	2,522	68,346,200
青山商事	44,200	2,581	114,080,200
しまむら	20,400	9,400	191,760,000
CFSコーポレーション	11,800	439	5,180,200
はせがわ	6,300	694	4,372,200
高島屋	238,000	929	221,102,000
松屋	35,400	956	33,842,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	103,000	760	78,280,000
近鉄百貨店	68,000	351	23,868,000
丸栄	29,000	188	5,452,000
ニッセンHD	35,200	427	15,030,400
パルコ	16,900	915	15,463,500
丸井グループ	229,600	890	204,344,000
クレディセゾン	143,900	2,282	328,379,800
アクシアルリテイリング	9,700	1,564	15,170,800
井筒屋	97,000	79	7,663,000
ダイエー	109,000	307	33,463,000
イズミヤ	66,000	476	31,416,000
イオン	703,400	1,300	914,420,000
ユニグループ・HD	168,500	631	106,323,500
イズミ	39,300	2,998	117,821,400
東武ストア	24,000	258	6,192,000
平和堂	35,700	1,421	50,729,700
フジ	19,500	1,749	34,105,500
ヤオコー	8,900	4,480	39,872,000
ゼビオ	21,200	1,881	39,877,200
ケーズホールディングス	37,200	2,959	110,074,800
Paltac	24,600	1,370	33,702,000
OLYMPICグループ	10,400	806	8,382,400
日産東京販売HD	26,000	387	10,062,000
新生銀行	1,525,000	205	312,625,000
あおぞら銀行	916,000	297	272,052,000
三菱UFJフィナンシャルG	13,343,300	615	8,206,129,500
りそなホールディングス	1,674,400	540	904,176,000
三井住友トラストHD	3,461,000	503	1,740,883,000

三井住友フィナンシャルG	1,332,100	4,791	6,382,091,100
第四銀行	224,000	363	81,312,000
北越銀行	192,000	204	39,168,000
西日本シティ銀行	618,000	249	153,882,000
千葉銀行	679,000	631	428,449,000
横浜銀行	1,162,000	527	612,374,000
常陽銀行	656,000	502	329,312,000
群馬銀行	395,000	553	218,435,000
武蔵野銀行	28,100	3,305	92,870,500
千葉興業銀行	36,500	667	24,345,500
筑波銀行	73,300	379	27,780,700
東京都民銀行	31,100	1,027	31,939,700
七十七銀行	276,000	463	127,788,000
青森銀行	129,000	274	35,346,000
秋田銀行	121,000	265	32,065,000
山形銀行	107,000	402	43,014,000
岩手銀行	11,500	4,475	51,462,500
東邦銀行	157,000	309	48,513,000
東北銀行	92,000	152	13,984,000
みちのく銀行	95,000	205	19,475,000
ふくおかフィナンシャルG	715,000	414	296,010,000
静岡銀行	516,000	1,017	524,772,000
十六銀行	221,000	348	76,908,000
スルガ銀行	172,000	1,804	310,288,000
八十二銀行	325,000	567	184,275,000
山梨中央銀行	112,000	430	48,160,000
大垣共立銀行	220,000	275	60,500,000
福井銀行	151,000	243	36,693,000
北國銀行	198,000	344	68,112,000
清水銀行	6,000	2,516	15,096,000
滋賀銀行	165,000	534	88,110,000
南都銀行	172,000	367	63,124,000
百五銀行	158,000	402	63,516,000
京都銀行	336,000	812	272,832,000
紀陽銀行	69,100	1,319	91,142,900
三重銀行	73,000	216	15,768,000
ほくほくフィナンシャルG	1,199,000	196	235,004,000
広島銀行	519,000	402	208,638,000
山陰合同銀行	109,000	706	76,954,000
中国銀行	130,900	1,299	170,039,100
鳥取銀行	57,000	181	10,317,000
伊予銀行	188,400	956	180,110,400
百十四銀行	193,000	337	65,041,000
四国銀行	126,000	222	27,972,000
阿波銀行	144,000	502	72,288,000
鹿児島銀行	122,000	611	74,542,000
大分銀行	111,000	385	42,735,000
宮崎銀行	118,000	289	34,102,000
肥後銀行	144,000	530	76,320,000
佐賀銀行	107,000	211	22,577,000

十八銀行	109,000	217	23,653,000
沖縄銀行	13,100	4,000	52,400,000
琉球銀行	34,200	1,273	43,536,600
八千代銀行	8,400	2,648	22,243,200
セブン銀行	660,100	376	248,197,600
みずほフィナンシャルG	22,803,700	216	4,925,599,200
高知銀行	69,000	157	10,833,000
山口フィナンシャルG	176,000	934	164,384,000
アクリーティブ	12,400	198	2,455,200
芙蓉総合リース	18,500	3,515	65,027,500
興銀リース	30,700	2,589	79,482,300
東京センチュリーリース	41,400	3,015	124,821,000
S B Iホールディングス	211,600	1,262	267,039,200
日本証券金融	77,400	657	50,851,800
アイフル	320,600	357	114,454,200
日本アジア投資	120,000	108	12,960,000
ポケットカード	17,700	670	11,859,000
長野銀行	59,000	183	10,797,000
名古屋銀行	159,000	349	55,491,000
北洋銀行	265,400	406	107,752,400
愛知銀行	6,400	4,760	30,464,000
第三銀行	100,000	171	17,100,000
中京銀行	73,000	174	12,702,000
東日本銀行	77,000	260	20,020,000
大光銀行	63,000	204	12,852,000
愛媛銀行	103,000	216	22,248,000
トマト銀行	69,000	175	12,075,000
みなと銀行	160,000	171	27,360,000
京葉銀行	145,000	434	62,930,000
関西アーバン銀行	245,000	117	28,665,000
栃木銀行	89,000	388	34,532,000
北日本銀行	5,500	2,630	14,465,000
東和銀行	209,000	102	21,318,000
福島銀行	219,000	87	19,053,000
大東銀行	114,000	105	11,970,000
リコーリース	12,100	2,683	32,464,300
イオンフィナンシャルサービス	102,100	2,568	262,192,800
アコム	353,700	317	112,122,900
ジャックス	107,000	439	46,973,000
オリコ	393,300	214	84,166,200
日立キャピタル	34,600	2,530	87,538,000
アプラスフィナンシャル	63,100	124	7,824,400
オリックス	1,088,500	1,573	1,712,210,500
三菱UFJリース	446,800	546	243,952,800
ジャフコ	24,100	5,460	131,586,000
トモニホールディングス	135,000	408	55,080,000
大和証券G本社	1,745,000	947	1,652,515,000
野村ホールディングス	3,600,900	712	2,563,840,800
岡三証券グループ	138,000	909	125,442,000
丸三証券	52,300	900	47,070,000

東洋証券	71,000	372	26,412,000
東海東京HD	186,600	904	168,686,400
光世証券	42,000	251	10,542,000
水戸証券	52,000	437	22,724,000
いちよし証券	34,500	1,520	52,440,000
松井証券	89,500	1,122	100,419,000
NKSJホールディングス	391,300	2,687	1,051,423,100
だいこう証券ビジ	8,600	788	6,776,800
日本取引所グループ	258,700	2,455	635,108,500
マネックスG	191,400	419	80,196,600
カブドットコム証券	68,200	534	36,418,800
極東証券	21,900	1,822	39,901,800
岩井コスモホールディング	16,700	1,236	20,641,200
フィデアホール	101,200	194	19,632,800
池田泉州HD	131,800	464	61,155,200
MS&AD	526,400	2,500	1,316,000,000
SONY FH	168,700	1,732	292,188,400
マネーパートナーズGP	13,600	252	3,427,200
小林洋行	5,200	273	1,419,600
第一生命	886,600	1,546	1,370,683,600
東京海上HD	682,300	3,100	2,115,130,000
イー・ギャランティ	5,100	2,129	10,857,900
アサックス	3,100	1,344	4,166,400
NECキャピタルソリューション	6,000	2,243	13,458,000
T&Dホールディングス	604,200	1,277	771,563,400
三井不動産	830,000	3,139	2,605,370,000
三菱地所	1,233,000	2,501	3,083,733,000
平和不動産	35,600	1,537	54,717,200
東京建物	360,000	874	314,640,000
ダイビル	51,800	1,095	56,721,000
京阪神ビルディング	29,300	543	15,909,900
住友不動産	422,000	4,294	1,812,068,000
太平洋興発	66,000	132	8,712,000
大京	296,000	237	70,152,000
テオーシー	60,700	763	46,314,100
東京楽天地	27,000	469	12,663,000
レオパレス21	202,500	527	106,717,500
フジ住宅	22,600	691	15,616,600
空港施設	21,500	769	16,533,500
明和地所	8,700	454	3,949,800
住友不動産販売	12,700	3,160	40,132,000
ゴールドクレスト	13,900	2,269	31,539,100
リロ・ホールディング	7,000	5,610	39,270,000
日本エスリード	6,900	1,109	7,652,100
日神不動産	23,600	384	9,062,400
タカラレーベン	58,700	312	18,314,400
サンヨーハウジ 名古屋	9,200	1,078	9,917,600
イオンモール	113,600	2,900	329,440,000
ファースト住建	5,000	1,367	6,835,000
ランド	40,500	14	567,000

トーセイ	24,200	697	16,867,400
穴吹興産	12,000	314	3,768,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	109,400	934	102,179,600
サンフロンティア不動産	16,600	1,326	22,011,600
エフ・ジェー・ネクスト	7,300	521	3,803,300
ランドビジネス	11,900	405	4,819,500
グランディハウス	10,600	335	3,551,000
東武鉄道	1,013,000	498	504,474,000
相鉄ホールディングス	305,000	372	113,460,000
東京急行	1,050,000	633	664,650,000
京浜急行	458,000	879	402,582,000
小田急電鉄	572,000	930	531,960,000
京王電鉄	499,000	725	361,775,000
京成電鉄	268,000	914	244,952,000
富士急行	49,000	916	44,884,000
新京成電鉄	24,000	376	9,024,000
東日本旅客鉄道	328,300	7,805	2,562,381,500
西日本旅客鉄道	161,100	4,264	686,930,400
東海旅客鉄道	159,800	11,900	1,901,620,000
鴻池運輸	9,500	1,367	12,986,500
西日本鉄道	231,000	406	93,786,000
ハマキョウレックス	5,100	3,040	15,504,000
サカイ引越センター	2,900	3,515	10,193,500
近畿日本鉄道	1,795,000	367	658,765,000
阪急阪神HLDGS	1,197,000	560	670,320,000
南海電鉄	372,000	383	142,476,000
京阪電鉄	376,000	403	151,528,000
神戸電鉄	44,000	339	14,916,000
名糖運輸	7,600	671	5,099,600
名古屋鉄道	623,000	310	193,130,000
山陽電鉄	66,000	413	27,258,000
トランコム	5,200	3,585	18,642,000
日本通運	706,000	484	341,704,000
ヤマトホールディングス	332,300	2,075	689,522,500
山 九	217,000	454	98,518,000
日 新	68,000	287	19,516,000
丸 運	11,200	228	2,553,600
丸全昭和運輸	60,000	331	19,860,000
センコー	72,000	511	36,792,000
トナミホールディングス	37,000	200	7,400,000
日本梱包運輸	54,500	1,801	98,154,500
日石輸送	21,000	233	4,893,000
福山通運	108,000	594	64,152,000
セイノーホールディングス	127,000	1,088	138,176,000
神奈川中央交通	22,000	510	11,220,000
日立物流	37,100	1,654	61,363,400
日本郵船	1,508,000	322	485,576,000
商船三井	1,003,000	417	418,251,000
川崎汽船	781,000	233	181,973,000
NSユニテッド海運	77,000	267	20,559,000

乾 汽 船	21,700	347	7,529,900
明治海運	16,100	414	6,665,400
飯野海運	74,000	520	38,480,000
共栄タンカー	15,000	222	3,330,000
第一中央汽船	132,000	96	12,672,000
日本航空	150,800	5,130	773,604,000
ANAホールディングス	3,508,000	230	806,840,000
スカイマーク	38,200	342	13,064,400
パスコ	17,000	455	7,735,000
三菱倉庫	117,000	1,453	170,001,000
三井倉庫	90,000	425	38,250,000
住友倉庫	119,000	523	62,237,000
渋沢倉庫	42,000	354	14,868,000
ヤマタネ	89,000	162	14,418,000
東陽倉庫	31,000	261	8,091,000
日本トランスシティ	37,000	336	12,432,000
ケイヒン	33,000	156	5,148,000
中央倉庫	10,500	860	9,030,000
安田倉庫	14,000	1,048	14,672,000
東洋埠頭	52,000	219	11,388,000
宇徳	14,600	371	5,416,600
上 組	213,000	969	206,397,000
サンリツ	1,700	563	957,100
キムラユニティー	4,200	942	3,956,400
キューソー流通システム	5,800	1,011	5,863,800
郵船ロジスティクス	16,400	1,333	21,861,200
近鉄エクスプレス	16,000	4,280	68,480,000
東海運	9,900	271	2,682,900
エーアイティー	6,600	771	5,088,600
東京放送HD	94,900	1,142	108,375,800
日本テレビHLD S	175,400	1,706	299,232,400
テレビ朝日	44,600	2,052	91,519,200
スカパーJ S A T H D	133,700	533	71,262,100
テレビ東京HD	14,400	1,687	24,292,800
コネクシオ	15,700	857	13,454,900
日本電信電話	692,100	5,778	3,998,953,800
K D D I	546,800	6,146	3,360,632,800
光通信	16,400	9,150	150,060,000
N T T ドコモ	1,451,300	1,700	2,467,210,000
G M O インターネット	58,800	1,173	68,972,400
学研ホールディングス	59,000	283	16,697,000
ゼンリン	23,300	994	23,160,200
昭文社	10,700	714	7,639,800
K A D O K A W A	17,000	3,455	58,735,000
インプレスホールディングス	13,000	149	1,937,000
東京電力	1,514,000	475	719,150,000
中部電力	588,000	1,281	753,228,000
関西電力	728,300	1,172	853,567,600
中国電力	246,700	1,490	367,583,000
北陸電力	174,800	1,343	234,756,400

東北電力	445,900	1,196	533,296,400
四国電力	160,700	1,614	259,369,800
九州電力	394,100	1,305	514,300,500
北海道電力	167,000	1,069	178,523,000
沖縄電力	11,700	3,460	40,482,000
電源開発	110,800	3,190	353,452,000
東京瓦斯	2,093,000	505	1,056,965,000
大阪瓦斯	1,847,000	420	775,740,000
東邦瓦斯	454,000	522	236,988,000
北海道瓦斯	36,000	284	10,224,000
西部瓦斯	201,000	245	49,245,000
静岡瓦斯	46,600	593	27,633,800
アイネット	7,600	788	5,988,800
松竹	116,000	897	104,052,000
東宝	125,700	2,028	254,919,600
エイチ・アイ・エス	15,200	6,010	91,352,000
東映	74,000	600	44,400,000
AOI Pro.	7,500	660	4,950,000
NTTデータ	124,300	4,060	504,658,000
共立メンテナンス	9,300	3,755	34,921,500
イチネンホールディングス	19,600	769	15,072,400
建設技術研究所	11,100	1,095	12,154,500
スペース	9,200	883	8,123,600
インファーマシーズ	9,700	4,680	45,396,000
燦ホールディングス	3,900	1,398	5,452,200
スバル興業	3,000	353	1,059,000
東京テアトル	72,000	155	11,160,000
よみうりランド	37,000	613	22,681,000
東京都競馬	144,000	346	49,824,000
常磐興産	60,000	148	8,880,000
カナモト	24,000	2,824	67,776,000
東京ドーム	138,000	618	85,284,000
D T S	16,800	1,968	33,062,400
スクウェア・エニックス・HD	64,100	2,370	151,917,000
シーイーシー	10,700	645	6,901,500
カプコン	45,000	2,041	91,845,000
西尾レントオール	10,100	3,070	31,007,000
アゴーラ・ホスピタリティーG	78,000	48	3,744,000
日本空港ビルデング	60,900	2,358	143,602,200
トランス・コスモス	24,400	2,267	55,314,800
乃村工藝社	36,700	817	29,983,900
ジャステック	11,500	746	8,579,000
S C S K	41,900	3,115	130,518,500
藤田観光	48,000	346	16,608,000
K N T - C Tホールディングス	60,000	188	11,280,000
日本管財	8,000	1,987	15,896,000
トーカイ	8,300	3,010	24,983,000
白洋舎	5,000	230	1,150,000
セコム	193,900	5,850	1,134,315,000
日本システムウエア	6,800	494	3,359,200

セントラル警備保障	8,500	991	8,423,500
アイネス	24,000	766	18,384,000
丹青社	23,400	484	11,325,600
メイテック	25,600	2,739	70,118,400
T K C	14,800	1,899	28,105,200
アサツー ディ・ケイ	32,700	2,273	74,327,100
富士ソフト	22,400	2,118	47,443,200
応用地質	17,800	1,567	27,892,600
船井総合研究所	19,500	794	15,483,000
N S D	37,500	1,361	51,037,500
進学会	8,100	399	3,231,900
丸紅建材リース	16,000	220	3,520,000
コナミ	79,500	2,591	205,984,500
ベネッセホールディングス	62,400	3,935	245,544,000
イオンデイライト	18,000	2,120	38,160,000
ナック	9,400	1,717	16,139,800
福井コンピュータH L D S	2,600	921	2,394,600
ニチイ学館	40,500	957	38,758,500
ダイセキ	27,600	1,813	50,038,800
ステップ	5,800	789	4,576,200
日鉄住金物産	116,000	404	46,864,000
元気寿司	5,500	1,645	9,047,500
トラスコ中山	20,200	2,438	49,247,600
ヤマダ電機	696,100	339	235,977,900
オートバックスセブン	61,800	1,602	99,003,600
アークランドサカモト	11,500	1,828	21,022,000
ニトリホールディングス	69,700	4,940	344,318,000
グルメ杵屋	13,000	752	9,776,000
愛眼	14,400	277	3,988,800
ケーユーホールディングス	3,700	1,274	4,713,800
吉野家ホールディングス	47,700	1,451	69,212,700
加藤産業	25,500	1,928	49,164,000
イノテック	16,400	464	7,609,600
イエローハット	15,200	1,958	29,761,600
富士エレクトロニクス	9,200	1,378	12,677,600
松屋フーズ	8,500	1,853	15,750,500
J B C Cホールディングス	14,800	763	11,292,400
J Kホールディングス	15,300	560	8,568,000
サガミチェーン	22,000	944	20,768,000
日伝	7,900	2,352	18,580,800
関西スーパーマーケット	13,300	812	10,799,600
ミロク情報サービス	12,000	411	4,932,000
北沢産業	11,000	185	2,035,000
杉本商事	9,500	969	9,205,500
因幡電機産業	24,100	3,280	79,048,000
王将フードサービス	8,700	3,305	28,753,500
プレナス	19,700	2,349	46,275,300
ミニストップ	13,100	1,637	21,444,700
アークス	30,000	1,977	59,310,000
パロ-	37,900	1,317	49,914,300

バイテック	6,200	807	5,003,400	
ミスミグループ本社	70,500	3,000	211,500,000	
江守商事	5,700	1,909	10,881,300	
アルテック	8,900	263	2,340,700	
ベルク	8,800	1,882	16,561,600	
大庄	8,300	1,276	10,590,800	
タキヒヨー	29,000	413	11,977,000	
ファーストリテイリング	41,100	36,530	1,501,383,000	
ソフトバンク	865,000	8,095	7,002,175,000	
スズケン	72,900	3,950	287,955,000	
サンドラッグ	37,200	4,255	158,286,000	
東京デリカ	8,900	1,384	12,317,600	
ジェコス	12,300	909	11,180,700	
ヤマザワ	4,200	1,585	6,657,000	
やまや	3,600	2,108	7,588,800	
ベルーナ	44,000	498	21,912,000	
合計	287,191,858		312,658,405,390	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,631,657,176	2,583,323,975
国債証券		346,588,387,200	351,275,841,100
地方債証券		30,151,679,544	28,762,321,767
特殊債券		33,325,384,069	29,885,012,244
社債券		29,828,276,580	27,524,696,780
未収利息		1,639,442,985	1,589,417,351
前払費用		86,551,626	35,039,973
流動資産合計		445,251,379,180	441,655,653,190
資産合計		445,251,379,180	441,655,653,190
負債の部			
流動負債			
未払金		1,676,929,000	-
未払解約金		105,723,000	114,210,000
流動負債合計		1,782,652,000	114,210,000
負債合計		1,782,652,000	114,210,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	379,645,534,947	369,629,287,107
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		63,823,192,233	71,912,156,083
元本等合計		443,468,727,180	441,541,443,190
純資産合計		443,468,727,180	441,541,443,190
負債純資産合計		445,251,379,180	441,655,653,190

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	356,921,096,490円	379,645,534,947円
同期中追加設定元本額	74,120,778,902円	68,533,693,970円
同期中一部解約元本額	51,396,340,445円	78,549,941,810円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	4,145,828,418円	6,124,799,820円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	9,639,969,262円	9,964,889,255円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	3,158,936,226円	3,689,890,795円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	4,988,855,432円	5,899,835,145円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,906,898,490円	2,441,051,268円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,215,755,390円	1,445,723,290円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,265,601,368円	1,576,398,413円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	179,823,015円	223,891,406円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	170,111,101円	155,827,199円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,078,574,212円	1,914,949,486円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	3,337,391円	3,450,420円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国1 0）	263,213円	65,611,552円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国2 0）	149,277円	32,831,575円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国3 0）	25,883円	9,744,053円
投資のソムリエ	12,291,403円	572,926,042円
クルーズコントロール	7,456,129円	41,067,151円
投資のソムリエ< D C年金>	- 円	2,528,769円
D I A M 8 資産バランスファンドN< D C年金>	- 円	4,868,709円

みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	6,676,001円	- 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)	15,864,480,682円	12,480,682,698円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	752,051,109円	729,182,367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)	12,421,255,809円	8,371,525,368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)	742,495,249円	550,031,413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)	505,225,510円	410,802,331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)	1,231,345,887円	883,135,350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)	529,504,408円	389,296,695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)	405,392,423円	344,472,009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)	30,901,107,819円	31,933,620,345円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,285,879,062円	10,587,775,823円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	13,458,738,263円	13,576,802,100円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,020,523,663円	5,159,581,547円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,843,207,878円	8,286,523,508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)	1,738,330,529円	1,453,753,657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)	6,280,241,353円	6,149,349,161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)	7,526,416,384円	6,772,700,939円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	14,184,635,152円	11,688,869,273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)	671,466,745円	508,585,424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)	13,840,784,053円	13,047,452,258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)	7,593,920,808円	8,305,551,020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)	1,529,921,775円	1,356,918,135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)	109,524,429,477円	107,438,352,199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)	2,519,540,024円	2,039,450,561円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	9,820,208,349円	9,556,849,896円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	33,693,034,005円	33,152,430,550円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	1,750,206,417円	167,899,806円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	201,859,633円	299,556,566円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	174,366円	122,282,533円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	36,807,246,878円	36,823,253,663円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	924,891,601円	896,638,916円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	204,949,674円	192,913,809円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	2,061,041,582円	1,752,178,041円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	353,788円	423,568円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	261,542円	300,391円
計	379,645,534,947円	369,629,287,107円
2. 受益権の総数	379,645,534,947口	369,629,287,107口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,277,509,300	165,657,200
地方債証券	46,780,285	2,858,895
特殊債券	30,744,184	1,961,920
社債券	27,127,320	4,941,220
合計	1,382,161,089	159,819,005

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.1681円	1.1946円
（1万口当たり純資産額）	(11,681円)	(11,946円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 2 6 回 利付国庫債券(2年)	3,500,000,000	3,500,910,000	
	3 2 7 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,280,000	
	3 2 8 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,000,900,000	
	3 2 9 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,502,415,000	
	3 3 0 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,440,000	
	3 3 1 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,720,000	
	3 3 2 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,380,000	
	3 3 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,800,000	
	3 3 4 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,001,260,000	
	3 3 5 回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,501,100,000	
	8 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,515,890,000	
	8 9 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,318,275,000	
	9 1 回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,412,144,000	
	9 2 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,014,000,000	
	9 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,526,880,000	
	9 5 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,010,680,000	
	9 6 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,218,964,000	
	9 7 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,036,300,000	
	9 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,023,760,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,017,100,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,514,350,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,526,730,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,512,600,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,013,250,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,508,610,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	2,994,540,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,018,750,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,515,720,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,521,700,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,023,520,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,502,375,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	684,696,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,141,100,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,484,912,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	1,400,000,000	1,521,660,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	528,430,000	
2 6 9 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,519,485,000		
2 7 0 回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,422,428,000		
2 7 2 回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	918,594,000		
2 7 4 回 利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,461,848,000		

277回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,578,300,000	
280回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,562,745,000	
282回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,540,352,000	
284回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,403,477,000	
285回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,460,941,000	
286回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,272,732,000	
288回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,112,060,000	
289回	利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	4,102,605,000	
290回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,050,830,000	
293回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,496,730,000	
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,242,720,000	
297回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,233,760,000	
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,274,809,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,636,028,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,453,157,000	
305回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,827,448,000	
306回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	4,069,230,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,918,584,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,106,900,000	
310回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,455,298,000	
312回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,393,344,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	4,054,182,000	
315回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,709,370,000	
317回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,105,060,000	
318回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,298,560,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,105,240,000	
320回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,089,300,000	
321回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,177,520,000	
324回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,081,630,000	
325回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,105,240,000	
326回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,065,760,000	
328回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,032,400,000	
329回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,115,200,000	
330回	利付国庫債券(10年)	4,700,000,000	4,802,366,000	
332回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,503,475,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,827,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	118,962,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	234,656,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,930,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	230,026,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	235,428,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	347,013,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	535,645,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	418,556,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	333,528,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	327,408,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	579,660,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	235,346,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	470,248,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	231,670,000	

18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	934,693,400	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	228,046,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	353,190,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	570,420,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	553,862,100	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	707,388,000	
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	707,700,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	685,068,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,161,150,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,064,088,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	947,280,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,515,436,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,720,110,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,352,700,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,839,792,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,956,078,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,695,555,000	
35回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,173,800,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,847,764,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	2,021,638,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,040,700,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	850,424,000	
40回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,039,090,000	
41回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	609,036,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	663,408,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	439,788,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	789,955,200	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	898,152,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	989,894,400	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,018,197,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	561,310,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,069,291,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	574,020,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	865,417,800	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	670,824,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	619,784,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	796,033,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	910,132,200	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,262,255,200	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	671,166,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,066,536,900	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	833,576,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,329,952,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	674,496,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,237,654,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,140,369,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,472,025,000	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,436,225,000	
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,356,373,900	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,611,904,000	

78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,640,080,500		
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,600,648,000		
83回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,848,384,000		
85回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,965,710,000		
88回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,770,975,000		
90回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,870,624,000		
92回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,968,226,000		
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	801,675,000		
94回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,273,569,000		
95回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,011,559,000		
97回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,872,896,000		
99回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,851,776,000		
100回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,339,040,000		
102回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,271,355,000		
105回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,078,082,000		
107回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,307,620,000		
109回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,136,360,000		
111回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,329,460,000		
113回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,527,580,000		
114回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,523,488,000		
116回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,899,025,000		
118回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,354,020,000		
119回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,427,803,000		
121回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,332,071,000		
123回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,505,008,000		
125回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,302,740,000		
128回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,102,690,000		
129回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,087,550,000		
130回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,386,252,000		
132回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,237,655,000		
134回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,294,368,000		
135回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,274,856,000		
137回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,330,130,000		
140回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,322,892,000		
141回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,315,500,000		
143回	利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,789,613,000		
145回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,615,975,000		
146回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,609,150,000		
147回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	511,935,000		
国債証券 合計		330,720,000,000	351,275,841,100		
地方債証券	622回	東京都公募公債	106,800,000	108,430,836	
	623回	東京都公募公債	200,000,000	203,132,000	
	627回	東京都公募公債	100,000,000	102,181,000	
	628回	東京都公募公債	100,000,000	102,656,000	
	629回	東京都公募公債	494,000,000	505,870,820	
	632回	東京都公募公債	115,300,000	119,759,804	
	633回	東京都公募公債	100,000,000	103,807,000	
	634回	東京都公募公債	200,000,000	208,034,000	
	638回	東京都公募公債	200,000,000	209,110,000	
	640回	東京都公募公債	150,000,000	156,969,000	

641回	東京都公募公債	100,000,000	104,730,000	
659回	東京都公募公債	203,500,000	216,001,005	
664回	東京都公募公債	300,000,000	317,022,000	
667回	東京都公募公債	300,000,000	320,439,000	
680回	東京都公募公債	200,000,000	213,482,000	
685回	東京都公募公債	500,000,000	526,115,000	
688回	東京都公募公債	200,000,000	208,034,000	
697回	東京都公募公債	500,000,000	524,840,000	
701回	東京都公募公債	700,000,000	728,189,000	
708回	東京都公募公債	500,000,000	515,360,000	
720回	東京都公募公債	300,000,000	307,281,000	
18年度4回	北海道公募公債	190,500,000	198,563,865	
18年度6回	北海道公募公債	100,000,000	104,788,000	
19年度4回	北海道公募公債	300,000,000	317,664,000	
21年度6回	北海道公募公債	200,000,000	214,136,000	
22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	211,652,000	
135回	神奈川県公募公債	200,000,000	204,934,000	
136回	神奈川県公募公債	100,000,000	102,531,000	
166回	神奈川県公募公債	300,000,000	318,456,000	
194回	神奈川県公募公債	300,000,000	305,694,000	
278回	大阪府公募公債	200,000,000	202,842,000	
285回	大阪府公募公債	100,000,000	102,426,000	
286回	大阪府公募公債	200,000,000	205,106,000	
289回	大阪府公募公債	200,000,000	207,036,000	
293回	大阪府公募公債	200,000,000	209,644,000	
301回	大阪府公募公債	100,000,000	105,158,000	
307回	大阪府公募公債	100,000,000	105,950,000	
310回	大阪府公募公債	240,000,000	253,092,000	
336回	大阪府公募公債	200,000,000	213,678,000	
345回	大阪府公募公債	300,000,000	317,154,000	
356回	大阪府公募公債	200,000,000	208,130,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	305,154,000	
374回	大阪府公募公債	300,000,000	307,533,000	
83回	大阪府公募公債 5年	300,000,000	301,083,000	
18年度1回	京都府公募公債	100,000,000	104,402,000	
17年度9回	兵庫県公募公債	306,000,000	313,766,280	
17年度13回	兵庫県公募公債	105,000,000	108,348,450	
18年度1回	兵庫県公募公債	120,000,000	124,249,200	
19年度2回	兵庫県公募公債	200,000,000	210,406,000	
18年度5回	静岡県公募公債	129,800,000	135,731,860	
21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	209,135,200	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	209,462,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	208,754,000	
18年度2回	愛知県公募公債	160,300,000	167,293,889	
20年度4回	愛知県公募公債	100,000,000	106,354,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	210,982,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	523,025,000	
25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	306,603,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	213,166,000	
17年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	202,944,000	

18年度1回	埼玉県公募公債	200,000,000	207,238,000	
21年度4回	埼玉県公募公債	440,000,000	468,855,200	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	210,986,000	
17年度5回	福岡県公募公債	100,000,000	102,644,000	
17年度1回	福岡県公募公債	100,000,000	101,914,000	
18年度1回	福岡県公募公債	104,000,000	109,137,600	
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	214,224,000	
19年度5回	千葉県公募公債	300,000,000	318,414,000	
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	212,888,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	304,284,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	203,946,000	
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	177,013,980	
28回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,318,000	
29回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,822,000	
31回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,546,000	
32回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,144,000	
33回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,079,000	
35回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,904,000	
36回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,065,000	
37回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,415,000	
38回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	177,131,500	
39回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	152,009,360	
40回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,120,500	
47回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	169,607,280	
54回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	421,944,000	
55回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,276,000	
57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,230,000	
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,911,000	
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,347,000	
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	537,110,000	
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	751,317,000	
94回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,909,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	737,324,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,328,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,765,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	720,958,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	806,816,753	
17年度3回	大阪市公募公債	100,000,000	101,621,000	
17年度7回	大阪市公募公債	200,000,000	203,952,000	
17年度8回	大阪市公募公債	200,000,000	204,808,000	
17年度11回	大阪市公募公債	100,000,000	102,872,000	
18年度2回	大阪市公募公債	100,000,000	104,229,000	
18年度3回	大阪市公募公債	150,000,000	156,966,000	
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	143,148,600	
12回ひ号	名古屋市公募公債	200,000,000	203,298,000	
12回せ号	名古屋市公募公債	359,500,000	366,794,255	
17年度1回	京都市公募公債	100,000,000	101,880,000	
18年度3回	京都市公募公債	101,700,000	107,008,740	
17年度13回	神戸市公募公債	103,000,000	105,979,790	
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	210,898,000	

	22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	212,138,000	
	23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	469,611,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	409,868,000	
	19年度7回 札幌市公募公債	300,000,000	315,666,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	108,266,000	
	21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	212,504,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	104,400,000	
地方債証券 合計		27,601,900,000	28,762,321,767	
特殊債券	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	126,676,110	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	209,332,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	211,882,000	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	419,220,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	317,055,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	422,776,000	
	48回 高速道路機構債	700,000,000	749,595,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	709,450,000	
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,073,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	215,263,730	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	111,351,240	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,574,000	
	16回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	314,725,600	
	17回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	127,776,700	
	18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	339,000,000	
	19回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,354,000	
	21回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	392,347,500	
	23回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,371,000	
	30回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,520,000	
	33回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	311,680,710	
	36回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	364,038,000	
	40回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	351,306,850	
	47回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,224,000	
	54回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	524,970,000	
	56回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,132,000	

6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	756,475,860	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,653,580	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	427,125,150	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	634,290,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	742,833,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,808,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,826,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,015,510,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	498,090,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	339,309,300	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	204,608,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	212,537,250	
8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	247,654,190	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,480,000	
8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,634,000	
8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	105,500,560	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	106,675,680	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	506,297,620	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	526,040,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	694,532,370	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,988,190	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,735,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,594,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	531,410,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,932,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,202,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,651,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,753,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	514,265,000	
1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	304,656,000	
1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,242,000	
2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	208,742,000	
2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	314,934,000	
1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	109,025,510	
1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	105,917,760	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	214,442,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,946,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	317,895,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	85,710,000	92,790,503	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	59,994,000	64,699,929	

9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	88,872,000	95,931,102	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	96,912,000	104,934,375	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	46,256,000	49,148,387	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	237,505,000	250,007,263	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,468,000	60,244,279	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,391,000	43,794,749	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	153,280,000	166,385,440	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	121,353,000	131,074,588	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	210,215,000	225,579,614	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	318,770,000	339,713,189	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	609,208,000	645,486,336	
7 2 3 号 利付商工債	300,000,000	301,524,000	
7 3 2 号 利付商工債	400,000,000	403,940,000	
7 3 6 号 利付商工債	300,000,000	302,202,000	
7 4 0 号 利付商工債	300,000,000	302,400,000	
7 3 7 号 利附農林債	300,000,000	302,430,000	
7 4 3 号 利附農林債	300,000,000	302,121,000	
7 5 3 号 利附農林債	300,000,000	299,883,000	
7 6 0 号 利附農林債	300,000,000	301,560,000	
2 5 3 回 利附信金中金債	300,000,000	302,436,000	
2 6 1 回 利附信金中金債	300,000,000	302,163,000	
2 7 5 回 利附信金中金債	400,000,000	401,396,000	
2 8 2 回 利附信金中金債	300,000,000	300,882,000	
1 5 6 号 利附商工債（3 年）	500,000,000	500,380,000	
1 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,624,990	
2 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,548,230	
8 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	177,860,800	
4 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	175,258,100	
1 0 回 政保中日本高速道路債券	215,000,000	224,797,550	
2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	319,221,000	
5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	214,200,000	
1 回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	206,223,990	
5 回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	271,564,090	
6 回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	122,831,280	
5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	508,870,000	
特殊債券 合計	28,661,934,000	29,885,012,244	
社債券			
1 2 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	101,593,000	
1 4 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	102,697,000	
2 回 J P モルガン・チェース劣後債	100,000,000	102,628,000	
1 2 回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	105,975,000	
1 6 回 シティグループ円貨社債	100,000,000	101,931,000	
7 回 ウエストパック銀行円貨社債	100,000,000	101,267,000	
2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	311,697,000	
7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	107,313,000	

3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	107,115,000	
41回 住友化学社債	100,000,000	106,578,000	
37回 三菱化学社債	100,000,000	107,598,000	
34回 三井化学社債	100,000,000	103,084,000	
11回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,360,000	
12回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,652,000	
24回 新日本石油社債	100,000,000	101,695,000	
29回 新日本製鐵社債	100,000,000	109,250,000	
64回 新日本製鐵社債	100,000,000	106,498,000	
15回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,407,000	
1回 日本電産社債	100,000,000	100,417,000	
10回 パナソニック社債	200,000,000	201,992,000	
11回 パナソニック社債	100,000,000	102,879,000	
17回 ソニー社債	100,000,000	101,428,000	
3回 パナソニック電工社債	100,000,000	101,850,000	
19回 三菱重工業社債	100,000,000	104,608,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,710,000	
49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	108,450,000	
58回 伊藤忠商事社債	100,000,000	100,868,000	
66回 伊藤忠商事社債	200,000,000	200,590,000	
77回 丸紅社債	100,000,000	100,774,000	
91回 丸紅社債	100,000,000	100,732,000	
30回 住友商事社債	100,000,000	102,932,000	
69回 三菱商事社債	300,000,000	321,249,000	
77回 三菱商事社債	150,000,000	151,417,500	
7回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	318,615,000	
24回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,438,000	
25回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	303,462,000	
27回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	302,334,000	
29回 みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	503,460,000	
31回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	300,732,000	
32回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	199,982,000	
7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	110,660,000	
126回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,739,000	
134回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,157,000	
140回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,297,000	
7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	219,562,000	
8回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,042,000	
11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,836,000	
12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,772,000	
25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,382,000	
28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,728,000	
4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	111,902,000	
6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,192,000	
7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	213,412,000	
9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,469,000	
10回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	212,790,000	
5回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,075,000	

7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	104,972,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,195,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	101,358,000	
50回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,956,000	
51回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,624,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,554,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,786,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,255,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,806,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,972,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	219,040,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,740,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	214,066,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,192,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,641,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	218,414,000	
19回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	214,706,000	
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	200,954,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,744,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,739,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,674,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,025,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	217,822,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	103,822,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	313,722,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	104,365,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	205,618,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,533,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,120,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,732,000	
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,765,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	101,086,000	
22回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,748,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	305,331,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,977,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	102,625,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	213,678,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	209,630,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	105,733,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	214,078,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,162,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	107,003,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	104,973,000	
3回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,132,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,764,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	343,695,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,218,000	
41回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,188,000	

5 2 回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,133,000	
5 6 回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	320,547,000	
3 回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	218,424,000	
1 0 回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	337,707,000	
2 回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	216,350,000	
5 回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,318,000	
6 回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,444,000	
1 0 回 東海旅客鉄道社債	190,000,000	198,181,400	
2 3 回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,895,000	
3 回 東京地下鉄社債	100,000,000	104,421,000	
5 回 K D D I 社債	100,000,000	109,334,000	
5 0 回 日本電信電話社債	100,000,000	102,195,000	
5 1 回 日本電信電話社債	200,000,000	208,716,000	
5 4 回 日本電信電話社債	200,000,000	212,758,000	
6 0 回 日本電信電話社債	300,000,000	317,991,000	
1 5 回 N T T ドコモ社債	200,000,000	214,584,000	
4 5 5 回 東京電力社債	200,000,000	188,132,000	
5 1 9 回 東京電力社債	372,000,000	363,458,880	
5 4 2 回 東京電力社債	500,000,000	465,435,000	
4 0 7 回 中部電力社債	100,000,000	104,442,000	
4 0 9 回 中部電力社債	300,000,000	325,323,000	
4 7 1 回 中部電力社債	300,000,000	304,233,000	
4 7 6 回 中部電力社債	100,000,000	107,501,000	
4 7 8 回 中部電力社債	100,000,000	104,183,000	
4 8 0 回 中部電力社債	200,000,000	208,856,000	
4 9 6 回 中部電力社債	500,000,000	522,680,000	
4 1 0 回 関西電力社債	300,000,000	318,840,000	
4 4 6 回 関西電力社債	200,000,000	205,694,000	
2 9 8 回 中国電力社債	200,000,000	209,562,000	
3 1 0 回 中国電力社債	200,000,000	219,754,000	
2 4 5 回 北陸電力社債	200,000,000	209,390,000	
2 6 0 回 北陸電力社債	100,000,000	111,269,000	
2 8 1 回 北陸電力社債	200,000,000	213,246,000	
3 7 5 回 東北電力社債	100,000,000	104,507,000	
3 8 0 回 東北電力社債	300,000,000	326,490,000	
4 2 7 回 東北電力社債	200,000,000	203,570,000	
4 3 2 回 東北電力社債	500,000,000	519,830,000	
2 3 7 回 四国電力社債	100,000,000	107,625,000	
3 8 7 回 九州電力社債	200,000,000	205,756,000	
2 5 7 回 北海道電力社債	200,000,000	215,200,000	
2 8 4 回 北海道電力社債	500,000,000	511,675,000	
1 4 回 電源開発社債	100,000,000	102,021,000	
1 7 回 電源開発社債	100,000,000	104,166,000	
1 7 回 東京ガス社債	100,000,000	110,175,000	
9 回 大阪ガス社債	100,000,000	110,462,000	
2 7 回 N T T データ社債	100,000,000	102,017,000	
社債券 合計	26,412,000,000	27,524,696,780	
合計	413,395,834,000	437,447,871,891	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		180,835,188	7,238,506,876
コール・ローン		109,284,920	95,423,713
株式		302,952,441,693	301,789,773,803
投資信託受益証券		1,224,748,076	872,653,837
投資証券		5,964,521,099	5,370,362,315
派生商品評価勘定		11,034,503	187,898,027
未収入金		5,314,208,035	-
未収配当金		611,418,215	823,647,139
差入委託証拠金		933,375,797	1,697,116,653
流動資産合計		317,301,867,526	318,075,382,363
資産合計		317,301,867,526	318,075,382,363
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,141,963	262,500
未払解約金		375,725,000	501,256,000
流動負債合計		387,866,963	501,518,500
負債合計		387,866,963	501,518,500
純資産の部			
元本等			
元本	1	182,478,399,692	137,116,704,251
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		134,435,600,871	180,457,159,612
元本等合計		316,914,000,563	317,573,863,863
純資産合計		316,914,000,563	317,573,863,863
負債純資産合計		317,301,867,526	318,075,382,363

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	214,623,769,712円	182,478,399,692円
同期中追加設定元本額	22,230,872,049円	14,598,144,822円
同期中一部解約元本額	54,376,242,069円	59,959,840,263円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,033,626,226円	1,157,227,895円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C 年金 >	34,650,796,949円	33,333,122,557円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型	186,485,879円	146,968,029円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型	1,035,780,437円	869,514,428円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型	1,293,270,382円	1,108,459,293円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	183,157,906円	147,409,276円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	514,180,903円	416,887,340円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	363,777,936円	335,873,826円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	64,869,948円	77,685,053円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	794,474,293円	952,637,609円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	166,833,422円	176,632,962円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国 1 0)	32,899円	6,128,891円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国 2 0)	52,191円	8,519,657円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国 3 0)	73,425円	20,501,667円
投資のソムリエ	914,737円	89,302,448円
クルーズコントロール	2,142,314円	8,482,513円
投資のソムリエ< D C 年金 >	- 円	398,539円
D I A M 8 資産バランスマ ファンドN< D C 年金 >	- 円	454,098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)	518,540,900円	445,997,136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)	5,415,663,534円	4,220,261,501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)	12,067,505,592円	- 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)	67,422,383円	50,901,162円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	7,131,166,790円	3,735,475,008円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50V A (適格機関投 資家限定)	1,279,601,641円	737,284,160円
D I A M国際分散バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	148,973,352円	94,323,154円
D I A M国際分散バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	848,083,750円	467,749,117円
D I A M国内重視バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	72,819,536円	41,625,205円
D I A M国内重視バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	139,501,195円	92,263,536円
D I A M世界バランスファンド 40V A (適格機関投資家限 定)	14,152,406,070円	11,371,122,917円
D I A M世界バランスファンド 50V A (適格機関投資家限 定)	7,076,705,349円	5,671,731,149円
D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	2,313,765,277円	1,813,277,510円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A (適格機関投資家限 定)	2,007,549,943円	1,607,532,960円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	5,383,375,061円	4,422,388,362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)	3,957,815,964円	2,618,996,253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)	5,145,895,619円	3,998,591,953円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	3,422,138,696円	2,375,814,024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)	3,249,114,848円	2,069,110,615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)	44,735,562円	27,678,338円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	14,180,871,174円	10,587,917,377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)	2,684,947,952円	2,237,421,615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)	106,032,833円	72,249,171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)	18,842,370,210円	14,346,736,140円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	1,728,047,572円	1,085,199,207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)	3,373,511,051円	2,555,117,327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)	11,570,881,537円	8,859,175,681円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	- 円	56,611,889円
D I A Mバランス50VA(適 格機関投資家限定)	108,813,620円	257,732,938円
D I A Mバランス70VA(適 格機関投資家限定)	241,095円	240,880,538円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資 家限定)	15,149,218,267円	11,814,829,536円
D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	- 円	284,017,847円
D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	69,454円	194,209円
D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	144,018円	290,635円
計	182,478,399,692円	137,116,704,251円
2 . 受益権の総数	182,478,399,692口	137,116,704,251口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	647,094,827	2,845,156,038
投資信託受益証券	10,076,622	14,535,066
投資証券	14,134,385	40,878,558
合計	622,883,820	2,900,569,662

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成25年2月16日から平成25年2月25日まで及び平成26年2月18日から平成26年2月25日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成25年2月25日 現在				平成26年2月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	477,245,753	-	479,326,800	2,081,047	5,236,927,180	-	5,236,634,000	293,180
アメリカ・ドル	243,369,180	-	244,582,000	1,212,820	3,138,079,860	-	3,137,724,000	355,860
イギリス・ポンド	28,446,200	-	28,466,000	19,800	546,447,450	-	546,496,000	48,550
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	222,176,400	-	222,290,000	113,600
カナダ・ドル	110,296,100	-	110,352,000	55,900	231,588,000	-	231,650,000	62,000
スイス・フラン	9,020,763	-	9,091,800	71,037	-	-	-	-
ユーロ	86,113,510	-	86,835,000	721,490	1,098,635,470	-	1,098,474,000	161,470
合計	477,245,753	-	479,326,800	2,081,047	5,236,927,180	-	5,236,634,000	293,180

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成25年2月25日 現在				平成26年2月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	6,240,161,287	-	6,241,134,874	973,587	4,084,177,311	-	4,271,519,658	187,342,347
合計	6,240,161,287	-	6,241,134,874	973,587	4,084,177,311	-	4,271,519,658	187,342,347

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.7367円	2.3161円
(1万口当たり純資産額)	(17,367円)	(23,161円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年2月25日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	VERIZON COMMUNICATIONS INC	129,959	46.760	6,076,882.840	
	AMAZON.COM INC	37,169	351.780	13,075,310.820	
	ABBOTT LABORATORIES	157,441	38.980	6,137,050.180	
	AES CORP	75,129	14.270	1,072,090.830	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	106,042	183.450	19,453,404.900	
	ADOBE SYSTEMS INC	47,588	68.765	3,272,388.820	
	ACE LTD	35,827	96.790	3,467,695.330	
	AGCO CORP	11,661	51.690	602,757.090	
	AIRGAS INC	6,292	104.720	658,898.240	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,869	118.730	2,477,776.370	
	ENERGEN CORP	8,985	80.660	724,730.100	
	ALLEGHANY CORP	1,956	379.500	742,302.000	
	ALLERGAN INC	30,222	124.500	3,762,639.000	
	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	93,314	64.580	6,026,218.120	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	159.270	842,538.300	
	ALLSTATE CORP	48,737	53.860	2,624,974.820	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	77,010	93.760	7,220,457.600	
	ALTERA CORPORATION	28,796	35.910	1,034,064.360	
	ALCOA INC	102,779	11.770	1,209,708.830	
	AMGEN INC	76,489	125.790	9,621,551.310	
	HESS CORP	30,613	81.450	2,493,428.850	
	BEAM INC	14,795	83.220	1,231,239.900	
	AMERICAN EXPRESS CO	98,830	89.920	8,886,793.600	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	48,454	50.070	2,426,091.780	
	AFLAC INC	47,249	62.300	2,943,612.700	
	AMERICAN INTL GROUP	144,852	49.450	7,162,931.400	
	ANALOG DEVICES	32,150	50.960	1,638,364.000	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	51,454	83.390	4,290,749.060	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,920	183.550	3,656,316.000	
	NABORS INDUSTRIES LTD	36,022	22.180	798,967.960	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	50,231	42.550	2,137,329.050	
	TIME WARNER	95,165	65.010	6,186,676.650	
	VALERO ENERGY CORP	56,486	50.920	2,876,267.120	
	APACHE CORP	40,751	84.330	3,436,531.830	
ANSYS INC	9,305	84.070	782,271.350		
APPLE INC	92,754	527.550	48,932,372.700		
APPLIED MATERIALS INC	128,032	19.070	2,441,570.240		

ALBEMARLE CORP	7,690	63.840	490,929.600	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65,752	40.160	2,640,600.320	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	13,584	54.440	739,512.960	
AMEREN CORP	25,297	40.900	1,034,647.300	
ARROW ELECTRONICS INC	11,621	56.020	651,008.420	
ASHLAND INC	6,333	94.160	596,315.280	
AUTOLIV INC	10,829	95.560	1,034,819.240	
AUTODESK INC	20,701	54.470	1,127,583.470	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	48,043	76.800	3,689,702.400	
AUTOZONE INC	3,337	542.210	1,809,354.770	
AVERY DENNISON CORP	8,865	48.790	432,523.350	
AVNET INC	15,099	42.830	646,690.170	
AVON PRODUCTS INC	41,317	15.300	632,150.100	
BAKER HUGHES INC	44,146	63.080	2,784,729.680	
BALL CORP	12,188	54.880	668,877.440	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	112,890	113.200	12,779,148.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	115,464	31.800	3,671,755.200	
CR BARD INC	6,949	142.440	989,815.560	
BAXTER INTERNATIONAL INC	55,596	69.480	3,862,810.080	
BED BATH & BEYOND INC	20,557	65.990	1,356,556.430	
BECTON DICKINSON & CO	19,000	115.000	2,185,000.000	
AMETEK INC	25,338	52.860	1,339,366.680	
BE AEROSPACE INC	10,265	83.510	857,230.150	
VERIZON COMM INC	291,965	46.230	13,497,541.950	
WR BERKLEY CORP	11,053	40.610	448,862.330	
BEST BUY CO INC	26,686	25.170	671,686.620	
YUM! BRANDS INC	46,751	72.970	3,411,420.470	
FIRSTENERGY CORP	45,992	31.700	1,457,946.400	
SLM CORP	49,666	23.960	1,189,997.360	
H&R BLOCK INC	26,590	31.550	838,914.500	
ENSCO PLC-CL A	22,819	53.290	1,216,024.510	
BOEING CO	72,809	129.590	9,435,318.310	
ROBERT HALF INTL INC	14,807	40.240	595,833.680	
BORGWARNER INC	20,836	61.300	1,277,246.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131,498	13.080	1,719,993.840	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,632	53.340	940,490.880	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,922	245.890	718,490.580	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	167,571	54.310	9,100,781.010	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,422	190.010	1,030,234.220	
ONEOK INC	20,139	61.230	1,233,110.970	
SEMPRA ENERGY	22,909	92.570	2,120,686.130	
FEDEX CORP	31,403	134.870	4,235,322.610	
VERISIGN INC	16,877	54.720	923,509.440	

AMPHENOL CORP	15,769	88.910	1,402,021.790	
BROWN-FORMAN CORP	14,456	83.110	1,201,438.160	
QUANTA SERVICES INC	25,480	34.780	886,194.400	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18,492	38.790	717,304.680	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	345,664	3.590	1,240,933.760	
CSX CORP	105,721	27.690	2,927,414.490	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	20,538	16.410	337,028.580	
CABOT OIL & GAS CORP	46,124	35.650	1,644,320.600	
CAMPBELL SOUP CO	22,764	44.190	1,005,941.160	
SEAGATE TECHNOLOGY	32,204	51.160	1,647,556.640	
WHITING PETROLEUM CORP	13,133	64.340	844,977.220	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,362	81.080	1,326,630.960	
CARDINAL HEALTH INC	33,720	71.770	2,420,084.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	37,957	39.690	1,506,513.330	
CATERPILLAR INC	65,969	97.320	6,420,103.080	
CELGENE CORP	42,543	164.090	6,980,880.870	
CORE LABORATORIES N.V.	4,891	191.470	936,479.770	
CITRIX SYSTEMS INC	19,857	59.610	1,183,675.770	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,295	27.290	1,590,870.550	
CENTURYLINK INC	63,731	31.190	1,987,769.890	
CERNER CORP	33,863	62.450	2,114,744.350	
JPMORGAN CHASE & CO	383,778	58.030	22,270,637.340	
CHUBB CORP	26,934	86.560	2,331,407.040	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,581	67.440	848,462.640	
CIGNA CORP	29,425	79.190	2,330,165.750	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,516	46.650	770,471.400	
CINTAS CORP	8,876	59.520	528,299.520	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	134,501	4.590	617,359.590	
CISCO SYSTEMS INC	543,117	22.120	12,013,748.040	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	9,607	80.300	771,442.100	
CLOROX COMPANY	15,155	87.060	1,319,394.300	
EQUINIX INC	5,159	189.790	979,126.610	
COCA-COLA CO/THE	406,611	37.500	15,247,912.500	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	24,325	47.250	1,149,356.250	
COLGATE-PALMOLIVE CO	94,230	61.950	5,837,548.500	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	21,321	53.470	1,140,033.870	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	48,067	49.410	2,374,990.470	
COMERICA INC	18,671	47.540	887,619.340	
NRG ENERGY, INC.	33,814	28.880	976,548.320	
COMCAST CORP-CL A	217,413	51.150	11,120,674.950	
CA INC	30,767	32.670	1,005,157.890	
COMPUTER SCIENCES CORP	16,463	63.400	1,043,754.200	

CONAGRA FOODS INC	45,240	28.540	1,291,149.600	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,579	55.750	1,593,279.250	
CMS ENERGY CORP	20,017	28.340	567,281.780	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	26,380	62.660	1,652,970.800	
MOLSON COORS BREWING CO	17,190	57.270	984,471.300	
CORNING INC	155,504	19.310	3,002,782.240	
DIRECTV	54,604	75.120	4,101,852.480	
CREE INC	13,242	61.060	808,556.520	
SEALED AIR CORP	20,323	32.840	667,407.320	
BROADCOM CORP-CL A	55,671	30.740	1,711,326.540	
CUMMINS INC	18,380	146.010	2,683,663.800	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	8,350	116.300	971,105.000	
DR HORTON INC	34,671	23.710	822,049.410	
DANAHER CORP	59,746	76.560	4,574,153.760	
MOODY'S CORP	19,691	78.760	1,550,863.160	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	30,639	104.240	3,193,809.360	
TARGET CORP	63,175	56.140	3,546,644.500	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	48.350	322,397.800	
DEERE & CO	37,524	84.800	3,182,035.200	
MORGAN STANLEY	147,597	30.310	4,473,665.070	
REPUBLIC SERVICES INC	29,354	33.760	990,991.040	
THE WALT DISNEY CO	172,342	80.730	13,913,169.660	
DOLLAR TREE INC	24,068	52.330	1,259,478.440	
DOVER CORP	18,750	89.470	1,677,562.500	
DOW CHEMICAL	121,961	46.950	5,726,068.950	
OMNICOM GROUP	27,703	75.850	2,101,272.550	
DTE ENERGY CO	19,035	71.860	1,367,855.100	
XL GROUP PLC	26,332	29.730	782,850.360	
DUKE ENERGY CORP	71,547	71.110	5,087,707.170	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	32,561	74.720	2,432,957.920	
FLOWSERVE CORP	12,469	81.500	1,016,223.500	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,828	51.010	705,366.280	
EBAY INC	119,842	56.300	6,747,104.600	
EMC CORP/MASS	210,363	25.690	5,404,225.470	
BANK OF AMERICA CORP	1,093,077	16.530	18,068,562.810	
CITIGROUP INC	308,990	48.980	15,134,330.200	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,731	84.090	1,406,909.790	
EATON CORP PLC	48,113	74.980	3,607,512.740	
EATON VANCE CORP	12,917	37.120	479,479.040	
DISH NETWORK CORP	23,833	57.370	1,367,299.210	
ECOLAB INC	27,290	102.390	2,794,223.100	
ELECTRONIC ARTS INC	35,610	27.960	995,655.600	
SALESFORCE.COM INC	59,007	63.910	3,771,137.370	
EMERSON ELECTRIC CO	72,168	64.320	4,641,845.760	
WEATHERFORD INTL LTD	73,546	15.600	1,147,317.600	

ENERGY CORP	16,359	64.120	1,048,939.080	
EOG RESOURCES INC	27,383	180.400	4,939,893.200	
EQUIFAX INC	11,487	69.830	802,137.210	
EQT CORP	14,624	101.790	1,488,576.960	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	23,912	67.900	1,623,624.800	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,066	42.010	842,972.660	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	82,264	74.350	6,116,328.400	
EXXON MOBIL CORP	449,640	96.440	43,363,281.600	
FMC CORP	12,155	72.320	879,049.600	
NEXTERA ENERGY INC	42,705	91.780	3,919,464.900	
FAMILY DOLLAR STORES	10,460	66.160	692,033.600	
ASSURANT INC	8,352	64.100	535,363.200	
FASTENAL CO	30,809	46.000	1,417,214.000	
FIFTH THIRD BANCORP	87,505	21.610	1,890,983.050	
M&T BANK CORP	11,528	114.900	1,324,567.200	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	11,007	82.870	912,150.090	
FISERV INC	26,258	57.560	1,511,410.480	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	33.000	475,926.000	
MACY'S INC	40,826	53.060	2,166,227.560	
FORD MOTOR CO	371,524	15.180	5,639,734.320	
FOREST LABORATORIES INC	24,901	98.250	2,446,523.250	
FOSSIL GROUP INC	5,086	119.440	607,471.840	
FRANKLIN RESOURCES INC	39,798	53.520	2,129,988.960	
FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	105,847	33.210	3,515,178.870	
FLEXTRONICS INTL LTD	74,709	9.420	703,758.780	
GAP INC/THE	34,421	42.920	1,477,349.320	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	15,658	45.110	706,332.380	
GENERAL DYNAMICS CORP	29,851	108.760	3,246,594.760	
GENERAL MILLS INC	65,106	49.850	3,245,534.100	
GENUINE PARTS CO	14,679	87.120	1,278,834.480	
GILEAD SCIENCES INC	155,525	83.570	12,997,224.250	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	17,970	81.390	1,462,578.300	
MCKESSON CORP	23,752	176.320	4,187,952.640	
NVIDIA CORP	51,123	18.880	965,202.240	
GENERAL ELECTRIC CO	1,039,570	25.290	26,290,725.300	
WW GRAINGER INC	5,965	251.610	1,500,853.650	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	12,666	121.490	1,538,792.340	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	15.300	340,210.800	
HALLIBURTON CO	88,400	56.370	4,983,108.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,686	74.520	1,243,440.720	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	43,162	166.540	7,188,199.480	
HARLEY-DAVIDSON INC	21,132	64.780	1,368,930.960	
HARRIS CORP	10,776	72.670	783,091.920	
CONSOL ENERGY INC	22,051	40.300	888,655.300	

HASBRO INC	11,176	54.480	608,868.480	
HENRY SCHEIN INC	7,142	119.580	854,040.360	
DENBURY RESOURCES INC	28,517	16.250	463,401.250	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	96.400	957,155.600	
HERSHEY FOODS CORP	16,263	108.070	1,757,542.410	
HEWLETT-PACKARD CO	197,600	29.920	5,912,192.000	
F5 NETWORKS INC	7,198	111.910	805,528.180	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	44.350	572,957.650	
REYNOLDS AMERICAN INC	32,398	49.050	1,589,121.900	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	14,788	95.900	1,418,169.200	
JUNIPER NETWORKS INC	48,236	27.580	1,330,348.880	
HOLLYFRONTIER CORP	19,247	47.390	912,115.330	
HOLOGIC INC	24,876	21.720	540,306.720	
UNUM GROUP	30,372	33.900	1,029,610.800	
HOME DEPOT INC	147,644	77.870	11,497,038.280	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,878	82.070	1,138,967.460	
HORMEL FOODS CORP	14,878	46.950	698,522.100	
HUDSON CITY BANCORP INC	61,279	9.340	572,345.860	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,422	24.380	1,058,628.360	
HUMANA INC	15,524	113.690	1,764,923.560	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,635	71.650	690,347.750	
RED HAT INC	20,247	58.890	1,192,345.830	
BIOGEN IDEC INC	24,030	345.630	8,305,488.900	
ILLINOIS TOOL WORKS	42,995	81.740	3,514,411.300	
INTUIT INC	27,600	77.410	2,136,516.000	
INGERSOLL-RAND PLC	28,100	59.970	1,685,157.000	
INTEL CORP	506,921	24.630	12,485,464.230	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,998	91.440	914,217.120	
INTL GAME TECH	20,749	14.900	309,160.100	
INTERNATIONAL PAPER CO	43,061	48.890	2,105,252.290	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	17.170	633,092.240	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,497	60.030	870,254.910	
JOHNSON & JOHNSON	287,687	91.110	26,211,162.570	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	41,564	34.640	1,439,776.960	
JOHNSON CONTROLS INC	69,702	49.720	3,465,583.440	
KLA-TENCOR CORP	16,662	65.350	1,088,861.700	
DEVON ENERGY CORP	38,601	64.370	2,484,746.370	
KELLOGG CO	28,361	60.710	1,721,796.310	
KEYCORP	86,740	12.970	1,125,017.800	
KIMBERLY-CLARK CORP	38,888	110.160	4,283,902.080	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,098	302.590	4,265,913.820	
KOHL'S CORP	23,092	51.950	1,199,629.400	
KROGER CO	48,049	39.780	1,911,389.220	

LSI CORP	55,560	11.100	616,716.000	
LAM RESEARCH CORP	14,133	52.620	743,678.460	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,064	62.640	1,068,888.960	
LEGG MASON INC	13,165	44.920	591,371.800	
LEGGETT & PLATT INC	8,522	31.360	267,249.920	
LENNAR CORP	18,341	41.820	767,020.620	
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,049	27.970	1,008,290.530	
ELI LILLY & CO	102,969	58.030	5,975,291.070	
L BRANDS INC	26,970	53.780	1,450,446.600	
LINCOLN NATIONAL CORP	28,925	50.770	1,468,522.250	
LINEAR TECH CORP	23,086	46.260	1,067,958.360	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	73,308	95.950	7,033,902.600	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34,061	56.750	1,932,961.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,544	166.140	4,576,160.160	
LOEWS CORP	33,738	43.580	1,470,302.040	
RANGE RESOURCES CORP	17,434	87.530	1,525,998.020	
LOWE'S COS INC	106,220	47.220	5,015,708.400	
DOMINION RESOURCES INC/VA	60,588	71.290	4,319,318.520	
IRON MOUNTAIN INC	12,968	28.620	371,144.160	
SCANA CORP	9,574	49.350	472,476.900	
MDU RESOURCES GROUP INC	21,313	34.780	741,266.140	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,258	27.840	1,148,622.720	
MCCORMICK & CO INC	14,416	66.250	955,060.000	
MCDONALD'S CORPORATION	102,385	96.500	9,880,152.500	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	26,382	80.150	2,114,517.300	
EVEREST RE GROUP LTD	5,049	146.730	740,839.770	
MANPOWERGROUP INC	7,953	74.240	590,430.720	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	12,156	68.900	837,548.400	
MARSH & MCLENNAN COS	56,000	48.070	2,691,920.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,466	95.510	713,077.660	
MASCO CORP	37,719	22.270	840,002.130	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	116.710	595,454.420	
MATTEL INC	37,311	35.960	1,341,703.560	
METLIFE INC	93,799	50.870	4,771,555.130	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	34,242	31.740	1,086,841.080	
MEDTRONIC INC	103,783	57.600	5,977,900.800	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,156	19.690	1,066,331.640	
CVS CAREMARK CORP	127,599	71.370	9,106,740.630	
MERCK & CO. INC.	298,696	56.180	16,780,741.280	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,600	93.760	993,856.000	
MICROSOFT CORP	807,386	37.690	30,430,378.340	
MICRON TECH INC	103,537	24.750	2,562,540.750	
RACKSPACE HOSTING INC	13,630	34.550	470,916.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,985	45.270	859,450.950	

MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	50,668	15.420	781,300.560	
3M CO	66,174	132.200	8,748,202.800	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,039	139.240	980,110.360	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,610	64.960	1,598,665.600	
KANSAS CITY SOUTHERN	10,506	94.600	993,867.600	
MURPHY OIL CORPORATION	17,184	59.130	1,016,089.920	
MYLAN LABORATORIES	37,298	51.050	1,904,062.900	
ILLUMINA INC	13,717	178.530	2,448,896.010	
XCEL ENERGY INC	48,810	29.980	1,463,323.800	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	45,346	75.940	3,443,575.240	
NETAPP INC	33,354	40.090	1,337,161.860	
SEARS HOLDINGS CORP	4,862	38.050	184,999.100	
NEWELL RUBBERMAID INC	29,362	32.070	941,639.340	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	99.720	366,670.440	
NEWMONT MINING CORP	49,529	23.670	1,172,351.430	
NIKE INC-CL B	72,273	77.840	5,625,730.320	
NOBLE ENERGY INC	35,626	69.330	2,469,950.580	
NORDSTROM INC	13,411	58.610	786,018.710	
NORFOLK SOUTHERN CORP	32,257	91.270	2,944,096.390	
NORTHEAST UTILITIES	34,447	44.410	1,529,791.270	
NISOURCE INC	33,928	35.440	1,202,408.320	
COACH INC	30,955	47.950	1,484,292.250	
TOWERS WATSON & COMPANY	6,639	110.930	736,464.270	
NORTHERN TRUST CORP	22,009	62.450	1,374,462.050	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,819	122.120	2,664,536.280	
WELLS FARGO & CO	515,521	46.080	23,755,207.680	
NUCOR CORP	35,421	49.700	1,760,423.700	
MONSANTO CO	54,120	108.970	5,897,456.400	
CHENIERE ENERGY INC	23,885	50.000	1,194,250.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	61,482	71.730	4,410,103.860	
OCWEN FINANCIAL CORP	12,196	39.000	475,644.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	82,883	96.070	7,962,569.810	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	70.440	639,665.640	
OGE ENERGY CORP	22,050	35.970	793,138.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,078	153.870	1,858,441.860	
OMNICARE INC	12,226	59.910	732,459.660	
ORACLE CORP	353,534	38.140	13,483,786.760	
OWENS-ILLINOIS INC	19,173	33.970	651,306.810	
PACCAR INC	34,453	64.190	2,211,538.070	
PALL CORP	10,048	86.000	864,128.000	
EXELON CORP	85,567	30.390	2,600,381.130	
PARKER HANNIFIN CORP	16,001	118.640	1,898,358.640	
PARTNERRE LTD	3,890	99.610	387,482.900	
PATTERSON COS INC	4,032	40.820	164,586.240	
PAYCHEX INC	32,595	41.530	1,353,670.350	

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,943	42.960	598,991.280	
PPL CORPORATION	64,994	31.810	2,067,459.140	
PEPSICO INC	157,377	78.880	12,413,897.760	
PENTAIR LTD	19,696	79.520	1,566,225.920	
PFIZER INC	676,001	31.990	21,625,271.990	
CONOCOPHILLIPS	118,436	66.420	7,866,519.120	
PVH CORP	7,894	123.180	972,382.920	
PETSMART INC	8,567	63.790	546,488.930	
PG&E CORP	44,930	44.020	1,977,818.600	
PHARMACYCLICS INC	5,559	151.480	842,077.320	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,788	194.740	2,879,815.120	
ALTRIA GROUP INC	208,659	35.380	7,382,355.420	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	56,300	81.340	4,579,442.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	6,387	130.550	833,822.850	
GARMIN LTD	13,579	51.700	702,034.300	
AETNA INC	38,540	71.800	2,767,172.000	
FLUOR CORP (NEW)	17,508	78.930	1,381,906.440	
PPG INDUSTRIES INC	14,182	188.520	2,673,590.640	
PRAXAIR INC	30,530	127.150	3,881,889.500	
PRECISION CASTPARTS CORP	15,193	257.080	3,905,816.440	
COSTCO WHOLESALE CORP	45,160	113.940	5,145,530.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,682	80.860	2,238,366.520	
QUEST DIAGNOSTICS	14,594	53.810	785,303.140	
PROCTER & GAMBLE CO	279,844	77.860	21,788,653.840	
PROGRESSIVE CORP	63,937	23.760	1,519,143.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,488	36.730	1,817,694.240	
PULTE GROUP INC	40,688	20.420	830,848.960	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	47,010	15.930	748,869.300	
QUALCOMM INC	174,034	75.430	13,127,384.620	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	53.110	550,963.140	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,570	94.810	528,091.700	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,865	347.620	2,734,031.300	
RESMED INC	16,867	46.270	780,436.090	
US BANCORP	187,987	40.800	7,669,869.600	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,613	55.230	807,075.990	
ROSS STORES INC	21,400	69.270	1,482,378.000	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,374	109.140	913,938.360	
ROPER INDUSTRIES INC	9,399	135.310	1,271,778.690	
ROWAN COMPANIES PLC-A	13,327	32.940	438,991.380	
PEABODY ENERGY CORP	33,467	17.110	572,620.370	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,791	120.560	1,783,202.960	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,326	52.530	857,604.780	

RAYTHEON COMPANY	33,183	98.220	3,259,234.260	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,822	70.650	835,224.300	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	286.300	1,311,254.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	22,653	50.660	1,147,600.980	
ACCENTURE PLC-CL A	65,120	83.950	5,466,824.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	170,829	34.400	5,876,517.600	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	18,347	42.190	774,059.930	
SANDISK CORP	24,773	75.810	1,878,041.130	
SAFEWAY INC	23,620	37.030	874,648.600	
ROCKWELL COLLINS INC	13,494	82.820	1,117,573.080	
ST JUDE MEDICAL INC	30,560	67.720	2,069,523.200	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	39,444	83.440	3,291,207.360	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,320	54.900	1,609,668.000	
PRICELINE.COM INC	5,196	1,313.670	6,825,829.320	
SCHLUMBERGER LTD	134,571	92.720	12,477,423.120	
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,670	26.530	3,121,785.100	
JOY GLOBAL INC	12,702	57.440	729,602.880	
ZIMMER HOLDINGS INC	17,978	95.590	1,718,517.020	
SPX CORP	3,361	106.910	359,324.510	
BUNGE LTD	13,535	79.880	1,081,175.800	
SEI INVESTMENTS CO	15,882	34.310	544,911.420	
WELLPOINT INC	31,319	90.930	2,847,836.670	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,772	68.580	1,561,703.760	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	32,264	44.880	1,448,008.320	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8,538	194.530	1,660,897.140	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	28.750	477,738.750	
SIGMA-ALDRICH	11,301	93.260	1,053,931.260	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	46,269	84.960	3,931,014.240	
ADVANCE AUTO PARTS	7,875	126.500	996,187.500	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	34,348	43.290	1,486,924.920	
EDISON INTERNATIONAL	34,152	51.500	1,758,828.000	
SOUTHERN CO	87,757	42.120	3,696,324.840	
BB&T CORP	73,195	37.700	2,759,451.500	
SOUTHWEST AIRLINES	17,528	22.160	388,420.480	
AT&T INC	542,288	32.470	17,608,091.360	
CHEVRON CORP	197,149	114.150	22,504,558.350	
MEADWESTVACO CORP	16,496	35.890	592,041.440	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,726	82.080	1,208,710.080	
STAPLES INC	72,899	13.390	976,117.610	
STATE STREET CORP	47,154	69.070	3,256,926.780	
STARBUCKS CORP	78,597	72.560	5,702,998.320	
STRYKER CORP	29,747	82.610	2,457,399.670	

NETFLIX INC	5,640	447.000	2,521,080.000	
STERICYCLE INC	7,859	115.220	905,513.980	
SUNTRUST BANKS INC	54,576	37.590	2,051,511.840	
SYMANTEC CORP	76,489	20.840	1,594,030.760	
SYNOPSIS INC	14,312	40.270	576,344.240	
SYSCO CORP	59,058	35.970	2,124,316.260	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,432	438.540	1,943,609.280	
TESORO CORP	15,352	51.230	786,482.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	110,530	44.450	4,913,058.500	
TEXTRON INC	25,116	39.190	984,296.040	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,264	123.370	4,597,259.680	
TIFFANY & CO	12,040	90.500	1,089,620.000	
TOLL BROTHERS INC	17,142	38.340	657,224.280	
TORCHMARK CORP	9,110	76.040	692,724.400	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	30.240	412,382.880	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	17,040	67.500	1,150,200.000	
TRACTOR SUPPLY CO	15,159	66.770	1,012,166.430	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	38.440	899,034.720	
TYSON FOODS INC	28,867	38.860	1,121,771.620	
MARATHON OIL CORP	70,393	33.890	2,385,618.770	
UNION PACIFIC CORP	47,799	179.610	8,585,178.390	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	88,532	116.490	10,313,092.680	
UNITEDHEALTH GROUP INC	105,909	76.010	8,050,143.090	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,035	83.110	750,898.850	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,927	84.010	917,977.270	
VF CORP	37,944	58.840	2,232,624.960	
CBS CORP	57,668	66.460	3,832,615.280	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,298	83.950	1,955,867.100	
VULCAN MATERIALS CO	15,610	65.030	1,015,118.300	
URBAN OUTFITTERS INC	13,462	36.220	487,593.640	
WALGREEN CO	91,195	66.520	6,066,291.400	
WAL-MART STORES INC	167,855	73.350	12,312,164.250	
WASTE MANAGEMENT INC	46,499	41.060	1,909,248.940	
WATERS CORP	8,002	113.590	908,947.180	
ACTAVIS PLC	18,272	222.370	4,063,144.640	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,083	98.700	995,192.100	
WESTERN DIGITAL CORP	23,595	88.600	2,090,517.000	
WHIRLPOOL CORP	7,676	140.870	1,081,318.120	
WYNN RESORTS LTD	7,511	235.870	1,771,619.570	
WHOLE FOODS MARKET INC	34,963	52.880	1,848,843.440	
NASDAQ OMX GROUP	10,282	39.120	402,231.840	
CME GROUP INC	33,607	74.320	2,497,672.240	
WILLIAMS COS INC	69,554	41.770	2,905,270.580	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	51.360	447,653.760	

LKQ CORP	28,289	29.510	834,808.390	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	20.620	375,180.900	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	53.510	567,687.590	
WISCONSIN ENERGY CORP	20,446	43.760	894,716.960	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	56.540	442,368.960	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	33.740	838,439.000	
CARMAX INC	24,979	47.890	1,196,244.310	
XEROX CORP	127,501	10.780	1,374,460.780	
XILINX INC	24,251	51.340	1,245,046.340	
YAHOO! INC	99,997	37.420	3,741,887.740	
CIMAREX ENERGY CO	9,368	114.050	1,068,420.400	
TJX COMPANIES INC	71,898	60.390	4,341,920.220	
HOSPIRA INC	15,624	42.500	664,020.000	
CBRE GROUP INC	28,979	27.450	795,473.550	
LIBERTY GLOBAL PLC	24,021	86.720	2,083,101.120	
REGIONS FINANCIAL CORP	138,567	10.440	1,446,639.480	
GOOGLE INC	27,917	1,212.510	33,849,641.670	
T-MOBILE US INC	19,051	32.310	615,537.810	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,336	84.410	3,573,581.760	
MOSAIC CO/THE	29,078	48.000	1,395,744.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	46,732	32.300	1,509,443.600	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	150,198	33.170	4,982,067.660	
HERBALIFE LTD	7,528	67.010	504,451.280	
CELANESE CORP	14,767	52.560	776,153.520	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	73,694	7.950	585,867.300	
IHS INC-CLASS A	5,758	118.980	685,086.840	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	13,414	82.460	1,106,118.440	
EXPEDIA INC	10,399	79.260	824,224.740	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,285	242.790	1,525,935.150	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,034	108.280	2,061,001.520	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,627	85.960	1,343,296.920	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	21,690	33.080	717,505.200	
GAMESTOP CORP. - CL. A	14,066	36.050	507,079.300	
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	11,889	215.320	2,559,939.480	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,718	115.230	889,345.140	
VIACOM INC-CLASS B	44,238	86.980	3,847,821.240	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,447	554.380	1,910,947.860	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	10,239	46.100	472,017.900	
TRANSDIGM GROUP INC	4,774	178.220	850,822.280	
MASTERCARD INC	107,800	75.960	8,188,488.000	

LIBERTY INTERACTIVE CORP	46,990	29.450	1,383,855.500	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	12,025	70.650	849,566.250	
WESTERN UNION CO	61,119	16.350	999,295.650	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,629	45.050	388,736.450	
KBR INC	15,988	31.430	502,502.840	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	45,731	27.510	1,258,059.810	
SPECTRA ENERGY CORP	67,253	37.520	2,523,332.560	
TIME WARNER CABLE INC	28,718	139.160	3,996,396.880	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	35,585	14.200	505,307.000	
DELTA AIR LINES INC	22,701	32.450	736,647.450	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,877	124.120	481,213.240	
DISCOVER FINANCIAL	51,410	57.440	2,952,990.400	
COVIDIEN PLC	47,677	70.820	3,376,485.140	
TE CONNECTIVITY LTD	40,997	57.970	2,376,596.090	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	118.550	1,194,628.350	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,339	51.620	636,939.180	
VMWARE INC	10,086	96.690	975,215.340	
TERADATA CORP	19,646	45.660	897,036.360	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	7,107	87.440	621,436.080	
INVESCO LTD	43,479	33.830	1,470,894.570	
NETSUITE INC	3,281	115.840	380,071.040	
CALPINE CORP NPR	42,931	19.820	850,892.420	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	164,815	79.170	13,048,403.550	
VISA INC	52,252	226.190	11,818,879.880	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	22,285	51.750	1,153,248.750	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	43.870	714,598.430	
LORILLARD INC	38,414	48.220	1,852,323.080	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	81.070	588,487.130	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- C	9,733	77.170	751,095.610	
MARATHON PETROLEUM CORP	33,263	88.120	2,931,135.560	
CAREFUSION CORP	20,958	41.100	861,373.800	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	67,126	32.100	2,154,744.600	
XYLEM INC	22,549	39.400	888,430.600	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	42,755	85.970	3,675,647.350	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	26,085	59.570	1,553,883.450	
LINKEDIN CORP	10,629	199.590	2,121,442.110	
HCA HOLDINGS INC	28,526	50.370	1,436,854.620	
NIelsen HOLDINGS NV	26,310	46.710	1,228,940.100	

VERISK ANALYTICS INC	16,556	65.380	1,082,431.280	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	124.440	891,239.280	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	20,925	80.960	1,694,088.000	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	51.640	407,542.880	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	32,899	18.030	593,168.970	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	7,245	123.580	895,337.100	
CIT GROUP INC	20,577	47.900	985,638.300	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	713,000	0.635	452,755.000	
DOLLAR GENERAL CORP	30,790	58.030	1,786,743.700	
AON PLC	29,492	86.680	2,556,366.560	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	45.750	524,478.000	
QEP RESOURCES INC	18,552	32.380	600,713.760	
TESLA MOTORS INC	9,661	217.650	2,102,716.650	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	40.250	619,568.250	
GENERAL MOTORS CO	101,523	36.550	3,710,665.650	
VANTIV INC	12,141	31.040	376,856.640	
TRIPADVISOR INC	12,944	98.260	1,271,877.440	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	19,210	98.580	1,893,721.800	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	29,892	66.510	1,988,116.920	
PHILLIPS 66	58,928	76.250	4,493,260.000	
LIBERTY MEDIA CORP	9,165	135.690	1,243,598.850	
FACEBOOK INC	175,797	70.780	12,442,911.660	
ADT CORP	23,368	31.270	730,717.360	
SERVICENOW INC	12,789	68.900	881,162.100	
WORKDAY INC	6,561	100.360	658,461.960	
KRAFT FOODS GROUP INC	59,385	55.120	3,273,301.200	
ABBVIE INC	161,206	50.850	8,197,325.100	
ZOETIS INC	51,278	29.700	1,522,956.600	
NEWS CORP/NEW-CL A	43,948	17.940	788,427.120	
SPRINT CORP	97,357	8.400	817,798.800	
NOBLE CORP PLC	24,088	31.650	762,385.200	
PERRIGO CO PLC	14,130	160.510	2,268,006.300	
アメリカ・ドル 小計	31,810,165		1,741,573,007.250 (178,598,311,895)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	3.900	361,518.300	
AMEC PLC	28,599	11.190	320,022.810	
ANTOFAGASTA PLC	44,020	9.330	410,706.600	
SEVERN TRENT PLC	28,908	18.300	529,016.400	
BHP BILLITON PLC	214,510	19.600	4,204,396.000	
BARCLAYS PLC	1,567,569	2.590	4,060,003.710	
BT GROUP PLC	800,927	4.139	3,315,036.850	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	104,248	9.410	980,973.680	
AGGREKO PLC	27,635	16.540	457,082.900	

TULLOW OIL PLC	97,933	7.810	764,856.730	
BUNZL PLC	34,501	15.850	546,840.850	
EASYJET PLC	13,628	17.720	241,488.160	
CAPITA PLC	64,410	10.890	701,424.900	
AVIVA PLC	295,997	4.753	1,406,873.740	
CRODA INTERNATIONAL	12,849	25.010	321,353.490	
DIAGEO PLC	258,978	19.100	4,946,479.800	
SCHRODERS PLC	12,609	26.810	338,047.290	
NATIONAL GRID PLC	375,807	8.400	3,156,778.800	
GKN PLC	182,053	4.149	755,337.890	
KINGFISHER PLC	234,699	3.966	930,816.230	
BAE SYSTEMS PLC	323,539	4.175	1,350,775.320	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	193,252	31.825	6,150,244.900	
COBHAM PLC	88,449	2.950	260,924.550	
NEXT PLC	15,179	65.800	998,778.200	
REXAM PLC	94,964	5.130	487,165.320	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	100,666	23.980	2,413,970.680	
IMI PLC	32,398	15.200	492,449.600	
JOHNSON MATTHEY PLC	21,473	32.980	708,179.540	
SABMILLER PLC	96,580	28.835	2,784,884.300	
ANGLO AMERICAN PLC	140,108	15.335	2,148,556.180	
COMPASS GROUP PLC	184,252	9.385	1,729,205.020	
HSBC HOLDINGS PLC	1,903,533	6.357	12,100,759.280	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	574,217	2.432	1,396,495.740	
ARM HOLDINGS PLC	141,802	9.890	1,402,421.780	
CENTRICA PLC	543,390	3.192	1,734,500.880	
UNILEVER PLC	128,821	24.740	3,187,031.540	
MEGGITT PLC	71,707	5.105	366,064.230	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	202,760	2.399	486,421.240	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82,325	7.810	642,958.250	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	411,297	0.975	401,014.570	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	38,784	29.200	1,132,492.800	
PEARSON PLC	89,377	10.990	982,253.230	
PERSIMMON PLC	29,923	14.710	440,167.330	
PRUDENTIAL PLC	257,589	13.720	3,534,121.080	
RIO TINTO PLC	129,113	35.365	4,566,081.240	
VODAFONE GROUP PLC	2,695,306	2.523	6,800,257.030	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	65,566	50.250	3,294,691.500	
REED ELSEVIER PLC	127,990	9.220	1,180,067.800	
OLD MUTUAL PLC	538,950	1.871	1,008,375.450	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	194,037	9.900	1,920,966.300	

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	234,054	3.618	846,807.370	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	19.820	394,318.900	
SSE PLC	99,390	14.370	1,428,234.300	
SERCO GROUP PLC	50,772	4.129	209,637.580	
BP PLC	1,922,200	5.059	9,724,409.800	
SHIRE PLC	57,161	34.100	1,949,190.100	
SAGE GROUP PLC(THE)	98,062	4.294	421,078.220	
SMITHS GROUP PLC	36,935	13.990	516,720.650	
STANDARD CHARTERED PLC	245,267	13.050	3,200,734.350	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,053,661	0.816	4,123,787.370	
TATE & LYLE PLC	36,876	6.485	239,140.860	
BG GROUP PLC	350,815	11.175	3,920,357.620	
TESCO PLC	818,585	3.334	2,729,162.390	
3I GROUP PLC	119,685	4.167	498,727.390	
SMITH & NEPHEW PLC	93,652	9.600	899,059.200	
GLAXOSMITHKLINE PLC	499,201	16.830	8,401,552.830	
WEIR GROUP	18,336	23.790	436,213.440	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	17,421	20.300	353,646.300	
BABCOCK INT'L GROUP	43,025	14.580	627,304.500	
WPP PLC	130,749	13.490	1,763,804.010	
WOLSELEY PLC	27,936	33.790	943,957.440	
ASTRAZENECA PLC	130,210	41.000	5,338,610.000	
WHITBREAD PLC	19,002	41.780	793,903.560	
CARNIVAL PLC	17,669	24.880	439,604.720	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	158,973	5.055	803,608.510	
INTERTEK GROUP PLC	19,178	30.310	581,285.180	
WILLIAM HILL PLC	104,797	3.714	389,216.050	
BURBERRY GROUP PLC	41,539	15.410	640,115.990	
INVESTEC PLC	50,655	4.435	224,654.920	
INTERCONTINENTAL HOTELS	25,287	19.250	486,774.750	
ICAP PLC	52,823	4.295	226,874.780	
ITV PLC	345,353	2.038	703,829.410	
SAINSBURY (J) PLC	147,222	3.478	512,038.110	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	10,689	48.750	521,088.750	
G4S PLC	171,953	2.362	406,152.980	
ADMIRAL GROUP PLC	22,361	14.700	328,706.700	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	397,909	22.225	8,843,527.520	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	248,943	23.735	5,908,662.100	
INMARSAT PLC	46,334	7.035	325,959.690	
PETROFAC LTD	29,942	13.680	409,606.560	
STANDARD LIFE PLC	223,263	3.888	868,046.540	
EXPERIAN PLC	98,499	11.110	1,094,323.890	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	13.570	351,829.390	
TUI TRAVEL PLC	52,043	4.466	232,424.030	
MELROSE INDUSTRIES PLC	90,508	3.258	294,875.060	

	FRESNILLO PLC NPR	23,779	9.975	237,195.520	
	RESOLUTION LTD	122,660	3.728	457,276.480	
	GLENCORE XSTRATA PLC	1,079,568	3.365	3,632,746.320	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	107,350	2.624	281,686.400	
	COCA-COLA HBC AG	25,293	15.160	383,441.880	
イギリス・ポンド	小計	27,873,331		174,197,240.420 (29,751,146,692)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	133,450	18.700	2,495,515.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	181,502	13.130	2,383,121.260	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.900	1,110,557.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	66,569	28.300	1,883,902.700	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	89,826	169.100	15,189,576.600	
イスラエル・シュケル	小計	659,577		23,062,672.560 (672,046,278)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	44.560	570,145.200	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	283,459	32.000	9,070,688.000	
	AMCOR LTD	123,722	10.660	1,318,876.520	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	321,420	33.570	10,790,069.400	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,216	12.140	366,822.240	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	5.990	893,743.940	
	TELSTRA CORP LTD	448,020	5.120	2,293,862.400	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	11.200	356,988.800	
	AMP LTD	324,183	5.000	1,620,915.000	
	ASX LTD	22,288	37.540	836,691.520	
	BHP BILLITON LTD	328,942	39.380	12,953,735.960	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	20.940	296,280.060	
	ALS LTD	34,895	8.420	293,815.900	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	3.130	318,474.370	
	COMPUTERSHARE LT	50,472	12.000	605,664.000	
	CSL LIMITED	50,259	70.800	3,558,337.200	
	TRANSURBAN GROUP	160,451	7.040	1,129,575.040	
	COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	11.200	677,600.000	
	COCHLEAR LTD	5,226	58.330	304,832.580	
	ORIGIN ENERGY LTD	107,742	14.560	1,568,723.520	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	163,026	75.360	12,285,639.360		
BORAL LIMITED	84,744	5.580	472,871.520		
RIO TINTO LIMITED	42,941	69.550	2,986,546.550		
APA GROUP	86,227	6.490	559,613.230		

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,859	5.660	1,267,041.940	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,423	49.320	218,142.360	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	13.830	494,975.700	
	ORICA LTD	34,301	24.250	831,799.250	
	LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	17.230	374,873.110	
	SYDNEY AIRPORT	115,539	3.950	456,379.050	
	MACQUARIE GROUP LTD	30,846	55.300	1,705,783.800	
	WORLEYPARSONS LTD	23,411	15.790	369,659.690	
	SUNCORP GROUP LTD	140,404	12.340	1,732,585.360	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	236,120	34.430	8,129,611.600	
	NEWCREST MINING LTD	92,633	11.430	1,058,795.190	
	INCITEC PIVOT LTD	165,148	3.100	511,958.800	
	TOLL HOLDINGS LTD	72,011	5.530	398,220.830	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	127,737	1.240	158,393.880	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	121,525	11.650	1,415,766.250	
	SANTOS LTD	104,285	13.670	1,425,575.950	
	SONIC HEALTHCARE	45,868	17.550	804,983.400	
	TABCORP HOLDINGS LTD	30,088	3.590	108,015.920	
	WESFARMERS LTD	103,161	42.800	4,415,290.800	
	ALUMINA LIMITED	388,179	1.300	504,632.700	
	ILUKA RESOURCES LIMI	55,637	9.470	526,882.390	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	64,556	37.990	2,452,482.440	
	WOOLWORTHS LTD	124,027	36.550	4,533,186.850	
	METCASH LTD	79,084	3.080	243,578.720	
	SEEK LTD	29,830	16.240	484,439.200	
	TATTS GROUP LTD	141,350	3.030	428,290.500	
	SP AUSNET	234,780	1.300	305,214.000	
	AGL ENERGY LTD	57,550	15.860	912,743.000	
	BRAMBLES LTD	152,289	9.330	1,420,856.370	
	ASCIANO LTD	108,957	5.660	616,696.620	
	CROWN RESORTS LTD	46,332	17.030	789,033.960	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	109,246	2.520	275,299.920	
	AURIZON HOLDINGS LTD	210,167	5.140	1,080,258.380	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	4.050	228,428.100	
	オーストラリア・ドル 小計	6,625,798		106,810,388.340 (9,894,914,375)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,334	37.970	658,171.980	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	15,943	87.220	1,390,548.460	
	BARRICK GOLD CORP	120,690	23.520	2,838,628.800	
	ATCO LTD	7,193	52.000	374,036.000	
	TALISMAN ENERGY INC	100,146	11.580	1,159,690.680	
	BANK OF MONTREAL	65,347	72.570	4,742,231.790	

BANK OF NOVA SCOTIA	124,468	63.510	7,904,962.680	
NATIONAL BANK OF CANADA	34,258	43.610	1,493,991.380	
BCE INC	26,643	47.950	1,277,531.850	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	55,291	45.070	2,491,965.370	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	32,566	161.410	5,256,478.060	
BOMBARDIER INC 'B'	155,097	3.570	553,696.290	
SAPUTO INC	15,632	54.300	848,817.600	
BLACKBERRY LTD	56,591	10.870	615,144.170	
CGI GROUP INC	22,652	36.160	819,096.320	
CAE INC	31,436	15.150	476,255.400	
CAMECO CORP	45,703	23.490	1,073,563.470	
ROGERS COMM-CL B	35,628	42.690	1,520,959.320	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	40,469	90.090	3,645,852.210	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	111,566	41.030	4,577,552.980	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,877	98.450	677,040.650	
CANADIAN UTILITIES LTD	15,036	39.110	588,057.960	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,758	62.260	5,214,773.080	
AGRIUM INC	16,162	100.790	1,628,967.980	
YAMANA GOLD INC	67,520	11.500	776,480.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	56.040	643,955.640	
OPEN TEXT CORP	14,658	56.970	835,066.260	
ELDORADO GOLD CORP	78,309	7.760	607,677.840	
EMPIRE CO LTD	5,031	71.400	359,213.400	
KINROSS GOLD CORP	125,461	5.850	733,946.850	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	30.150	517,374.000	
FORTIS INC	20,884	30.580	638,632.720	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	60,600	21.070	1,276,842.000	
TELUS CORP	26,152	39.280	1,027,250.560	
GREAT WEST LIFECO INC	32,106	31.320	1,005,559.920	
IMPERIAL OIL LTD	32,537	49.200	1,600,820.400	
ENBRIDGE INC	80,635	47.520	3,831,775.200	
IGM FINANCIAL INC	6,816	53.800	366,700.800	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	49,079	4.030	197,788.370	
MANULIFE FINANCIAL CORP	190,370	21.200	4,035,844.000	
LOBLAW CO LTD	12,181	45.290	551,677.490	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	35,435	15.700	556,329.500	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	47.520	457,617.600	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,217	95.840	2,225,117.280	
SUN LIFE FINANCIAL INC	61,535	39.610	2,437,401.350	

FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,025	450.340	461,598.500	
METRO INC	10,154	63.260	642,342.040	
HUSKY ENERGY INC	35,673	33.640	1,200,039.720	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	37,273	39.070	1,456,256.110	
METHANEX CORP	9,418	71.970	677,813.460	
ONEX CORP	10,676	58.350	622,944.600	
GOLDCORP INC	75,826	30.550	2,316,484.300	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	88,758	36.650	3,252,980.700	
POWER CORP OF CANADA	39,841	30.500	1,215,150.500	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	34.890	820,647.690	
ROYAL BANK OF CANADA	146,553	72.490	10,623,626.970	
SNC-LAVALIN GROUP INC	16,326	48.480	791,484.480	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	17,692	174.870	3,093,800.040	
SHAW COMM INC-B	39,522	25.240	997,535.280	
SHOPPERS DRUG MART CORP	22,208	60.070	1,334,034.560	
NEW GOLD INC	51,627	7.040	363,454.080	
SUNCOR ENERGY INC	150,001	36.970	5,545,536.970	
ENCANA CORP	71,646	21.470	1,538,239.620	
TECK RESOURCES LTD-CL B	60,753	25.000	1,518,825.000	
THOMSON REUTERS CORP	41,062	38.540	1,582,529.480	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	187,660	49.440	9,277,910.400	
TRANSCANADA CORP	73,427	49.030	3,600,125.810	
TRANSALTA CORP	34,014	13.060	444,222.840	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	79.580	377,447.940	
INTACT FINANCIAL CORP	12,288	66.710	819,732.480	
SILVER WHEATON CORP	41,308	28.600	1,181,408.800	
CATAMARAN CORP	20,272	56.970	1,154,895.840	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,024	59.000	945,416.000	
CI FINANCIAL CORP	16,122	33.990	547,986.780	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	50.640	799,048.560	
KEYERA CORP	8,738	65.480	572,164.240	
ALTAGAS LTD	12,358	42.440	524,473.520	
PEMBINA PIPELINE CORP	28,565	40.070	1,144,599.550	
TIM HORTONS INC	14,007	57.940	811,565.580	
DOLLARAMA INC	6,908	82.430	569,426.440	
BAYTEX ENERGY CORP	11,962	40.420	483,504.040	
MEG ENERGY CORP	17,794	33.880	602,860.720	
ATHABASCA OIL CORP	42,987	8.520	366,249.240	
CENOVUS ENERGY INC W/I	72,925	28.890	2,106,803.250	
ENERPLUS CORP	20,814	22.080	459,573.120	
VERMILION ENERGY INC	8,291	63.260	524,488.660	
PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	9.120	478,407.840	
ARC RESOURCES LTD	30,599	30.370	929,291.630	
CANADIAN OIL SANDS LTD	53,022	20.970	1,111,871.340	

	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	36.620	408,972.160	
	PENGROWTH ENERGY CORP	36,505	7.550	275,612.750	
カナダ・ドル 小計		3,997,585		147,084,469.290 (13,630,317,769)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.800	475,000.000	
	SEBFCORP INDUSTRIES	139,000	5.430	754,770.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.090	691,210.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.555	456,010.200	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	174,000	16.650	2,897,100.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	9.250	342,250.000	
	SEBFCORP MARINE	108,000	4.090	441,720.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	39.100	508,300.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	6.980	607,260.000	
	CAPITALAND LTD	276,000	2.850	786,600.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	1.355	791,862.000	
	KEPPEL CORP LTD	137,500	10.440	1,435,500.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	90,000	1.955	175,950.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	0.995	409,704.180	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	280,200	9.660	2,706,732.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	819,867	3.640	2,984,315.880	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	10.140	663,156.000	
	KEPPEL LAND LTD	95,000	3.240	307,800.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	125,000	20.840	2,605,000.000	
	STARHUB LTD	65,000	4.160	270,400.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.390	678,000.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.145	264,495.000		
CAPITAMALLS ASIA LTD	120,000	1.810	217,200.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.810	800,850.000		
シンガポール・ドル 小計		5,459,770		22,271,185.260 (1,809,088,380)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	157,904	28.230	4,457,629.920	
	SYNGENTA AG	9,713	325.900	3,165,466.700	
	NESTLE SA-REGISTERED	328,388	66.400	21,804,963.200	
	CIE FINANC RICHEMONT	52,226	88.600	4,627,223.600	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	71,471	270.000	19,297,170.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,842	133.400	645,922.800	
	SIKA INHABER	188	3,251.000	611,188.000	
	SGS SA-REG	576	2,222.000	1,279,872.000	
	SULZER AG-REG	3,187	124.600	397,100.200	
	NOVARTIS AG-REG SHS	234,010	74.400	17,410,344.000	

BALOISE HOLDING AG -R	5,702	112.100	639,194.200	
BARRY CALLEBAUT AG	69	1,101.000	75,969.000	
SWISSCOM AG-REG	2,309	521.000	1,202,989.000	
ABB LTD	220,149	22.400	4,931,337.600	
ADECCO SA-REG	11,879	73.600	874,294.400	
GEBERIT AG	4,109	270.900	1,113,128.100	
LONZA GROUP AG-REG	5,846	93.000	543,678.000	
LINDT & SPRUENGLI PART	91	4,240.000	385,840.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	50,175.000	652,275.000	
UBS AG-REGISTERED	372,228	18.550	6,904,829.400	
GIVAUDAN-REG	909	1,383.000	1,257,147.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	15,295	267.500	4,091,412.500	
HOLCIM LTD-REG	22,704	69.650	1,581,333.600	
ACTELION	12,017	89.800	1,079,126.600	
SONOVA HOLDING AG	4,519	124.800	563,971.200	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,445	125.200	806,914.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,715	585.500	1,589,632.500	
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	104.200	578,518.400	
SCHINDLER NAMEN	1,824	135.500	247,152.000	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	202.000	717,706.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	1,280	338.750	433,600.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,477	73.400	402,011.800	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	222.700	447,627.000	
ARYZTA AG	8,596	72.850	626,218.600	
JULIUS BAER GROUP LTD	23,855	41.340	986,165.700	
SWISS RE LTD	36,822	83.700	3,082,001.400	
TRANSOCEAN LTD	39,921	39.040	1,558,515.840	
スイス・フラン 小計	1,678,394		111,069,469.260 (12,814,084,669)	
スウェーデン・ クローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	66,188	180.600	11,953,552.800	
ATLAS COPCO AB-B SHS	42,459	168.600	7,158,587.400	
ELEKTA AB	32,078	88.500	2,838,903.000	
ERICSSON LM-B SHS	319,794	83.000	26,542,902.000	
GETINGE AB-B SHS	22,760	236.900	5,391,844.000	
SKF AB-B SHS	43,481	175.000	7,609,175.000	
SANDVIK AB	108,906	89.800	9,779,758.800	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,348	89.750	14,570,733.000	
SKANSKA AB-B SHS	39,626	137.200	5,436,687.200	
SWEDBANK AB	88,783	179.500	15,936,548.500	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	63,427	192.500	12,209,697.500	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	48,233	331.200	15,974,769.600	
VOLVO AB-B SHS	144,477	98.550	14,238,208.350	
SCANIA AB	35,390	194.500	6,883,355.000	
SWEDISH MATCH AB	24,727	206.100	5,096,234.700	
TELE2 AB-B SHS	24,305	80.250	1,950,476.250	

	NORDEA AB	312,909	91.300	28,568,591.700	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	124.500	2,284,948.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	28,642	148.500	4,253,337.000	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	69.050	1,882,372.050	
	INVESTOR AB-B SHS	44,529	225.500	10,041,289.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	94,656	291.300	27,573,292.800	
	ASSA ABLOY AB-B	32,006	329.500	10,545,977.000	
	TELIASONERA AB	243,599	50.250	12,240,849.750	
	LUNDIN PETROLEUM AB	28,131	128.300	3,609,207.300	
	BOLIDEN AB	17,761	102.600	1,822,278.600	
	ALFA LAVAL AB	31,389	173.000	5,430,297.000	
	KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	257.300	5,973,991.400	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,723	689.000	5,321,147.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	54,633	43.080	2,353,589.640	
	HEXAGON AB	21,871	224.700	4,914,413.700	
スウェーデン・クローナ 小計		2,253,663		290,387,016.040 (4,576,499,372)	
デンマーク・ クローネ	CARLSBERG AS-B	10,483	589.000	6,174,487.000	
	A P MOLLER A/S	124	66,000.000	8,184,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	62	63,300.000	3,924,600.000	
	DANSKE BANK A/S	74,115	139.700	10,353,865.500	
	NOVOZYMES-B SHS	24,240	252.200	6,113,328.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	206,880	247.000	51,099,360.000	
	TDC A/S	84,208	53.400	4,496,707.200	
	COLOPLAST-B	12,458	440.300	5,485,257.400	
	DSV A/S	15,918	172.500	2,745,855.000	
	WILLIAM DEMANT	2,595	534.500	1,387,027.500	
デンマーク・クローネ 小計		431,083		99,964,487.600 (1,886,329,880)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	118,545	3.735	442,765.570	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	41,674	7.620	317,555.880	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	9.870	730,301.040	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	209,231	2.450	512,615.950	
ニュージーランド・ドル 小計		443,442		2,003,238.440 (171,156,693)	
ノルウェー・ クローネ	DNB ASA	98,819	105.900	10,464,932.100	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	30.100	3,222,566.200	
	TELENOR ASA	65,096	134.300	8,742,392.800	
	SUBSEA 7 SA	22,609	115.900	2,620,383.100	
	ORKLA ASA	86,098	47.150	4,059,520.700	
	STATOIL ASA	117,819	161.100	18,980,640.900	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,131	248.100	5,242,601.100	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	101.700	1,925,791.200	
	SEADRILL LTD	38,772	227.800	8,832,261.600	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21,678	126.100	2,733,595.800	
ノルウェー・クローネ 小計		598,020		66,824,685.500 (1,135,351,406)	
ユーロ	CRH PLC	73,961	20.375	1,506,955.370	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	52.030	739,606.450	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.364	881,914.480	
	UMICORE	13,643	34.805	474,844.610	
	AIR LIQUIDE	32,433	99.240	3,218,650.920	
	AIRBUS GROUP NV	62,297	53.070	3,306,101.790	
	AXA	177,702	19.635	3,489,178.770	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,954	12.960	504,843.840	
	ADIDAS AG	20,732	84.860	1,759,317.520	
	ASSICURAZIONI GENERALI	112,448	16.560	1,862,138.880	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	157,125	1.388	218,089.500	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	40,778	17.365	708,109.970	
	DANONE	57,035	50.940	2,905,362.900	
	SAFRAN SA	28,086	50.930	1,430,419.980	
	INTESA SANPAOLO	1,125,068	2.234	2,513,401.910	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,402	84.590	2,910,065.180	
	ACCOR SA	17,313	37.030	641,100.390	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	9,683	36.235	350,863.500	
	BOUYGUES	22,659	30.750	696,764.250	
	BNP PARIBAS	99,978	59.340	5,932,694.520	
	REED ELSEVIER NV	68,686	16.075	1,104,127.450	
	THALES SA	8,128	48.495	394,167.360	
	CAP GEMINI SA	15,406	56.680	873,212.080	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	82.910	544,469.970	
	CHRISTIAN DIOR	5,133	145.650	747,621.450	
	CGG	16,618	12.085	200,828.530	
	ALCATEL-LUCENT	298,978	3.178	950,152.080	
	UNICREDIT SPA	437,673	5.910	2,586,647.430	
	NATIXIS	102,266	5.143	525,954.030	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,919	47.715	759,575.080	
	DELHAIZE GROUP	12,505	51.800	647,759.000	
	COMMERZBANK AG	96,311	13.075	1,259,266.320	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,555	119.000	1,613,045.000	
	UNITED INTERNET	9,260	33.740	312,432.400	
FUCHS PETROLUB SE PREF	4,411	72.010	317,636.110		
PUBLICIS GROUPE	17,067	68.870	1,175,404.290		
MAN SE	3,396	93.510	317,559.960		
IBERDROLA SA	506,305	4.743	2,401,404.610		
ENI SPA	253,048	17.420	4,408,096.160		
IMERYS SA	4,401	65.370	287,693.370		
JERONIMO MARTINS	33,291	12.900	429,453.900		
KBC GROUPE	24,972	45.200	1,128,734.400		
LAFARGE SA	19,853	54.410	1,080,201.730		
HANNOVER RUECK SE	5,730	61.850	354,400.500		

WARTSILA OYJ	21,069	42.300	891,218.700	
L'OREAL	25,480	123.250	3,140,410.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	25,343	138.750	3,516,341.250	
LAGARDERE S.C.A.	13,927	29.375	409,105.620	
GEA GROUP AG	20,171	34.900	703,967.900	
MEDIOBANCA SPA	55,752	7.150	398,626.800	
MICHELIN(CGDE)-B	20,134	88.750	1,786,892.500	
CONTINENTAL AG	10,728	169.150	1,814,641.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	90,507	26.510	2,399,340.570	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	33.510	314,960.490	
AXEL SPRINGER SE	6,021	51.210	308,335.410	
OMV AG	15,010	34.265	514,317.650	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA- REG	67,989	3.257	221,440.170	
PERNOD-RICARD	20,773	86.590	1,798,734.070	
PIRELLI & C	30,073	12.520	376,513.960	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	14,295	75.600	1,080,702.000	
RENAULT SA	21,020	74.000	1,555,480.000	
REPSOL SA	89,426	18.210	1,628,447.460	
REMY COINTREAU	3,877	61.880	239,908.760	
MERCK KGAA	6,349	125.000	793,625.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	82,955	74.660	6,193,420.300	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,154	43.675	1,928,425.950	
SAIPEM	35,323	16.780	592,719.940	
RWE AG	50,913	30.725	1,564,301.920	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	19,633	40.120	787,675.960	
SOCIETE GENERALE-A	73,735	47.950	3,535,593.250	
VINCI S.A.	47,191	53.660	2,532,269.060	
SODEXO	9,625	77.740	748,247.500	
SOLVAY SA	5,471	113.400	620,411.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	57,289	65.720	3,765,033.080	
VIVENDI SA	123,403	21.250	2,622,313.750	
SAP AG	95,146	58.220	5,539,400.120	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	72.940	699,713.420	
TELEFONICA S.A	419,237	11.450	4,800,263.650	
TOTAL SA	217,116	46.235	10,038,358.260	
VALLOUREC	11,847	37.915	449,179.000	
VALEO	8,400	97.810	821,604.000	
E.ON SE	185,310	14.475	2,682,362.250	
VOEST-ALPINE AG	9,875	32.455	320,493.120	
ZODIAC AEROSPACE	3,509	129.800	455,468.200	
HENKEL AG & CO KGAA	14,673	74.660	1,095,486.180	
METRO AG	11,655	31.915	371,969.320	
SIEMENS AG-REG	80,638	95.690	7,716,250.220	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	13.010	602,467.080	

ING GROEP NV-CVA	388,916	10.615	4,128,343.340	
BAYER AG	84,009	102.200	8,585,719.800	
STORA ENSO OYJ-R SHS	67,549	8.245	556,941.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,679	81.380	1,357,337.020	
DAIMLER AG	97,645	67.690	6,609,590.050	
BASF SE	94,899	83.260	7,901,290.740	
CELESIO AG	8,447	25.410	214,638.270	
BEIERSDORF AG	10,562	73.580	777,151.960	
HOCHTIEF AG	1,935	64.930	125,639.550	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,234	59.040	781,335.360	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	21,622	52.850	1,142,722.700	
ORANGE	192,070	9.613	1,846,368.910	
SAMPO OYJ-A SHS	46,036	36.760	1,692,283.360	
RANDSTAD HOLDINGS	13,985	45.505	636,387.420	
ALLIANZ SE	46,088	130.800	6,028,310.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	203,441	3.022	614,798.700	
KONINKLIJKE AHOLD NV	101,654	13.420	1,364,196.680	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	19,236	34.750	668,451.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	18.775	512,538.720	
ERSTE GROUP BANK AG	30,671	29.600	907,861.600	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	18,428	158.700	2,924,523.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	102,748	11.900	1,222,701.200	
SOCIETE BIC SA	3,322	92.730	308,049.060	
DASSAULT SYSTEMES SA	5,838	85.130	496,988.940	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,046	26.695	535,127.970	
HEINEKEN NV	21,379	49.080	1,049,281.320	
AKZO NOBEL	24,058	59.070	1,421,106.060	
ASML HOLDING NV	37,808	65.520	2,477,180.160	
AEGON NV	167,051	6.568	1,097,190.960	
VOLKSWAGEN AG	3,623	184.850	669,711.550	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,120	187.900	2,653,148.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	592,047	9.072	5,371,050.380	
KERING	7,231	153.750	1,111,766.250	
CNP ASSURANCES	22,463	15.690	352,444.470	
FORTUM OYJ	43,978	18.120	796,881.360	
AGEAS	19,877	32.390	643,816.030	
UCB SA	10,367	54.510	565,105.170	
THYSSENKRUPP AG	44,483	20.150	896,332.450	
UNILEVER NV-CVA	166,176	28.895	4,801,655.520	
CARREFOUR SA	61,756	26.785	1,654,134.460	
GAS NATURAL SDG SA	36,738	18.835	691,960.230	
ATOS	6,025	68.330	411,688.250	
NOKIA OYJ	391,422	5.525	2,162,606.550	
POHJOLA BANK PLC	9,831	16.820	165,357.420	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	100,900	25.550	2,577,995.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,008	20.570	699,544.560	
SANOFI	121,234	74.650	9,050,118.100	
IMMOFINANZ AG	131,110	3.675	481,829.250	
STMICROELECTRONICS NV	80,884	6.155	497,841.020	
ELISA OYJ	13,898	20.530	285,325.940	
BANCO SANTANDER SA	1,191,998	6.570	7,831,426.860	
METSO OYJ	10,879	23.210	252,501.590	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	11,690	55.550	649,379.500	
QIAGEN N.V.	27,019	16.225	438,383.270	
LINDE AG	19,271	149.000	2,871,379.000	
FIAT SPA	92,315	7.575	699,286.120	
DEUTSCHE BANK AG-REG	102,711	35.695	3,666,269.140	
BMW VORZUG	6,146	64.600	397,031.600	
K & S	18,738	23.975	449,243.550	
SUEDZUCKER AG	11,866	19.815	235,124.790	
ENEL SPA	672,106	3.768	2,532,495.400	
COLRUYT NV	7,116	40.075	285,173.700	
VOPAK (KON.)	8,976	43.410	389,648.160	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	297,815	12.510	3,725,665.650	
BANCO POPULAR ESPANOL	144,093	5.296	763,116.520	
FINMECCANICA SPA	55,583	7.180	399,085.940	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	103,908	7.943	825,341.240	
KONINKLIJKE KPN NV	366,685	2.706	992,249.610	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.362	217,285.100	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,044	59.520	1,193,018.880	
BANCO SABADELL	344,219	2.383	820,273.870	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,358	70.110	656,089.380	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VPR	516	0.001	0.510	
FRAPORT AG	3,149	56.650	178,390.850	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	46.655	373,893.170	
INDITEX	22,630	106.150	2,402,174.500	
JC DECAUX INTERNATIONAL	8,589	32.380	278,111.820	
ANDRITZ AG	9,129	43.625	398,252.620	
MAPFRE SA	80,219	3.046	244,347.070	
ESSILOR INTL	19,980	78.590	1,570,228.200	
SNAM SPA	225,511	4.140	933,615.540	
CREDIT AGRICOLE SA	111,051	11.250	1,249,323.750	
ENAGAS	15,332	20.790	318,752.280	
WENDEL	4,087	107.950	441,191.650	
TENARIS SA	46,257	15.400	712,357.800	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	6.115	458,343.710	
TELECOM ITALIA SPA	1,035,863	0.870	901,200.810	
TELECOM ITALIA-RNC	792,074	0.678	537,026.170	
ATLANTIA SPA	38,919	18.080	703,655.520	

ILIAD SA	2,821	183.800	518,499.800	
BELGACOM SA	13,498	22.850	308,429.300	
SES FDR	28,786	25.010	719,937.860	
TERNA SPA	179,290	3.722	667,317.380	
GRIFOLS SA	17,550	39.700	696,735.000	
FERROVIAL SA	45,760	14.840	679,078.400	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	54.600	374,337.600	
SKY DEUTSCHLAND AG	45,911	7.540	346,168.940	
EXOR SPA	9,585	29.630	284,003.550	
NESTE OIL OYJ	10,692	15.270	163,266.840	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	27.185	247,356.310	
FUGRO CERT	7,283	42.455	309,199.760	
KONE OYJ	31,230	31.220	975,000.600	
GDF SUEZ	136,591	18.025	2,462,052.770	
ALSTOM	22,916	19.690	451,216.040	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	44.500	223,612.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	23.390	408,155.500	
ELECTRICITE DE FRANCE	23,911	28.685	685,887.030	
DEUTSCHE WOHNEN AG	32,216	14.995	483,078.920	
ARKEMA SA	5,658	81.800	462,824.400	
LEGRAND SA	27,260	44.470	1,212,252.200	
ADP	2,540	86.790	220,446.600	
ORION OYJ	8,051	23.210	186,863.710	
RTL GROUP SA	3,848	94.940	365,329.120	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	12.025	409,066.450	
SCOR SE	14,425	25.375	366,034.370	
REXEL SA	20,799	18.420	383,117.580	
PRYSMIAN SPA	14,445	19.050	275,177.250	
CAIXABANK	156,629	4.686	733,963.490	
BUREAU VERITAS SA	24,211	20.370	493,178.070	
GROUPE EUROTUNNEL SA	46,533	8.542	397,484.880	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	14.190	321,729.870	
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	42,576	31.495	1,340,931.120	
TNT EXPRESS NV W/I	34,234	7.046	241,212.760	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,019	101.650	205,231.350	
ENEL GREEN POWER SPA	224,723	2.000	449,446.000	
BRENTAG AG	5,161	134.950	696,476.950	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	119,317	5.410	645,504.970	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.308	369,692.950	
DELTA LLOYD NV	19,898	20.120	400,347.760	

	EDENRED	18,682	22.965	429,032.130	
	ZIGGO NV	16,833	33.570	565,083.810	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	31,777	6.070	192,886.390	
	HUGO BOSS AG -ORD	4,016	97.480	391,479.680	
	OSRAM LICHT AG	9,503	49.035	465,979.600	
	GEMALTO	8,626	81.400	702,156.400	
	OCI NV	10,713	35.780	383,311.140	
	CNH INDUSTRIAL NV	109,614	8.190	897,738.660	
	ACS ACTIVIDADES DE CONS Y -RTS	20,026	0.428	8,571.120	
	BANCO POPULAR ESPANOL - RTS	144,018	0.042	6,048.750	
ユーロ 小計		20,631,432		306,583,383.870 (43,179,203,785)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	36,200	68.000	2,461,600.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	21.100	4,599,800.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	31.750	3,545,205.000	
	CLP HOLDINGS LTD	204,000	59.850	12,209,400.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	114,000	15.260	1,739,640.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	10.080	5,366,592.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	136,000	118.800	16,156,800.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	46.750	2,290,750.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	108,200	120.800	13,070,560.000	
	MTR CORP	165,500	27.600	4,567,800.000	
	FIRST PACIFIC CO	223,500	7.790	1,741,065.000	
	HANG SENG BANK LTD	85,500	125.000	10,687,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	111,700	42.800	4,780,760.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	130,500	62.950	8,214,975.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	163,750	53.600	8,777,000.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	564,740	16.160	9,126,198.400	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	222,000	103.300	22,932,600.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	31.850	2,802,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	208,000	72.350	15,048,800.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	88,000	25.300	2,226,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	451,500	23.900	10,790,850.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	86,000	23.200	1,995,200.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	430,700	9.680	4,169,176.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	13.560	3,118,800.000	
SINO LAND CO	257,400	10.780	2,774,772.000		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	164,000	97.500	15,990,000.000		
SWIRE PACIFIC LTD A	73,500	84.150	6,185,025.000		
WHEELLOCK & CO LTD	107,000	32.000	3,424,000.000		

	SJM HOLDINGS LTD	196,000	24.050	4,713,800.000	
	WYNN MACAU LTD	169,600	34.650	5,876,640.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	89,600	32.250	2,889,600.000	
	AIA GROUP LTD	1,241,200	36.950	45,862,340.000	
	SANDS CHINA LTD	240,000	59.350	14,244,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	20.400	3,329,280.000	
香港・ドル	小計	7,460,350		277,709,728.400 (3,671,322,609)	
合計		109,922,610		301,789,773,803 (301,789,773,803)	

(2) 株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	235,579.000	468,802.210	
		DEXUS PROPERTY GROUP	553,747.000	603,584.230	
		FEDERATION CENTRES	146,114.000	352,134.740	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	740,113.200	
		GPT GROUP	198,416.000	732,155.040	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	546,387.600	
		MIRVAC GROUP	399,690.000	701,455.950	
		STOCKLAND	210,736.000	826,085.120	
		WESTFIELD GROUP	201,312.000	2,119,815.360	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	326,593.000	1,022,236.090	
	オーストラリア・ドル	小計	2,474,207.000	8,112,769.540 (751,566,970)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	295,906.000	633,238.840	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	301,730.000	
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	555,698.000	
シンガポール・ドル	小計	801,706.000	1,490,666.840 (121,086,867)		
投資信託受益証券	合計		3,275,913	872,653,837 (872,653,837)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	45,817.000	1,010,264.850	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	76,239.000	1,085,643.360	
		AMERICAN TOWER CORP	40,012.000	3,320,195.760	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	88,038.000	949,049.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,610.000	1,500,244.200	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,442.000	1,818,978.460	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	410,221.950	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,517.000	840,090.380	
		DUKE REALTY TRUST	38,117.000	631,979.860	
		EQUITY RESIDENTIAL	37,715.000	2,208,213.250	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,764.000	861,493.440	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	1,046,995.200	
		HCP INC	44,698.000	1,690,478.360	

	HEALTH CARE REIT INC	30,578.000	1,774,441.340	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	80,629.000	1,581,940.980	
	KIMCO REALTY	32,980.000	716,655.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.000	598,812.500	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	567,326.480	
	PROLOGIS INC	53,944.000	2,194,981.360	
	PUBLIC STORAGE	14,278.000	2,380,142.600	
	RAYONIER INC	10,834.000	498,797.360	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	736,143.120	
	REGENCY CENTERS CORP	10,144.000	509,228.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,510.000	5,038,764.100	
	SL GREEN	10,737.000	1,039,341.600	
	THE MACERICH COMPANY	15,776.000	958,549.760	
	UDR INC	28,307.000	726,074.550	
	VENTAS INC	31,176.000	1,923,870.960	
	VORNADO REALTY TRUST	16,326.000	1,545,092.640	
	WEYERHAEUSER CO	60,041.000	1,813,838.610	
アメリカ・ドル 小計		948,597.000	41,977,850.870 (4,304,828,606)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	575,892.120	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	395,347.260	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	292,191.690	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	85,101.000	925,047.870	
	SEGRO PLC	87,111.000	308,721.380	
イギリス・ポンド 小計		411,756.000	2,497,200.320 (426,496,843)	
カナダ・ドル	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	24,845.000	523,732.600	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	207,270.300	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	412,543.880	
カナダ・ドル 小計		50,340.000	1,143,546.780 (105,972,481)	
ユーロ	CORIO NV	7,710.000	250,150.950	
	GECINA SA	2,977.000	289,959.800	
	ICADE	3,001.000	207,399.110	
	KLEPIERRE	13,172.000	443,962.260	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	9,344.000	1,787,507.200	
ユーロ 小計		36,204.000	2,978,979.320 (419,559,447)	
香港・ドル	LINK REIT/THE	240,500.000	8,585,850.000	
香港・ドル 小計		240,500.000	8,585,850.000 (113,504,938)	
投資証券 合計		1,687,397	5,370,362,315 (5,370,362,315)	
合計			6,243,016,152 (6,243,016,152)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券時価 比率	組入投資証 券時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式	581銘柄	56.24%	-%	-%
	投資証券	30銘柄	-%	-%	1.36%
イギリス・ポンド	株式	100銘柄	9.37%	-%	-%
	投資証券	5銘柄	-%	-%	0.13%
イスラエル・シケル	株式	5銘柄	0.21%	-%	-%
オーストラリア・ドル	株式	58銘柄	3.12%	-%	-%
	投資信託受益証券	10銘柄	-%	0.24%	-%
カナダ・ドル	株式	91銘柄	4.29%	-%	-%
	投資証券	3銘柄	-%	-%	0.03%
シンガポール・ドル	株式	24銘柄	0.57%	-%	-%
	投資信託受益証券	3銘柄	-%	0.04%	-%
スイス・フラン	株式	37銘柄	4.03%	-%	-%
スウェーデン・クローナ	株式	31銘柄	1.44%	-%	-%
デンマーク・クローネ	株式	10銘柄	0.59%	-%	-%
ニュージーランド・ドル	株式	4銘柄	0.05%	-%	-%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.36%	-%	-%
ユーロ	株式	229銘柄	13.60%	-%	-%
	投資証券	5銘柄	-%	-%	0.13%
香港・ドル	株式	34銘柄	1.16%	-%	-%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.04%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,626,793,933	5,003,458,961
コール・ローン		224,467,264	225,302,330
国債証券		399,086,594,496	375,243,989,904
派生商品評価勘定		32,569	13,817
未収利息		4,373,160,008	4,017,527,019
前払費用		98,596,525	141,576,037
流動資産合計		407,409,644,795	384,631,868,068
資産合計		407,409,644,795	384,631,868,068
負債の部			
流動負債			
未払解約金		61,001,000	62,372,000
流動負債合計		61,001,000	62,372,000
負債合計		61,001,000	62,372,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	280,556,875,822	234,028,916,867
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		126,791,767,973	150,540,579,201
元本等合計		407,348,643,795	384,569,496,068
純資産合計		407,348,643,795	384,569,496,068
負債純資産合計		407,409,644,795	384,631,868,068

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。
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。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	319,525,161,815円	280,556,875,822円
同期中追加設定元本額	17,234,672,505円	17,179,528,256円
同期中一部解約元本額	56,202,958,498円	63,707,487,211円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ ファンド	1,898,323,853円	3,042,808,840円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C 年金 >	4,260,130,129円	4,215,730,642円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	342,547,297円	331,588,356円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	1,211,058,264円	1,211,540,212円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,225,792,520円	1,303,541,985円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	319,632,288円	305,504,835円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	655,695,333円	656,719,484円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	422,627,684円	461,916,251円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	120,498,876円	45,079,861円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,473,874,705円	545,649,215円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,430,533円	8,202,426円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 1 0）	11,910円	2,492,699円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 2 0）	16,817円	3,064,251円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 3 0）	21,021円	7,073,170円
クルーズコントロール	6,178,922円	30,350,803円
D I A M 8 資産バランスファ ンド N < D C 年金 >	- 円	186,505円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	4,393,878,779円	3,440,686,045円
D I A M為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド（適 格機関投資家向け）	6,726,037,848円	6,268,094,899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）	5,275,180,057円	4,910,796,362円
外国債券パッシブファンド（適 格機関投資家限定）	944,573,320円	1,256,699,172円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	187,013,136円	162,201,386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)	40,632,697,261円	24,485,399,797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)	2,429,151,703円	1,609,853,495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)	412,833,626円	300,395,823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)	670,391,606円	430,402,346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)	173,044,060円	113,653,304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)	82,652,473円	62,920,414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)	25,251,716,375円	23,349,328,976円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	5,601,128,458円	5,158,609,726円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	9,618,558,546円	8,685,291,057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)	4,445,387,368円	4,087,051,309円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	6,403,552,087円	6,058,907,931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)	2,365,406,764円	1,772,289,243円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	7,175,916,781円	6,291,716,856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)	8,162,884,532円	6,633,814,428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)	42,160,069,986円	31,608,060,489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)	171,480,956円	104,311,492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)	5,648,460,467円	4,753,049,113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)	14,127,138,954円	13,764,142,018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)	250,715,497円	202,690,780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)	22,330,739,151円	19,631,763,420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)	27,490,872,817円	24,240,319,192円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	535,372,475円	45,970,194円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	162,557,659円	219,032,482円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	142,556円	89,231,077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)	24,049,047,712円	21,537,285,269円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	230,013,594円	199,262,536円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	505,084,754円	383,883,760円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	206,435円	221,510円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	127,877円	131,431円
計	280,556,875,822円	234,028,916,867円
2 . 受益権の総数	280,556,875,822口	234,028,916,867口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年2月28日 至 平成25年2月25日	自 平成25年2月26日 至 平成26年2月25日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	945,335,647	282,734,109
合計	945,335,647	282,734,109

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成25年2月25日 現在				平成26年2月25日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	397,188,409	-	397,155,840	32,569	237,312,367	-	237,298,550	13,817
アメリカ・ドル	198,693,369	-	198,675,840	17,529	-	-	-	-
ユーロ	198,495,040	-	198,480,000	15,040	237,312,367	-	237,298,550	13,817
合計	397,188,409	-	397,155,840	32,569	237,312,367	-	237,298,550	13,817

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年2月25日現在	平成26年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.4519円	1.6433円
（1万口当たり純資産額）	（14,519円）	（16,433円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 11/30/15	10,000,000.000	9,994,500.000	
		US T N/B 0.25 12/15/15	11,000,000.000	10,990,870.000	
		US T N/B 0.25 12/31/15	10,000,000.000	9,991,000.000	
		US T N/B 0.375 01/15/16	15,000,000.000	15,015,150.000	
		US T N/B 0.375 06/15/15	20,000,000.000	20,053,000.000	
		US T N/B 0.375 11/15/15	5,000,000.000	5,008,550.000	
		US T N/B 0.5 07/31/17	10,000,000.000	9,850,000.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	12,000,000.000	11,906,640.000	
		US T N/B 0.625 07/15/16	38,000,000.000	38,117,040.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	11,500,000.000	11,294,610.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	19,000,000.000	18,726,020.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	15,000,000.000	14,806,500.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	10,000,000.000	10,113,200.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	7,000,000.000	6,712,300.000	
		US T N/B 1.0 09/30/16	6,000,000.000	6,065,100.000	
		US T N/B 1.0 10/31/16	8,000,000.000	8,082,800.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,000,000.000	5,716,140.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	8,000,000.000	7,773,120.000	
		US T N/B 1.25 08/31/15	30,000,000.000	30,462,600.000	
		US T N/B 1.25 09/30/15	23,000,000.000	23,368,230.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	9,000,000.000	8,721,900.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	10,000,000.000	9,898,000.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	15,500,000.000	14,921,075.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	17,500,000.000	17,448,025.000	
		US T N/B 1.375 11/30/15	17,000,000.000	17,324,020.000	
		US T N/B 1.375 11/30/18	20,000,000.000	19,892,000.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	12,000,000.000	12,050,520.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	10,000,000.000	9,988,200.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,000,000.000	2,791,620.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	10,500,000.000	9,714,075.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	8,000,000.000	7,561,840.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	19,000,000.000	17,571,960.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	20,500,000.000	21,099,625.000	
		US T N/B 1.75 07/31/15	15,000,000.000	15,331,050.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,857,020.000	
		US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.000	15,341,550.000	
US T N/B 1.875 06/30/20	16,000,000.000	15,860,000.000			
US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.000	8,245,600.000			
US T N/B 1.875 09/30/17	10,000,000.000	10,299,600.000			
US T N/B 2.0 02/15/22	12,000,000.000	11,630,520.000			

US T N/B 2.0 02/15/23	16,000,000.000	15,204,960.000	
US T N/B 2.0 04/30/16	18,000,000.000	18,617,220.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	16,000,000.000	15,903,680.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	3,000,000.000	2,922,870.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,862,500.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,009,360.000	
US T N/B 2.25 01/31/15	12,000,000.000	12,235,680.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	10,000,000.000	10,424,200.000	
US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.000	23,517,500.000	
US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.000	20,832,800.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	6,000,000.000	6,264,360.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	2,000,000.000	2,027,500.000	
US T N/B 2.5 03/31/15	30,000,000.000	30,772,200.000	
US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.000	20,557,000.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	8,000,000.000	8,418,720.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	16,000,000.000	15,752,480.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,081,295.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,192,600.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	11,000,000.000	11,623,810.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	6,000,000.000	4,979,280.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	4,000,000.000	4,009,680.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	6,400,000.000	5,298,944.000	
US T N/B 2.75 11/30/16	14,000,000.000	14,804,440.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,656,200.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	13,000,000.000	11,024,520.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.000	21,328,000.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	7,000,000.000	6,138,090.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.000	21,244,400.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	7,900,000.000	7,114,898.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	11,500,000.000	10,295,145.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	18,000,000.000	19,296,540.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,962,780.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	11,000,000.000	11,654,830.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	5,000,000.000	4,510,500.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	12,000,000.000	12,905,520.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.000	26,616,000.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.000	21,449,200.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,345,120.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	15,255,520.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	5,000,000.000	4,900,000.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	15,274,140.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	19,794,240.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	10,500,000.000	11,496,660.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	9,000,000.000	9,891,540.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	10,000,000.000	9,855,400.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	4,800,000.000	4,876,080.000	
US T N/B 3.75 11/15/18	10,000,000.000	11,040,600.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,600,000.000	5,646,760.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,856,240.000	

US T N/B 3.875 08/15/40	4,800,000.000	4,995,744.000	
US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.000	20,750,000.000	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	13,372,440.000	
US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.000	18,871,020.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	2,800,000.000	3,100,328.000	
US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.000	15,894,600.000	
US T N/B 4.25 11/15/17	9,000,000.000	10,035,630.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	4,700,000.000	5,202,289.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	2,500,000.000	2,823,225.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	4,600,000.000	5,193,308.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,000,000.000	3,385,770.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	3,100,000.000	3,501,760.000	
US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.000	17,309,280.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	3,700,000.000	4,261,327.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,500,000.000	1,724,880.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	3,200,000.000	3,682,720.000	
US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.000	19,306,980.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	14,000,000.000	15,601,740.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	6,000,000.000	7,035,900.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	5,500,000.000	6,576,790.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.000	16,933,500.000	
US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.000	18,810,840.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,700,000.000	2,095,250.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,700,000.000	2,105,875.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	3,000,000.000	3,719,520.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,170,606.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,282,202.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	4,000,000.000	5,230,440.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,800,000.000	3,740,940.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,200,000.000	3,022,580.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	5,000,000.000	6,538,650.000	
US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.000	11,504,600.000	
US T N/B 7.5 11/15/16	4,000,000.000	4,742,800.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	8,438,880.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	5,352,160.000	
US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.000	8,758,190.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	5,413,720.000	
アメリカ・ドル 小計	1,372,600,000.000 (140,760,130,000)	1,421,824,056.000 (145,808,056,943)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	6,100,000.000	6,037,170.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	6,100,000.000	5,995,690.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/17	3,800,000.000	3,879,800.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,900,000.000	5,507,650.000	
UK TREASURY 2.0 01/22/16	7,000,000.000	7,182,000.000	

UK TREASURY 2.25 09/07/23	5,950,000.000	5,691,413.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	5,800,000.000	5,494,340.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	900,000.000	904,500.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	4,000,000.000	4,210,800.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	5,000,000.000	5,467,000.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	5,700,000.000	6,238,080.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	5,000,000.000	5,461,600.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	3,100,000.000	3,485,950.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	3,900,000.000	4,331,340.000	
UK TREASURY 4.0 09/07/16	6,600,000.000	7,130,640.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	5,000,000.000	5,624,000.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	5,050,000.000	5,678,725.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	3,350,000.000	3,783,490.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,300,000.000	3,715,470.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	4,200,000.000	4,748,520.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	4,000,000.000	4,580,000.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	4,000,000.000	4,623,200.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,700,000.000	4,340,100.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	5,500,000.000	6,206,750.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	4,500,000.000	5,227,200.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,750,000.000	5,618,300.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	4,800,000.000	5,524,800.000	
UK TREASURY 4.75 09/07/15	1,900,000.000	2,023,120.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,100,000.000	4,879,000.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	4,150,000.000	5,041,420.000	

	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,500,000.000	6,260,100.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	4,450,000.000	5,336,440.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	2,650,000.000	3,540,930.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	3,500,000.000	4,821,950.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	2,000,000.000	2,267,400.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	2,500,000.000	3,140,500.000	
イギリス・ポンド 小計		157,750,000.000 (26,942,122,500)	173,999,388.000 (29,717,355,477)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,900,000.000	5,124,518.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,100,000.000	4,441,858.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	4,800,000.000	5,375,616.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	2,737,889.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,300,000.000	2,096,565.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,800,000.000	1,540,008.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,100,000.000	1,140,755.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	650,000.000	630,129.500	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,000,000.000	3,097,020.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	4,950,000.000	5,164,038.000	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/15	1,800,000.000	1,861,614.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	5,100,000.000	5,526,360.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	5,100,000.000	5,651,616.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,500,000.000	5,055,120.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	7,500,000.000	8,142,975.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	4,100,000.000	4,271,708.000	
オーストラリア・ドル 小計		58,800,000.000 (5,447,232,000)	61,857,789.500 (5,730,505,619)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,598,360.000	
	CANADA 1.0 11/01/15	4,100,000.000	4,097,663.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,700,000.000	1,684,139.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,050,000.000	2,017,671.500	
	CANADA 1.5 03/01/17	2,000,000.000	2,017,740.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,450,000.000	3,188,800.500	

	CANADA 1.5 08/01/15	2,000,000.000	2,013,780.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	3,900,000.000	3,920,202.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,200,000.000	2,195,050.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,050,000.000	3,162,575.500	
	CANADA 2.75 09/01/16	4,000,000.000	4,162,000.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	6,000,000.000	6,204,900.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,750,000.000	2,974,537.500	
	CANADA 3.5 06/01/20	3,000,000.000	3,287,280.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,500,000.000	3,842,650.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	5,500,000.000	6,064,080.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	8,500,000.000	9,060,065.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	3,500,000.000	3,806,985.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	3,900,000.000	4,604,535.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	3,500,000.000	3,896,410.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.000	8,350,240.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	3,400,000.000	4,560,352.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	2,900,000.000	3,968,795.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	3,200,000.000	4,540,064.000	
カナダ・ドル 小計		87,100,000.000 (8,071,557,000)	95,218,875.000 (8,823,933,146)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.75 04/01/42	700,000.000	642,992.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	300,000.000	306,702.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	2,400,000.000	2,484,120.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	800,000.000	781,296.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	300,000.000	308,544.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,100,000.000	2,228,373.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,700,000.000	1,847,764.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	300,000.000	308,505.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,400,000.000	1,487,276.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	2,100,000.000	2,275,854.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	3,000,000.000	3,387,000.000	
シンガポール・ドル 小計		15,100,000.000 (1,226,573,000)	16,058,426.000 (1,304,425,944)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	22,500,000.000	21,114,450.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	13,000,000.000	13,646,360.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	10,600,000.000	11,620,992.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	16,000,000.000	17,778,240.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	12,000,000.000	13,045,560.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	20,500,000.000	23,224,040.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	18,000,000.000	19,001,340.000	
SWEDEN 5.0 12/01/20	12,100,000.000	14,535,730.000		
スウェーデン・クローナ 小計		124,700,000.000 (1,965,272,000)	133,966,712.000 (2,111,315,381)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	7,500,000.000	7,384,875.000	
	DENMARK 2.5 11/15/16	2,000,000.000	2,125,940.000	

	DENMARK 3.0 11/15/21	25,500,000.000	28,580,400.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	24,000,000.000	25,620,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	14,100,000.000	15,998,988.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	23,600,000.000	27,753,600.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	30,200,000.000	41,571,810.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	8,000,000.000	12,242,400.000	
デンマーク・クローネ	小計	134,900,000.000 (2,545,563,000)	161,278,013.000 (3,043,316,105)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 2.0 05/24/23	10,600,000.000	9,914,074.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	14,000,000.000	15,114,400.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	14,600,000.000	15,731,500.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	13,500,000.000	15,032,925.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	18,000,000.000	18,774,000.000	
ノルウェー・クローネ	小計	70,700,000.000 (1,201,193,000)	74,566,899.000 (1,266,891,614)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.5 07/25/18	3,000,000.000	2,858,100.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	2,800,000.000	2,817,640.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,400,000.000	3,291,370.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	10,300,000.000	10,701,185.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	7,000,000.000	7,274,050.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.000	12,723,600.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	9,000,000.000	9,603,450.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	7,000,000.000	7,212,450.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.000	9,728,550.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.000	3,288,450.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	7,400,000.000	8,133,488.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	5,500,000.000	6,028,825.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	11,400,000.000	11,960,880.000	
ポーランド・ズロチ	小計	90,800,000.000 (3,069,040,000)	95,622,038.000 (3,232,024,884)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,725,050.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,700,000.000	5,162,718.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.000	7,075,740.000	
	MALAYSIA 3.835 08/12/15	10,000,000.000	10,108,200.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	2,000,000.000	1,857,920.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,006,600.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	10,000,000.000	10,212,100.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.000	7,162,400.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	9,000,000.000	9,229,050.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.000	2,141,880.000	
マレーシア・リンギット	小計	61,700,000.000 (1,929,976,000)	61,681,658.000 (1,929,402,262)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	20,000,000.000	25,727,800.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.000	70,612,850.000	
	MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	19,500,000.000	20,479,290.000	

	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	22,000,000.000	22,866,360.000	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/15/16	50,000,000.000	53,913,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	20,703,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.000	77,299,600.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	58,000,000.000	65,277,260.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/17/15	30,000,000.000	32,095,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	52,000,000.000	59,733,440.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	29,000,000.000	32,556,270.000	
	メキシコ・ペソ 小計	425,500,000.000 (3,284,860,000)	481,264,870.000 (3,715,364,796)	
ユーロ	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,500,000.000	1,469,250.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	500,000.000	524,550.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	800,000.000	762,912.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	800,000.000	852,328.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,700,000.000	1,841,610.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	2,300,000.000	2,594,262.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	2,400,000.000	2,510,400.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	3,500,000.000	3,986,500.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	2,100,000.000	2,412,480.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	1,000,000.000	1,237,220.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	3,500,000.000	4,063,500.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	4,000,000.000	4,376,000.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,000,000.000	3,700,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	3,000,000.000	3,396,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	3,700,000.000	4,321,045.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	2,750,000.000	3,174,875.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,500,000.000	3,177,750.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,600,000.000	2,306,320.000	
	BELGIUM 1.25 06/22/18	2,500,000.000	2,535,625.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	3,300,000.000	3,310,494.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.000	3,153,390.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	3,000,000.000	3,277,920.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	4,000,000.000	4,300,120.000	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	2,000,000.000	2,190,300.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,000,000.000	1,073,310.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	4,000,000.000	4,225,440.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	4,300,000.000	4,896,023.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	3,700,000.000	4,093,310.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	3,000,000.000	3,381,720.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	2,650,000.000	3,025,611.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	4,500,000.000	5,199,615.000	

BELGIUM 4.0 03/28/32	2,000,000.000	2,269,500.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	3,000,000.000	3,532,710.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	3,900,000.000	4,578,639.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	3,100,000.000	3,638,563.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,900,000.000	2,273,103.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	4,400,000.000	5,673,756.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	4,100,000.000	5,404,087.000	
BELGIUM 5.5 09/28/17	3,000,000.000	3,513,450.000	
BUNDESOBL 0.5 02/23/18	5,700,000.000	5,717,670.000	
BUNDESOBL 0.5 10/13/17	2,500,000.000	2,516,300.000	
BUNDESOBL 1.0 10/12/18	5,500,000.000	5,604,830.000	
BUNDESOBL 2.75 04/08/16	8,500,000.000	8,975,150.000	
BUNDESSCHAT 12/11/15	14,000,000.000	13,973,400.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	4,500,000.000	4,500,585.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	4,500,000.000	4,482,000.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	4,000,000.000	4,028,360.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	6,300,000.000	6,489,441.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	3,500,000.000	3,693,550.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	4,600,000.000	4,766,612.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	5,000,000.000	5,408,000.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	4,500,000.000	4,846,950.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	4,200,000.000	4,605,510.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	4,000,000.000	3,946,400.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	5,500,000.000	6,206,750.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	5,000,000.000	5,696,150.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	11,600,000.000	12,094,856.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	5,500,000.000	6,319,500.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	3,600,000.000	4,106,520.000	
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	13,000,000.000	13,818,740.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	6,500,000.000	7,455,825.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	6,000,000.000	6,611,580.000	

DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	6,000,000.000	6,907,980.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	11,000,000.000	12,538,130.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	5,800,000.000	7,281,320.000	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	9,000,000.000	9,815,850.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	7,000,000.000	7,930,860.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	6,000,000.000	6,975,480.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,400,000.000	4,483,240.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,700,000.000	3,559,950.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,000,000.000	6,816,000.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,000,000.000	5,689,200.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	4,100,000.000	5,887,600.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,600,000.000	5,114,160.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	2,600,000.000	3,701,360.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	2,300,000.000	3,510,950.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	2,700,000.000	4,109,400.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,200,000.000	1,169,280.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	1,300,000.000	1,290,640.000	
FINLAND 1.75 04/15/16	2,500,000.000	2,583,500.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	700,000.000	690,375.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	800,000.000	832,400.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,550,000.000	1,748,322.500	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,500,000.000	1,709,250.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	2,400,000.000	2,684,400.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,700,000.000	2,017,645.000	
FINLAND 4.25 07/04/15	700,000.000	738,612.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	1,400,000.000	1,645,280.000	
FR TREASURY 1.0 07/25/17	3,000,000.000	3,046,260.000	
FR TREASURY 2.5 07/25/16	6,700,000.000	7,054,631.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	3,000,000.000	4,643,250.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	8,000,000.000	8,307,040.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	6,000,000.000	6,053,940.000	

FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,700,000.000	2,632,824.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,700,000.000	2,694,843.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	4,820,790.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,500,000.000	10,148,850.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,500,000.000	4,536,090.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	10,000,000.000	10,912,000.000	
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	15,500,000.000	16,220,750.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	15,500,000.000	16,501,145.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	600,000.000	597,252.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	9,000,000.000	10,022,580.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	9,000,000.000	10,176,030.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	7,500,000.000	8,257,500.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	12,900,000.000	14,232,441.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	8,500,000.000	9,768,200.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,500,000.000	7,424,560.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.000	10,206,720.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	4,750,000.000	5,475,800.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,900,000.000	3,338,190.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	5,900,000.000	6,761,754.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	9,500,000.000	11,040,995.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.000	9,058,000.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.000	9,232,800.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	10,800,000.000	12,819,492.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,800,000.000	7,181,850.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,100,000.000	6,449,613.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	9,000,000.000	10,111,770.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	6,700,000.000	8,959,977.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	6,100,000.000	8,563,241.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	4,500,000.000	6,139,800.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.000	4,214,700.000	
IRISH 3.9 03/20/23	900,000.000	970,551.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,700,000.000	1,917,430.000	
IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.000	3,389,040.000	
IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.000	3,390,750.000	

IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.000	3,252,330.000	
IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.000	2,323,500.000	
IRISH 5.4 03/13/25	3,700,000.000	4,385,795.000	
IRISH 5.5 10/18/17	1,500,000.000	1,727,505.000	
IRISH 5.9 10/18/19	1,500,000.000	1,810,125.000	
ITALY BTPS 2.75 12/01/15	700,000.000	723,443.000	
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	13,000,000.000	13,340,210.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	7,000,000.000	7,390,250.000	
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	10,000,000.000	10,573,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.000	15,637,800.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.000	14,858,200.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	7,500,000.000	7,904,250.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	11,900,000.000	12,774,650.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	6,100,000.000	5,974,950.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	5,400,000.000	5,822,820.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	2,400,000.000	2,479,944.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	2,900,000.000	3,178,400.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	8,000,000.000	8,745,600.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	7,300,000.000	8,000,070.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	13,300,000.000	14,594,090.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,981,950.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,500,000.000	8,320,500.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,800,000.000	4,091,954.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,900,000.000	4,174,560.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,500,000.000	3,792,145.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	7,000,000.000	7,723,800.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,000,000.000	7,732,900.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	7,000,000.000	7,818,300.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,600,000.000	3,885,660.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,200,000.000	2,290,662.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,500,000.000	5,076,450.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	6,100,000.000	6,803,330.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	5,300,000.000	5,804,560.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,650,000.000	5,067,570.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	5,250,000.000	5,693,625.000	

ITALY BTPS 5.25 08/01/17	11,200,000.000	12,513,760.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	7,000,000.000	7,917,700.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	6,000,000.000	6,963,300.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	4,400,000.000	5,104,616.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,800,000.000	4,537,580.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	7,200,000.000	8,791,920.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	7,000,000.000	8,857,100.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	3,500,000.000	4,690,000.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.000	5,800,000.000	
NETHERLANDS 0.75 04/15/15	1,000,000.000	1,006,950.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,100,000.000	2,070,768.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	4,500,000.000	4,686,390.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	4,900,000.000	5,202,771.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,700,000.000	2,647,431.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.000	6,253,980.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,000,000.000	5,610,000.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	4,000,000.000	4,547,600.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,600,000.000	4,332,672.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,100,000.000	3,806,490.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/16	4,000,000.000	4,354,400.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	7,700,000.000	8,770,300.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	5,000,000.000	5,785,000.000	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.000	5,671,000.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,900,000.000	3,975,610.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	3,000,000.000	4,411,200.000	
SPAIN 2.75 03/31/15	2,000,000.000	2,047,500.000	
SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.000	6,163,800.000	
SPAIN 3.15 01/31/16	7,000,000.000	7,291,830.000	
SPAIN 3.25 04/30/16	7,000,000.000	7,320,180.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	5,700,000.000	6,118,152.000	

	SPAIN 3.8 01/31/17	6,000,000.000	6,411,000.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	4,500,000.000	4,858,875.000	
	SPAIN 4.0 07/30/15	7,000,000.000	7,329,350.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	5,500,000.000	5,983,450.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	3,800,000.000	3,732,816.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	5,000,000.000	5,381,800.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,500,000.000	6,048,900.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	4,800,000.000	4,960,848.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,000,000.000	4,302,600.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	3,000,000.000	3,293,250.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	5,500,000.000	6,138,550.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,500,000.000	3,813,075.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,900,000.000	3,016,290.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	6,200,000.000	6,870,530.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	4,500,000.000	5,062,050.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	3,300,000.000	3,565,650.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,000,000.000	2,263,400.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,000,000.000	1,101,230.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	4,500,000.000	5,202,225.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	5,700,000.000	6,644,775.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	6,000,000.000	6,759,960.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,600,000.000	4,353,120.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,800,000.000	5,702,400.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	3,100,000.000	3,746,970.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	4,300,000.000	5,261,222.000	
	ユーロ 小計	1,057,700,000.000 (148,966,468,000)	1,184,632,734.500 (166,843,674,327)	
	南アフリカ・ランド			
	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	36,000,000.000	41,211,720.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	30,000,000.000	22,008,600.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	17,000,000.000	12,522,200.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	42,000,000.000	38,198,580.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	14,000,000.000	13,319,040.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	45,500,000.000	45,189,690.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	9,000,000.000	8,553,690.000	
	南アフリカ・ランド 小計	193,500,000.000 (1,836,315,000)	181,003,520.000 (1,717,723,405)	
	国債証券 合計	347,246,301,500 (347,246,301,500)	375,243,989,904 (375,243,989,904)	
	合計	347,246,301,500 (347,246,301,500)	375,243,989,904 (375,243,989,904)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 126銘柄	37.91%	38.86%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	7.73%	7.92%
オーストラリア・ドル	国債証券 16銘柄	1.49%	1.53%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	2.29%	2.35%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.34%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.55%	0.56%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.79%	0.81%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.33%	0.34%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.84%	0.86%
マレーシア・リンギット	国債証券 10銘柄	0.50%	0.51%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.97%	0.99%
ユーロ	国債証券 217銘柄	43.38%	44.46%
南アフリカ・ランド	国債証券 7銘柄	0.45%	0.46%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	3,334,359,236円
負債総額	124,111円
純資産総額（ - ）	3,334,235,125円
発行済数量	2,961,867,263口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1257円

D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	6,277,891,101円
負債総額	592,880円
純資産総額（ - ）	6,277,298,221円
発行済数量	5,854,947,880口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0721円

D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	3,766,421,925円
負債総額	2,100,915円
純資産総額（ - ）	3,764,321,010円
発行済数量	3,746,425,039口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0048円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	320,350,547,995円
負債総額	613,760,621円
純資産総額（ - ）	319,736,787,374円
発行済数量	189,494,620,498口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6873円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	456,982,845,195円
負債総額	13,071,255,000円
純資産総額（ - ）	443,911,590,195円
発行済数量	371,500,803,767口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1949円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	311,738,256,738円
負債総額	766,159,555円
純資産総額(-)	310,972,097,183円
発行済数量	135,007,944,528口
1口当たり純資産額(/)	2.3034円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	384,551,345,315円
負債総額	220,350,924円
純資産総額(-)	384,330,994,391円
発行済数量	234,163,804,391口
1口当たり純資産額(/)	1.6413円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

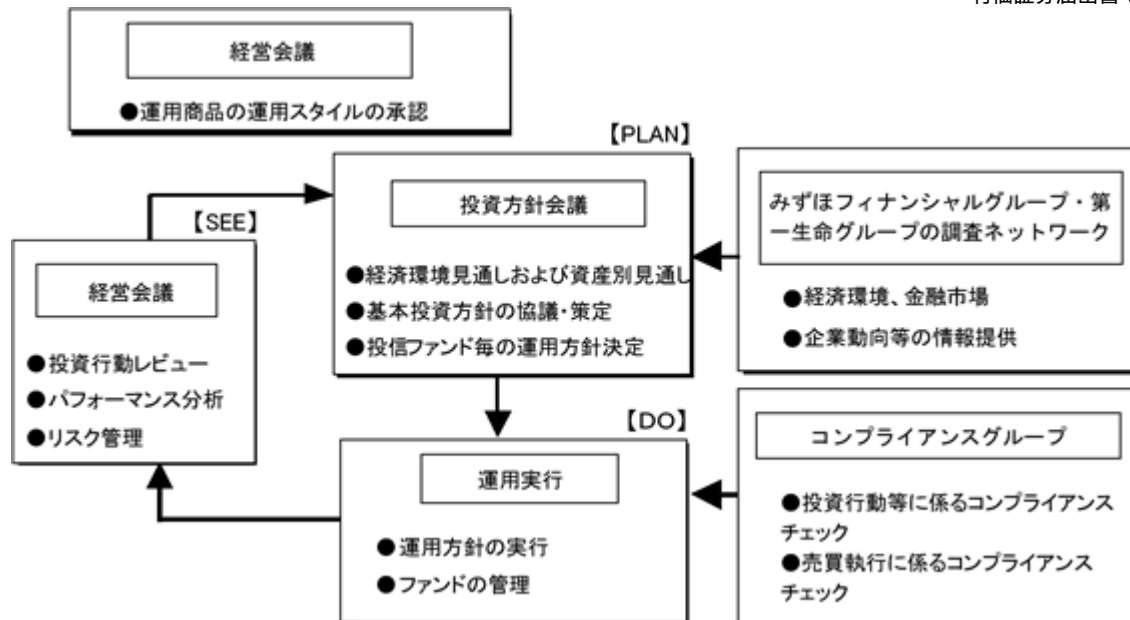
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は315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	8	21,903,771,605
追加型株式投資信託	297	4,966,954,572,956
単位型公社債投資信託	9	89,877,531,429
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	102,533,373
合計	315	5,078,838,409,363

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,520,748	10,806,745
金銭の信託	6,548,577	10,214,440
前払費用	25,744	69,143
未収委託者報酬	2,780,527	3,073,481
未収運用受託報酬	1,167,998	1,173,744
未収投資助言報酬	2 241,851	2 245,819
未収収益	212,226	244,974
繰延税金資産	344,793	426,229
その他	22,264	25,354
流動資産計	23,864,733	26,279,933
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 167,433	1 142,820
車両運搬具	1 4,752	1 2,770
器具備品	1 188,367	1 231,732
建設仮勘定	109,529	1,207
無形固定資産		
商標権	1 383	1 289
ソフトウェア	1 1,101,685	1 1,261,335
ソフトウェア仮勘定	152,513	68,920
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 371	1 292
投資その他の資産		
投資有価証券	3,982,258	4,002,042
関係会社株式	450,882	400,579
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	590,822	661,777
長期差入保証金	731,197	731,564
その他	90,282	89,047
固定資産計	5,714,444	5,718,557
資産合計	29,579,177	31,998,491

（単位：千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	132,805	571,153
未払金	1,460,128	1,547,527
未払収益分配金	670	48
未払償還金	86,391	84,932
未払手数料	1,088,348	1,195,452
その他未払金	284,718	267,093
未払費用	2 1,105,512	2 1,306,837
未払法人税等	1,195,056	1,299,068
未払消費税等	92,354	116,872
賞与引当金	574,646	724,974
その他	-	100,000
流動負債計	4,560,503	5,666,434
固定負債		
退職給付引当金	680,768	802,603
役員退職慰労引当金	56,690	98,510
固定負債計	737,458	901,113
負債合計	5,297,962	6,567,548
（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	19,716,594	20,898,697
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,463,300	3,945,403
株主資本計	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	136,143	103,768
評価・換算差額等計	136,143	103,768
純資産合計	24,281,215	25,430,943
負債・純資産合計	29,579,177	31,998,491

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)		第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	23,208,602		23,374,427	
運用受託報酬	4,966,992		5,374,163	
投資助言報酬	943,057		885,923	
その他営業収益	697,063		715,164	
営業収益計		29,815,715		30,349,678
営業費用				
支払手数料	10,154,958		10,846,568	
広告宣伝費	164,286		177,553	
公告費	-		3,769	
調査費	4,590,302		4,546,312	
調査費	2,888,013		3,001,788	
委託調査費	1,702,289		1,544,523	
委託計算費	335,754		341,978	
営業雑経費	496,565		456,677	
通信費	26,941		25,513	
印刷費	399,066		374,775	
協会費	25,014		25,492	
諸会費	41		42	
支払販売手数料	45,500		30,854	
営業費用計		15,741,867		16,372,860
一般管理費				
給料	4,630,102		4,870,759	
役員報酬	245,224		242,014	
給料・手当	3,824,122		4,035,751	
賞与	560,755		592,994	
交際費	35,987		36,212	
寄付金	3,156		2,693	
旅費交通費	213,642		187,653	
租税公課	84,346		95,064	
不動産賃借料	656,463		675,811	
退職給付費用	164,627		173,065	
固定資産減価償却費	475,556		524,750	
福利厚生費	24,887		26,642	
修繕費	6,721		6,018	
賞与引当金繰入	574,646		724,974	
役員退職慰労引当金繰入	30,048		47,820	
役員退職金	27,503		7,200	
機器リース料	1,510		35	
事務委託費	323,740		224,066	
消耗品費	58,739		60,044	
器具備品費	2,889		2,065	
諸経費	114,695		159,247	

一般管理費計		7,429,267		7,824,126
営業利益		6,644,580		6,152,691

（単位：千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）		第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	
	営業外収益			
受取配当金	61,720		10,223	
受取利息	3,921		3,554	
時効成立分配金	11,383		2,080	
為替差益	1,660		-	
金銭の信託運用益	-		168,444	
雑収入	5,992		4,957	
営業外収益計		84,678		189,260
営業外費用				
為替差損	-		6,549	
時効成立後支払分配金	36		-	
金銭の信託運用損	417,812		-	
雑損失	1,152		-	
営業外費用計		419,001		6,549
経常利益		6,310,257		6,335,402
特別利益				
ゴルフ会員権売却益	1,959		-	
特別利益計		1,959		-
特別損失				
固定資産除却損	1 36,415		1 1,752	
固定資産売却損	381		115	
関係会社株式評価損	338,244		-	
特別損失計		375,042		1,868
税引前当期純利益		5,937,173		6,333,533
法人税、住民税及び事業税		2,582,251		2,573,893
法人税等調整額		56,997		134,463
法人税等合計		2,525,253		2,439,430
当期純利益		3,411,920		3,894,102

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期	第28期
	(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	13,430,000	15,630,000
当期変動額	2,200,000	700,000
当期末残高	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	4,459,380	3,463,300
当期変動額		
剰余金の配当	2,208,000	2,712,000
別途積立金の積立	2,200,000	700,000
当期純利益	3,411,920	3,894,102
当期末残高	3,463,300	3,945,403
利益剰余金合計		
当期首残高	18,512,674	19,716,594
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	19,716,594	20,898,697
株主資本合計		
当期首残高	22,941,152	24,145,072
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	24,145,072	25,327,175

評価・換算差額等	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高	216,534	136,143
	当期変動額（純額）	80,390	32,375
	当期末残高	136,143	103,768
純資産合計			
	当期首残高	23,157,686	24,281,215
	当期変動額	1,123,529	1,149,727
	当期末残高	24,281,215	25,430,943

重要な会計方針

項目	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

平成25年4月1日以後に開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
建物	513,080	539,393
車両運搬具	171	2,152
器具備品	462,449	565,794
商標権	2,555	649
ソフトウェア	961,584	1,071,133
電話施設利用権	1,225	1,304

2. 関係会社項目

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

(千円)

		第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	238,121	241,190
流動負債	未払費用	292,536	334,888

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
建物	1,892	-
器具備品	18,917	-
ソフトウェア	15,606	1,752

(株主資本等変動計算書関係)

第27期(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成25年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(リース取引関係)

1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額
該当事項はありません。

未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
支払リース料	588	-
減価償却費相当額	543	-
支払利息相当額	1	-

減価償却費相当額の算定方法

該当事項はありません。

利息相当額の算定方法

該当事項はありません。

2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第27期（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,520,748	12,520,748	-
(2) 金銭の信託	6,548,577	6,548,577	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	370,636	370,636	-
資産計	19,439,962	19,439,962	-
(1) 未払法人税等	1,195,056	1,195,056	-
負債計	1,195,056	1,195,056	-

第28期（平成25年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
長期差入保証金	731,197	731,564

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期(平成24年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,520,524	-	-	-
合計	12,520,524	-	-	-

第28期(平成25年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第27期及び第28期の貸借対照表計上額2,119,074千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	359,540	146,101	213,438
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,482	3,000	482
小計	363,022	149,101	213,920
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,614	10,000	2,386
小計	7,614	10,000	2,386
合計	370,636	159,101	211,534

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

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第27期（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	6,548,577	495,939

第28期（平成25年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

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

(千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(1) 退職給付債務	740,560	936,125
(2) 未認識数理計算上の差異	59,792	133,522
退職給付引当金	680,768	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
(1) 勤務費用	102,728	102,125
(2) 利息費用	9,549	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	13,388	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	38,960	41,923
(5) その他	-	314
退職給付費用	164,627	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1.5%	1.5%

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第27期	第28期
	(平成24年3月31日現在)	(平成25年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	87,682	107,022
未払事業所税	5,792	5,986
賞与引当金	218,423	275,562
未払法定福利費	24,791	34,566
未払確定拠出年金掛金	2,607	3,091
減価償却超過額（一括償却資産）	5,496	5,192
減価償却超過額	150,369	159,737
繰延資産償却超過額（税法上）	47,261	27,873
退職給付引当金	243,845	286,796
役員退職慰労引当金	20,204	35,109
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	4,410	22,907
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	678	109
繰延税金資産合計	935,615	1,088,007
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	-	-
差引繰延税金資産の純額	935,615	1,088,007

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,208,602	5,910,049	697,063	29,815,715

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その 他の 関係 会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務 1名, 出向 2名, 転籍 3名	資産運用 の助言	資産運用 の 助言の顧 問 料の受入	687,972	未収投資 助言報酬	177,282

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	523,845	未払 費用	158,645
	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	203,092	未払 費用	75,484

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の引出 (純額) 受取利息	1,548,354 91,135 104	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	122,786 433,779 -
	株式会社 みずほ コーポ レート銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	450,766 392,267 3,654	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	83,446 11,440,025 -
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	237,031 15,140	未払 費用 未払 費用	127,757 6,373
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	1,000,000 5,087	金銭の 信託	6,548,577

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	1,661,638 191,782 106	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	142,323 625,561 -
	株式会社 みずほ コーポ レート銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の引出 (純額) 受取利息	460,605 1,912,442 3,210	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	100,875 9,527,582 61
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	259,435 11,140	未払 費用 未払 費用	132,250 5,848
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	3,500,000 5,908	金銭の 信託	10,214,440

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
1株当たり純資産額	1,011,717円32銭	1,059,622円64銭
1株当たり当期純利益金額	142,163円33銭	162,254円29銭

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,422,331
金銭の信託		9,988,674
前払費用		81,570
未収委託者報酬		3,539,476
未収運用受託報酬		1,927,231
未収投資助言報酬		233,557
未収収益		265,944
繰延税金資産		365,930
その他		77,287
	流動資産計	25,902,003
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	131,728
車両運搬具	1	2,193
器具備品	1	192,157
建設仮勘定		6,839
無形固定資産		
商標権	1	242
ソフトウェア	1	1,141,508
ソフトウェア仮勘定		292,572
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	258
投資その他の資産		
投資有価証券		409,446
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		675,426
差入保証金		731,197
その他		87,266
	固定資産計	5,797,060
資産合計		31,699,064

（単位：千円）

	第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	915,630
未払金	1,777,659
未払収益分配金	48
未払償還金	51,109
未払手数料	1,403,573
その他未払金	322,928
未払費用	1,320,067
未払法人税等	1,362,916
未払消費税等	149,912
賞与引当金	592,328
	流動負債計
	6,118,515
固定負債	
退職給付引当金	870,468
役員退職慰労引当金	121,100
	固定負債計
	991,568
負債合計	7,110,084
（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	20,051,026
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	19,927,733
別途積立金	17,130,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,297,733
	株主資本計
	24,479,504
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	109,475
	評価・換算差額等計
	109,475
純資産合計	24,588,979
負債・純資産合計	31,699,064

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,617,519	
運用受託報酬	3,032,543	
投資助言報酬	455,315	
その他営業収益	409,599	
	営業収益計	16,514,977
営業費用		
支払手数料	5,584,176	
広告宣伝費	113,543	
調査費	2,650,938	
調査費	1,833,878	
委託調査費	817,060	
委託計算費	178,138	
営業雑経費	239,279	
通信費	16,255	
印刷費	206,531	
協会費	12,524	
諸会費	15	
支払販売手数料	3,952	
	営業費用計	8,766,076
一般管理費		
給料	2,201,917	
役員報酬	125,877	
給料・手当	2,076,040	
交際費	17,522	
寄付金	2,515	
旅費交通費	97,277	
租税公課	53,858	
不動産賃借料	341,829	
退職給付費用	110,074	
固定資産減価償却費	1 279,285	
福利厚生費	11,941	
修繕費	5,939	
賞与引当金繰入額	592,328	
役員退職慰労引当金繰入額	26,388	
役員退職慰労金	528	
機器リース料	23	
事務委託費	105,422	
事務用消耗品費	32,711	
器具備品費	2,550	
諸経費	56,566	
	一般管理費計	3,938,680
営業利益		3,810,221

（単位：千円）

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日至平成25年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,371	
受取利息	1,297	
時効成立分配金・償還金	33,823	
雑収入	3,864	
		営業外収益計 45,357
営業外費用		
為替差損	5,352	
金銭の信託運用損	205,313	
		営業外費用計 210,666
経常利益		3,644,913
特別損失		
固定資産除却損	22	
固定資産売却損	1,448	
		特別損失計 1,470
税引前中間純利益		3,643,442
法人税、住民税及び事業税		1,351,622
法人税等調整額		43,490
法人税等合計		1,395,112
中間純利益		2,248,329

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	16,330,000
	当中間期変動額	800,000
	当中間期末残高	17,130,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	3,945,403
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	3,096,000
	別途積立金の積立	800,000
	中間純利益	2,248,329
	当中間期末残高	2,297,733
	利益剰余金合計	
	当期首残高	20,898,697
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	20,051,026
	株主資本合計	
	当期首残高	25,327,175
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	24,479,504
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	103,768
	当中間期変動額（純額）	5,706
	当中間期末残高	109,475
純資産合計		
	当期首残高	25,430,943
	当中間期変動額	841,963
	当中間期末残高	24,588,979

重要な会計方針

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異及び過去勤務債務の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務債務：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)
1. 固定資産の減価償却累計額	建物 ... 550,694千円
	車両運搬具 ... 2,730千円
	器具備品 ... 610,752千円
	商標権 ... 696千円
	ソフトウェア ... 1,285,419千円
	電信電話専用施設利用権 ... 1,338千円

(中間損益計算書関係)

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1. 減価償却実施額	有形固定資産 ... 64,676千円
	無形固定資産 ... 214,609千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	9,422,331	9,422,331	-
(2) 金銭の信託	9,988,674	9,988,674	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	329,200	329,200	-
資産計	19,740,206	19,740,206	-
(1) 未払法人税等	1,362,916	1,362,916	-
負債計	1,362,916	1,362,916	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,119,074
差入保証金	731,197

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

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

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

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
2. 子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	315,920	146,101	169,818
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,263	3,000	1,263
小計	320,184	149,101	171,082
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	9,016	10,000	984
小計	9,016	10,000	984
合計	329,200	159,101	170,098

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

（金銭の信託関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

1. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	12,617,519	3,487,859	409,599	16,514,977

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,024,540円	82銭
1株当たり中間純利益金額	93,680円	39銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
中間純利益	2,248,329千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,248,329千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成25年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 [*] (単位:百万円)	事 業 の 内 容
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。

* 平成25年3月末日現在

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)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況 には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されません。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
（委託会社の略称： D I A M 、当ファンドの略称： D C 3 0、D C 5 0、D C 7 0）

独立監査人の監査報告書

平成25年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注1) 上記は、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。

(注2) 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年4月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス30インデックスファンドの平成25年2月26日から平成26年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス30インデックスファンドの平成26年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年4月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 涉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス50インデックスファンドの平成25年2月26日から平成26年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス50インデックスファンドの平成26年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年4月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 涉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス70インデックスファンドの平成25年2月26日から平成26年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C バランス70インデックスファンドの平成26年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25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25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注1）上記は、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。

（注2）中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。