

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成29年5月26日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 西 惠正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	三木谷 正直
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	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
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】</b>	各ファンドにつき、 1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

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

（以上を総称して、または個別に「DIAM DC 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、「DIAM DC バランス30インデックスファンド」を「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」を「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」を「DC 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。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下、「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

( 5 ) 【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

( 7 ) 【申込期間】

継続申込期間：平成29年5月27日から平成30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：0120-104-694（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  
する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を  
行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

**(10) 【払込取扱場所】**

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

**(11) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

**(12) 【その他】**

お申込みに際しては、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す。

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

### (参考)

#### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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。

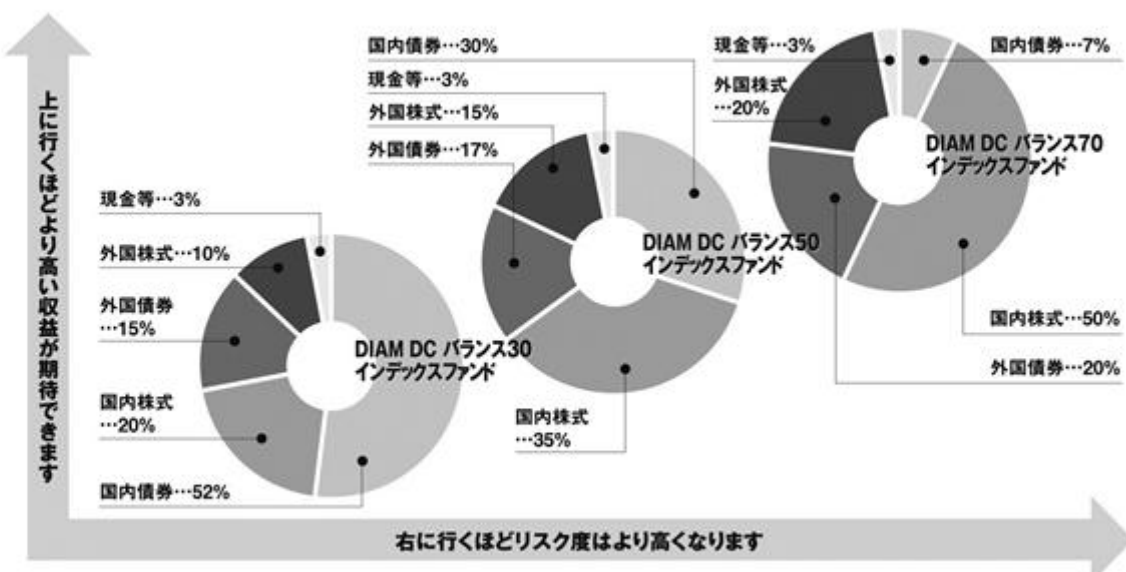
#### 2

##### ●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

D I A M D C バランス30インデックスファンド

D I A M D C バランス50インデックスファンド

D I A M D C バランス70インデックスファンド

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	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 ( ) 資産複合	特殊型
	内外		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。



## 属性区分表

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	年1回	グローバル (日本を含む)			
大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
債券 一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
公債 社債	年6回 (隔月)	欧州			
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア オセアニア			TOPIX
不動産投信	日々	中南米		なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))	その他 ( )	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		その他 (MSCIコクサ イ・インデック ス、NOMURA -BPI総合、シ ティ世界国債イン デックス)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

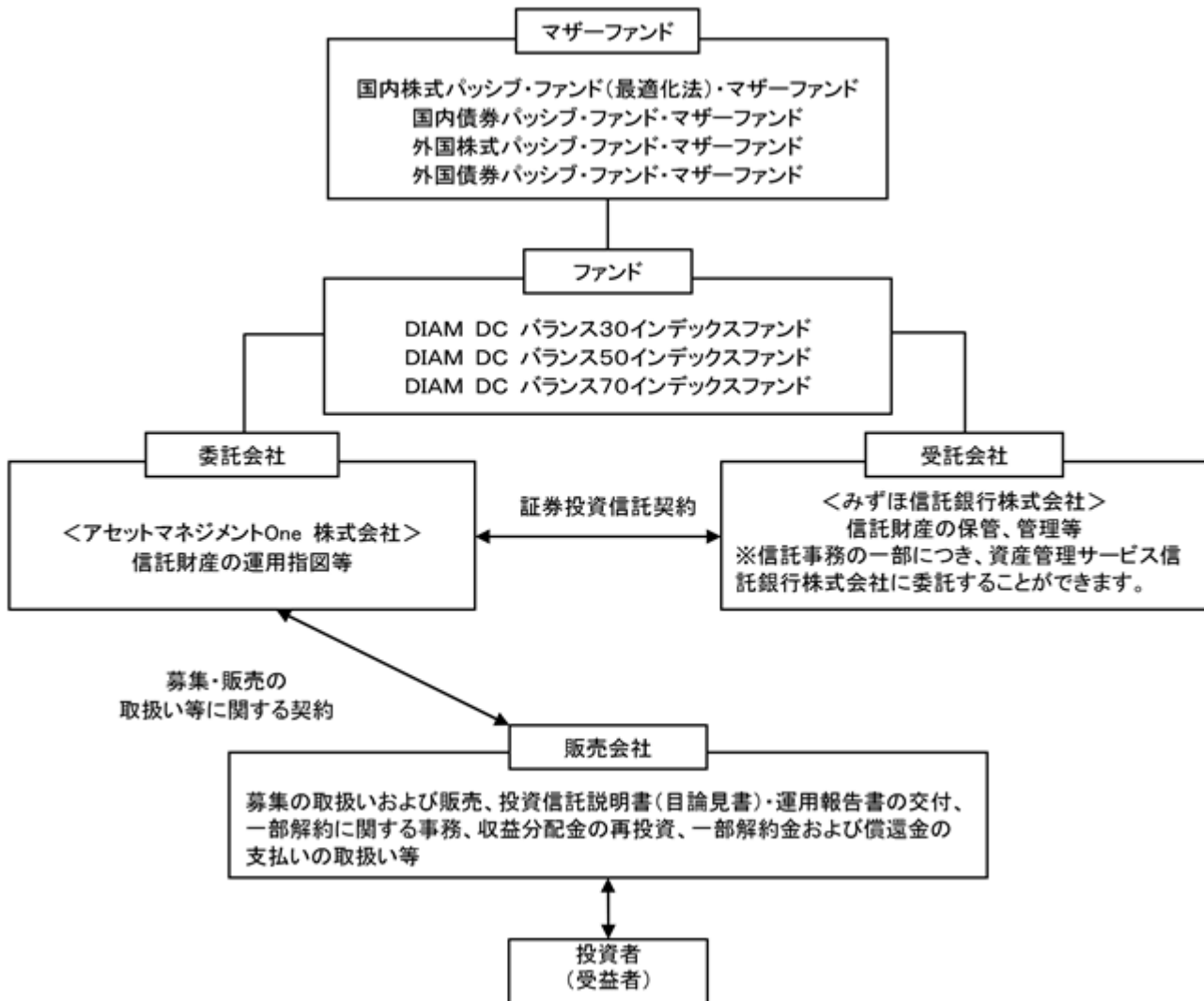
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、債券)資産配 分固定型))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(株式、債券)を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券)資産配分固定型))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

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

## (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】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

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

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

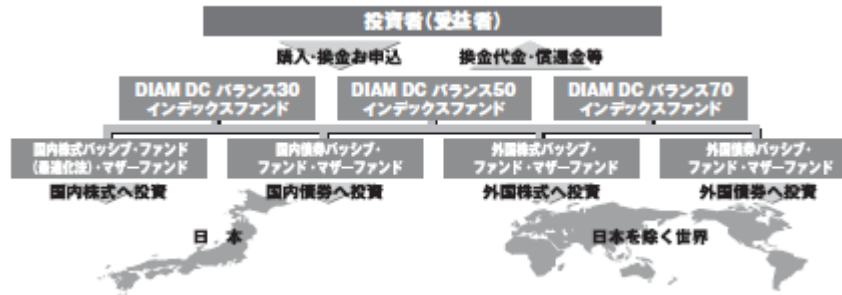
- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、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：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

#### 資本金の額

20億円（平成29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ルユ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年 1月 1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月 1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

（平成29年2月28日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## &lt;基本方針&gt;

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。

## &lt;投資対象&gt;

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。

## &lt;投資態度&gt;

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

## (2)「DIAM DC バランス30インデックスファンド」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が40%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が35%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

## 「DIAM DC バランス50インデックスファンド」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が60%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が45%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

## 「DIAM DC バランス70インデックスファンド」

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(TOPIX)(配当込み)<sup>(注1)</sup>、国内債券についてはNOMURA-BPI総合<sup>(注2)</sup>、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)<sup>(注3)</sup>、外国債券についてはシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)<sup>(注4)</sup>、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

(注1) TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

(3)各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を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。

対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成インデックスに連動させるため、以下の対応を行います。

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

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

## (2)【投資対象】

### 1.投資の対象とする資産（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形



## 2. 有価証券の指図範囲(約款第17条第1項)

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

- (1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- (2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (5) 株券または新株引受権証券
- (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せん。)
- (21) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- (23) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- (24) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

(26)外国の者に対する権利で(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)

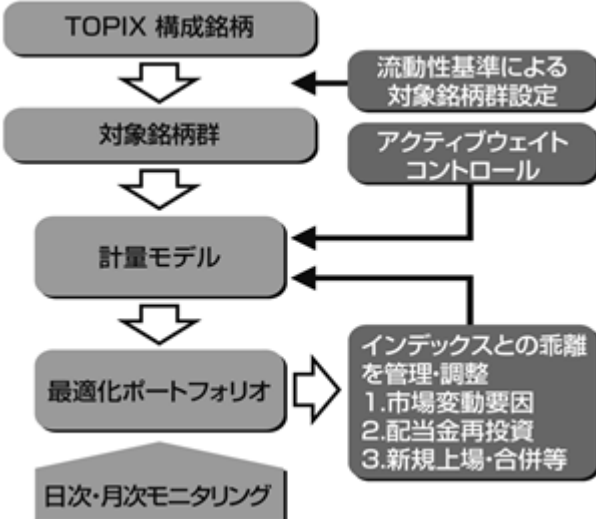
委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- 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)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

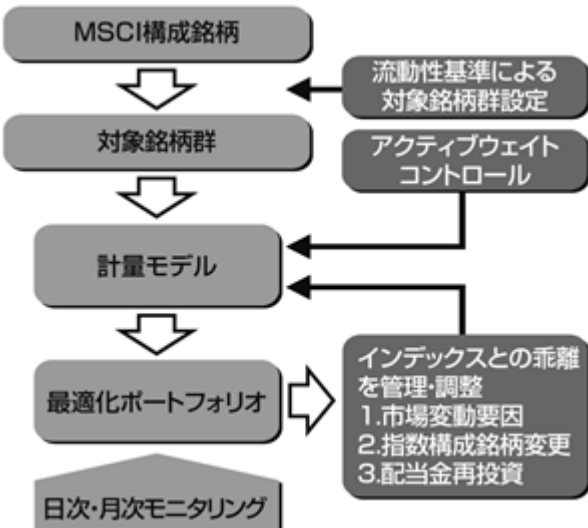
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 最適化法によるポートフォリオ構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

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。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul> 
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

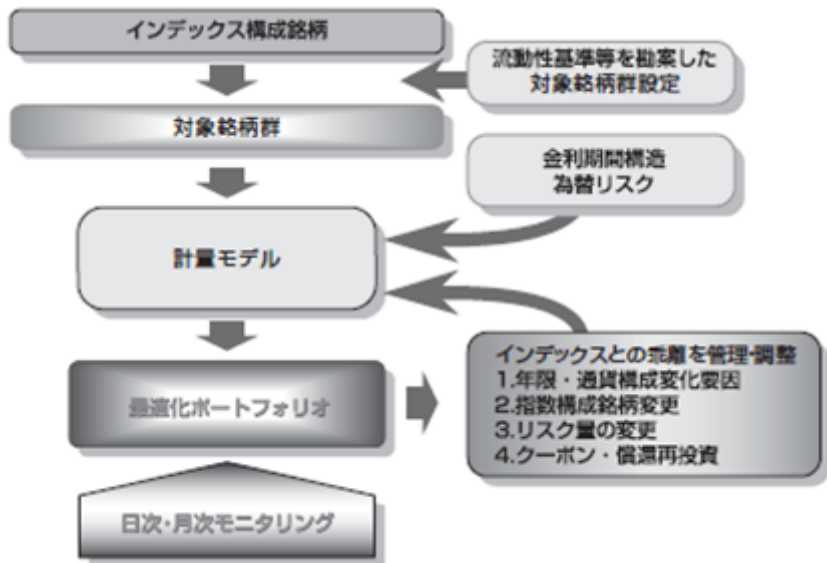
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</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"> <li>・ 年限構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン、償還再投資</li> </ul>
主な投資制限	<p>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	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</li> <li>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。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul> </li> </ol> 
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> </ol>



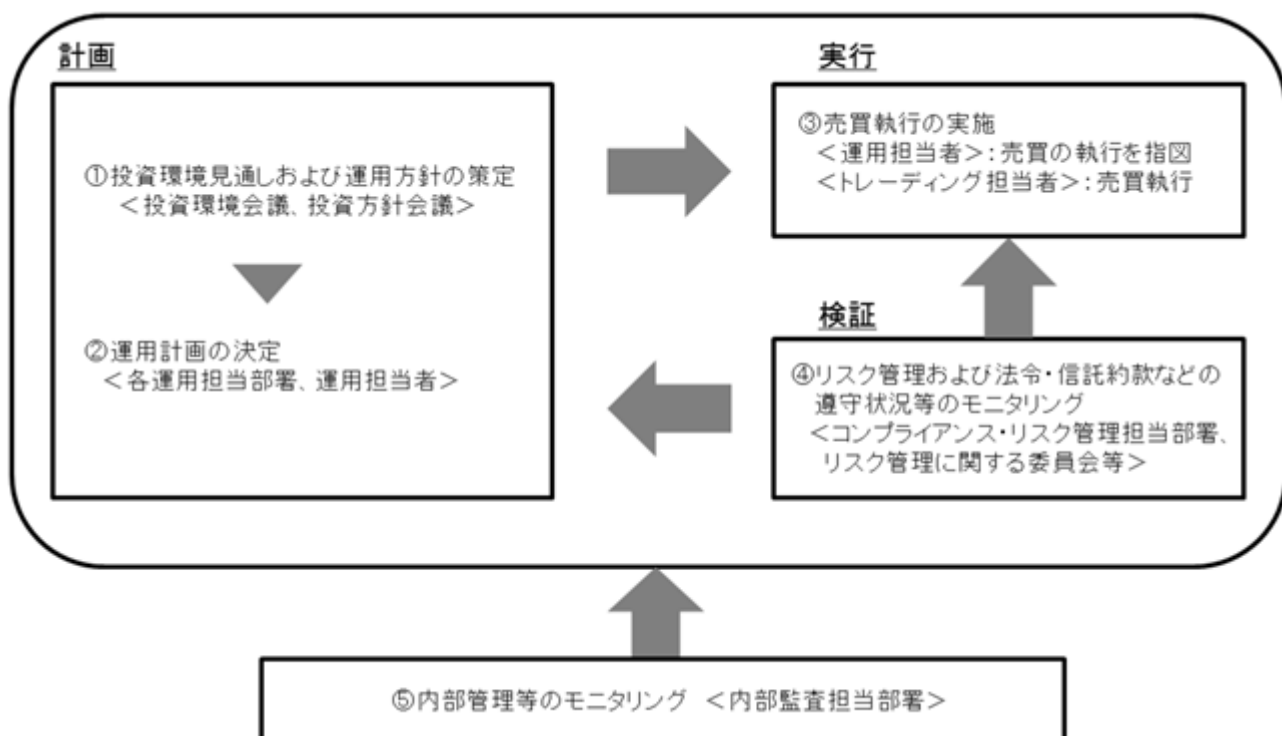
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限・通貨構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン・償還再投資</li> </ul> 

主な投資制限	<p>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す。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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



#### モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成29年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

#### （４）【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時（原則毎年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て扱います。)に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## (5) 【投資制限】

### 「DIAM DC 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。

### 「DIAM DC 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。

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

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

- 1)信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
- 2)株式分割により取得する株券
- 3)有償増資により取得する株券
- 4)売出しにより取得する株券
- 5)信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)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号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

- 1)先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券

の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(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)デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第26条の2)
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (13)有価証券の貸付の指図および範囲(約款第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。
- (14)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。

(15)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。

(16)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。

(17)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。



(18)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。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### (1)株式投資リスク

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。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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が、各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成インデックスが乖離する場合があります。

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、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、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。

資金動向、市況動向等によっては、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10億口を下回るようになった場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了(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。

### < リスク管理体制 >

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

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



上記体制は平成29年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

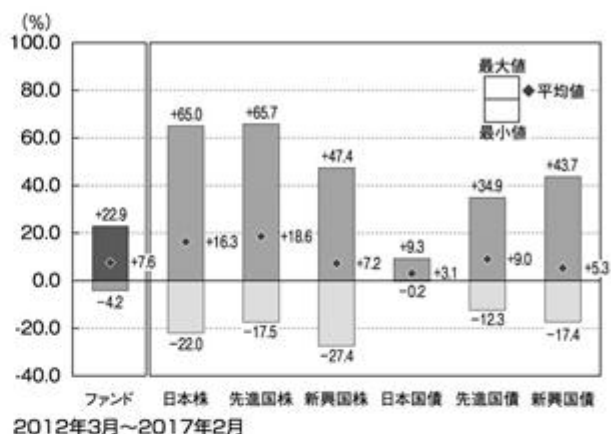
## ＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

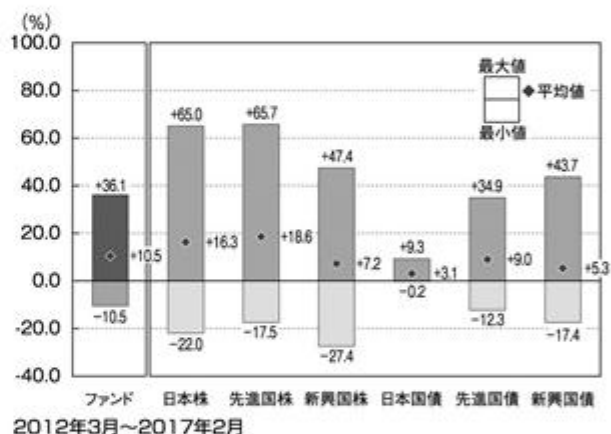
## DIAM DC バランス30インデックスファンド



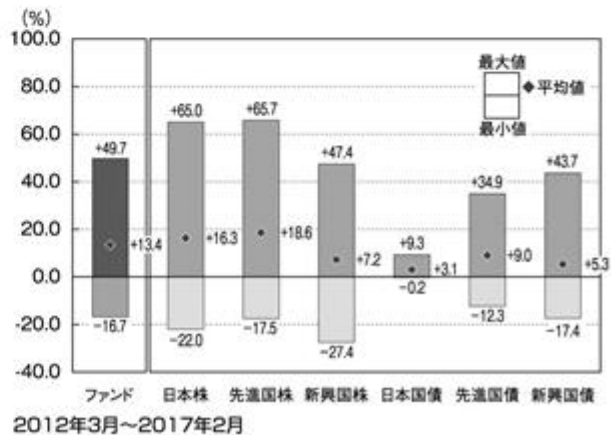
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



## DIAM 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



\* ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

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

\* 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## \*各資産クラスの指数

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

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(兼東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に有しています。
- 「MSCIコクサイインデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージングマーケットインデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループインデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループインデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバルディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬の配分(税抜)(年率)		
	委託会社	販売会社	受託会社
DIAMDC バランス30 インデックスファンド 年率0.2592%(税抜0.24)	0.090%	0.120%	0.030%
DIAMDC バランス50 インデックスファンド 年率0.2916%(税抜0.27%)	0.105%	0.135%	0.030%
DIAMDC バランス70 インデックスファンド 年率0.3240%(税抜0.30%)	0.120%	0.150%	0.030%
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (4) 【その他の手数料等】

##### 1. 信託財産留保額

ありません。

##### 2. その他の費用

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

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

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

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・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、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・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。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 解約時および償還時

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

原則として確定申告が必要ですが、特定口座(源泉徴収口座)を利用する場合、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。)を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、平成29年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 個別元本方式について

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

### < 個別元本について >

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

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

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

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



< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## DIAM DC バランス30インデックスファンド

平成29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	4,069,996,718	97.01
内 日本	4,069,996,718	97.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	125,650,492	2.99
純資産総額	4,195,647,210	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## DIAM DC バランス50インデックスファンド

平成29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	7,611,253,263	97.01
内 日本	7,611,253,263	97.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	234,246,071	2.99
純資産総額	7,845,499,334	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## DIAM DC バランス70インデックスファンド

平成29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	4,801,062,756	96.99
内 日本	4,801,062,756	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	149,180,574	3.01
純資産総額	4,950,243,330	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29年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	280,876,308,590	98.34
内 日本	280,876,308,590	98.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,729,479,775	1.66
純資産総額	285,605,788,365	100.00

## その他資産の投資状況

平成29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）	4,479,280,000	1.57
内 日本	4,479,280,000	1.57

（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29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	316,941,931,900	83.69
内 日本	316,941,931,900	83.69
地方債証券	23,947,324,893	6.32
内 日本	23,947,324,893	6.32
特殊債券	18,326,161,188	4.84
内 日本	18,326,161,188	4.84
社債券	16,592,868,630	4.38
内 日本	16,292,898,630	4.30
内 オランダ	200,102,000	0.05
内 イギリス	99,868,000	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,879,426,677	0.76
純資産総額	378,687,713,288	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29年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	264,263,363,554	95.13
内 アメリカ	165,080,159,827	59.43
内 イギリス	18,150,893,963	6.53
内 カナダ	10,944,018,141	3.94
内 スイス	10,118,569,943	3.64
内 ドイツ	9,852,949,235	3.55
内 フランス	9,382,119,115	3.38
内 オーストラリア	7,355,963,624	2.65
内 オランダ	4,859,090,633	1.75
内 アイルランド	4,519,177,059	1.63
内 スペイン	3,263,150,040	1.17
内 スウェーデン	3,014,213,925	1.09
内 香港	2,558,330,888	0.92
内 シンガポール	2,027,184,615	0.73
内 イタリア	1,810,228,628	0.65
内 デンマーク	1,751,758,689	0.63
内 ジャージー	1,695,817,692	0.61

内 バミューダ	1,264,989,262	0.46
内 ベルギー	1,205,914,603	0.43
内 フィンランド	1,030,240,853	0.37
内 オランダ領キュラソー	944,984,445	0.34
内 ノルウェー	688,457,995	0.25
内 ケイマン諸島	665,280,207	0.24
内 イスラエル	659,978,429	0.24
内 ルクセンブルグ	373,612,599	0.13
内 オーストリア	226,206,954	0.08
内 ニューージーランド	174,865,923	0.06
内 パナマ	172,481,422	0.06
内 ポルトガル	163,294,568	0.06
内 リベリア	147,655,445	0.05
内 パプアニューギニア	56,982,918	0.02
内 イギリス領バージン諸島	50,461,188	0.02
内 マン島	32,999,491	0.01
内 モーリシャス	21,331,235	0.01
投資信託受益証券	833,047,187	0.30
内 オーストラリア	709,488,423	0.26
内 シンガポール	123,558,764	0.04
投資証券	6,360,350,226	2.29
内 アメリカ	5,572,084,720	2.01
内 フランス	341,195,247	0.12
内 イギリス	267,794,502	0.10
内 香港	128,613,187	0.05
内 カナダ	50,662,570	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,335,213,069	2.28
純資産総額	277,791,974,036	100.00

## その他資産の投資状況

平成29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）	2,884,738,600	1.04
-	2,884,738,600	1.04
株価指数先物取引（買建）	6,384,798,938	2.30
内 アメリカ	4,225,137,987	1.52
内 ドイツ	1,170,010,056	0.42
内 イギリス	506,496,677	0.18
内 カナダ	249,594,624	0.09
内 オーストラリア	233,559,594	0.08

（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29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	242,522,056,660	97.35
内 アメリカ	109,257,139,764	43.86
内 フランス	23,879,941,407	9.59
内 イタリア	22,757,661,467	9.13
内 ドイツ	17,879,177,717	7.18
内 イギリス	17,671,198,671	7.09
内 スペイン	13,331,469,120	5.35
内 ベルギー	6,091,644,574	2.45
内 オランダ	5,392,246,646	2.16
内 カナダ	5,303,243,793	2.13
内 オーストラリア	5,100,071,407	2.05
内 オーストリア	3,401,826,301	1.37
内 メキシコ	1,914,127,478	0.77
内 アイルランド	1,811,936,992	0.73
内 ポーランド	1,382,632,254	0.55
内 デンマーク	1,369,513,137	0.55
内 フィンランド	1,363,927,331	0.55
内 南アフリカ	1,278,426,184	0.51
内 スウェーデン	991,480,955	0.40
内 マレーシア	949,266,469	0.38
内 シンガポール	867,177,876	0.35
内 ノルウェー	527,947,117	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,606,680,917	2.65
純資産総額	249,128,737,577	100.00

## その他資産の投資状況

平成29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）	711,867,820	0.29
-	711,867,820	0.29
為替予約取引（売建）	474,316,760	0.19
-	474,316,760	0.19

（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】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

平成29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	1,657,494,852	1.2799 2,121,593,410	1.2801 2,121,759,160	- -	50.57%
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	382,332,675	2.2705 868,124,571	2.2724 868,812,770	- -	20.71%
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	361,249,152	1.7268 623,841,160	1.7314 625,466,781	- -	14.91%
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	151,198,377	2.9900 452,098,267	3.0024 453,958,007	- -	10.82%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.01%
合計	97.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## DIAM DC バランス50インデックスファンド

平成29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	1,242,482,131	2.2705 2,821,179,926	2.2724 2,823,416,394	- -	35.99%
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	1,744,690,480	1.2799 2,233,203,814	1.2801 2,233,378,283	- -	28.47%
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	744,657,416	1.7268 1,285,948,891	1.7314 1,289,299,850	- -	16.43%
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	421,382,473	2.9900 1,259,975,732	3.0024 1,265,158,736	- -	16.13%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.01%
合計	97.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## DIAM DC バランス70インデックスファンド

平成29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	1,100,067,394	2.2706 2,497,813,025	2.2724 2,499,793,146	- -	50.50%
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	340,601,324	2.9900 1,018,432,018	3.0024 1,022,621,415	- -	20.66%
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	555,306,358	1.7268 958,958,549	1.7314 961,457,428	- -	19.42%
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	247,785,929	1.2799 317,165,989	1.2801 317,190,767	- -	6.41%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.99%
合計	96.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。



(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成29年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,526,000	6,346.00 9,683,996,000	6,365.00 9,712,990,000	- -	3.40%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	9,387,800	751.20 7,052,115,360	738.40 6,931,951,520	- -	2.43%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	994,500	4,874.00 4,847,193,000	4,751.00 4,724,869,500	- -	1.65%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	557,700	8,664.00 4,831,912,800	8,362.00 4,663,487,400	- -	1.63%
5	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	992,000	4,479.00 4,443,168,000	4,377.00 4,341,984,000	- -	1.52%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,129,500	3,541.00 3,999,559,500	3,489.00 3,940,825,500	- -	1.38%
7	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,225,600	2,947.00 3,611,843,200	2,939.00 3,602,038,400	- -	1.26%
8	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	16,819,100	208.50 3,506,782,350	209.70 3,526,965,270	- -	1.23%
9	ソニー 日本	株式 電気機器	886,200	3,599.00 3,189,433,800	3,478.00 3,082,203,600	- -	1.08%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	779,500	3,632.00 2,831,144,000	3,757.00 2,928,581,500	- -	1.03%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	127,300	21,565.00 2,745,224,500	22,125.00 2,816,512,500	- -	0.99%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	492,900	5,021.00 2,474,850,900	5,222.00 2,573,923,800	- -	0.90%
13	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,900	43,880.00 2,496,772,000	43,460.00 2,472,874,000	- -	0.87%
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	501,900	4,705.00 2,361,439,500	4,919.00 2,468,846,100	- -	0.86%
15	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	925,700	2,690.00 2,490,133,000	2,667.00 2,468,841,900	- -	0.86%
16	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	242,800	9,995.00 2,426,786,000	10,155.00 2,465,634,000	- -	0.86%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	929,600	2,541.00 2,362,113,600	2,534.50 2,356,071,200	- -	0.82%
18	セブン&アイ・ホールディン グス 日本	株式 小売業	518,500	4,428.00 2,295,918,000	4,400.00 2,281,400,000	- -	0.80%
19	信越化学工業 日本	株式 化学	235,800	9,505.00 2,241,279,000	9,503.00 2,240,807,400	- -	0.78%
20	キャノン 日本	株式 電気機器	675,700	3,252.00 2,197,376,400	3,281.00 2,216,971,700	- -	0.78%

21	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,338,900	1,608.50 2,153,620,650	1,647.50 2,205,837,750	- -	0.77%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	131,700	15,385.00 2,026,204,500	16,150.00 2,126,955,000	- -	0.74%
23	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,343,100	1,490.50 2,001,890,550	1,512.00 2,030,767,200	- -	0.71%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	921,000	2,194.50 2,021,134,500	2,195.00 2,021,595,000	- -	0.71%
25	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	443,600	4,054.00 1,798,354,400	4,481.00 1,987,771,600	- -	0.70%
26	花王 日本	株式 化学	333,900	5,863.00 1,957,655,700	5,801.00 1,936,953,900	- -	0.68%
27	三井物産 日本	株式 卸売業	1,120,100	1,654.00 1,852,645,400	1,719.00 1,925,451,900	- -	0.67%
28	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	104,400	17,995.00 1,878,678,000	18,380.00 1,918,872,000	- -	0.67%
29	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,014,000	672.30 2,026,312,200	618.80 1,865,063,200	- -	0.65%
30	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	2,532,800	737.10 1,866,926,880	729.30 1,847,171,040	- -	0.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年2月28日現在

種類	投資比率
株式	98.34%
合計	98.34%

(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29年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.34%
輸送用機器		9.12%
銀行業		8.37%
情報・通信業		7.67%
化学		6.64%
機械		5.02%
医薬品		4.67%
小売業		4.55%
卸売業		4.50%
食料品		4.36%
陸運業		4.12%
サービス業		3.65%
建設業		2.86%
保険業		2.70%
不動産業		2.45%
電気・ガス業		1.75%
その他製品		1.71%
精密機器		1.51%
鉄鋼		1.33%
その他金融業		1.24%
証券、商品先物取引業		1.22%
ガラス・土石製品		0.98%
非鉄金属		0.97%
ゴム製品		0.94%
繊維製品		0.71%
金属製品		0.70%
空運業		0.57%
石油・石炭製品		0.55%
鉱業		0.33%
パルプ・紙		0.25%
海運業	0.25%	
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.11%	
合計		98.34%

(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29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	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.78 4,535,460,000	100.92 4,541,805,000	0.100000 2020/6/20	1.20%
2	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.74 4,533,390,000	100.84 4,538,025,000	0.100000 2019/12/20	1.20%
3	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	100.82 4,234,524,000	100.87 4,236,876,000	0.200000 2018/12/20	1.12%
4	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.91 4,036,600,000	101.10 4,044,160,000	0.100000 2021/6/20	1.07%
5	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.84 4,033,960,000	100.92 4,037,040,000	0.200000 2019/3/20	1.07%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.22 4,009,000,000	100.67 4,027,080,000	0.100000 2026/3/20	1.06%
7	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.18 4,007,400,000	100.60 4,024,080,000	0.100000 2026/6/20	1.06%
8	366回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.50 4,020,040,000	100.53 4,021,440,000	0.100000 2018/7/15	1.06%
9	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.14 4,005,680,000	100.52 4,020,920,000	0.100000 2026/9/20	1.06%
10	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.28 4,011,460,000	100.48 4,019,480,000	0.100000 2026/12/20	1.06%
11	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.91 3,733,892,000	100.99 3,736,778,000	0.200000 2019/6/20	0.99%
12	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	102.02 3,570,700,000	102.50 3,587,675,000	0.300000 2025/12/20	0.95%
13	129回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.92 3,532,270,000	101.14 3,540,110,000	0.100000 2021/9/20	0.93%
14	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.84 3,529,680,000	101.01 3,535,490,000	0.100000 2020/12/20	0.93%
15	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.87 3,530,450,000	100.91 3,531,920,000	0.300000 2018/9/20	0.93%

16	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.75 3,526,565,000	100.88 3,531,115,000	0.100000 2020/3/20	0.93%
17	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	105.76 3,173,010,000	105.92 3,177,840,000	1.300000 2021/3/20	0.84%
18	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	102.90 3,087,180,000	103.37 3,101,310,000	0.400000 2025/9/20	0.82%
19	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	101.06 3,031,845,000	101.18 3,035,520,000	0.100000 2021/12/20	0.80%
20	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.88 3,026,490,000	101.05 3,031,770,000	0.100000 2021/3/20	0.80%
21	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.81 3,024,330,000	100.96 3,028,950,000	0.100000 2020/9/20	0.80%
22	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	103.95 3,014,811,000	104.00 3,016,058,000	1.500000 2019/6/20	0.80%
23	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	104.04 2,913,120,000	104.18 2,917,096,000	1.000000 2020/9/20	0.77%
24	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	102.94 2,882,557,000	103.36 2,894,164,000	0.400000 2025/6/20	0.76%
25	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,700,000,000	104.79 2,829,465,000	105.08 2,837,268,000	0.800000 2022/9/20	0.75%
26	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,600,000,000	104.25 2,710,500,000	104.72 2,722,824,000	0.600000 2024/6/20	0.72%
27	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	105.49 2,637,250,000	105.71 2,642,900,000	1.000000 2022/3/20	0.70%
28	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	104.15 2,603,800,000	104.22 2,605,675,000	1.300000 2019/12/20	0.69%
29	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	102.81 2,570,475,000	103.34 2,583,600,000	0.400000 2025/3/20	0.68%
30	149回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	2,200,000,000	115.77 2,546,962,000	117.04 2,574,924,000	1.500000 2034/6/20	0.68%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	83.69%
地方債証券	6.32%
特殊債券	4.84%
社債券	4.38%
合計	99.24%

(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29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	402,214	15,197.85 6,112,788,522	15,412.84 6,199,260,349	- -	2.23%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	553,414	7,267.99 4,022,212,509	7,229.72 4,001,033,134	- -	1.44%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,084	94,144.05 2,832,229,852	95,522.91 2,873,711,477	- -	1.03%
4	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	309,835	9,322.21 2,888,349,785	9,178.14 2,843,709,750	- -	1.02%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	204,804	13,097.48 2,682,416,621	13,777.34 2,821,655,160	- -	1.02%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	269,975	10,080.87 2,721,583,850	10,178.80 2,748,021,745	- -	0.99%
7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	173,536	15,066.15 2,614,520,447	15,354.30 2,664,525,470	- -	0.96%
8	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	358,022	6,526.22 2,336,533,487	6,535.23 2,339,757,403	- -	0.84%
9	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	669,933	3,408.31 2,283,343,898	3,370.04 2,257,705,294	- -	0.81%
10	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	460,498	4,586.81 2,112,221,436	4,707.25 2,167,683,447	- -	0.78%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,139	92,349.85 2,136,883,225	93,343.75 2,159,881,188	- -	0.78%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	761,401	2,708.19 2,062,021,315	2,765.59 2,105,729,996	- -	0.76%
13	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	21,999	94,553.77 2,080,088,535	95,638.85 2,103,959,175	- -	0.76%
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	191,488	9,889.52 1,893,724,712	10,230.57 1,959,032,996	- -	0.71%
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	232,379	8,137.30 1,890,939,960	8,282.22 1,924,614,233	- -	0.69%
16	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	140,802	12,665.25 1,783,292,699	12,578.57 1,771,089,221	- -	0.64%

17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	91,251	18,791.89 1,714,778,936	19,206.11 1,752,576,999	- -	0.63%
18	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	453,602	3,686.33 1,672,131,196	3,858.55 1,750,249,081	- -	0.63%
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	305,099	5,433.27 1,657,685,609	5,621.24 1,715,036,655	- -	0.62%
20	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	206,907	7,390.68 1,529,185,413	7,412.07 1,533,610,408	- -	0.55%
21	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	359,104	4,282.34 1,537,807,290	4,224.37 1,516,990,606	- -	0.55%
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	92,204	15,911.48 1,467,102,249	16,354.96 1,507,993,469	- -	0.54%
23	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	216,601	6,734.46 1,458,691,810	6,755.85 1,463,324,125	- -	0.53%
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	353,216	4,044.28 1,428,504,687	4,109.56 1,451,564,322	- -	0.52%
25	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	375,461	3,636.81 1,365,481,671	3,856.30 1,447,892,356	- -	0.52%
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	166,725	8,371.39 1,395,721,164	8,677.93 1,446,829,463	- -	0.52%
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	306,559	4,562.05 1,398,539,570	4,690.37 1,437,876,730	- -	0.52%
28	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	52,476	26,462.97 1,388,671,233	27,154.09 1,424,938,131	- -	0.51%
29	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	115,885	11,546.40 1,338,055,120	12,235.27 1,417,884,495	- -	0.51%
30	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	113,984	12,418.74 1,415,538,207	12,407.48 1,414,255,203	- -	0.51%

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年2月28日現在

種類	投資比率
株式	95.13%
投資信託受益証券	0.30%
投資証券	2.29%
合計	97.72%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## 投資株式の業種別投資比率

平成29年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.44%
石油・ガス・消耗燃料		6.21%
医薬品		5.81%
保険		4.08%
ソフトウェア		3.45%
インターネットソフトウェア・サービス		2.90%
資本市場		2.80%
情報技術サービス		2.67%
メディア		2.64%
コンピュータ・周辺機器		2.62%
化学		2.60%
各種電気通信サービス		2.51%
半導体・半導体製造装置		2.41%
バイオテクノロジー		2.32%
食品		2.13%
コングロマリット		2.11%
飲料		2.00%
航空宇宙・防衛		1.93%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.92%
食品・生活必需品小売り		1.91%
ヘルスケア機器・用品		1.89%
電力		1.84%
専門小売り		1.76%
ホテル・レストラン・レジャー		1.70%
タバコ		1.62%
インターネット販売・通信販売		1.56%
金属・鉱業		1.48%
機械		1.47%
家庭用品		1.47%
繊維・アパレル・贅沢品		1.13%
総合公益事業		1.07%
自動車		1.00%
陸運・鉄道		0.91%
各種金融サービス		0.89%
通信機器		0.85%
エネルギー設備・サービス		0.74%
電気設備		0.73%
パーソナル用品		0.68%
専門サービス		0.59%
消費者金融		0.58%
航空貨物・物流サービス		0.56%
不動産管理・開発		0.53%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.49%
家庭用耐久財		0.45%
自動車部品		0.45%
電子装置・機器・部品		0.42%
複合小売り		0.40%

建設関連製品	0.37%
商業サービス・用品	0.36%
建設資材	0.35%
無線通信サービス	0.34%
商社・流通業	0.32%
建設・土木	0.30%
容器・包装	0.30%
運送インフラ	0.23%
旅客航空輸送業	0.15%
ガス	0.14%
紙製品・林産品	0.10%
水道	0.09%
販売	0.08%
レジャー用品	0.08%
海運業	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.05%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.04%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.03%
各種消費者サービス	0.01%
合計	95.13%

(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29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 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	3,995,880,000	100.42 4,013,022,325	100.44 4,013,661,666	1.375000 2018/9/30	1.61%
2	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	2,363,760,000	101.09 2,389,595,896	101.25 2,393,307,000	2.125000 2021/8/15	0.96%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,913,520,000	106.25 2,033,115,000	106.31 2,034,377,923	3.625000 2020/2/15	0.82%
4	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,913,520,000	100.57 1,924,580,145	100.60 1,925,020,255	1.500000 2018/12/31	0.77%
5	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,857,240,000	103.32 1,919,048,947	103.46 1,921,500,504	2.625000 2020/8/15	0.77%
6	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,767,192,000	100.98 1,784,581,169	101.15 1,787,620,739	2.125000 2021/12/31	0.72%
7	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,688,400,000	101.83 1,719,449,676	101.80 1,718,926,272	2.375000 2018/6/30	0.69%
8	US T N/B 1.625 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,688,400,000	100.75 1,701,063,000	100.79 1,701,839,664	1.625000 2019/3/31	0.68%
9	US T N/B 1.25 12/15/18 アメリカ	国債証券	1,688,400,000	100.13 1,690,696,224	100.17 1,691,354,700	1.250000 2018/12/15	0.68%
10	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,575,840,000	106.09 1,671,918,964	106.14 1,672,722,643	3.500000 2020/5/15	0.67%
11	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,688,400,000	98.82 1,668,611,952	99.04 1,672,292,664	1.750000 2022/5/15	0.67%

12	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,688,400,000	97.97 1,654,226,784	98.15 1,657,265,904	1.625000 2022/8/15	0.67%
13	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,688,400,000	97.64 1,648,553,760	97.94 1,653,703,380	1.750000 2023/5/15	0.66%
14	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,463,280,000	104.00 1,521,811,200	104.00 1,521,855,098	3.125000 2019/5/15	0.61%
15	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,519,560,000	99.82 1,516,885,574	99.83 1,517,113,508	0.750000 2018/2/28	0.61%
16	US T N/B 1.375 06/30/23 アメリカ	国債証券	1,575,840,000	95.30 1,501,838,553	95.61 1,506,770,932	1.375000 2023/6/30	0.60%
17	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,519,560,000	99.08 1,505,716,808	99.15 1,506,734,913	1.000000 2019/8/31	0.60%
18	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,463,280,000	100.29 1,467,552,777	100.33 1,468,138,089	1.375000 2019/2/28	0.59%
19	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,429,512,000	100.64 1,438,775,237	100.63 1,438,546,515	1.500000 2018/8/31	0.58%
20	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,350,720,000	104.39 1,410,124,665	104.30 1,408,800,960	4.000000 2018/8/15	0.57%
21	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,350,720,000	103.01 1,391,390,179	102.98 1,390,971,456	2.750000 2019/2/15	0.56%
22	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,350,720,000	100.78 1,361,269,123	100.91 1,363,065,580	2.000000 2021/5/31	0.55%
23	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,350,720,000	99.45 1,343,331,561	99.54 1,344,587,731	1.375000 2020/4/30	0.54%
24	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,294,440,000	101.85 1,318,503,639	101.99 1,320,225,244	2.250000 2021/3/31	0.53%
25	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,350,720,000	97.01 1,310,401,008	97.43 1,316,101,046	2.000000 2025/8/15	0.53%
26	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,154,106,000	110.01 1,269,747,421	110.42 1,274,479,255	2.500000 2020/10/25	0.51%
27	US T N/B 2.0 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	100.97 1,250,244,441	101.09 1,251,693,088	2.000000 2021/2/28	0.50%
28	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	100.93 1,249,761,559	101.02 1,250,875,903	1.875000 2020/6/30	0.50%
29	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	1,350,720,000	92.08 1,243,810,512	92.57 1,250,469,561	1.500000 2026/8/15	0.50%
30	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	99.60 1,233,269,268	99.65 1,233,900,729	1.125000 2019/5/31	0.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	97.35%
合計	97.35%

（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】

DIAM DC 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。

DIAM DC 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。

DIAM DC 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29年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2903月	買建	292	4,442,084,764	4,479,280,000	1.57%

（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29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2017年03月	買建	16,800,000	1,884,891,750	1,890,840,000	0.68%
		ユーロ買/円売201 7年03月	買建	4,430,000	525,210,570	527,081,400	0.19%
		イギリス・ポンド買/ 円売2017年03月	買建	1,620,000	225,649,872	226,476,000	0.08%
		オーストラリア・ドル 買/円売2017年0 3月	買建	1,430,000	123,069,218	123,493,900	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2017年03月	買建	1,370,000	117,164,490	116,847,300	0.04%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Mar 17	買建	317	4,193,048,538	4,225,137,987	1.52%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Mar 17	買建	297	1,169,092,720	1,170,010,056	0.42%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Mar 17	買建	50	504,955,971	506,496,677	0.18%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT M ar 17	買建	16	251,827,778	249,594,624	0.09%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Mar 1 7	買建	19	234,067,018	233,559,594	0.08%

(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29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2017年03月	買建	2,694,000	319,331,673	320,532,120	0.13%
		アメリカ・ドル買/円売2017年03月	買建	2,846,000	319,251,473	320,317,300	0.13%
		イギリス・ポンド買/円売2017年03月	買建	508,000	70,743,876	71,018,400	0.03%
		ユーロ売/円買2017年03月	売建	1,992,000	237,014,136	237,008,160	0.10%
		イギリス・ポンド売/円買2017年03月	売建	1,018,000	142,324,136	142,316,400	0.06%
		アメリカ・ドル売/円買2017年03月	売建	844,000	94,998,108	94,992,200	0.04%

(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29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。

DIAM DC 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
第8計算期間末 (平成27年2月25日)	3,961	3,961	1.2516	1.2516
第9計算期間末 (平成28年2月25日)	3,872	3,872	1.2197	1.2197
第10計算期間末 (平成29年2月27日)	4,191	4,191	1.2846	1.2846
平成28年2月末日	3,881	-	1.2224	-
3月末日	3,985	-	1.2478	-
4月末日	3,989	-	1.2459	-
5月末日	4,042	-	1.2579	-
6月末日	3,939	-	1.2206	-
7月末日	4,007	-	1.2388	-
8月末日	3,979	-	1.2320	-
9月末日	3,985	-	1.2266	-
10月末日	4,036	-	1.2404	-
11月末日	4,125	-	1.2687	-
12月末日	4,207	-	1.2884	-
平成29年1月末日	4,186	-	1.2801	-
2月末日	4,195	-	1.2859	-

## DIAM DC 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
第8計算期間末 (平成27年2月25日)	7,650	7,650	1.2462	1.2462
第9計算期間末 (平成28年2月25日)	7,107	7,107	1.1681	1.1681
第10計算期間末 (平成29年2月27日)	7,834	7,834	1.2776	1.2776
平成28年2月末日	7,126	-	1.1713	-
3月末日	7,367	-	1.2056	-
4月末日	7,343	-	1.1993	-
5月末日	7,471	-	1.2161	-
6月末日	7,117	-	1.1522	-
7月末日	7,309	-	1.1861	-
8月末日	7,270	-	1.1826	-
9月末日	7,243	-	1.1761	-
10月末日	7,394	-	1.2007	-
11月末日	7,688	-	1.2463	-
12月末日	7,878	-	1.2784	-
平成29年1月末日	7,830	-	1.2713	-
2月末日	7,845	-	1.2794	-



## DIAM DC 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
第8計算期間末 (平成27年2月25日)	4,726	4,726	1.2215	1.2215
第9計算期間末 (平成28年2月25日)	4,274	4,274	1.0985	1.0985
第10計算期間末 (平成29年2月27日)	4,943	4,943	1.2455	1.2455
平成28年2月末日	4,282	-	1.1021	-
3月末日	4,489	-	1.1447	-
4月末日	4,458	-	1.1340	-
5月末日	4,548	-	1.1552	-
6月末日	4,227	-	1.0659	-
7月末日	4,425	-	1.1143	-
8月末日	4,434	-	1.1140	-
9月末日	4,423	-	1.1061	-
10月末日	4,566	-	1.1400	-
11月末日	4,806	-	1.2010	-
12月末日	4,954	-	1.2442	-
平成29年1月末日	4,928	-	1.2381	-
2月末日	4,950	-	1.2476	-

## 【分配の推移】

## DIAM DC 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
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000

## DIAM DC 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
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000

## DIAM DC 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
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## DIAM DC 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
第8計算期間	10.7
第9計算期間	2.5
第10計算期間	5.3

(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。

## DIAM DC 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
第8計算期間	15.4
第9計算期間	6.3
第10計算期間	9.4

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

## DIAM DC 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
第8計算期間	20.4
第9計算期間	10.1
第10計算期間	13.4

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

## DIAM DC 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
第8計算期間	587,018,593	370,175,319
第9計算期間	305,909,017	296,074,964
第10計算期間	275,951,706	188,670,759

(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。

## DIAM DC 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
第8計算期間	941,276,993	622,378,462
第9計算期間	486,750,602	541,314,986
第10計算期間	463,520,203	415,914,505

(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。

## DIAM DC 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
第8計算期間	651,362,252	510,532,126
第9計算期間	464,619,957	442,857,312
第10計算期間	358,141,987	280,091,973

(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。

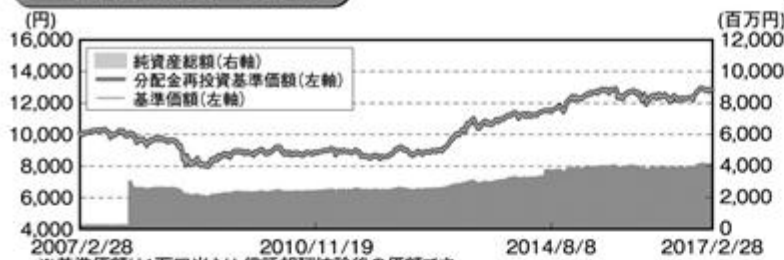
&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2017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

(2007年2月28日～2017年2月28日)



※基準価額は1万口当たり信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2006年12月27日)  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

期	日付	金額
第6期	(2013.02.25)	0円
第7期	(2014.02.25)	0円
第8期	(2015.02.25)	0円
第9期	(2016.02.25)	0円
第10期	(2017.02.27)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

組入銘柄一覧 ※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。

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	50.57%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.71%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.91%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.82%

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## DIAM 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

(2007年2月28日～2017年2月28日)



※基準価額は1万口当たり信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2006年12月27日)  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

期	日付	金額
第6期	(2013.02.25)	0円
第7期	(2014.02.25)	0円
第8期	(2015.02.25)	0円
第9期	(2016.02.25)	0円
第10期	(2017.02.27)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

組入銘柄一覧 ※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。

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	35.99%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.47%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.43%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.13%

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

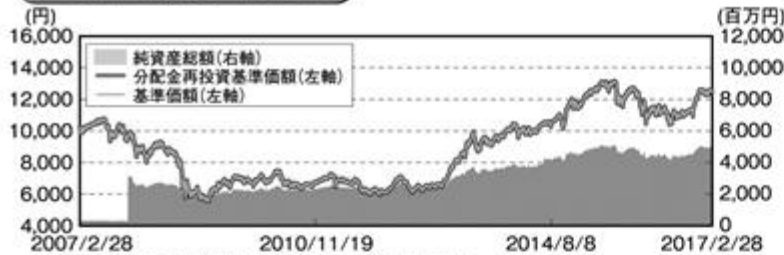
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2017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 (2007年2月28日～2017年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2006年12月27日)  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

第6期	(2013.02.25)	0円
第7期	(2014.02.25)	0円
第8期	(2015.02.25)	0円
第9期	(2016.02.25)	0円
第10期	(2017.02.27)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

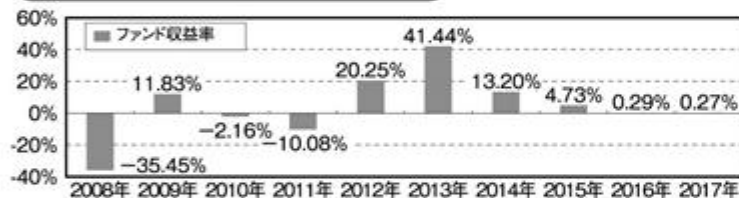
## 主要な資産の状況

組入銘柄一覧 ※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。

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	50.50%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.66%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.42%
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.41%

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## 各マザーファンドの主要な資産の状況

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

※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	98.34
内 日本	98.34
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.66
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)	1.57

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.34%
2	輸送用機器	9.12%
3	銀行業	8.37%
4	情報・通信業	7.67%
5	化学	6.64%

## 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	3.40%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.43%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.65%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.63%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.52%
6	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.38%
7	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.26%
8	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.23%
9	ソニー	株式	日本	電気機器	1.08%
10	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.03%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



データの基準日:2017年2月28日

## ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.13
内 アメリカ	59.43
内 イギリス	6.53
内 カナダ	3.94
内 スイス	3.64
内 ドイツ	3.55
内 その他	18.04
投資信託受益証券	0.30
内 オーストラリア	0.26
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.29
内 アメリカ	2.01
内 フランス	0.12
内 イギリス	0.10
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.28
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(%)
為替予約取引(買建)	1.04
株価指数先物取引(買建)	2.30

## ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	83.69
内 日本	83.69
地方債証券	6.32
内 日本	6.32
特殊債券	4.84
内 日本	4.84
社債券	4.38
内 日本	4.30
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.03
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.76
純資産総額	100.00

## ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	97.35
内 アメリカ	43.86
内 フランス	9.59
内 イタリア	9.13
内 ドイツ	7.18
内 イギリス	7.09
内 その他	20.50
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.65
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(%)
為替予約取引(買建)	0.29
為替予約取引(売建)	△0.19

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	2.23%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.44%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売通販販売	1.03%
4	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油ガス・消耗燃料	1.02%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.02%
6	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.99%
7	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	0.96%
8	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.84%
9	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.81%
10	AT&T INC	株式	アメリカ	各種電気通信サービス	0.78%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	9.44%
2	石油・ガス・消耗燃料	6.21%
3	医薬品	5.81%
4	保険	4.08%
5	ソフトウェア	3.45%

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.20%
2	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.20%
3	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.12%
4	128回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2021/6/20	1.07%
5	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.07%
6	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	1.06%
7	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/6/20	1.06%
8	366回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2018/7/15	1.06%
9	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/9/20	1.06%
10	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/12/20	1.06%

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	1.61%
2	US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/8/15	0.96%
3	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.82%
4	US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	アメリカ	1.500000	2018/12/31	0.77%
5	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.77%
6	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/12/31	0.72%
7	US T N/B 2.375 06/30/18	国債証券	アメリカ	2.375000	2018/6/30	0.69%
8	US T N/B 1.625 03/31/19	国債証券	アメリカ	1.625000	2019/3/31	0.68%
9	US T N/B 1.25 12/15/18	国債証券	アメリカ	1.250000	2018/12/15	0.68%
10	US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	アメリカ	3.500000	2020/5/15	0.67%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込みの方法

お申込みには、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1万口当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.am-one.co.jp/>

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

・ お申込単位

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本 1口 = 1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

・ 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經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部に  
ついて委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、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.am-one.co.jp/>

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

### 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。

#### < 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額(1万口当たり)は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

## (2)【保管】

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10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に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。

#### 八．関係法人との契約の更改

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

#### 二．公告

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

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

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

#### ホ．運用報告書

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

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

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

#### 4【受益者の権利等】

##### 収益分配金請求権

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

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

#### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

#### 一部解約請求権

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

#### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

#### DIAM DC 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10期計算期間(平成28年2月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DIAM DC 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9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	120,710,357	-
コール・ローン	-	130,902,588
親投資信託受益証券	3,758,019,382	4,065,657,408
未収入金	1,085,000	58,000
流動資産合計	3,879,814,739	4,196,617,996
資産合計	3,879,814,739	4,196,617,996
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,831,766	122,345
未払受託者報酬	653,303	673,488
未払委託者報酬	4,573,433	4,714,763
その他未払費用	103,354	100,952
流動負債合計	7,161,856	5,611,548
負債合計	7,161,856	5,611,548
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,317,190,384	1,326,471,331
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	697,462,499	928,535,117
(分配準備積立金)	758,940,328	776,882,879
元本等合計	3,872,652,883	4,191,006,448
純資産合計	3,872,652,883	4,191,006,448
負債純資産合計	3,879,814,739	4,196,617,996

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期		第10期	
	自	平成27年2月26日 平成28年2月25日	自	平成28年2月26日 平成29年2月27日
営業収益				
受取利息		66,906		133
有価証券売買等損益		90,894,377		220,228,026
営業収益合計		90,827,471		220,228,159
営業費用				
支払利息		-		81,341
受託者報酬		1,301,718		1,311,486
委託者報酬		9,112,647		9,181,089
その他費用		205,938		197,716
営業費用合計		10,620,303		10,771,632
営業利益又は営業損失( )		101,447,774		209,456,527
経常利益又は経常損失( )		101,447,774		209,456,527
当期純利益又は当期純損失( )		101,447,774		209,456,527
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( )		2,093,633		5,043,554
期首剰余金又は期首欠損金( )		796,463,608		697,462,499
剰余金増加額又は欠損金減少額		79,207,497		68,259,627
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		79,207,497		68,259,627
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,667,199		41,599,982
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,667,199		41,599,982
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		697,462,499		928,535,117

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成29年2月27日としております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	3,165,356,331円 305,909,017円 296,074,964円	3,175,190,384円 275,951,706円 188,670,759円
2. 受益権の総数	3,175,190,384口	3,262,471,331口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27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(54,609,147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(237,421,640円)及び分配準備積立金(704,331,181円)より分配対象収益は996,361,968円(1万口当たり3,137.96円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(61,008,222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(308,140,354円)及び分配準備積立金(715,874,657円)より分配対象収益は1,085,023,233円(1万口当たり3,325.77円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## （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9期	第10期
	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期	第10期
	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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9期	第10期
	平成28年2月25日現在	平成29年2月27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	101,640,927	209,940,571
合計	101,640,927	209,940,571

## (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9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.2197円	1.2846円
(1万口当たり純資産額)	(12,197円)	(12,846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29年2月27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	382,332,675	868,124,571	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,657,494,852	2,121,593,410	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	151,198,377	452,098,267	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	361,249,152	623,841,160	
親投資信託受益証券 合計		2,552,275,056	4,065,657,408	
合計		2,552,275,056	4,065,657,408	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



DIAM DC 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10期計算期間(平成28年2月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 【DIAM DC 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9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	222,785,336	-
コール・ローン	-	249,566,663
親投資信託受益証券	6,899,509,821	7,600,308,363
未収入金	36,000	-
流動資産合計	7,122,331,157	7,849,875,026
資産合計	7,122,331,157	7,849,875,026
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,653,687	3,838,487
未払受託者報酬	1,236,917	1,247,820
未払委託者報酬	9,895,557	9,982,954
その他未払費用	195,754	187,087
流動負債合計	14,981,915	15,256,348
負債合計	14,981,915	15,256,348
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	16,084,762,586	16,132,368,284
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,022,586,656	1,702,250,394
(分配準備積立金)	1,820,327,543	1,834,005,540
元本等合計	7,107,349,242	7,834,618,678
純資産合計	7,107,349,242	7,834,618,678
負債純資産合計	7,122,331,157	7,849,875,026

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期		第10期	
	自	平成27年2月26日 平成28年2月25日	自	平成28年2月26日 平成29年2月27日
営業収益				
受取利息		129,097		246
有価証券売買等損益		453,872,035		695,220,542
営業収益合計		453,742,938		695,220,788
営業費用				
支払利息		-		149,388
受託者報酬		2,504,907		2,415,499
委託者報酬		20,039,841		19,324,678
その他費用		396,440		364,263
営業費用合計		22,941,188		22,253,828
営業利益又は営業損失( )		476,684,126		672,966,960
経常利益又は経常損失( )		476,684,126		672,966,960
当期純利益又は当期純損失( )		476,684,126		672,966,960
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		3,786,775		17,299,980
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,511,568,689		1,022,586,656
剰余金増加額又は欠損金減少額		125,258,277		94,245,345
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		125,258,277		94,245,345
剰余金減少額又は欠損金増加額		133,769,409		70,248,587
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		133,769,409		70,248,587
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,022,586,656		1,702,250,394

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成29年2月27日としております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	6,139,326,970円 486,750,602円 541,314,986円	6,084,762,586円 463,520,203円 415,914,505円
2. 受益権の総数	6,084,762,586口	6,132,368,284口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27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(117,030,515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(421,220,236円)及び分配準備積立金(1,703,297,028円)より分配対象収益は2,241,547,779円(1万口当たり3,683.87円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(132,922,325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(558,571,078円)及び分配準備積立金(1,701,083,215円)より分配対象収益は2,392,576,618円(1万口当たり3,901.55円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## （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9期	第10期
	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期	第10期
	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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9期	第10期
	平成28年2月25日現在	平成29年2月27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	474,713,904	668,863,747
合計	474,713,904	668,863,747

## (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9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1,168円	1,277円
(1万口当たり純資産額)	(11,681円)	(12,776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29年2月27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	1,242,482,131	2,821,179,926	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,744,690,480	2,233,203,814	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	421,382,473	1,259,975,732	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	744,657,416	1,285,948,891	
親投資信託受益証券 合計		4,153,212,500	7,600,308,363	
合計		4,153,212,500	7,600,308,363	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



DIAM DC 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10期計算期間(平成28年2月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 【DIAM DC 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9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	135,776,338	-
コール・ローン	-	159,790,089
親投資信託受益証券	4,146,512,149	4,793,978,582
流動資産合計	4,282,288,487	4,953,768,671
資産合計	4,282,288,487	4,953,768,671
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	40,416	2,294,717
未払受託者報酬	763,668	776,397
未払委託者報酬	6,873,444	6,987,924
その他未払費用	120,831	116,367
流動負債合計	7,798,359	10,175,405
負債合計	7,798,359	10,175,405
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,891,233,122	1 3,969,283,136
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	383,257,006	974,310,130
(分配準備積立金)	1,253,618,465	1,262,876,375
元本等合計	4,274,490,128	4,943,593,266
純資産合計	4,274,490,128	4,943,593,266
負債純資産合計	4,282,288,487	4,953,768,671

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	平成27年2月26日 平成28年2月25日	自	平成28年2月26日 平成29年2月27日
<b>営業収益</b>				
受取利息		81,635		150
有価証券売買等損益		460,531,044		601,083,433
営業収益合計		460,449,409		601,083,583
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		92,430
受託者報酬		1,558,319		1,481,786
委託者報酬		14,025,631		13,336,670
その他費用		246,564		223,381
営業費用合計		15,830,514		15,134,267
営業利益又は営業損失（ ）		476,279,923		585,949,316
経常利益又は経常損失（ ）		476,279,923		585,949,316
当期純利益又は当期純損失（ ）		476,279,923		585,949,316
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（ ）		9,485,248		19,037,635
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		857,107,610		383,257,006
剰余金増加額又は欠損金減少額		110,841,735		52,077,718
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		110,841,735		52,077,718
剰余金減少額又は欠損金増加額		98,927,168		27,936,275
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		98,927,168		27,936,275
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		383,257,006		974,310,130

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成29年2月27日としております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	3,869,470,477円 464,619,957円 442,857,312円	3,891,233,122円 358,141,987円 280,091,973円
2 . 受益権の総数	3,891,233,122口	3,969,283,136口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第9期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27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(82,386,177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(357,319,305円)及び分配準備積立金(1,171,232,288円)より分配対象収益は1,610,937,770円(1万口当たり4,139.92円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(94,781,411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(475,660,558円)及び分配準備積立金(1,168,094,964円)より分配対象収益は1,738,536,933円(1万口当たり4,379.98円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## （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9期	第10期
	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期	第10期
	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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9期	第10期
	平成28年2月25日現在	平成29年2月27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	477,377,024	583,658,914
合計	477,377,024	583,658,914

## (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9期 平成28年2月25日現在	第10期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.0985円	1.2455円
(1万口当たり純資産額)	(10,985円)	(12,455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29年2月27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	1,100,776,018	2,499,422,026	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	247,785,929	317,165,989	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	340,601,324	1,018,432,018	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	555,306,358	958,958,549	
親投資信託受益証券	合計	2,244,469,629	4,793,978,582	
合計		2,244,469,629	4,793,978,582	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



（参考）

「DIAM 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」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28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		3,319,697,186	-
コール・ローン		-	5,770,713,779
株式	2	266,950,636,500	280,719,581,820
派生商品評価勘定		16,762,460	746,900
未収配当金		477,553,356	549,786,376
前払金		256,490,000	-
流動資産合計		271,021,139,502	287,040,828,875
資産合計		271,021,139,502	287,040,828,875
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		199,635,772	39,445,944
前受金		-	2,090,100
未払解約金		131,488,000	1,869,829,000
流動負債合計		331,123,772	1,911,365,044
負債合計		331,123,772	1,911,365,044
純資産の部			
元本等			
元本	1	142,969,149,329	125,576,804,116
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		127,720,866,401	159,552,659,715
元本等合計		270,690,015,730	285,129,463,831
純資産合計		270,690,015,730	285,129,463,831
負債純資産合計		271,021,139,502	287,040,828,875

## 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28年2月25日現在	平成29年2月27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	155,777,350,252円	142,969,149,329円
同期中追加設定元本額	39,180,158,135円	31,828,067,138円
同期中一部解約元本額	51,988,359,058円	49,220,412,351円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	5,696,126,195円	6,296,121,588円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,699,376,937円	1,669,207,881円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	6,524,503円	5,012,187円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,299,631円	12,048,308円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	31,387,977円	23,525,414円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,547,145円	14,468,349円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,269,512円	11,463,058円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,755,011円	14,708,962円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	38,084,258,210円	36,554,930,032円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	856,679,246円	816,514,087円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,984,860,292円	2,899,738,685円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,003,978,386円	2,949,143,393円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	368,862,991円	382,332,675円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,225,176,057円	1,242,482,131円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,095,709,664円	1,100,776,018円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	60,788,627円	59,530,357円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,229,112,654円	1,318,320,660円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	27,113,958円	28,435,219円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	25,953,986円	35,217,725円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	51,128,058円	68,814,338円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	108,496,820円	140,148,670円
投資のソムリエ	1,057,072,049円	1,146,020,551円
クルーズコントロール	292,854,639円	1,099,018,981円
投資のソムリエ<DC年金>	20,915,913円	36,165,399円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	76,867,727円	114,712,450円
DIAM DC バランス・F(成長型)	60,755,446円	122,053,447円
クルーズコントロール<DC年金>	73,605円	405,651円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,971,426円	10,061,702円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	7,035,679円	32,908,087円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	762,065円	13,983,088円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	1,427,701円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	- 円	75,809,247円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	199,876,126円	313,751,716円

D I A Mワールドバ ランス25VA(適 格機関投資家 限定)	113,636,589円	86,560,257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)	492,301,556円	209,554,515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)	474,003,080円	389,570,983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)	39,526,570円	26,792,261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)	166,681,120円	117,532,264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)	39,752,947円	29,346,280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)	58,181,496円	30,052,812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)	5,219,612,585円	831,235,040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)	1,982,163,464円	374,549,335円
D I A Mバ ランス ファンド25VA(適 格機関投資家 限定)	1,997,353,962円	1,451,571,979円
D I A Mバ ランス ファンド37.5VA(適 格機関投資家 限定)	1,598,529,122円	1,289,496,820円
D I A Mバ ランス ファンド50VA(適 格機関投資家 限定)	4,159,227,906円	3,504,438,578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)	319,046,954円	275,194,302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)	847,270,983円	426,211,367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)	999,463,797円	793,276,429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)	4,058,272,373円	3,115,298,558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)	46,003,219円	13,741,300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 )	1,326,335,640円	1,034,605,688円
D I A M世界バランス ファンド3 5 V A ( 適格 機関投資家限定 )	5,832,541,011円	4,854,751,930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 )	20,951,975,557円	18,487,572,950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 )	793,931,787円	674,423,695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 )	2,393,749,966円	2,103,188,596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 )	13,362,055,990円	11,713,549,624円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	4,455,809円	6,605,415円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	7,115,578円	81,551円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	5,949,384円	4,672,150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 )	12,007,265,860円	10,473,010,652円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家 限定 )	112,585,022円	94,419,937円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関投資家 限定 )	42,353,931円	33,859,295円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	39,006,138円	35,633,726円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	12,076,611円	73,509円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	120,493円	119,539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 )	670,998,289円	612,913,713円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7 V A ( 1 3 0 3 ) ( 適格機関 投資家限定 )	1,887,540,594円	1,622,373,744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 )	2,485,634,300円		2,159,696,264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 )	94,839,111円		91,571,301円	
	計	142,969,149,329円		125,576,804,116円	
2 .	受益権の総数	142,969,149,329口		125,576,804,116口	
3 .	2 差入代用有価証券	株式 2,965,500,000円		株式 3,203,000,000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27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成28年2月25日現在	平成29年2月27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	14,881,124,320	3,265,212,730
合計	14,881,124,320	3,265,212,730

（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28年2月9日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月8日から平成29年2月27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28年2月25日 現在				平成29年2月27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	3,945,500,000	-	3,762,720,000	182,780,000	4,740,289,900	-	4,701,690,000	38,599,900
合計	3,945,500,000	-	3,762,720,000	182,780,000	4,740,289,900	-	4,701,690,000	38,599,900

## （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28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.8933円	2.2706円
（1万口当たり純資産額）	（18,933円）	（22,706円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成29年2月27日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,700	2,946.00	16,792,200	
日本水産	182,800	562.00	102,733,600	
マルハニチロ	26,700	3,345.00	89,311,500	
ハウスイ	12,000	126.00	1,512,000	
カネコ種苗	4,900	1,438.00	7,046,200	
サカタのタネ	20,800	3,200.00	66,560,000	
ホクト	14,400	2,165.00	31,176,000	
ホクリヨウ	1,600	790.00	1,264,000	
ショーボンドホールディングス	13,600	4,890.00	66,504,000	
ミライト・ホールディングス	43,300	1,116.00	48,322,800	
タマホーム	10,800	565.00	6,102,000	
サンヨーホームズ	3,200	706.00	2,259,200	
インベスターズクラウド	1,300	5,140.00	6,682,000	
住石ホールディングス	39,800	99.00	3,940,200	
日鉄鉱業	3,900	5,720.00	22,308,000	
三井松島産業	8,700	1,514.00	13,171,800	
国際石油開発帝石	740,900	1,113.50	824,992,150	
日本海洋掘削	4,900	2,489.00	12,196,100	
石油資源開発	22,200	2,668.00	59,229,600	
K&Oエナジーグループ	9,500	1,799.00	17,090,500	
ダイセキ環境ソリューション	3,960	1,316.00	5,211,360	
安藤・間	101,100	815.00	82,396,500	
東急建設	49,900	831.00	41,466,900	
コムシスホールディングス	55,000	1,990.00	109,450,000	
ミサワホーム	16,600	1,057.00	17,546,200	
ビーアールホールディングス	13,200	348.00	4,593,600	
高松コンストラクショングループ	10,600	2,736.00	29,001,600	
東建コーポレーション	5,200	8,090.00	42,068,000	
ヤマウラ	6,900	622.00	4,291,800	
大成建設	715,000	783.00	559,845,000	
大林組	421,800	1,048.00	442,046,400	
清水建設	430,000	1,027.00	441,610,000	
飛鳥建設	135,500	172.00	23,306,000	
長谷工コーポレーション	164,100	1,329.00	218,088,900	
松井建設	15,500	1,020.00	15,810,000	
銭高組	20,000	422.00	8,440,000	
鹿島建設	618,000	725.00	448,050,000	
不動テトラ	113,800	202.00	22,987,600	
大末建設	5,100	1,031.00	5,258,100	
鉄建建設	85,000	331.00	28,135,000	
西松建設	162,000	585.00	94,770,000	
三井住友建設	538,300	125.00	67,287,500	
大豊建設	51,000	517.00	26,367,000	

前田建設工業	87,000	1,000.00	87,000,000
佐田建設	9,800	426.00	4,174,800
ナカノフード建設	10,800	592.00	6,393,600
奥村組	115,000	705.00	81,075,000
東鉄工業	16,900	3,070.00	51,883,000
イチケン	13,000	500.00	6,500,000
浅沼組	45,000	361.00	16,245,000
戸田建設	163,000	684.00	111,492,000
熊谷組	221,000	307.00	67,847,000
青木あすなろ建設	9,200	831.00	7,645,200
北野建設	29,000	319.00	9,251,000
植木組	18,000	260.00	4,680,000
三井ホーム	18,000	584.00	10,512,000
矢作建設工業	19,200	1,032.00	19,814,400
ピーエス三菱	14,900	418.00	6,228,200
日本ハウスホールディングス	28,700	509.00	14,608,300
大東建託	51,700	15,735.00	813,499,500
新日本建設	16,800	940.00	15,792,000
N I P P O	33,000	2,161.00	71,313,000
東亜道路工業	27,000	342.00	9,234,000
前田道路	44,000	2,025.00	89,100,000
日本道路	42,000	483.00	20,286,000
東亜建設工業	11,400	1,971.00	22,469,400
若築建設	82,000	152.00	12,464,000
東洋建設	40,500	418.00	16,929,000
五洋建設	156,200	531.00	82,942,200
大林道路	14,600	679.00	9,913,400
世紀東急工業	20,400	511.00	10,424,400
福田組	23,000	1,041.00	23,943,000
日本ドライケミカル	1,700	2,301.00	3,911,700
住友林業	96,700	1,632.00	157,814,400
日本基礎技術	15,800	361.00	5,703,800
日成ビルド工業	42,000	557.00	23,394,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	74,000	79.00	5,846,000
巴コーポレーション	17,600	364.00	6,406,400
パナホーム	53,000	1,040.00	55,120,000
大和ハウス工業	415,400	3,104.00	1,289,401,600
ライト工業	27,100	1,139.00	30,866,900
積水ハウス	442,400	1,800.50	796,541,200
日特建設	12,200	452.00	5,514,400
北陸電気工事	6,900	875.00	6,037,500
ユアテック	22,000	784.00	17,248,000
西部電気工業	2,400	2,284.00	5,481,600
四電工	6,000	433.00	2,598,000
中電工	17,700	2,363.00	41,825,100
関電工	56,000	923.00	51,688,000
きんでん	93,600	1,499.00	140,306,400
東京エネシス	15,000	943.00	14,145,000
トーエネック	20,000	535.00	10,700,000
住友電設	9,700	1,284.00	12,454,800

日本電設工業	22,900	1,938.00	44,380,200
協和エクシオ	55,100	1,584.00	87,278,400
新日本空調	10,900	1,350.00	14,715,000
日本工営	8,800	2,714.00	23,883,200
N D S	2,200	2,911.00	6,404,200
九電工	27,300	2,829.00	77,231,700
三機工業	31,200	969.00	30,232,800
日揮	131,200	2,015.00	264,368,000
中外炉工業	43,000	242.00	10,406,000
ヤマト	12,900	541.00	6,978,900
太平電業	19,000	1,078.00	20,482,000
高砂熱学工業	38,700	1,633.00	63,197,100
三晃金属工業	1,300	3,285.00	4,270,500
N E C ネットエスアイ	13,600	2,162.00	29,403,200
朝日工業社	3,200	3,140.00	10,048,000
明星工業	25,600	635.00	16,256,000
大気社	18,600	2,864.00	53,270,400
ダイダン	19,000	984.00	18,696,000
日比谷総合設備	15,700	1,695.00	26,611,500
東芝プラントシステム	22,800	1,570.00	35,796,000
日本製粉	41,900	1,688.00	70,727,200
日清製粉グループ本社	154,300	1,696.00	261,692,800
日東富士製粉	800	4,030.00	3,224,000
昭和産業	58,000	608.00	35,264,000
鳥越製粉	11,600	799.00	9,268,400
中部飼料	15,500	1,162.00	18,011,000
フィード・ワン	85,700	198.00	16,968,600
東洋精糖	23,000	118.00	2,714,000
日本甜菜製糖	7,300	2,494.00	18,206,200
三井製糖	10,000	2,724.00	27,240,000
塩水港精糖	16,300	260.00	4,238,000
日新製糖	6,000	1,905.00	11,430,000
ネクスト	32,500	743.00	24,147,500
ジェイエイシーリクルートメント	8,100	1,602.00	12,976,200
日本M & A センター	37,900	3,445.00	130,565,500
中広	1,400	698.00	977,200
タケエイ	11,600	1,066.00	12,365,600
トラスト・テック	5,400	1,740.00	9,396,000
コシダカホールディングス	4,500	2,394.00	10,773,000
パソナグループ	11,400	804.00	9,165,600
C D S	3,200	1,016.00	3,251,200
リンクアンドモチベーション	29,800	505.00	15,049,000
G C A	11,700	955.00	11,173,500
エス・エム・エス	18,500	2,492.00	46,102,000
テンブホールディングス	101,400	1,898.00	192,457,200
リニカル	7,800	1,489.00	11,614,200
クックパッド	29,300	960.00	28,128,000
エスクリ	4,700	896.00	4,211,200
アイ・ケイ・ケイ	6,000	736.00	4,416,000
森永製菓	27,500	5,120.00	140,800,000

中村屋	3,400	5,150.00	17,510,000
江崎グリコ	35,200	5,450.00	191,840,000
名糖産業	6,300	1,397.00	8,801,100
不二家	81,000	226.00	18,306,000
山崎製パン	103,100	2,237.00	230,634,700
第一屋製パン	23,000	126.00	2,898,000
モロゾフ	22,000	507.00	11,154,000
亀田製菓	7,900	5,000.00	39,500,000
寿スピリッツ	10,100	2,669.00	26,956,900
カルビー	57,400	3,810.00	218,694,000
森永乳業	126,000	878.00	110,628,000
六甲バター	6,300	2,420.00	15,246,000
ヤクルト本社	75,500	6,150.00	464,325,000
明治ホールディングス	83,300	9,070.00	755,531,000
雪印メグミルク	30,400	3,080.00	93,632,000
プリマハム	89,000	456.00	40,584,000
日本ハム	95,000	2,995.00	284,525,000
林兼産業	4,700	867.00	4,074,900
丸大食品	68,000	488.00	33,184,000
S Foods	7,600	3,175.00	24,130,000
伊藤ハム米久ホールディングス	81,300	1,119.00	90,974,700
学情	5,500	1,224.00	6,732,000
スタジオアリス	5,400	2,260.00	12,204,000
シミックホールディングス	6,700	1,479.00	9,909,300
システナ	9,900	1,625.00	16,087,500
N J S	3,000	1,419.00	4,257,000
デジタルアーツ	5,500	3,305.00	18,177,500
新日鉄住金ソリューションズ	20,700	2,250.00	46,575,000
総合警備保障	47,700	4,245.00	202,486,500
キューブシステム	5,600	683.00	3,824,800
いちご	117,800	359.00	42,290,200
日本駐車場開発	149,600	150.00	22,440,000
コア	5,300	1,336.00	7,080,800
カカクコム	93,600	1,627.00	152,287,200
アイロムグループ	3,900	1,312.00	5,116,800
ルネサンス	6,800	1,798.00	12,226,400
ディップ	17,000	2,258.00	38,386,000
S B Sホールディングス	12,400	817.00	10,130,800
オプトホールディング	9,300	947.00	8,807,100
新日本科学	13,900	571.00	7,936,900
ツクイ	31,200	699.00	21,808,800
キャリアデザインセンター	2,800	1,149.00	3,217,200
エムスリー	113,600	2,864.00	325,350,400
ツカダ・グローバルホールディング	9,600	622.00	5,971,200
アウトソーシング	7,500	3,740.00	28,050,000
ウェルネット	9,900	1,313.00	12,998,700
ワールドホールディングス	3,000	1,988.00	5,964,000
ディー・エヌ・エー	58,800	2,534.00	148,999,200
博報堂D Yホールディングス	181,800	1,359.00	247,066,200
ぐるなび	19,000	2,236.00	42,484,000

エスアールジータカミヤ	14,300	582.00	8,322,600
ジャパンベストレスキューシステム	17,300	256.00	4,428,800
ファンコミュニケーションズ	33,400	775.00	25,885,000
ライク	2,800	2,584.00	7,235,200
WDBホールディングス	4,800	1,330.00	6,384,000
ティア	6,500	739.00	4,803,500
パリュウコマース	12,900	404.00	5,211,600
インフォマート	55,700	590.00	32,863,000
サッポロホールディングス	46,100	2,822.00	130,094,200
アサヒグループホールディングス	263,900	4,026.00	1,062,461,400
麒麟ホールディングス	605,700	1,947.50	1,179,600,750
宝ホールディングス	102,000	1,142.00	116,484,000
オエノンホールディングス	37,000	252.00	9,324,000
養命酒製造	4,500	1,883.00	8,473,500
コカ・コーラウエスト	47,700	3,385.00	161,464,500
コカ・コーライーストジャパン	54,800	2,523.00	138,260,400
サントリー食品インターナショナル	96,400	4,740.00	456,936,000
ダイドーグループホールディングス	6,500	5,720.00	37,180,000
伊藤園	41,800	3,835.00	160,303,000
キーコーヒー	12,500	2,172.00	27,150,000
ユニカフェ	4,200	978.00	4,107,600
ジャパンフーズ	2,100	1,387.00	2,912,700
日清オイリオグループ	81,000	581.00	47,061,000
不二製油グループ本社	37,600	2,469.00	92,834,400
J-オイルミルズ	6,600	4,140.00	27,324,000
ローソン	43,000	7,740.00	332,820,000
サンエー	9,300	5,160.00	47,988,000
カワチ薬品	9,600	2,993.00	28,732,800
エービーシー・マート	22,500	6,730.00	151,425,000
ハードオフコーポレーション	5,500	1,164.00	6,402,000
高千穂交易	4,900	1,075.00	5,267,500
アスクル	12,900	3,220.00	41,538,000
ゲオホールディングス	20,700	1,374.00	28,441,800
アダストリア	19,000	2,864.00	54,416,000
ジーフット	7,500	776.00	5,820,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,900	731.00	1,388,900
伊藤忠食品	3,100	4,520.00	14,012,000
くらコーポレーション	8,100	4,605.00	37,300,500
キャンドウ	6,600	1,806.00	11,919,600
エレマテック	4,900	1,935.00	9,481,500
パルグループホールディングス	6,300	2,721.00	17,142,300
JALUX	4,000	2,258.00	9,032,000
エディオン	48,000	1,019.00	48,912,000
あらた	5,600	2,899.00	16,234,400
サーラコーポレーション	15,500	647.00	10,028,500
ワッツ	5,500	1,255.00	6,902,500
トーメンデバイス	1,900	2,215.00	4,208,500
ハローズ	4,100	2,271.00	9,311,100
J Pホールディングス	37,800	253.00	9,563,400
あみやき亭	2,400	4,030.00	9,672,000

東京エレクトロン デバイス	4,600	1,630.00	7,498,000
ひらまつ	17,200	672.00	11,558,400
フィールズ	9,400	1,251.00	11,759,400
双日	731,200	291.00	212,779,200
ゲンキー	2,500	6,440.00	16,100,000
アルフレッサ ホールディングス	146,600	2,012.00	294,959,200
大黒天物産	3,000	5,060.00	15,180,000
ハニーズ	10,900	1,114.00	12,142,600
ファーマライズホールディングス	3,100	518.00	1,605,800
キッコーマン	98,000	3,405.00	333,690,000
味の素	289,800	2,256.00	653,788,800
キューピー	71,600	2,994.00	214,370,400
ハウス食品グループ本社	52,100	2,411.00	125,613,100
カゴメ	50,600	2,883.00	145,879,800
焼津水産化学工業	7,000	1,240.00	8,680,000
アリアケジャパン	11,500	6,230.00	71,645,000
ピエトロ	1,700	1,650.00	2,805,000
エバラ食品工業	3,600	2,119.00	7,628,400
ニチレイ	69,300	2,616.00	181,288,800
横浜冷凍	30,900	1,077.00	33,279,300
東洋水産	69,200	4,105.00	284,066,000
イトアンド	1,700	2,311.00	3,928,700
日清食品ホールディングス	55,000	6,300.00	346,500,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,422.00	9,954,000
一正蒲鉾	5,000	1,212.00	6,060,000
フジッコ	13,700	2,423.00	33,195,100
ロック・フィールド	14,700	1,747.00	25,680,900
日本たばこ産業	779,500	3,778.00	2,944,951,000
ケンコーマヨネーズ	5,000	2,727.00	13,635,000
わらべや日洋ホールディングス	8,300	2,503.00	20,774,900
なとり	7,200	1,943.00	13,989,600
北の達人コーポレーション	3,100	620.00	1,922,000
ユーグレナ	45,300	1,218.00	55,175,400
片倉工業	16,500	1,449.00	23,908,500
グンゼ	98,000	413.00	40,474,000
ヒューリック	258,400	1,068.00	275,971,200
神栄	18,000	175.00	3,150,000
山下医科器械	1,100	1,809.00	1,989,900
ラサ商事	5,800	705.00	4,089,000
アルペン	9,500	1,971.00	18,724,500
ラクーン	5,600	507.00	2,839,200
クオール	14,000	1,568.00	21,952,000
アルコニックス	7,100	1,746.00	12,396,600
神戸物産	6,700	3,870.00	25,929,000
ジェイアイエヌ	8,400	5,950.00	49,980,000
ビックカメラ	71,100	1,085.00	77,143,500
DCMホールディングス	75,200	986.00	74,147,200
MonotaRO	43,900	3,235.00	142,016,500
東京一番フーズ	2,400	583.00	1,399,200
ダイヤモンドダイニング	2,800	1,642.00	4,597,600

あい ホールディングス	17,600	2,347.00	41,307,200
ディービーエックス	4,500	1,305.00	5,872,500
きちり	3,600	657.00	2,365,200
アークランドサービスホールディングス	3,900	3,070.00	11,973,000
J.フロント リテイリング	156,700	1,717.00	269,053,900
ドトール・日レスホールディングス	21,700	2,144.00	46,524,800
マツモトキヨシホールディングス	23,400	5,260.00	123,084,000
ブロンコピリー	6,500	2,811.00	18,271,500
スタートトゥデイ	113,100	2,346.00	265,332,600
トレジャー・ファクトリー	3,700	802.00	2,967,400
物語コーポレーション	3,300	4,600.00	15,180,000
ココカラファイン	12,900	4,720.00	60,888,000
三越伊勢丹ホールディングス	246,400	1,422.00	350,380,800
東洋紡	521,000	195.00	101,595,000
ユニチカ	361,000	93.00	33,573,000
富士紡ホールディングス	6,400	3,235.00	20,704,000
日清紡ホールディングス	69,600	1,158.00	80,596,800
倉敷紡績	132,000	243.00	32,076,000
ダイワボウホールディングス	105,000	298.00	31,290,000
シキボウ	72,000	150.00	10,800,000
日東紡績	106,000	489.00	51,834,000
トヨタ紡織	43,900	2,467.00	108,301,300
マクニカ・富士エレホールディングス	22,900	1,570.00	35,953,000
H a m e e	1,900	1,003.00	1,905,700
ウエルシアホールディングス	24,600	3,140.00	77,244,000
クリエイトSDホールディングス	18,200	2,586.00	47,065,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,300	1,036.00	24,138,800
八洲電機	9,800	645.00	6,321,000
U K Cホールディングス	8,000	2,173.00	17,384,000
丸善C H Iホールディングス	14,800	366.00	5,416,800
O C H Iホールディングス	3,300	1,393.00	4,596,900
T O K A Iホールディングス	54,600	827.00	45,154,200
ミサワ	1,800	461.00	829,800
エー・ピーカンパニー	2,300	863.00	1,984,900
三洋貿易	6,800	1,802.00	12,253,600
チムニー	3,400	2,858.00	9,717,200
シュッピン	4,700	1,587.00	7,458,900
ビューティガレージ	1,100	1,259.00	1,384,900
ウイン・パートナーズ	9,000	974.00	8,766,000
ネクステージ	2,200	2,795.00	6,149,000
ジョイフル本田	20,100	3,485.00	70,048,500
鳥貴族	3,100	2,409.00	7,467,900
キリン堂ホールディングス	4,100	832.00	3,411,200
ホットランド	4,900	1,066.00	5,223,400
すかいらく	53,200	1,624.00	86,396,800
綿半ホールディングス	5,000	1,655.00	8,275,000
日本毛織	37,000	895.00	33,115,000
ダイトウボウ	20,000	76.00	1,520,000



トーア紡コーポレーション	5,500	542.00	2,981,000
ダイドーリミテッド	15,000	457.00	6,855,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	40,900	1,009.00	41,268,100
三栄建築設計	5,000	1,517.00	7,585,000
野村不動産ホールディングス	82,200	1,904.00	156,508,800
三重交通グループホールディングス	22,100	391.00	8,641,100
サムティ	10,000	1,145.00	11,450,000
ディア・ライフ	8,800	395.00	3,476,000
エー・ディー・ワークス	116,100	42.00	4,876,200
日本商業開発	6,900	1,922.00	13,261,800
プレサンスコーポレーション	19,300	1,375.00	26,537,500
ユニゾホールディングス	10,200	2,945.00	30,039,000
THEグローバル社	4,900	457.00	2,239,300
日本管理センター	8,900	1,356.00	12,068,400
サンセイランディック	2,700	801.00	2,162,700
エストラスト	2,400	709.00	1,701,600
フージャースホールディングス	16,100	636.00	10,239,600
オープンハウス	17,900	2,666.00	47,721,400
東急不動産ホールディングス	299,500	637.00	190,781,500
飯田グループホールディングス	103,300	1,896.00	195,856,800
ムゲンエステート	4,000	737.00	2,948,000
帝国繊維	13,800	1,730.00	23,874,000
ブックオフコーポレーション	7,300	843.00	6,153,900
日本コークス工業	107,000	102.00	10,914,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	785.00	3,061,500
ミタチ産業	3,300	643.00	2,121,900
B E E N O S	1,500	1,453.00	2,179,500
あさひ	9,200	1,283.00	11,803,600
日本調剤	4,400	3,890.00	17,116,000
コスモス薬品	6,200	21,360.00	132,432,000
シップヘルスケアホールディングス	23,800	3,150.00	74,970,000
トーエル	6,200	952.00	5,902,400
一六堂	3,300	395.00	1,303,500
ソフトクリエイイトホールディングス	6,100	1,342.00	8,186,200
セブン&アイ・ホールディングス	518,500	4,407.00	2,285,029,500
薬王堂	6,200	2,444.00	15,152,800
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	33,300	976.00	32,500,800
明治電機工業	4,300	1,232.00	5,297,600
ツルハホールディングス	24,800	10,400.00	257,920,000
デリカフーズ	2,900	1,076.00	3,120,400
スターティア	2,600	541.00	1,406,600
サンマルクホールディングス	8,000	3,390.00	27,120,000
フェリシモ	3,600	1,033.00	3,718,800
トリドールホールディングス	15,200	2,318.00	35,233,600
帝人	107,400	2,151.00	231,017,400
東レ	954,000	995.00	949,230,000
クラレ	221,200	1,691.00	374,049,200
旭化成	820,000	1,084.50	889,290,000

サカイオーベックス	3,300	1,899.00	6,266,700
稲葉製作所	7,100	1,337.00	9,492,700
宮地エンジニアリンググループ	38,000	234.00	8,892,000
トーカロ	8,600	2,641.00	22,712,600
アルファ	4,500	1,353.00	6,088,500
SUMCO	137,200	1,652.00	226,654,400
川田テクノロジーズ	2,500	7,640.00	19,100,000
ファーストブラザーズ	1,300	1,710.00	2,223,000
シーアールイー	1,800	1,765.00	3,177,000
住江織物	33,000	284.00	9,372,000
日本フェルト	7,900	520.00	4,108,000
イチカワ	9,000	301.00	2,709,000
エコナックホールディングス	44,000	53.00	2,332,000
日東製網	1,500	1,908.00	2,862,000
芦森工業	29,000	166.00	4,814,000
アツギ	108,000	132.00	14,256,000
コメダホールディングス	16,700	1,841.00	30,744,700
サツドラホールディングス	1,700	2,030.00	3,451,000
ダイユー・リックホールディングス	4,200	751.00	3,154,200
パロックジャパンリミテッド	7,300	1,453.00	10,606,900
クスリのアオキホールディングス	9,800	4,835.00	47,383,000
ダイニック	26,000	190.00	4,940,000
共和レザー	7,700	924.00	7,114,800
セーレン	32,800	1,463.00	47,986,400
ソトー	5,000	1,158.00	5,790,000
東海染工	19,000	149.00	2,831,000
小松精練	18,600	723.00	13,447,800
ワコールホールディングス	78,000	1,411.00	110,058,000
ホギメディカル	8,300	6,680.00	55,444,000
レナウン	35,700	116.00	4,141,200
クラウドディア	3,400	551.00	1,873,400
T S Iホールディングス	54,100	775.00	41,927,500
T I S	41,100	2,717.00	111,668,700
ネオス	3,900	449.00	1,751,100
電算システム	4,300	1,695.00	7,288,500
グリー	75,500	702.00	53,001,000
コーエーテックモホールディングス	29,400	2,244.00	65,973,600
三菱総合研究所	4,800	3,145.00	15,096,000
ボルテージ	2,500	1,010.00	2,525,000
電算	1,500	2,488.00	3,732,000
A G S	2,600	2,022.00	5,257,200
ファインデックス	9,200	1,076.00	9,899,200
ヒト・コミュニケーションズ	2,800	1,740.00	4,872,000
ブレインパッド	1,900	1,119.00	2,126,100
K L a b	23,700	893.00	21,164,100
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,900	1,097.00	9,763,300
イーブクイニシアティブジャパン	2,100	930.00	1,953,000
ネクソン	135,600	1,897.00	257,233,200
アイスタイル	26,100	962.00	25,108,200

エムアップ	3,700	936.00	3,463,200
エイチーム	6,900	2,188.00	15,097,200
テクノスジャパン	9,600	1,183.00	11,356,800
e n i s h	3,800	570.00	2,166,000
コロプラ	34,500	1,056.00	36,432,000
モバイルクリエイト	8,600	413.00	3,551,800
オルトプラス	5,300	788.00	4,176,400
ブロードリーフ	30,600	672.00	20,563,200
ハーツユナイテッドグループ	6,600	1,461.00	9,642,600
メディアドゥ	2,700	1,665.00	4,495,500
ブイキューブ	6,900	630.00	4,347,000
サイバーリンクス	2,000	1,032.00	2,064,000
ディー・エル・イー	3,800	622.00	2,363,600
フィックスターズ	1,800	3,500.00	6,300,000
VOYAGE GROUP	4,300	1,808.00	7,774,400
オブティム	1,100	5,540.00	6,094,000
セレス	2,200	1,660.00	3,652,000
特種東海製紙	7,700	4,265.00	32,840,500
ベリサーブ	1,500	2,960.00	4,440,000
ティーガイア	12,400	1,928.00	23,907,200
日本アジアグループ	14,100	418.00	5,893,800
豆蔵ホールディングス	9,200	876.00	8,059,200
テクマトリックス	7,800	1,183.00	9,227,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	259,900	259.00	67,314,100
GMOペイメントゲートウェイ	10,200	6,440.00	65,688,000
ザッパラス	7,500	457.00	3,427,500
インターネットイニシアティブ	18,300	2,023.00	37,020,900
さくらインターネット	8,800	998.00	8,782,400
GMOクラウド	2,800	1,860.00	5,208,000
SRAホールディングス	6,600	2,890.00	19,074,000
MINORIソリューションズ	2,700	1,371.00	3,701,700
システムインテグレータ	2,000	680.00	1,360,000
朝日ネット	11,700	520.00	6,084,000
アドソル日進	2,500	1,283.00	3,207,500
フリービット	6,900	949.00	6,548,100
コムチュア	2,100	3,630.00	7,623,000
サイバーコム	1,600	1,084.00	1,734,400
王子ホールディングス	514,000	538.00	276,532,000
日本製紙	58,900	2,041.00	120,214,900
三菱製紙	18,900	785.00	14,836,500
北越紀州製紙	73,500	769.00	56,521,500
中越パルプ工業	52,000	238.00	12,376,000
巴川製紙所	21,000	250.00	5,250,000
大王製紙	52,500	1,389.00	72,922,500
メディカル・データ・ビジョン	2,100	2,819.00	5,919,900
g u m i	12,800	1,247.00	15,961,600
PCIホールディングス	1,500	2,844.00	4,266,000
パイブドHD	1,800	1,109.00	1,996,200
オーブンドア	1,200	3,215.00	3,858,000

LINE	20,700	3,805.00	78,763,500
レンゴー	127,000	644.00	81,788,000
トーモク	42,000	329.00	13,818,000
ザ・バック	9,300	3,070.00	28,551,000
AOI TYO HOLDINGS	10,200	836.00	8,527,200
昭和電工	87,500	1,963.00	171,762,500
住友化学	968,000	626.00	605,968,000
住友精化	5,500	4,725.00	25,987,500
日産化学工業	72,000	3,695.00	266,040,000
ラサ工業	51,000	149.00	7,599,000
クレハ	9,900	4,705.00	46,579,500
多木化学	8,000	904.00	7,232,000
テイカ	20,000	683.00	13,660,000
石原産業	23,600	1,106.00	26,101,600
片倉コープアグリ	17,000	253.00	4,301,000
日東エフシー	7,700	968.00	7,453,600
日本曹達	79,000	653.00	51,587,000
東ソー	380,000	965.00	366,700,000
トクヤマ	205,000	534.00	109,470,000
セントラル硝子	134,000	510.00	68,340,000
東亜合成	82,200	1,262.00	103,736,400
大阪ソーダ	57,000	499.00	28,443,000
関東電化工業	27,000	1,081.00	29,187,000
デンカ	272,000	586.00	159,392,000
イビデン	87,800	1,812.00	159,093,600
信越化学工業	235,800	9,560.00	2,254,248,000
日本カーバイド工業	45,000	159.00	7,155,000
堺化学工業	49,000	413.00	20,237,000
エア・ウォーター	108,400	2,092.00	226,772,800
大陽日酸	101,300	1,385.00	140,300,500
日本化学工業	49,000	244.00	11,956,000
日本パーカライジング	67,100	1,350.00	90,585,000
高压ガス工業	19,500	738.00	14,391,000
チタン工業	16,000	190.00	3,040,000
四国化成工業	19,000	1,158.00	22,002,000
戸田工業	26,000	281.00	7,306,000
ステラ ケミファ	6,200	3,245.00	20,119,000
保土谷化学工業	4,600	3,615.00	16,629,000
日本触媒	20,700	7,320.00	151,524,000
大日精化工業	54,000	697.00	37,638,000
カネカ	177,000	872.00	154,344,000
協和発酵キリン	157,300	1,677.00	263,792,100
三菱瓦斯化学	122,500	2,309.00	282,852,500
三井化学	597,000	568.00	339,096,000
J S R	132,100	1,919.00	253,499,900
東京応化工業	24,600	3,650.00	89,790,000
大阪有機化学工業	8,700	966.00	8,404,200
三菱ケミカルホールディングス	885,600	864.00	765,158,400
K Hネオケム	16,100	1,388.00	22,346,800
ダイセル	177,300	1,360.00	241,128,000

住友ベークライト	116,000	665.00	77,140,000
積水化学工業	298,400	1,847.00	551,144,800
日本ゼオン	111,000	1,246.00	138,306,000
アイカ工業	42,100	2,868.00	120,742,800
宇部興産	662,000	281.00	186,022,000
積水樹脂	20,300	1,863.00	37,818,900
タキロン	28,000	543.00	15,204,000
旭有機材	42,000	240.00	10,080,000
日立化成	73,100	3,150.00	230,265,000
ニチバン	13,000	996.00	12,948,000
リケンテクノス	28,400	528.00	14,995,200
大倉工業	32,000	558.00	17,856,000
積水化成品工業	18,200	815.00	14,833,000
群栄化学工業	3,100	3,730.00	11,563,000
タイガースポリマー	6,500	783.00	5,089,500
ミライアル	5,000	886.00	4,430,000
ダイキアクシス	2,200	1,375.00	3,025,000
ダイキョーニシカワ	23,100	1,499.00	34,626,900
日本化薬	85,000	1,543.00	131,155,000
カーリットホールディングス	12,300	611.00	7,515,300
E P Sホールディングス	16,300	1,544.00	25,167,200
レグス	3,000	785.00	2,355,000
プレステージ・インターナショナル	18,700	909.00	16,998,300
フェイス	3,400	1,367.00	4,647,800
アミューズ	7,300	2,049.00	14,957,700
野村総合研究所	92,600	3,900.00	361,140,000
ドリームインキュベータ	4,000	2,084.00	8,336,000
サイバネットシステム	10,200	774.00	7,894,800
クイック	6,800	1,224.00	8,323,200
T A C	7,700	229.00	1,763,300
C Eホールディングス	1,800	1,134.00	2,041,200
ケネディクス	166,200	442.00	73,460,400
電通	146,100	6,180.00	902,898,000
インテージホールディングス	7,100	2,238.00	15,889,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,300	939.00	5,915,700
東邦システムサイエンス	4,300	657.00	2,825,100
ぴあ	4,000	2,930.00	11,720,000
イオンファンタジー	3,900	3,010.00	11,739,000
ソースネクスト	6,800	622.00	4,229,600
シーティーエス	7,200	812.00	5,846,400
ネクシィーズグループ	4,700	1,600.00	7,520,000
メディカルシステムネットワーク	14,100	440.00	6,204,000
日本精化	11,000	923.00	10,153,000
扶桑化学工業	9,400	3,185.00	29,939,000
A D E K A	56,500	1,565.00	88,422,500
日油	106,000	1,224.00	129,744,000
ミヨシ油脂	50,000	142.00	7,100,000
新日本理化	21,600	153.00	3,304,800
ハリマ化成グループ	11,300	796.00	8,994,800
花王	333,900	5,780.00	1,929,942,000

第一工業製薬	29,000	443.00	12,847,000
日華化学	4,100	1,222.00	5,010,200
三洋化成工業	8,200	4,635.00	38,007,000
武田薬品工業	492,900	5,325.00	2,624,692,500
アステラス製薬	1,343,100	1,523.00	2,045,541,300
大日本住友製薬	93,100	1,992.00	185,455,200
塩野義製薬	177,900	5,507.00	979,695,300
田辺三菱製薬	153,200	2,330.00	356,956,000
わかもと製薬	7,000	249.00	1,743,000
あすか製薬	14,300	1,741.00	24,896,300
日本新薬	30,100	6,130.00	184,513,000
バイオフェルミン製薬	2,200	3,145.00	6,919,000
中外製薬	130,900	3,720.00	486,948,000
科研製薬	24,500	6,020.00	147,490,000
エーザイ	161,800	6,285.00	1,016,913,000
理研ビタミン	4,200	4,315.00	18,123,000
ロート製薬	64,400	2,161.00	139,168,400
小野薬品工業	298,600	2,502.50	747,246,500
久光製薬	37,100	6,070.00	225,197,000
有機合成薬品工業	9,400	272.00	2,556,800
持田製薬	9,000	8,490.00	76,410,000
参天製薬	237,300	1,634.00	387,748,200
扶桑薬品工業	4,500	2,876.00	12,942,000
日本ケミファ	1,800	5,540.00	9,972,000
ツムラ	44,100	3,315.00	146,191,500
日医工	30,700	1,702.00	52,251,400
テルモ	192,400	3,905.00	751,322,000
みらかホールディングス	33,500	5,190.00	173,865,000
キッセイ薬品工業	23,300	2,854.00	66,498,200
生化学工業	24,400	1,765.00	43,066,000
栄研化学	11,000	3,040.00	33,440,000
日水製薬	5,300	1,407.00	7,457,100
鳥居薬品	9,000	2,900.00	26,100,000
JCRファーマ	10,100	2,751.00	27,785,100
東和薬品	6,000	5,470.00	32,820,000
富士製薬工業	4,300	3,120.00	13,416,000
沢井製薬	22,300	6,100.00	136,030,000
ゼリア新薬工業	26,900	1,743.00	46,886,700
第一三共	386,900	2,575.50	996,460,950
キョーリン製薬ホールディングス	32,100	2,371.00	76,109,100
大幸薬品	6,600	1,884.00	12,434,400
ダイト	7,400	2,321.00	17,175,400
大塚ホールディングス	282,700	5,141.00	1,453,360,700
大正製薬ホールディングス	28,100	9,150.00	257,115,000
ペプチドリーム	24,600	5,350.00	131,610,000
大日本塗料	75,000	230.00	17,250,000
日本ペイントホールディングス	101,500	3,625.00	367,937,500
関西ペイント	138,100	2,172.00	299,953,200
神東塗料	10,000	219.00	2,190,000
中国塗料	37,700	845.00	31,856,500

日本特殊塗料	9,200	1,752.00	16,118,400
藤倉化成	17,900	665.00	11,903,500
太陽ホールディングス	10,700	4,810.00	51,467,000
D I C	51,900	3,960.00	205,524,000
サカタインクス	26,800	1,574.00	42,183,200
東洋インキ S C ホールディングス	130,000	556.00	72,280,000
T & K T O K A	9,500	1,103.00	10,478,500
アルプス技研	5,300	3,120.00	16,536,000
サニックス	22,000	189.00	4,158,000
ダイオーズ	2,600	1,070.00	2,782,000
日本空調サービス	12,800	662.00	8,473,600
オリエンタルランド	141,700	6,324.00	896,110,800
フォーカスシステムズ	5,100	617.00	3,146,700
ダスキン	33,600	2,447.00	82,219,200
パーク24	62,800	3,145.00	197,506,000
明光ネットワークジャパン	16,300	1,219.00	19,869,700
ファルコホールディングス	6,300	1,502.00	9,462,600
クレスコ	2,900	2,446.00	7,093,400
フジ・メディア・ホールディングス	128,900	1,545.00	199,150,500
秀英予備校	2,900	484.00	1,403,600
田谷	2,600	671.00	1,744,600
ラウンドワン	41,000	842.00	34,522,000
リゾートトラスト	50,800	2,074.00	105,359,200
オービック	42,700	5,270.00	225,029,000
ジャストシステム	20,100	1,183.00	23,778,300
T D C ソフトウェアエンジニアリング	5,500	1,259.00	6,924,500
ヤフー	888,500	521.00	462,908,500
ビー・エム・エル	17,200	2,450.00	42,140,000
ワタベウェディング	2,100	600.00	1,260,000
トレンドマイクロ	65,600	4,915.00	322,424,000
りらいあコミュニケーションズ	21,700	1,095.00	23,761,500
インフォメーション・ディベロプメント	3,700	1,195.00	4,421,500
リソー教育	22,400	617.00	13,820,800
日本オラクル	19,900	6,570.00	130,743,000
早稲田アカデミー	1,900	1,285.00	2,441,500
アルファシステムズ	4,100	1,931.00	7,917,100
フューチャー	16,800	866.00	14,548,800
C A C H o l d i n g s	9,300	1,131.00	10,518,300
ソフトバンク・テクノロジー	3,000	3,915.00	11,745,000
トーセ	3,600	807.00	2,905,200
ユー・エス・エス	158,700	1,930.00	306,291,000
オービックビジネスコンサルタント	6,300	5,490.00	34,587,000
伊藤忠テクノソリューションズ	28,100	3,085.00	86,688,500
アイティフォー	16,400	630.00	10,332,000
東京個別指導学院	4,400	1,031.00	4,536,400
東計電算	2,300	2,212.00	5,087,600
サイバーエージェント	69,000	3,165.00	218,385,000
楽天	670,000	1,131.00	757,770,000
エクスネット	1,300	2,040.00	2,652,000

クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,025.00	4,817,500
テー・オー・ダブリュー	10,600	684.00	7,250,400
大塚商会	33,300	5,780.00	192,474,000
総合メディカル	6,000	3,925.00	23,550,000
サイボウズ	16,800	432.00	7,257,600
ソフトブレーン	17,100	537.00	9,182,700
セントラルスポーツ	4,500	3,455.00	15,547,500
パラカ	3,600	1,968.00	7,084,800
電通国際情報サービス	7,700	2,258.00	17,386,600
デジタルガレージ	18,000	2,118.00	38,124,000
イーエムシステムズ	4,300	1,720.00	7,396,000
ウェザーニューズ	4,200	3,610.00	15,162,000
C I J	11,600	530.00	6,148,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,553.00	2,174,200
日本エンタープライズ	13,400	279.00	3,738,600
WOWOW	5,900	3,895.00	22,980,500
スカラ	7,800	827.00	6,450,600
フルキャストホールディングス	13,500	1,092.00	14,742,000
富士フイルムホールディングス	260,700	4,324.00	1,127,266,800
コニカミノルタ	293,800	1,072.00	314,953,600
資生堂	249,500	2,979.50	743,385,250
ライオン	163,000	1,942.00	316,546,000
高砂香料工業	8,600	3,625.00	31,175,000
マンダム	13,200	5,280.00	69,696,000
ミルボン	7,100	5,580.00	39,618,000
ファンケル	28,000	1,673.00	46,844,000
コーセー	21,300	9,510.00	202,563,000
コタ	5,000	1,355.00	6,775,000
シーズ・ホールディングス	17,100	3,270.00	55,917,000
シーボン	1,600	2,565.00	4,104,000
ポーラ・オルビスホールディングス	13,400	10,920.00	146,328,000
ノエビアホールディングス	8,300	4,440.00	36,852,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	977.00	2,735,600
エステー	9,100	1,750.00	15,925,000
アグロ カネショウ	5,200	1,297.00	6,744,400
コニシ	20,600	1,312.00	27,027,200
長谷川香料	16,600	1,934.00	32,104,400
星光P M C	7,200	1,103.00	7,941,600
小林製薬	36,500	5,250.00	191,625,000
荒川化学工業	11,300	2,031.00	22,950,300
メック	10,200	1,187.00	12,107,400
日本高純度化学	3,800	2,491.00	9,465,800
タカラバイオ	28,200	1,567.00	44,189,400
J C U	4,100	6,920.00	28,372,000
新田ゼラチン	8,200	840.00	6,888,000
O A T アグリオ	1,600	1,456.00	2,329,600
デクセリアルズ	34,400	1,261.00	43,378,400
アース製薬	9,500	5,340.00	50,730,000
イハラケミカル工業	18,200	1,069.00	19,455,800
北興化学工業	13,000	488.00	6,344,000



大成ラミック	3,800	2,917.00	11,084,600
クミアイ化学工業	27,200	687.00	18,686,400
日本農薬	30,000	686.00	20,580,000
昭和シェル石油	117,500	1,119.00	131,482,500
富士興産	4,600	492.00	2,263,200
ニチレキ	16,100	931.00	14,989,100
東燃ゼネラル石油	214,000	1,313.00	280,982,000
ユシロ化学工業	7,100	1,426.00	10,124,600
ピーピー・カストロール	5,400	1,610.00	8,694,000
富士石油	30,600	367.00	11,230,200
MORESCO	4,500	1,718.00	7,731,000
出光興産	62,400	3,515.00	219,336,000
JXホールディングス	1,458,200	524.60	764,971,720
コスモエネルギーホールディングス	39,700	1,920.00	76,224,000
横浜ゴム	79,300	2,225.00	176,442,500
東洋ゴム工業	69,400	1,789.00	124,156,600
ブリヂストン	443,600	4,495.00	1,993,982,000
住友ゴム工業	123,000	1,842.00	226,566,000
藤倉ゴム工業	11,100	699.00	7,758,900
オカモト	40,000	1,022.00	40,880,000
アキレス	10,700	1,787.00	19,120,900
フコク	5,300	941.00	4,987,300
ニッタ	11,800	3,015.00	35,577,000
クリエートメディック	4,400	959.00	4,219,600
住友理工	24,300	1,160.00	28,188,000
三ツ星ベルト	32,000	1,028.00	32,896,000
バンドー化学	23,800	1,034.00	24,609,200
旭硝子	647,000	911.00	589,417,000
日本板硝子	59,900	826.00	49,477,400
石塚硝子	19,000	236.00	4,484,000
有沢製作所	22,000	796.00	17,512,000
日本山村硝子	52,000	203.00	10,556,000
日本電気硝子	271,000	692.00	187,532,000
オハラ	5,200	1,350.00	7,020,000
住友大阪セメント	244,000	459.00	111,996,000
太平洋セメント	793,000	389.00	308,477,000
リソルホールディングス	13,000	351.00	4,563,000
日本ヒューム	12,700	710.00	9,017,000
日本コンクリート工業	29,500	347.00	10,236,500
三谷セキサン	6,600	2,673.00	17,641,800
アジアパイルホールディングス	16,300	628.00	10,236,400
東海カーボン	122,800	446.00	54,768,800
日本カーボン	65,000	290.00	18,850,000
東洋炭素	7,300	1,869.00	13,643,700
ノリタケカンパニーリミテド	7,400	2,920.00	21,608,000
TOTO	96,600	4,270.00	412,482,000
日本碍子	165,900	2,418.00	401,146,200
日本特殊陶業	113,300	2,503.00	283,589,900
ダントーホールディングス	11,000	192.00	2,112,000
MARUWA	4,800	3,630.00	17,424,000

品川リフラクトリーズ	33,000	301.00	9,933,000
黒崎播磨	28,000	437.00	12,236,000
ヨータイ	7,000	384.00	2,688,000
イソライト工業	6,800	405.00	2,754,000
東京窯業	16,000	206.00	3,296,000
ニッカトー	4,800	424.00	2,035,200
フジインコーポレーテッド	11,200	2,486.00	27,843,200
エーアンドエーマテリアル	28,000	132.00	3,696,000
ニチアス	69,000	1,079.00	74,451,000
新日鐵住金	592,600	2,763.50	1,637,650,100
神戸製鋼所	227,100	1,071.00	243,224,100
中山製鋼所	14,700	793.00	11,657,100
合同製鐵	7,300	1,850.00	13,505,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	359,200	2,121.00	761,863,200
日新製鋼	59,900	1,598.00	95,720,200
東京製鐵	66,500	977.00	64,970,500
共英製鋼	14,000	2,113.00	29,582,000
大和工業	26,400	3,165.00	83,556,000
東京鐵鋼	27,000	461.00	12,447,000
大阪製鐵	8,200	2,129.00	17,457,800
淀川製鋼所	18,100	3,320.00	60,092,000
東洋鋼鈑	31,400	458.00	14,381,200
丸一鋼管	43,900	3,545.00	155,625,500
モリ工業	4,200	2,421.00	10,168,200
大同特殊鋼	220,000	547.00	120,340,000
日本高周波鋼業	46,000	86.00	3,956,000
日本冶金工業	108,800	225.00	24,480,000
山陽特殊製鋼	78,000	595.00	46,410,000
愛知製鋼	7,700	4,800.00	36,960,000
日立金属	133,700	1,580.00	211,246,000
日本金属	3,200	1,447.00	4,630,400
大平洋金属	84,000	409.00	34,356,000
新日本電工	74,400	318.00	23,659,200
栗本鐵工所	6,300	2,318.00	14,603,400
虹 技	19,000	239.00	4,541,000
日本鑄鉄管	14,000	195.00	2,730,000
日本製鋼所	43,400	1,985.00	86,149,000
三菱製鋼	91,000	248.00	22,568,000
日垂鋼業	18,400	286.00	5,262,400
日本精線	9,000	611.00	5,499,000
大紀アルミニウム工業所	22,000	524.00	11,528,000
日本軽金属ホールディングス	320,300	278.00	89,043,400
三井金属鉱業	357,000	367.00	131,019,000
東邦亜鉛	74,000	577.00	42,698,000
三菱マテリアル	82,000	3,700.00	303,400,000
住友金属鉱山	340,000	1,571.50	534,310,000
DOWAホールディングス	145,000	901.00	130,645,000
古河機械金属	205,000	231.00	47,355,000
エス・サイエンス	65,100	39.00	2,538,900

大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	1,817.00	26,164,800
東邦チタニウム	22,200	947.00	21,023,400
U A C J	167,000	309.00	51,603,000
古河電気工業	44,100	4,075.00	179,707,500
住友電気工業	495,000	1,841.50	911,542,500
フジクラ	172,900	832.00	143,852,800
昭和電線ホールディングス	157,000	90.00	14,130,000
東京特殊電線	1,900	1,729.00	3,285,100
タツタ電線	24,700	454.00	11,213,800
沖電線	14,000	247.00	3,458,000
カナレ電気	1,900	2,200.00	4,180,000
平河ヒューテック	6,200	1,176.00	7,291,200
リョービ	80,000	490.00	39,200,000
アーレスティ	15,200	1,158.00	17,601,600
アサヒホールディングス	19,800	1,946.00	38,530,800
東洋製罐グループホールディングス	93,300	2,029.00	189,305,700
ホッカシホールディングス	34,000	515.00	17,510,000
コロナ	6,900	1,168.00	8,059,200
横河ブリッジホールディングス	23,100	1,387.00	32,039,700
OSJBホールディングス	43,300	254.00	10,998,200
駒井ハルテック	2,500	2,113.00	5,282,500
高田機工	12,000	259.00	3,108,000
三和ホールディングス	130,400	1,050.00	136,920,000
文化シャッター	36,600	829.00	30,341,400
三協立山	17,200	1,699.00	29,222,800
アルインコ	9,100	1,049.00	9,545,900
東洋シャッター	3,400	651.00	2,213,400
L I X I Lグループ	183,000	2,747.00	502,701,000
日本フィルコン	9,800	563.00	5,517,400
ノーリツ	25,700	2,145.00	55,126,500
長府製作所	14,000	2,709.00	37,926,000
リンナイ	22,400	8,960.00	200,704,000
ユニプレス	24,200	2,288.00	55,369,600
ダイニチ工業	7,000	738.00	5,166,000
日東精工	19,000	422.00	8,018,000
三洋工業	17,000	200.00	3,400,000
岡部	27,300	1,011.00	27,600,300
ジーテクト	13,700	2,091.00	28,646,700
中国工業	2,300	693.00	1,593,900
東プレ	25,300	2,945.00	74,508,500
高周波熱錬	24,400	898.00	21,911,200
東京製綱	8,900	1,772.00	15,770,800
サンコール	7,100	542.00	3,848,200
モリテックスチール	7,200	311.00	2,239,200
パイオラックス	6,600	7,660.00	50,556,000
日本発条	123,500	1,276.00	157,586,000
中央発條	15,000	348.00	5,220,000
アドパネクス	2,300	1,857.00	4,271,100
三浦工業	53,700	1,733.00	93,062,100
タクマ	42,100	1,048.00	44,120,800

テクノプロ・ホールディングス	21,300	4,040.00	86,052,000
インターワークス	2,600	1,149.00	2,987,400
Keepers 技研	1,500	2,083.00	3,124,500
ファーストロジック	700	2,402.00	1,681,400
イー・ガーディアン	4,300	1,763.00	7,580,900
リブセンス	9,300	452.00	4,203,600
ジャパンマテリアル	9,600	1,611.00	15,465,600
ベクトル	10,700	1,315.00	14,070,500
ウチヤマホールディングス	6,300	443.00	2,790,900
サクセスホールディングス	1,100	1,362.00	1,498,200
キャリアリンク	3,100	700.00	2,170,000
I B J	10,300	616.00	6,344,800
アサンテ	4,900	1,700.00	8,330,000
N・フィールド	6,200	1,445.00	8,959,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,700	4,010.00	6,817,000
ライドオン・エクスプレス	3,100	953.00	2,954,300
E R Iホールディングス	3,700	822.00	3,041,400
アビスト	2,100	3,820.00	8,022,000
ウィルグループ	5,400	737.00	3,979,800
日本ピューホテル	1,900	1,363.00	2,589,700
リクルートホールディングス	286,500	5,450.00	1,561,425,000
エラン	1,700	1,495.00	2,541,500
ツガミ	35,000	690.00	24,150,000
オークマ	85,000	1,204.00	102,340,000
東芝機械	78,000	477.00	37,206,000
アマダホールディングス	176,700	1,272.00	224,762,400
アイダエンジニアリング	37,300	999.00	37,262,700
滝澤鉄工所	39,000	184.00	7,176,000
富士機械製造	40,000	1,487.00	59,480,000
牧野フライス製作所	65,000	1,036.00	67,340,000
オーエスジー	59,800	2,362.00	141,247,600
ダイジェット工業	17,000	182.00	3,094,000
旭ダイヤモンド工業	37,600	915.00	34,404,000
D M G 森精機	77,700	1,743.00	135,431,100
ソディック	33,300	1,099.00	36,596,700
ディスコ	15,400	16,880.00	259,952,000
日東工器	7,600	2,577.00	19,585,200
パンチ工業	4,800	1,181.00	5,668,800
日本郵政	341,900	1,445.00	494,045,500
ベルシステム24ホールディングス	20,000	939.00	18,780,000
ソラスト	6,000	1,471.00	8,826,000
豊田自動織機	114,300	5,460.00	624,078,000
豊和工業	7,600	659.00	5,008,400
O K K	48,000	125.00	6,000,000
石川製作所	3,500	765.00	2,677,500
東洋機械金属	8,900	567.00	5,046,300
津田駒工業	30,000	178.00	5,340,000
エンシュウ	34,000	93.00	3,162,000
島精機製作所	17,100	3,720.00	63,612,000
N Cホールディングス	4,400	935.00	4,114,000

フリー	7,800	1,523.00	11,879,400
ヤマシンフィルタ	2,600	1,918.00	4,986,800
日阪製作所	17,800	898.00	15,984,400
やまびこ	24,100	1,391.00	33,523,100
ペガサスミシン製造	12,700	924.00	11,734,800
ナプテスコ	68,300	3,115.00	212,754,500
三井海洋開発	13,200	2,424.00	31,996,800
レオン自動機	11,100	1,027.00	11,399,700
S M C	39,400	31,970.00	1,259,618,000
新川	11,000	772.00	8,492,000
ホソカワミクロン	22,000	825.00	18,150,000
ユニオンツール	5,700	3,655.00	20,833,500
オイレス工業	16,900	2,095.00	35,405,500
日精エー・エス・ビー機械	4,200	2,382.00	10,004,400
サトーホールディングス	16,300	2,418.00	39,413,400
日本エアテック	4,400	668.00	2,939,200
日精樹脂工業	10,400	1,101.00	11,450,400
オカダアイヨン	2,800	1,148.00	3,214,400
ワイエイシイ	5,000	1,329.00	6,645,000
小松製作所	606,100	2,662.00	1,613,438,200
住友重機械工業	383,000	787.00	301,421,000
日立建機	58,700	2,544.00	149,332,800
日工	4,000	2,093.00	8,372,000
巴工業	5,400	1,871.00	10,103,400
井関農機	134,000	254.00	34,036,000
T O W A	10,800	1,944.00	20,995,200
丸山製作所	28,000	190.00	5,320,000
北川鉄工所	6,000	2,360.00	14,160,000
シンニッタン	10,800	699.00	7,549,200
ローツェ	4,700	2,491.00	11,707,700
タカキタ	3,600	566.00	2,037,600
クボタ	628,700	1,770.00	1,112,799,000
荏原実業	3,700	1,377.00	5,094,900
東洋エンジニアリング	83,000	271.00	22,493,000
三菱化工機	43,000	222.00	9,546,000
月島機械	24,900	1,259.00	31,349,100
帝国電機製作所	9,600	1,016.00	9,753,600
東京機械製作所	50,000	75.00	3,750,000
新東工業	29,700	1,029.00	30,561,300
澁谷工業	11,000	2,878.00	31,658,000
アイチコーポレーション	18,600	873.00	16,237,800
小森コーポレーション	31,500	1,484.00	46,746,000
鶴見製作所	9,800	1,524.00	14,935,200
住友精密工業	21,000	365.00	7,665,000
酒井重工業	25,000	324.00	8,100,000
荏原製作所	59,500	3,320.00	197,540,000
石井鐵工所	2,000	1,760.00	3,520,000
西島製作所	12,900	1,142.00	14,731,800
北越工業	14,100	988.00	13,930,800
千代田化工建設	101,000	717.00	72,417,000

ダイキン工業	171,400	10,590.00	1,815,126,000
オルガノ	25,000	490.00	12,250,000
トーヨーカネツ	60,000	310.00	18,600,000
栗田工業	74,300	2,689.00	199,792,700
椿本チエイン	75,000	955.00	71,625,000
大同工業	26,000	289.00	7,514,000
日機装	43,400	1,212.00	52,600,800
木村化工機	11,500	343.00	3,944,500
新興プランテック	28,800	926.00	26,668,800
アネスト岩田	22,800	1,083.00	24,692,400
ダイフク	62,700	2,612.00	163,772,400
サムコ	3,300	1,016.00	3,352,800
加藤製作所	6,900	2,861.00	19,740,900
油研工業	24,000	242.00	5,808,000
タダノ	65,600	1,426.00	93,545,600
フジテック	36,500	1,291.00	47,121,500
C K D	37,600	1,430.00	53,768,000
キトー	15,800	1,215.00	19,197,000
平和	38,900	3,010.00	117,089,000
理想科学工業	12,500	2,026.00	25,325,000
SANKYO	34,800	3,965.00	137,982,000
日本金銭機械	11,600	1,499.00	17,388,400
マースエンジニアリング	7,100	2,365.00	16,791,500
福島工業	7,800	3,785.00	29,523,000
オーイズミ	5,500	685.00	3,767,500
ダイコク電機	5,200	1,765.00	9,178,000
竹内製作所	22,900	2,216.00	50,746,400
アマノ	38,900	2,261.00	87,952,900
JUKI	19,800	1,280.00	25,344,000
サンデンホールディングス	77,000	382.00	29,414,000
蛇の目ミシン工業	12,200	755.00	9,211,000
ブラザー工業	162,300	2,096.00	340,180,800
マックス	19,000	1,505.00	28,595,000
モリタホールディングス	22,000	1,560.00	34,320,000
グローリー	40,100	3,790.00	151,979,000
新晃工業	8,800	1,470.00	12,936,000
大和冷機工業	20,100	1,062.00	21,346,200
セガサミーホールディングス	124,500	1,668.00	207,666,000
日本ピストンリング	4,900	2,323.00	11,382,700
リケン	5,800	4,410.00	25,578,000
T P R	14,100	3,785.00	53,368,500
ツバキ・ナカシマ	14,100	1,863.00	26,268,300
ホシザキ	27,500	9,010.00	247,775,000
大豊工業	10,200	1,516.00	15,463,200
日本精工	257,800	1,581.00	407,581,800
NTN	290,000	556.00	161,240,000
ジェイテクト	133,700	1,885.00	252,024,500
不二越	126,000	605.00	76,230,000
ミネベアミツミ	228,300	1,345.00	307,063,500
日本トムソン	40,100	534.00	21,413,400

THK	88,700	2,926.00	259,536,200
ユーシン精機	5,600	2,872.00	16,083,200
前澤給装工業	4,800	1,546.00	7,420,800
イーグル工業	13,600	1,585.00	21,556,000
前澤工業	9,300	334.00	3,106,200
日本ピラー工業	12,700	1,513.00	19,215,100
キッツ	60,100	764.00	45,916,400
日立製作所	3,014,000	616.90	1,859,336,600
東芝	2,808,000	215.80	605,966,400
三菱電機	1,338,900	1,651.50	2,211,193,350
富士電機	378,000	620.00	234,360,000
東洋電機製造	5,000	1,712.00	8,560,000
安川電機	145,500	2,096.00	304,968,000
シンフォニアテクノロジー	81,000	303.00	24,543,000
明電舎	115,000	375.00	43,125,000
オリジン電気	18,000	316.00	5,688,000
山洋電気	33,000	872.00	28,776,000
デンヨー	11,600	1,697.00	19,685,200
日立工機	33,600	867.00	29,131,200
三櫻工業	16,100	863.00	13,894,300
マキタ	81,800	7,770.00	635,586,000
東芝テック	79,000	589.00	46,531,000
芝浦メカトロニクス	21,000	275.00	5,775,000
マブチモーター	35,400	6,100.00	215,940,000
日本電産	162,700	10,480.00	1,705,096,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,500	2,913.00	4,369,500
東光高岳	6,400	2,141.00	13,702,400
ダブル・スコープ	12,100	1,911.00	23,123,100
宮越ホールディングス	4,500	494.00	2,223,000
ダイヘン	69,000	729.00	50,301,000
田淵電機	19,100	354.00	6,761,400
ヤーマン	1,600	5,930.00	9,488,000
JVCケンウッド	92,200	285.00	26,277,000
ミマキエンジニアリング	11,300	743.00	8,395,900
第一精工	5,900	1,772.00	10,454,800
日新電機	25,200	1,319.00	33,238,800
大崎電気工業	25,000	1,071.00	26,775,000
オムロン	133,400	4,815.00	642,321,000
日東工業	18,400	1,564.00	28,777,600
I D E C	16,400	1,202.00	19,712,800
不二電機工業	1,400	1,342.00	1,878,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	242,000	507.00	122,694,000
サクサホールディングス	32,000	231.00	7,392,000
メルコホールディングス	7,000	3,310.00	23,170,000
テクノメディカ	2,900	2,236.00	6,484,400
日本電気	1,725,000	279.00	481,275,000
富士通	1,210,000	652.00	788,920,000
沖電気工業	54,300	1,585.00	86,065,500
岩崎通信機	56,000	89.00	4,984,000
電気興業	36,000	559.00	20,124,000

サンケン電気	73,000	490.00	35,770,000
ナカヨ	13,000	407.00	5,291,000
アイホン	7,200	1,878.00	13,521,600
ルネサスエレクトロニクス	65,100	923.00	60,087,300
セイコーエプソン	186,900	2,523.00	471,548,700
ワコム	97,500	422.00	41,145,000
アルバック	21,200	4,965.00	105,258,000
アクセル	5,300	836.00	4,430,800
E I Z O	12,400	3,225.00	39,990,000
ジャパンディスプレイ	234,500	272.00	63,784,000
日本信号	34,600	1,071.00	37,056,600
京三製作所	29,000	422.00	12,238,000
能美防災	14,200	1,525.00	21,655,000
ホーチキ	9,100	1,439.00	13,094,900
エレコム	10,900	2,008.00	21,887,200
日本無線	7,700	1,402.00	10,795,400
パナソニック	1,434,000	1,229.50	1,763,103,000
アンリツ	91,400	844.00	77,141,600
富士通ゼネラル	43,000	2,220.00	95,460,000
日立国際電気	32,900	2,555.00	84,059,500
ソニー	886,200	3,454.00	3,060,934,800
T D K	70,700	7,750.00	547,925,000
帝国通信工業	27,000	190.00	5,130,000
タムラ製作所	48,000	450.00	21,600,000
アルプス電気	115,900	3,325.00	385,367,500
池上通信機	40,000	154.00	6,160,000
パイオニア	188,700	225.00	42,457,500
日本電波工業	12,200	835.00	10,187,000
鈴木	4,900	645.00	3,160,500
日本トリム	3,100	4,015.00	12,446,500
ローランド ディー・ジー・	6,400	3,410.00	21,824,000
日本コロムビア	3,900	650.00	2,535,000
フォスター電機	14,700	1,908.00	28,047,600
クラリオン	66,000	432.00	28,512,000
S M K	32,000	439.00	14,048,000
ヨコオ	9,000	1,346.00	12,114,000
ティアック	92,000	45.00	4,140,000
ホシデン	38,100	983.00	37,452,300
ヒロセ電機	20,300	14,950.00	303,485,000
日本航空電子工業	36,000	1,551.00	55,836,000
T O A	14,800	996.00	14,740,800
日立マクセル	18,700	2,188.00	40,915,600
古野電気	16,200	744.00	12,052,800
ユニデンホールディングス	37,000	166.00	6,142,000
アルパイン	29,900	1,645.00	49,185,500
スミダコーポレーション	10,300	1,318.00	13,575,400
アイコム	6,900	2,436.00	16,808,400
リオン	4,900	1,620.00	7,938,000
本多通信工業	3,600	1,314.00	4,730,400
船井電機	13,800	982.00	13,551,600



横河電機	136,100	1,736.00	236,269,600
新電元工業	48,000	463.00	22,224,000
アズビル	38,000	3,600.00	136,800,000
東亜ディーケーケー	6,400	558.00	3,571,200
日本光電工業	52,500	2,448.00	128,520,000
チノー	4,600	1,282.00	5,897,200
共和電業	14,400	441.00	6,350,400
日本電子材料	5,100	631.00	3,218,100
堀場製作所	24,900	6,250.00	155,625,000
アドバンテスト	85,600	1,967.00	168,375,200
小野測器	6,300	870.00	5,481,000
エスベック	11,100	1,386.00	15,384,600
パナソニック デバイスSUNX	11,100	834.00	9,257,400
キーエンス	56,900	43,630.00	2,482,547,000
日置電機	6,600	2,279.00	15,041,400
シスメックス	97,500	6,500.00	633,750,000
日本マイクロニクス	23,400	917.00	21,457,800
メガチップス	11,700	2,571.00	30,080,700
OBARA GROUP	7,300	4,965.00	36,244,500
イマジカ・ロボット ホールディングス	10,500	795.00	8,347,500
澤藤電機	8,000	248.00	1,984,000
デンソー	309,500	5,008.00	1,549,976,000
コーセル	17,400	1,426.00	24,812,400
イリソ電子工業	4,000	6,950.00	27,800,000
新日本無線	9,900	428.00	4,237,200
オブテックスグループ	9,500	2,997.00	28,471,500
千代田インテグレ	6,600	2,471.00	16,308,600
アイ・オー・データ機器	4,000	1,189.00	4,756,000
レーザーテック	13,800	2,771.00	38,239,800
スタンレー電気	89,500	3,095.00	277,002,500
岩崎電気	46,000	175.00	8,050,000
ウシオ電機	76,200	1,436.00	109,423,200
岡谷電機産業	7,000	413.00	2,891,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	656.00	7,740,800
日本セラミック	10,300	2,389.00	24,606,700
遠藤照明	6,400	921.00	5,894,400
古河電池	9,000	764.00	6,876,000
双信電機	6,500	303.00	1,969,500
山一電機	11,800	1,479.00	17,452,200
図研	8,200	1,301.00	10,668,200
日本電子	46,000	517.00	23,782,000
カシオ計算機	101,000	1,515.00	153,015,000
ファナック	127,300	21,965.00	2,796,144,500
日本シイエムケイ	27,100	635.00	17,208,500
エンプラス	5,700	3,365.00	19,180,500
大真空	4,600	1,522.00	7,001,200
ローム	60,700	7,280.00	441,896,000
浜松ホトニクス	97,900	3,315.00	324,538,500
三井ハイテック	16,600	864.00	14,342,400

新光電気工業	47,400	782.00	37,066,800	
京セラ	206,000	6,232.00	1,283,792,000	
協栄産業	16,000	180.00	2,880,000	
太陽誘電	61,000	1,483.00	90,463,000	
村田製作所	131,700	16,130.00	2,124,321,000	
ユーシン	16,800	781.00	13,120,800	
双葉電子工業	20,500	2,023.00	41,471,500	
日東電工	94,800	9,455.00	896,334,000	
北陸電気工業	51,000	139.00	7,089,000	
東海理化電機製作所	33,000	2,234.00	73,722,000	
ニチコン	39,500	1,069.00	42,225,500	
日本ケミコン	108,000	338.00	36,504,000	
K O A	17,400	1,407.00	24,481,800	
三井造船	453,000	183.00	82,899,000	
日立造船	99,300	645.00	64,048,500	
三菱重工業	2,103,000	438.30	921,744,900	
川崎重工業	977,000	348.00	339,996,000	
I H I	965,000	338.00	326,170,000	
名村造船所	37,600	751.00	28,237,600	
サノヤスホールディングス	15,300	300.00	4,590,000	
日本車輛製造	46,000	303.00	13,938,000	
ニチユ三菱フォークリフト	14,500	699.00	10,135,500	
近畿車輛	1,900	2,630.00	4,997,000	
F P G	44,200	1,102.00	48,708,400	
島根銀行	2,800	1,402.00	3,925,600	
じもとホールディングス	89,200	192.00	17,126,400	
全国保証	34,900	3,595.00	125,465,500	
めぶきフィナンシャルグループ	597,300	489.00	292,079,700	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	17,900	3,840.00	68,736,000	
九州フィナンシャルグループ	203,100	761.00	154,559,100	
かんぽ生命保険	46,800	2,731.00	127,810,800	
ゆうちょ銀行	350,800	1,401.00	491,470,800	
富山第一銀行	31,600	525.00	16,590,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	811,100	591.30	479,603,430	
西日本フィナンシャルホールディングス	84,000	1,219.00	102,396,000	
日産自動車	1,480,300	1,105.00	1,635,731,500	
いすゞ自動車	363,700	1,490.00	541,913,000	
トヨタ自動車	1,526,000	6,406.00	9,775,556,000	*
日野自動車	179,100	1,297.00	232,292,700	
三菱自動車工業	460,100	738.00	339,553,800	
エフテック	6,700	1,388.00	9,299,600	
レシップホールディングス	4,300	855.00	3,676,500	
G M B	2,100	1,366.00	2,868,600	
ファルテック	2,300	1,428.00	3,284,400	
武蔵精密工業	14,600	2,945.00	42,997,000	
日産車体	55,100	1,063.00	58,571,300	
新明和工業	51,000	1,139.00	58,089,000	
極東開発工業	25,000	1,757.00	43,925,000	

日信工業	28,000	1,999.00	55,972,000
トビー工業	10,300	3,115.00	32,084,500
ティラド	49,000	308.00	15,092,000
曙ブレーキ工業	58,500	301.00	17,608,500
タチエス	21,300	2,079.00	44,282,700
NOK	60,700	2,596.00	157,577,200
フタバ産業	38,300	772.00	29,567,600
KYB	140,000	598.00	83,720,000
市光工業	26,000	523.00	13,598,000
大同メタル工業	15,800	1,020.00	16,116,000
プレス工業	66,600	560.00	37,296,000
ミクニ	16,000	437.00	6,992,000
カルソニックカンセイ	85,000	1,283.00	109,055,000
太平洋工業	25,800	1,389.00	35,836,200
ケーヒン	28,800	1,854.00	53,395,200
河西工業	16,700	1,464.00	24,448,800
アイシン精機	114,800	5,570.00	639,436,000
富士機工	12,500	571.00	7,137,500
マツダ	397,400	1,573.50	625,308,900
今仙電機製作所	11,500	1,001.00	11,511,500
本田技研工業	1,129,500	3,498.00	3,950,991,000
スズキ	248,800	4,407.00	1,096,461,600
富士重工業	389,700	4,229.00	1,648,041,300
安永	4,300	1,681.00	7,228,300
ヤマハ発動機	177,300	2,558.00	453,533,400
ショーワ	32,700	929.00	30,378,300
小糸製作所	75,200	5,780.00	434,656,000
TBK	16,300	519.00	8,459,700
エクセディ	17,000	3,175.00	53,975,000
ミツバ	23,100	2,121.00	48,995,100
豊田合成	40,500	2,856.00	115,668,000
愛三工業	22,000	953.00	20,966,000
盟和産業	1,800	1,222.00	2,199,600
ヨロズ	11,700	1,787.00	20,907,900
エフ・シー・シー	20,500	2,244.00	46,002,000
新家工業	29,000	174.00	5,046,000
シマノ	50,600	16,660.00	842,996,000
タカタ	22,700	553.00	12,553,100
テイ・エス テック	29,100	2,937.00	85,466,700
ジャムコ	7,400	2,419.00	17,900,600
小野建	10,800	1,414.00	15,271,200
はるやまホールディングス	5,700	980.00	5,586,000
ノジマ	14,400	1,466.00	21,110,400
佐島電機	9,800	812.00	7,957,600
カップ・クリエイト	17,500	1,290.00	22,575,000
エコートレーディング	3,200	688.00	2,201,600
伯東	8,400	1,113.00	9,349,200
コンドーテック	9,900	909.00	8,999,100
中山福	7,500	843.00	6,322,500
ライトオン	9,300	984.00	9,151,200

ナガイレーベン	17,900	2,382.00	42,637,800
ジーンズメイト	4,600	258.00	1,186,800
三菱食品	13,600	3,480.00	47,328,000
良品計画	16,400	23,750.00	389,500,000
三城ホールディングス	15,500	486.00	7,533,000
松田産業	9,000	1,526.00	13,734,000
第一興商	20,100	4,730.00	95,073,000
メディバルホールディングス	123,900	1,831.00	226,860,900
アドヴァン	12,600	1,169.00	14,729,400
S P K	2,800	2,552.00	7,145,600
萩原電気	4,200	2,126.00	8,929,200
アルビス	3,300	3,430.00	11,319,000
アズワン	9,700	4,950.00	48,015,000
スズデン	4,400	1,089.00	4,791,600
尾家産業	4,400	1,178.00	5,183,200
シモジマ	7,700	1,195.00	9,201,500
ドウシシャ	14,600	2,130.00	31,098,000
小津産業	2,800	2,171.00	6,078,800
コナカ	15,700	593.00	9,310,100
高速	7,500	1,118.00	8,385,000
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,573.00	2,674,100
G - 7ホールディングス	3,700	2,298.00	8,502,600
たけびし	4,300	1,469.00	6,316,700
イオン北海道	12,400	594.00	7,365,600
コジマ	18,400	271.00	4,986,400
ヒマラヤ	3,900	840.00	3,276,000
コーナン商事	17,600	2,079.00	36,590,400
黒田電気	16,900	2,290.00	38,701,000
ネットワンシステムズ	53,500	863.00	46,170,500
エコス	4,800	1,203.00	5,774,400
ワタミ	14,700	1,228.00	18,051,600
マルシェ	3,100	842.00	2,610,200
リックス	2,900	1,685.00	4,886,500
システムソフト	22,800	156.00	3,556,800
ドンキホーテホールディングス	80,100	3,955.00	316,795,500
丸文	11,000	736.00	8,096,000
西松屋チェーン	21,700	1,259.00	27,320,300
ゼンショーホールディングス	64,200	1,892.00	121,466,400
ハビネット	10,400	1,571.00	16,338,400
幸楽苑ホールディングス	8,000	1,709.00	13,672,000
ハークスレイ	3,000	1,135.00	3,405,000
橋本総業ホールディングス	2,600	1,502.00	3,905,200
日本ライフライン	10,600	2,036.00	21,581,600
サイゼリヤ	20,400	2,618.00	53,407,200
エクセル	5,300	1,461.00	7,743,300
V Tホールディングス	42,000	522.00	21,924,000
マルカキカイ	4,000	1,836.00	7,344,000
アルゴグラフィックス	5,700	2,515.00	14,335,500
魚力	3,900	1,292.00	5,038,800
I D O M	33,400	740.00	24,716,000

日本エム・ディ・エム	9,400	770.00	7,238,000
ポブラ	3,500	533.00	1,865,500
フジ・コーポレーション	1,900	2,310.00	4,389,000
ユナイテッドアローズ	16,500	3,505.00	57,832,500
進和	7,300	1,775.00	12,957,500
エスケイジャパン	2,700	303.00	818,100
ダイترون	5,700	1,094.00	6,235,800
ハイデイ日高	13,560	2,345.00	31,798,200
シークス	8,800	4,250.00	37,400,000
京都きもの友禅	8,100	1,001.00	8,108,100
コロワイド	41,100	1,853.00	76,158,300
ピーシーデポコーポレーション	16,500	549.00	9,058,500
田中商事	3,900	720.00	2,808,000
オーハシテクニカ	7,000	1,435.00	10,045,000
壱番屋	8,700	3,705.00	32,233,500
白銅	3,100	1,777.00	5,508,700
トップカルチャー	5,000	481.00	2,405,000
P L A N T	2,800	1,210.00	3,388,000
スギホールディングス	27,100	5,170.00	140,107,000
島津製作所	161,500	1,833.00	296,029,500
J M S	23,000	350.00	8,050,000
クボテック	2,800	566.00	1,584,800
長野計器	8,500	717.00	6,094,500
ブイ・テクノロジー	2,500	16,060.00	40,150,000
スター精密	22,000	1,620.00	35,640,000
東京計器	43,000	230.00	9,890,000
愛知時計電機	1,700	3,680.00	6,256,000
オーバル	12,500	270.00	3,375,000
東京精密	24,200	3,655.00	88,451,000
マニー	16,700	2,596.00	43,353,200
ニコン	218,700	1,705.00	372,883,500
トプコン	63,200	1,957.00	123,682,400
オリンパス	200,300	3,950.00	791,185,000
理研計器	11,000	1,592.00	17,512,000
S C R E E Nホールディングス	25,700	7,560.00	194,292,000
キヤノン電子	11,400	1,793.00	20,440,200
タムロン	11,100	2,092.00	23,221,200
H O Y A	258,200	5,062.00	1,307,008,400
ノーリツ鋼機	12,300	964.00	11,857,200
エー・アンド・デイ	11,600	458.00	5,312,800
キヤノン	675,700	3,292.00	2,224,404,400
リコー	377,300	991.00	373,904,300
シチズン時計	137,200	720.00	98,784,000
リズム時計工業	51,000	188.00	9,588,000
大研医器	10,800	813.00	8,780,400
メニコン	8,600	3,520.00	30,272,000
スノーピーク	1,600	2,893.00	4,628,800
パラマウントベッドホールディングス	12,000	4,260.00	51,120,000
トランザクション	5,600	1,046.00	5,857,600
S H O B I	5,000	431.00	2,155,000

ニホンフラッシュ	5,300	1,312.00	6,953,600
前田工織	12,600	1,311.00	16,518,600
永大産業	16,000	526.00	8,416,000
アートネイチャー	13,400	750.00	10,050,000
ダンロップスポーツ	8,000	1,039.00	8,312,000
バンダイナムコホールディングス	138,400	3,225.00	446,340,000
アイフィスジャパン	2,400	420.00	1,008,000
共立印刷	21,600	341.00	7,365,600
S H O E I	5,700	2,574.00	14,671,800
フランスベッドホールディングス	15,800	946.00	14,946,800
マーベラス	20,900	946.00	19,771,400
パイロットコーポレーション	21,900	4,480.00	98,112,000
萩原工業	3,500	2,646.00	9,261,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	22,800	1,610.00	36,708,000
トッパン・フォームズ	22,400	1,055.00	23,632,000
フジシールインターナショナル	28,200	2,240.00	63,168,000
タカラトミー	48,900	1,187.00	58,044,300
廣済堂	12,700	386.00	4,902,200
アーク	53,500	111.00	5,938,500
レック	4,100	4,280.00	17,548,000
タカノ	5,700	1,040.00	5,928,000
プロネクサス	11,800	1,183.00	13,959,400
ホクシン	9,700	214.00	2,075,800
ウッドワン	22,000	300.00	6,600,000
大建工業	8,900	2,140.00	19,046,000
きもと	23,400	243.00	5,686,200
凸版印刷	354,000	1,119.00	396,126,000
大日本印刷	362,000	1,210.00	438,020,000
図書印刷	17,000	480.00	8,160,000
共同印刷	39,000	384.00	14,976,000
日本写真印刷	21,100	3,130.00	66,043,000
光村印刷	3,000	268.00	804,000
藤森工業	9,800	2,951.00	28,919,800
ヴィア・ホールディングス	9,400	1,184.00	11,129,600
宝印刷	6,200	1,583.00	9,814,600
前澤化成工業	8,700	1,189.00	10,344,300
アシックス	124,700	1,970.00	245,659,000
ツツミ	4,700	2,079.00	9,771,300
J S P	6,100	2,615.00	15,951,500
ニチハ	17,500	3,190.00	55,825,000
エフピコ	11,700	5,110.00	59,787,000
小松ウオール工業	4,300	1,881.00	8,088,300
ヤマハ	84,600	2,919.00	246,947,400
河合楽器製作所	5,000	2,343.00	11,715,000
クリナップ	14,800	842.00	12,461,600
ピジョン	75,900	3,225.00	244,777,500
天馬	8,700	2,073.00	18,035,100
兼松サステック	14,000	243.00	3,402,000
キングジム	10,600	867.00	9,190,200

リンテック	29,800	2,387.00	71,132,600
T A S A K I	2,700	1,500.00	4,050,000
信越ポリマー	25,800	813.00	20,975,400
東リ	31,500	411.00	12,946,500
イトーキ	26,500	722.00	19,133,000
任天堂	77,300	23,680.00	1,830,464,000
三菱鉛筆	10,300	5,610.00	57,783,000
松風	6,600	1,351.00	8,916,600
タカラスタANDARD	25,900	1,862.00	48,225,800
コクヨ	65,200	1,445.00	94,214,000
ナカバヤシ	23,000	273.00	6,279,000
ニフコ	23,000	5,690.00	130,870,000
立川ブラインド工業	5,500	943.00	5,186,500
グローブライト	6,200	1,739.00	10,781,800
岡村製作所	43,900	1,010.00	44,339,000
日本バルカー工業	10,100	1,847.00	18,654,700
M U T O Hホールディングス	16,000	261.00	4,176,000
伊藤忠商事	907,300	1,625.50	1,474,816,150
丸紅	1,219,100	725.50	884,457,050
スクロール	18,800	354.00	6,655,200
高島	21,000	209.00	4,389,000
ヨンドシーホールディングス	9,400	2,544.00	23,913,600
三陽商会	69,000	177.00	12,213,000
長瀬産業	74,200	1,620.00	120,204,000
ナイガイ	49,000	65.00	3,185,000
蝶理	7,900	1,995.00	15,760,500
豊田通商	137,900	3,330.00	459,207,000
オンワードホールディングス	85,000	827.00	70,295,000
三共生興	18,800	412.00	7,745,600
兼松	263,000	193.00	50,759,000
美津濃	68,000	588.00	39,984,000
ツカモトコーポレーション	23,000	126.00	2,898,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	54,300	6,840.00	371,412,000
ルック	24,000	207.00	4,968,000
三井物産	1,120,100	1,709.50	1,914,810,950
日本紙パルプ商事	65,000	375.00	24,375,000
東京エレクトロン	83,700	11,175.00	935,347,500
日立ハイテクノロジーズ	43,000	4,690.00	201,670,000
カメイ	16,100	1,300.00	20,930,000
東都水産	2,000	1,967.00	3,934,000
O U Gホールディングス	20,000	262.00	5,240,000
スターゼン	5,200	4,780.00	24,856,000
セイコーホールディングス	89,000	468.00	41,652,000
山善	47,500	1,030.00	48,925,000
椿本興業	14,000	423.00	5,922,000
住友商事	779,800	1,511.50	1,178,667,700
日本ユニシス	34,200	1,518.00	51,915,600
内田洋行	6,100	2,517.00	15,353,700
三菱商事	929,600	2,543.00	2,363,972,800

第一実業	28,000	760.00	21,280,000
キヤノンマーケティングジャパン	35,300	2,270.00	80,131,000
西華産業	39,000	365.00	14,235,000
佐藤商事	11,100	886.00	9,834,600
菱洋エレクトロ	11,800	1,575.00	18,585,000
東京産業	12,500	477.00	5,962,500
ユアサ商事	11,700	3,170.00	37,089,000
神鋼商事	3,100	2,456.00	7,613,600
小林産業	9,400	275.00	2,585,000
阪和興業	124,000	797.00	98,828,000
カナデン	11,900	1,064.00	12,661,600
菱電商事	20,000	740.00	14,800,000
ニプロ	86,800	1,430.00	124,124,000
フルサト工業	6,800	1,787.00	12,151,600
岩谷産業	137,000	657.00	90,009,000
すてきナイスグループ	53,000	154.00	8,162,000
昭光通商	46,000	97.00	4,462,000
ニチモウ	18,000	190.00	3,420,000
極東貿易	19,000	237.00	4,503,000
イワキ	19,000	306.00	5,814,000
兼松エレクトロニクス	7,800	2,617.00	20,412,600
三愛石油	33,200	917.00	30,444,400
稲畑産業	29,600	1,467.00	43,423,200
G S Iクレオス	31,000	146.00	4,526,000
明和産業	11,600	418.00	4,848,800
キムラタン	566,000	8.00	4,528,000
ゴールドウイン	5,600	6,040.00	33,824,000
ユニ・チャーム	266,200	2,500.00	665,500,000
デサント	30,000	1,322.00	39,660,000
キング	6,600	415.00	2,739,000
ワキタ	26,300	1,023.00	26,904,900
ヤマトインターナショナル	8,300	410.00	3,403,000
東邦ホールディングス	39,600	2,461.00	97,455,600
サンゲツ	42,400	1,937.00	82,128,800
ミツウロコグループホールディングス	20,000	761.00	15,220,000
シナネンホールディングス	5,300	2,317.00	12,280,100
伊藤忠エネクス	27,300	947.00	25,853,100
サンリオ	38,200	2,214.00	84,574,800
サンワテクノス	7,300	1,108.00	8,088,400
リョーサン	18,400	3,580.00	65,872,000
新光商事	13,500	1,310.00	17,685,000
トーヨー	5,700	2,562.00	14,603,400
三信電気	13,700	1,348.00	18,467,600
東陽テクニカ	16,400	997.00	16,350,800
モスフードサービス	16,200	3,365.00	54,513,000
加賀電子	11,200	1,996.00	22,355,200
三益半導体工業	9,700	1,682.00	16,315,400
ソーダニッカ	13,100	516.00	6,759,600
立花エレテック	8,400	1,325.00	11,130,000
木曽路	15,200	2,454.00	37,300,800



サトレストランシステムズ	14,800	877.00	12,979,600
千趣会	22,300	791.00	17,639,300
タカキュー	10,700	205.00	2,193,500
ケーヨー	21,000	566.00	11,886,000
上新電機	29,000	1,105.00	32,045,000
日本瓦斯	22,700	3,300.00	74,910,000
ベスト電器	40,300	141.00	5,682,300
ロイヤルホールディングス	20,500	2,027.00	41,553,500
東天紅	10,000	177.00	1,770,000
いなげや	13,800	1,559.00	21,514,200
島忠	32,000	2,824.00	90,368,000
チヨダ	14,600	2,763.00	40,339,800
ライフコーポレーション	9,400	3,295.00	30,973,000
リンガーハット	13,100	2,233.00	29,252,300
さが美	11,000	122.00	1,342,000
MR MAX	15,600	417.00	6,505,200
テナアライド	12,500	398.00	4,975,000
AOKIホールディングス	24,700	1,391.00	34,357,700
オークワ	18,000	1,111.00	19,998,000
コメリ	19,100	2,721.00	51,971,100
青山商事	25,900	4,225.00	109,427,500
しまむら	14,400	14,430.00	207,792,000
はせがわ	4,800	445.00	2,136,000
高島屋	208,000	1,006.00	209,248,000
松屋	27,000	1,022.00	27,594,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	63,400	1,911.00	121,157,400
近鉄百貨店	47,000	348.00	16,356,000
丸栄	26,000	88.00	2,288,000
パルコ	11,800	1,180.00	13,924,000
丸井グループ	130,300	1,553.00	202,355,900
クレディセゾン	93,900	2,128.00	199,819,200
アクシアル リテイリング	9,600	4,460.00	42,816,000
井筒屋	7,000	393.00	2,751,000
イオン	509,600	1,673.50	852,815,600
イズミ	24,600	5,020.00	123,492,000
東武ストア	1,500	3,010.00	4,515,000
フォーバル	5,500	682.00	3,751,000
平和堂	25,100	2,696.00	67,669,600
フジ	13,800	2,395.00	33,051,000
ヤオコー	14,000	4,490.00	62,860,000
ゼビオホールディングス	16,800	1,836.00	30,844,800
ケーズホールディングス	57,100	2,024.00	115,570,400
PALTAC	19,800	3,145.00	62,271,000
三谷産業	13,300	385.00	5,120,500
Olympicグループ	7,400	625.00	4,625,000
日産東京販売ホールディングス	18,300	358.00	6,551,400
新生銀行	1,179,000	207.00	244,053,000
あおぞら銀行	784,000	415.00	325,360,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,387,800	738.90	6,936,645,420
りそなホールディングス	1,449,400	624.80	905,585,120

三井住友トラスト・ホールディングス	258,600	4,051.00	1,047,588,600
三井住友フィナンシャルグループ	992,000	4,380.00	4,344,960,000
第四銀行	152,000	508.00	77,216,000
北越銀行	13,400	2,662.00	35,670,800
千葉銀行	478,000	777.00	371,406,000
群馬銀行	275,200	645.00	177,504,000
武蔵野銀行	19,700	3,575.00	70,427,500
千葉興業銀行	34,100	611.00	20,835,100
筑波銀行	51,600	344.00	17,750,400
七十七銀行	194,000	522.00	101,268,000
青森銀行	96,000	385.00	36,960,000
秋田銀行	81,000	354.00	28,674,000
山形銀行	70,000	476.00	33,320,000
岩手銀行	8,100	4,680.00	37,908,000
東邦銀行	111,000	426.00	47,286,000
東北銀行	65,000	156.00	10,140,000
みちのく銀行	63,000	190.00	11,970,000
ふくおかフィナンシャルグループ	503,000	516.00	259,548,000
静岡銀行	337,000	984.00	331,608,000
十六銀行	166,000	395.00	65,570,000
スルガ銀行	126,700	2,455.00	311,048,500
八十二銀行	238,900	698.00	166,752,200
山梨中央銀行	77,000	527.00	40,579,000
大垣共立銀行	165,000	369.00	60,885,000
福井銀行	106,000	267.00	28,302,000
北國銀行	131,000	458.00	59,998,000
清水銀行	4,200	3,645.00	15,309,000
富山銀行	2,400	4,145.00	9,948,000
滋賀銀行	116,000	616.00	71,456,000
南都銀行	12,000	4,540.00	54,480,000
百五銀行	111,000	501.00	55,611,000
京都銀行	222,000	914.00	202,908,000
紀陽銀行	46,500	1,860.00	86,490,000
三重銀行	5,600	2,406.00	13,473,600
ほくほくフィナンシャルグループ	82,400	1,943.00	160,103,200
広島銀行	365,000	528.00	192,720,000
山陰合同銀行	74,400	995.00	74,028,000
中国銀行	87,800	1,764.00	154,879,200
鳥取銀行	4,000	1,845.00	7,380,000
伊予銀行	132,400	817.00	108,170,800
百十四銀行	136,000	393.00	53,448,000
四国銀行	96,000	300.00	28,800,000
阿波銀行	106,000	778.00	82,468,000
大分銀行	71,000	444.00	31,524,000
宮崎銀行	83,000	361.00	29,963,000
佐賀銀行	75,000	304.00	22,800,000
十八銀行	76,000	361.00	27,436,000
沖縄銀行	12,000	4,175.00	50,100,000
琉球銀行	25,500	1,582.00	40,341,000
セブン銀行	464,400	349.00	162,075,600

みずほフィナンシャルグループ	16,819,100	208.40	3,505,100,440	
高知銀行	47,000	134.00	6,298,000	
山口フィナンシャルグループ	116,000	1,279.00	148,364,000	
アクリーティブ	10,600	382.00	4,049,200	
芙蓉総合リース	14,200	5,390.00	76,538,000	
興銀リース	23,300	2,541.00	59,205,300	
東京センチュリー	24,900	3,800.00	94,620,000	
SBIホールディングス	140,000	1,570.00	219,800,000	
日本証券金融	54,300	634.00	34,426,200	
アイフル	207,700	349.00	72,487,300	
日本アジア投資	12,200	479.00	5,843,800	
ポケットカード	9,400	607.00	5,705,800	
長野銀行	4,100	1,991.00	8,163,100	
名古屋銀行	10,400	4,175.00	43,420,000	
北洋銀行	202,000	461.00	93,122,000	
愛知銀行	4,200	6,860.00	28,812,000	
第三銀行	7,100	1,733.00	12,304,300	
中京銀行	5,100	2,280.00	11,628,000	
大光銀行	44,000	243.00	10,692,000	
愛媛銀行	14,700	1,380.00	20,286,000	
トマト銀行	4,900	1,611.00	7,893,900	
みなと銀行	11,200	2,217.00	24,830,400	
京葉銀行	101,000	518.00	52,318,000	
関西アーバン銀行	17,300	1,484.00	25,673,200	
栃木銀行	68,300	562.00	38,384,600	
北日本銀行	3,900	3,175.00	12,382,500	
東和銀行	233,000	118.00	27,494,000	
福島銀行	136,000	95.00	12,920,000	
大東銀行	65,000	172.00	11,180,000	
リコーリース	9,700	3,685.00	35,744,500	
イオンフィナンシャルサービス	79,100	2,151.00	170,144,100	
アコム	249,000	483.00	120,267,000	
ジャックス	68,000	501.00	34,068,000	
オリエントコーポレーション	267,600	210.00	56,196,000	
日立キャピタル	29,200	2,904.00	84,796,800	
アプラスフィナンシャル	60,100	114.00	6,851,400	
オリックス	877,300	1,742.50	1,528,695,250	
三菱UFJリース	314,200	623.00	195,746,600	
ジャフコ	20,700	3,770.00	78,039,000	
トモニホールディングス	102,200	627.00	64,079,400	
大和証券グループ本社	1,159,000	702.00	813,618,000	
野村ホールディングス	2,532,800	720.60	1,825,135,680	
岡三証券グループ	105,000	733.00	76,965,000	
丸三証券	39,400	958.00	37,745,200	
東洋証券	44,000	275.00	12,100,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	142,000	650.00	92,300,000	
光世証券	30,000	187.00	5,610,000	
水戸証券	38,500	313.00	12,050,500	
いちよし証券	27,700	867.00	24,015,900	

松井証券	70,600	924.00	65,234,400
SOMPOホールディングス	259,000	4,176.00	1,081,584,000
だいに証券ビジネス	6,200	635.00	3,937,000
日本取引所グループ	385,200	1,563.00	602,067,600
マネックスグループ	132,900	290.00	38,541,000
カブドットコム証券	92,300	384.00	35,443,200
極東証券	16,600	1,661.00	27,572,600
岩井コスモホールディングス	11,700	1,086.00	12,706,200
藍澤証券	23,200	654.00	15,172,800
フィデアホールディングス	120,400	213.00	25,645,200
池田泉州ホールディングス	131,400	502.00	65,962,800
アニコムホールディングス	8,400	2,209.00	18,555,600
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	370,200	3,769.00	1,395,283,800
ソニーフィナンシャルホールディング ス	118,700	1,975.00	234,432,500
マネーパートナーズグループ	15,900	521.00	8,283,900
小林洋行	4,300	295.00	1,268,500
第一生命ホールディングス	747,100	2,110.50	1,576,754,550
東京海上ホールディングス	501,900	4,886.00	2,452,283,400
イー・ギャランティ	3,700	2,615.00	9,675,500
アサックス	2,300	1,684.00	3,873,200
NECキャピタルソリューション	5,000	1,782.00	8,910,000
T&Dホールディングス	451,500	1,733.00	782,449,500
アドバンスクリエイト	3,000	2,065.00	6,195,000
三井不動産	657,000	2,542.50	1,670,422,500
三菱地所	921,000	2,219.00	2,043,699,000
平和不動産	23,400	1,582.00	37,018,800
東京建物	143,700	1,582.00	227,333,400
ダイビル	31,900	1,014.00	32,346,600
京阪神ビルディング	20,600	653.00	13,451,800
住友不動産	297,000	3,120.00	926,640,000
太平洋興発	53,000	106.00	5,618,000
大京	230,000	234.00	53,820,000
テーオーシー	48,100	908.00	43,674,800
東京楽天地	21,000	523.00	10,983,000
レオパレス21	156,300	589.00	92,060,700
スターツコーポレーション	12,600	2,439.00	30,731,400
フジ住宅	15,800	747.00	11,802,600
空港施設	15,100	592.00	8,939,200
明和地所	7,000	763.00	5,341,000
住友不動産販売	11,100	2,850.00	31,635,000
ゴールドクレスト	11,200	2,062.00	23,094,400
リログループ	4,900	16,010.00	78,449,000
日本エスリード	4,900	1,501.00	7,354,900
日神不動産	14,700	582.00	8,555,400
日本エスコン	16,700	391.00	6,529,700
タカラレーベン	54,100	593.00	32,081,300
サンヨーハウジング名古屋	6,400	992.00	6,348,800
イオンモール	79,700	1,705.00	135,888,500

ファースト住建	4,700	1,449.00	6,810,300
ランド	64,400	18.00	1,159,200
東祥	2,800	4,865.00	13,622,000
トーセイ	17,000	765.00	13,005,000
穴吹興産	1,400	2,691.00	3,767,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	76,900	1,029.00	79,130,100
サンフロンティア不動産	13,300	1,015.00	13,499,500
エフ・ジェー・ネクスト	10,900	783.00	8,534,700
ランドビジネス	8,000	293.00	2,344,000
グランディハウス	11,100	417.00	4,628,700
東武鉄道	670,000	573.00	383,910,000
相鉄ホールディングス	201,000	560.00	112,560,000
東京急行電鉄	682,000	831.00	566,742,000
京浜急行電鉄	344,000	1,238.00	425,872,000
小田急電鉄	201,100	2,202.00	442,822,200
京王電鉄	351,000	877.00	307,827,000
京成電鉄	94,100	2,658.00	250,117,800
富士急行	34,000	1,019.00	34,646,000
新京成電鉄	16,000	421.00	6,736,000
東日本旅客鉄道	242,800	10,175.00	2,470,490,000
西日本旅客鉄道	120,800	7,422.00	896,577,600
東海旅客鉄道	104,400	18,360.00	1,916,784,000
西武ホールディングス	173,300	1,928.00	334,122,400
鴻池運輸	17,700	1,424.00	25,204,800
西日本鉄道	151,000	492.00	74,292,000
ハマキョウレックス	8,200	2,316.00	18,991,200
サカイ引越センター	4,300	3,105.00	13,351,500
近鉄グループホールディングス	1,263,000	416.00	525,408,000
阪急阪神ホールディングス	158,500	3,730.00	591,205,000
南海電気鉄道	265,000	551.00	146,015,000
京阪ホールディングス	281,000	710.00	199,510,000
神戸電鉄	31,000	381.00	11,811,000
名古屋鉄道	457,000	514.00	234,898,000
山陽電気鉄道	46,000	605.00	27,830,000
トランコム	3,600	5,840.00	21,024,000
日本通運	485,000	583.00	282,755,000
ヤマトホールディングス	224,400	2,462.00	552,472,800
山九	165,000	713.00	117,645,000
日新	51,000	369.00	18,819,000
丸運	7,100	255.00	1,810,500
丸全昭和運輸	42,000	443.00	18,606,000
センコー	56,400	740.00	41,736,000
トナミホールディングス	26,000	364.00	9,464,000
ニッコンホールディングス	42,500	2,469.00	104,932,500
日本石油輸送	1,400	2,501.00	3,501,400
福山通運	76,000	672.00	51,072,000
セイノーホールディングス	88,900	1,291.00	114,769,900
神奈川中央交通	15,000	725.00	10,875,000
日立物流	26,100	2,310.00	60,291,000
丸和運輸機関	3,200	2,527.00	8,086,400

C & F ロジホールディングス	13,100	1,573.00	20,606,300
日本郵船	1,060,000	243.00	257,580,000
商船三井	658,000	367.00	241,486,000
川崎汽船	476,000	295.00	140,420,000
N S ユナイテッド海運	56,000	240.00	13,440,000
明治海運	11,400	432.00	4,924,800
飯野海運	64,900	520.00	33,748,000
共栄タンカー	11,000	230.00	2,530,000
九州旅客鉄道	93,500	3,455.00	323,042,500
日本航空	226,100	3,670.00	829,787,000
A N A ホールディングス	2,330,000	334.70	779,851,000
パスコ	12,000	420.00	5,040,000
三菱倉庫	82,000	1,614.00	132,348,000
三井倉庫ホールディングス	73,000	341.00	24,893,000
住友倉庫	91,000	645.00	58,695,000
澁澤倉庫	33,000	356.00	11,748,000
ヤマタネ	6,300	1,610.00	10,143,000
東陽倉庫	22,200	304.00	6,748,800
乾汽船	9,200	984.00	9,052,800
日本トランスシティ	29,000	465.00	13,485,000
ケイヒン	23,000	159.00	3,657,000
中央倉庫	7,400	1,097.00	8,117,800
安田倉庫	9,700	805.00	7,808,500
東洋埠頭	37,000	187.00	6,919,000
宇徳	10,400	419.00	4,357,600
上組	150,000	1,055.00	158,250,000
サンリツ	1,700	520.00	884,000
キムラユニティー	3,300	1,183.00	3,903,900
キューソー流通システム	3,900	2,829.00	11,033,100
郵船ロジスティクス	11,500	1,198.00	13,777,000
近鉄エクスプレス	22,500	1,718.00	38,655,000
東海運	7,200	456.00	3,283,200
エーアイティー	7,700	1,014.00	7,807,800
内外トランスライン	3,800	1,088.00	4,134,400
東京放送ホールディングス	81,600	2,051.00	167,361,600
日本テレビホールディングス	113,000	2,011.00	227,243,000
朝日放送	12,100	782.00	9,462,200
テレビ朝日ホールディングス	33,800	2,318.00	78,348,400
スカパーJ S A Tホールディングス	80,400	504.00	40,521,600
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,645.00	26,714,500
日本B S放送	2,800	1,020.00	2,856,000
ビジョン	1,400	3,615.00	5,061,000
U - N E X T	3,400	1,037.00	3,525,800
ワイヤレスゲート	4,100	1,549.00	6,350,900
コネクシオ	10,900	1,621.00	17,668,900
日本通信	104,200	183.00	19,068,600
クロップス	1,400	610.00	854,000
日本電信電話	994,500	4,788.00	4,761,666,000
K D D I	1,225,600	2,969.00	3,638,806,400
光通信	14,900	11,040.00	164,496,000

NTTドコモ	925,700	2,687.50	2,487,818,750
エムティーアイ	19,000	685.00	13,015,000
GMOインターネット	45,300	1,459.00	66,092,700
カドカワ	35,900	1,700.00	61,030,000
学研ホールディングス	41,000	310.00	12,710,000
ゼンリン	16,400	2,201.00	36,096,400
昭文社	6,900	719.00	4,961,100
インプレスホールディングス	11,100	146.00	1,620,600
東京電力ホールディングス	1,064,800	429.00	456,799,200
中部電力	413,500	1,484.00	613,634,000
関西電力	512,300	1,251.00	640,887,300
中国電力	173,400	1,239.00	214,842,600
北陸電力	122,800	1,115.00	136,922,000
東北電力	313,500	1,437.00	450,499,500
四国電力	113,000	1,132.00	127,916,000
九州電力	277,300	1,245.00	345,238,500
北海道電力	117,500	809.00	95,057,500
沖縄電力	18,500	2,598.00	48,063,000
電源開発	99,800	2,619.00	261,376,200
エフオン	5,300	981.00	5,199,300
イーレックス	5,300	3,425.00	18,152,500
東京瓦斯	1,346,000	511.30	688,209,800
大阪瓦斯	1,218,000	434.00	528,612,000
東邦瓦斯	316,000	790.00	249,640,000
北海道瓦斯	31,000	279.00	8,649,000
広島ガス	26,000	371.00	9,646,000
西部瓦斯	142,000	267.00	37,914,000
静岡ガス	38,600	713.00	27,521,800
メタウォーター	7,100	2,844.00	20,192,400
アイネット	7,100	1,225.00	8,697,500
松竹	82,000	1,299.00	106,518,000
東宝	81,000	3,180.00	257,580,000
エイチ・アイ・エス	21,400	2,986.00	63,900,400
東映	46,000	1,008.00	46,368,000
ラックランド	2,200	2,022.00	4,448,400
エヌ・ティ・ティ・データ	76,500	5,300.00	405,450,000
共立メンテナンス	10,600	7,060.00	74,836,000
イチネンホールディングス	13,900	1,177.00	16,360,300
建設技術研究所	8,400	1,064.00	8,937,600
スペース	7,000	1,318.00	9,226,000
アインホールディングス	16,200	8,090.00	131,058,000
燦ホールディングス	2,600	1,590.00	4,134,000
ピー・シー・エー	1,800	1,595.00	2,871,000
スバル興業	10,000	507.00	5,070,000
東京テアトル	52,000	153.00	7,956,000
タナベ経営	2,700	1,393.00	3,761,100
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,047.00	1,779,900
ナガワ	2,400	4,425.00	10,620,000
よみうりランド	26,000	462.00	12,012,000
東京都競馬	90,000	261.00	23,490,000

常磐興産	5,000	1,612.00	8,060,000
カナモト	18,300	2,858.00	52,301,400
東京ドーム	52,300	1,123.00	58,732,900
D T S	12,800	2,590.00	33,152,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	47,700	3,440.00	164,088,000
シーイーシー	7,400	1,814.00	13,423,600
カブコン	29,000	2,289.00	66,381,000
西尾レントオール	10,600	3,210.00	34,026,000
アイ・エス・ビー	2,300	918.00	2,111,400
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	72,000	37.00	2,664,000
日本空港ビルデング	39,500	3,950.00	156,025,000
トランス・コスモス	15,200	2,589.00	39,352,800
乃村工藝社	28,100	1,859.00	52,237,900
ジャステック	7,900	1,045.00	8,255,500
S C S K	33,700	4,160.00	140,192,000
藤田観光	43,000	357.00	15,351,000
K N T - C Tホールディングス	72,000	135.00	9,720,000
日本管財	11,300	1,825.00	20,622,500
トーカイ	5,800	4,025.00	23,345,000
白洋舎	500	2,715.00	1,357,500
セコム	136,400	8,178.00	1,115,479,200
日本システムウエア	4,100	1,529.00	6,268,900
セントラル警備保障	5,800	1,823.00	10,573,400
アイネス	15,600	1,114.00	17,378,400
丹青社	22,700	846.00	19,204,200
メイテック	15,900	4,395.00	69,880,500
T K C	11,500	3,235.00	37,202,500
アサツー ディ・ケイ	21,400	2,930.00	62,702,000
富士ソフト	18,400	2,868.00	52,771,200
応用地質	12,400	1,444.00	17,905,600
船井総研ホールディングス	16,900	1,986.00	33,563,400
N S D	26,300	1,710.00	44,973,000
進学会	5,500	572.00	3,146,000
丸紅建材リース	12,000	237.00	2,844,000
オオバ	9,700	484.00	4,694,800
コナミホールディングス	55,900	4,735.00	264,686,500
学究社	3,500	1,644.00	5,754,000
ベネッセホールディングス	43,900	3,395.00	149,040,500
イオンディライト	14,800	3,440.00	50,912,000
ナック	8,100	1,007.00	8,156,700
福井コンピュータホールディングス	3,600	2,847.00	10,249,200
ニチイ学館	22,800	864.00	19,699,200
ダイセキ	22,900	2,349.00	53,792,100
ステップ	4,500	1,409.00	6,340,500
日鉄住金物産	10,800	4,795.00	51,786,000
元気寿司	3,200	2,258.00	7,225,600
トラスコ中山	28,300	2,542.00	71,938,600
ヤマダ電機	414,300	569.00	235,736,700



オートバックスセブン	45,800	1,784.00	81,707,200
モリト	9,900	964.00	9,543,600
アークランドサカモト	21,000	1,467.00	30,807,000
ニトリホールディングス	53,500	12,970.00	693,895,000
グルメ杵屋	9,000	1,070.00	9,630,000
愛眼	9,700	198.00	1,920,600
ケーユーホールディングス	6,500	926.00	6,019,000
吉野家ホールディングス	43,100	1,640.00	70,684,000
加藤産業	19,400	2,953.00	57,288,200
イノテック	10,800	713.00	7,700,400
イエローハット	11,700	2,865.00	33,520,500
松屋フーズ	6,000	4,225.00	25,350,000
JBCホールディングス	10,500	801.00	8,410,500
JKホールディングス	12,400	658.00	8,159,200
サガミチェーン	15,600	1,388.00	21,652,800
日伝	5,100	3,505.00	17,875,500
関西スーパーマーケット	10,200	1,547.00	15,779,400
ミロク情報サービス	9,200	1,697.00	15,612,400
北沢産業	11,000	217.00	2,387,000
杉本商事	7,200	1,569.00	11,296,800
因幡電機産業	17,300	3,965.00	68,594,500
王将フードサービス	9,100	4,170.00	37,947,000
プレナス	13,900	2,414.00	33,554,600
ミニストップ	9,100	2,142.00	19,492,200
アークス	23,200	2,528.00	58,649,600
パローホールディングス	26,700	2,778.00	74,172,600
バイテックホールディングス	5,100	1,360.00	6,936,000
ミスミグループ本社	139,200	1,976.00	275,059,200
アルテック	11,200	215.00	2,408,000
ベルク	5,500	4,510.00	24,805,000
大 庄	6,700	1,525.00	10,217,500
タキヒヨー	19,000	462.00	8,778,000
ファーストリテイリング	20,700	35,250.00	729,675,000
ソフトバンクグループ	557,700	8,393.00	4,680,776,100
蔵王産業	2,000	1,511.00	3,022,000
スズケン	56,400	3,800.00	214,320,000
サンドラッグ	23,600	7,410.00	174,876,000
サックスパー ホールディングス	11,700	1,236.00	14,461,200
ジェコス	8,600	1,118.00	9,614,800
ヤマザワ	2,600	1,827.00	4,750,200
やまや	2,600	1,726.00	4,487,600
ルネサスイーストン	11,200	610.00	6,832,000
ペルーナ	31,000	854.00	26,474,000
合計	189,890,120		280,719,581,820

\*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28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		5,472,962,846	-
コール・ローン		-	3,480,771,002
国債証券		323,036,447,800	317,647,724,400
地方債証券		26,836,345,819	23,951,302,530
特殊債券		22,621,064,661	18,324,582,251
社債券		20,858,587,300	16,594,570,860
未収入金		5,561,648,080	-
未収利息		1,289,905,463	1,174,107,807
前払費用		21,283,042	14,204,595
流動資産合計		405,698,245,011	381,187,263,445
資産合計		405,698,245,011	381,187,263,445
負債の部			
流動負債			
未払解約金		6,394,594,000	3,333,561,000
流動負債合計		6,394,594,000	3,333,561,000
負債合計		6,394,594,000	3,333,561,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	311,246,557,550	295,190,206,036
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		88,057,093,461	82,663,496,409
元本等合計		399,303,651,011	377,853,702,445
純資産合計		399,303,651,011	377,853,702,445
負債純資産合計		405,698,245,011	381,187,263,445

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	345,746,995,990円 87,184,744,613円 121,685,183,053円	311,246,557,550円 65,544,715,948円 81,601,067,462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	9,175,982,314円	10,994,419,624円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	184,519,752円	141,332,941円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	135,188,893円	123,053,964円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	55,433,709円	42,096,310円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	439,534,915円	408,295,789円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	113,983,594円	117,006,883円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	20,718,437円	26,386,628円
たわらノーロード 国内債券	352,758,070円	1,032,184,471円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	- 円	755,274円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	11,609,907,063円	12,135,343,680円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	4,397,137,375円	4,912,270,839円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	6,424,462,977円	6,923,494,244円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,637,655,262円	2,718,978,952円

DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,668,885,289円	1,657,494,852円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,829,884,341円	1,744,690,480円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	275,586,880円	247,785,929円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	118,176,862円	98,517,017円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,437,259,337円	2,182,976,967円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	7,449,695円	1,831,280円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	223,190,480円	356,002,601円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	166,232,315円	254,997,478円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	41,960,388円	63,187,247円
投資のソムリエ	5,533,410,782円	7,588,674,489円
クルーズコントロール	604,204,415円	2,463,848,090円
投資のソムリエ<DC年金>	99,483,266円	240,441,643円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	706,595,262円	1,159,116,457円
DIAM DC バランス・F(成長型)	50,283,533円	121,311,364円
クルーズコントロール<DC年金>	151,948円	909,502円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,220,634円	6,058,111円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,942,514円	19,630,847円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,975,697円	145,993,757円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	460,972円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	- 円	797,399,737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
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円

D I A M国内債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	31,110,776,277円	31,037,609,957円
D I A Mアクティブアロ ケーション私募ファンド (適格機関投資家限定)	925,357,458円	548,565,885円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	598,181,155円	511,856,892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)	890,668,185円	452,644,236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)	295,141,650円	278,222,935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)	145,393,586円	113,027,666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)	396,454,681円	315,455,060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)	158,862,523円	131,854,367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)	122,661,862円	72,187,907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)	12,416,124,695円	2,253,845,204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)	4,716,711,039円	1,015,599,225円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	8,456,183,355円	6,998,400,243円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	3,795,959,754円	3,474,267,418円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	6,570,343,905円	6,265,110,925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)	787,739,006円	734,607,542円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	3,456,549,937円	1,931,112,724円
D I A M アクサ グ ローバル バランスファ ンド30VA(適格機関 投資家限定)	4,821,704,426円	4,285,930,749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)	6,663,294,119円	5,583,515,787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)	839,267,900円	273,887,149円
D I A M世界バランス ファンド5 5 V A (適格 機関投資家限定)	6,555,700,476円	5,572,131,426円
D I A M世界バランス ファンド3 5 V A (適格 機関投資家限定)	6,940,477,535円	6,745,903,203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)	89,526,721,508円	88,332,879,239円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1,276,115,973円	1,204,275,501円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	7,766,460,038円	7,547,500,500円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	28,803,192,292円	27,992,746,964円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	58,681,744円	95,642,492円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	29,226,882円	369,888円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	9,770,347円	8,244,501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)	32,292,361,602円	31,327,804,436円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	593,551,673円	547,765,920円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	158,113,403円	139,363,216円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	641,936,416円	640,261,286円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	69,505,002円	454,852円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	330,308円	351,483円
計	311,246,557,550円	295,190,206,036円

2. 受益権の総数	311,246,557,550口	295,190,206,036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27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<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28年2月25日現在	平成29年2月27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	6,348,296,900	1,861,783,300
地方債証券	118,622,402	52,629,642
特殊債券	55,700,444	14,982,365
社債券	59,665,370	25,950,390
合計	6,582,285,116	1,955,345,697

(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28年2月16日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月15日から平成29年2月27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28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.2829円	1.2800円
(1万口当たり純資産額)	(12,829円)	(12,800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29年2月27日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 6 3 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,330,000	
	3 6 4 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,506,975,000	
	3 6 5 回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,512,450,000	
	3 6 6 回 利付国庫債券(2年)	4,000,000,000	4,021,200,000	
	3 6 7 回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	502,850,000	
	3 6 9 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,006,280,000	
	3 7 0 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,006,700,000	
	3 7 1 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,007,020,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,008,220,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,012,440,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,513,440,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,300,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,531,710,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,236,582,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,036,680,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,736,408,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,515,795,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,920,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,537,440,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,531,150,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,541,850,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,028,980,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,535,490,000	
	1 2 7 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,031,800,000	
	1 2 8 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,044,160,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,540,110,000	
	1 3 0 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,517,775,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	835,602,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	980,518,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,126,872,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,083,568,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	929,761,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,014,472,000	
	8 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,173,310,000	
	9 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	843,330,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,232,820,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,055,640,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,369,667,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	928,674,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,015,855,000	

303回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,353,781,000
305回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,605,425,000
306回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,572,960,000
308回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	839,208,000
309回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,042,370,000
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,916,676,000
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,314,554,000
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,177,990,000
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,587,375,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,056,850,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,052,270,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,589,205,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,581,960,000
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,642,975,000
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,097,660,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,837,349,000
326回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,779,934,000
328回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,563,930,000
329回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,268,112,000
330回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,799,178,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,092,340,000
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,094,220,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,722,876,000
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,081,060,000
336回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,041,050,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,333,033,000
338回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,583,625,000
339回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,377,372,000
340回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,101,340,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,587,710,000
342回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,027,080,000
343回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,025,960,000
344回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,022,840,000
345回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,010,720,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	132,251,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,904,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,926,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	271,220,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,376,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,954,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,484,000
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	365,121,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	481,060,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	379,779,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	375,585,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	659,630,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,538,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	535,160,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,726,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,071,485,800

19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,464,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	402,909,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	654,700,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	632,408,500	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	808,410,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	404,364,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	525,488,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	933,877,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,221,858,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,090,216,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,483,592,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,333,670,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,449,657,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,611,480,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,665,313,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,595,172,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,932,900,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,809,122,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,781,570,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,252,020,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,022,336,000	
40回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	878,325,000	
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	986,120,000	
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,233,050,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	986,776,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	987,080,000	
45回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,184,820,000	
46回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,421,760,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,211,180,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,277,166,000	
49回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,160,840,000	
50回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,205,676,000	
51回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	960,311,000	
52回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,017,467,000	
53回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	190,144,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	748,915,200	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	846,760,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	928,610,800	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	971,253,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	539,440,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,030,246,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	550,850,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	845,098,800	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	655,488,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	606,243,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	778,680,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	897,552,900	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,251,508,900	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	667,416,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,076,714,100	

6 1 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	853,576,000	
6 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	845,136,000	
6 4 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	678,072,000	
6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,248,170,000	
6 7 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,164,499,000	
7 0 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,473,962,500	
7 2 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,451,637,500	
7 3 回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,377,912,900	
7 5 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,638,700,000	
7 8 回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,680,173,000	
8 1 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,638,868,000	
8 3 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,657,418,000	
8 5 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,663,116,000	
8 8 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,453,404,000	
9 0 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,448,124,000	
9 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,561,560,000	
9 3 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	836,101,000	
9 4 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	963,544,000	
9 5 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,475,268,000	
9 7 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,712,466,000	
9 9 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,702,036,000	
1 0 0 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,599,286,000	
1 0 2 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,757,952,000	
1 0 5 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,592,474,000	
1 0 7 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,086,954,000	
1 0 9 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,931,456,000	
1 1 1 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,993,840,000	
1 1 3 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,854,750,000	
1 1 4 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,859,310,000	
1 1 6 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,257,920,000	
1 1 8 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,230,870,000	
1 1 9 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,083,798,000	
1 2 1 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,073,218,000	
1 2 3 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,122,518,000	
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,276,478,000	
1 2 8 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	857,136,000	
1 2 9 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,089,639,000	
1 3 0 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,817,610,000	
1 3 2 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,157,228,000	
1 3 4 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,092,060,000	
1 3 5 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	959,224,000	
1 3 7 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,040,782,000	
1 4 0 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,921,488,000	
1 4 1 回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,524,578,000	
1 4 3 回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,491,377,000	
1 4 5 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,683,710,000	
1 4 6 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,924,464,000	
1 4 7 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,018,053,000	
1 4 8 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,756,380,000	
1 4 9 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,574,968,000	

	150回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,959,573,000	
	151回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,012,580,000	
	152回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,451,866,000	
	153回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,153,080,000	
	154回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,671,195,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,722,704,000	
	156回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,449,945,000	
	157回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,391,370,000	
	158回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,762,326,000	
	159回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	996,470,000	
国債証券 合計		288,020,000,000	317,647,724,400	
地方債証券	659回 東京都公募公債	203,500,000	207,810,130	
	667回 東京都公募公債	300,000,000	309,627,000	
	680回 東京都公募公債	200,000,000	208,428,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	518,630,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	206,718,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	524,105,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	732,060,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	523,755,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	316,080,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	418,736,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	116,095,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	242,346,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	361,761,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	207,944,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	210,064,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,371,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	313,521,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,374,000	
	319回 大阪府公募公債	200,000,000	205,614,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	208,948,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	314,400,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	210,198,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	312,873,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	317,139,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	360,202,500	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,384,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	322,155,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	203,963,950	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	207,360,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	209,866,000	
	1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	117,393,000	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	102,505,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	208,022,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	527,665,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	315,570,000		
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	208,848,000		
21年度4回 埼玉県公募公債	200,000,000	207,006,000		
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	210,042,000		
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	415,648,000		

21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	207,686,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	208,896,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	207,208,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	312,645,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	210,430,000	
65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,394,000	
80回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,388,000	
94回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	524,145,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	735,245,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,250,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	527,205,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	732,949,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,295,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,755,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	833,991,950	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,075,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,393,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,875,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,065,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,415,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,512,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	414,280,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,925,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	467,158,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	122,168,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	208,270,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	209,540,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	472,036,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	421,852,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	209,706,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	105,389,000	
21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	207,616,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	211,316,000	
地方債証券 合計	22,844,400,000	23,951,302,530	
特殊債券			
48回 高速道路機構債	700,000,000	724,570,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	728,952,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	104,362,000	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,871,000	
18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	330,174,000	
60回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	724,215,450	
66回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	165,912,300	
67回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	411,907,200	
71回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	615,606,000	



7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	721,644,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,556,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,296,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	419,628,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,044,980,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	517,795,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	528,965,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	349,988,100	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	515,475,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	673,192,590	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,798,610	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	518,535,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,517,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,140,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,134,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,388,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,186,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,691,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	420,580,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,065,000	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,595,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	310,719,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	55,488,000	59,217,348	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	39,092,000	41,721,327	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	57,975,000	61,929,474	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	61,869,000	66,579,086	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	26,095,000	27,258,576	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	132,875,000	137,884,387	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,233,000	38,104,996	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,419,000	22,939,106	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,908,000	86,605,541	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,624,000	64,614,877	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,705,000	115,384,922	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	201,470,000	216,332,441	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	373,528,000	397,680,320	
7 5 5 号 利付商工債	260,000,000	260,873,600	
い第 7 6 9 号 利付商工債	200,000,000	201,090,000	
い第 7 7 9 号 利付商工債	200,000,000	201,214,000	
7 6 0 号 利附農林債	300,000,000	301,848,000	

	764号 利附農林債	500,000,000	503,245,000	
	282回 利附信金中金債	300,000,000	301,074,000	
	293回 利附信金中金債	400,000,000	402,024,000	
	302回 利附信金中金債	300,000,000	301,572,000	
	186号 利附商工債(3年)	200,000,000	200,422,000	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	306,351,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	205,798,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	524,380,000	
特殊債券	合計	17,669,281,000	18,324,582,251	
社債券	1回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,871,000	
	337回 東京交通債	200,000,000	217,378,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,114,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	310,887,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	104,228,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,992,000	
	3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,571,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	104,057,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	102,918,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,852,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	104,285,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,582,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	101,330,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	210,072,000	
	16回 トヨタ自動車社債	100,000,000	103,352,000	
	49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	102,984,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	103,800,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	103,500,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	102,408,000	
	69回 三菱商事社債	300,000,000	307,338,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,397,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	105,349,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	210,942,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	208,282,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,636,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	318,006,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,023,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	105,621,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	209,108,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	106,092,000	
	12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,310,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	206,318,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	104,136,000	
	20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	209,994,000	
	22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	208,932,000	
	23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	421,596,000	
14回 みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	210,268,000		
15回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	211,568,000		

47回	日立キャピタル社債	200,000,000	206,580,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	102,475,000	
14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	103,452,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,054,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,370,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	208,624,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	114,610,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	101,903,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	207,358,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	101,988,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,177,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,306,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	345,756,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	305,562,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,486,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	222,162,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	337,494,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,476,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,390,000	
11回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,037,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,429,000	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	209,096,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,484,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	313,581,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	205,220,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	206,224,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	508,225,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	102,801,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	518,410,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	310,056,000	
492回	関西電力社債	200,000,000	202,068,000	
493回	関西電力社債	200,000,000	202,088,000	
377回	中国電力社債	200,000,000	211,332,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	107,107,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	204,546,000	
471回	東北電力社債	200,000,000	211,894,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	305,088,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	103,510,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	209,860,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	204,254,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	212,114,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	419,888,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	203,488,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	167,320,860	
13回	電源開発社債	200,000,000	227,716,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	314,430,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	103,439,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	107,760,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,785,000	
社債券	合計	15,861,000,000	16,594,570,860	

合計	344,394,681,000	376,518,180,041	
----	-----------------	-----------------	--

## 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28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
預金		805,145,627	1,507,142,684
金銭信託		85,897,312	-
コール・ローン		-	681,046,972
株式		236,834,617,141	263,147,490,307
投資信託受益証券		789,271,471	825,923,149
投資証券		5,598,714,114	6,315,863,305
派生商品評価勘定		29,661,401	90,791,280
未収入金		159,029,454	2,417,530
未収配当金		490,890,995	565,567,832
差入委託証拠金		1,511,748,469	1,456,599,809
流動資産合計		246,304,975,984	274,592,842,868
資産合計		246,304,975,984	274,592,842,868
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		29,068,874	1,503,362
未払解約金		550,706,000	658,103,000
流動負債合計		579,774,874	659,606,362
負債合計		579,774,874	659,606,362
純資産の部			
元本等			
元本	1	101,062,929,782	91,611,980,480
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		144,662,271,328	182,321,256,026
元本等合計		245,725,201,110	273,933,236,506
純資産合計		245,725,201,110	273,933,236,506
負債純資産合計		246,304,975,984	274,592,842,868

## 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28年2月25日現在	平成29年2月27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	109,314,267,788円	101,062,929,782円
同期中追加設定元本額	20,720,942,880円	17,462,001,997円
同期中一部解約元本額	28,972,280,886円	26,912,951,299円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,265,346,668円	1,957,218,700円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,067,406円	4,597,665円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	10,330,738円	12,813,496円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	24,590,871円	27,139,952円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	12,074,361円	13,284,546円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	8,743,829円	12,182,802円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	9,184,637円	16,970,640円
たわらノーロード 先進国株式	826,190,880円	2,401,466,878円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	- 円	425,695円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	- 円	95,071,790円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	34,283,257,934円	35,537,387,647円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	169,874,284円	169,317,804円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	905,415,134円	929,041,840円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,068,407,169円	1,088,784,171円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	140,986,314円	151,198,377円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	406,671,520円	421,382,473円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	338,651,848円	340,601,324円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	43,215,717円	42,243,439円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	874,460,875円	932,693,027円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	242,048,956円	215,631,374円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国10)	19,784,452円	27,054,593円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国20)	39,211,766円	52,812,992円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国30)	83,633,667円	106,602,334円
投資のソムリエ	477,923,774円	1,447,959,597円
クルーズコントロール	116,268,511円	423,103,664円
投資のソムリエ<DC年金>	9,139,329円	44,003,627円
DIAM 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	60,602,702円	88,624,580円
DIAM DC バラン ス・F(成長型)	21,789,339円	44,097,862円
クルーズコントロール< DC年金>	29,118円	156,043円
DIAMコア資産設計 ファンド(堅実型)	1,060,414円	2,581,654円
DIAMコア資産設計 ファンド(積極型)	1,885,928円	8,454,381円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	389,909円	19,173,147円
ダイナミック・ナビゲー ション	- 円	1,575,046円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド	- 円	104,007,220円
ワールドアセットバラン ス(基本コース)	- 円	111,316,911円
ワールドアセットバラン ス(リスク抑制コース)	- 円	145,454,314円
DIAM外国株式イン デックスファンドVA (適格機関投資家専用)	246,302,019円	163,368,838円
DIAM外国株式パッシ ブ私募ファンド(適格機 関投資家向け)	3,399,312,717円	3,207,285,574円
DIAMアクティブアロ ケーション私募ファンド (適格機関投資家限定)	117,716,486円	180,603,347円
DIAM先進国株式パッ シブファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	392,000円



D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	38,663,574円	28,887,946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)	380,345,852円	161,611,237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)	374,359,591円	298,410,591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)	31,054,047円	20,377,575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)	198,593,205円	135,252,737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)	15,800,472円	11,414,013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)	30,800,758円	15,373,489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)	4,146,137,174円	632,259,643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)	2,361,996,766円	427,409,243円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	1,057,860,672円	743,979,293円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	1,111,132,004円	870,032,675円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	3,303,720,878円	2,693,426,272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)	1,243,117,731円	1,053,591,911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)	1,975,013,508円	980,540,194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)	1,590,347,521円	1,217,509,769円
D I A M世界アセットバ ランスファンドVA(適 格機関投資家向け)	1,062,501,229円	799,238,075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)	12,333,699円	3,672,039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 )	4,679,814,254円	3,561,322,538円
D I A M世界バランス ファンド3 5 V A ( 適格 機関投資家限定 )	1,794,957,557円	1,507,107,240円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2 V A ( 適格機関投資家限定 )	11,097,820,859円	9,475,846,807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 )	630,608,542円	519,886,797円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,901,357,227円	1,623,806,982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 )	7,078,616,550円	6,051,606,509円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	17,738,254円	25,152,055円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	22,620,054円	239,046円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	17,318,549円	13,078,140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 )	9,537,135,837円	8,108,064,369円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	92,569,470円	84,358,582円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	28,741,863円	169,337円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	282,813円	274,012円
計	101,062,929,782円	91,611,980,480円
2 . 受益権の総数	101,062,929,782口	91,611,980,480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27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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28年2月25日現在	平成29年2月27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	7,430,439,349	1,851,257,751
投資信託受益証券	22,625,311	1,845,255
投資証券	230,562,250	145,524,021
合計	7,683,626,910	1,994,936,517

（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28年2月16日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月16日から平成29年2月27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28年2月25日 現在				平成29年2月27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	534,711,398	-	535,463,600	752,202	-	-	-	-
アメリカ・ドル	362,801,552	-	363,395,200	593,648	-	-	-	-
イギリス・債券	43,862,032	-	43,721,600	140,432	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	19,353,404	-	19,324,400	29,004	-	-	-	-
カナダ・ドル	18,676,884	-	18,816,300	139,416	-	-	-	-
ユーロ	90,017,526	-	90,206,100	188,574	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	2,719,286,282	-	2,719,140,100	146,182
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,783,590,450	-	1,783,503,000	87,450
イギリス・債券	-	-	-	-	213,067,188	-	213,052,500	14,688
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	115,296,548	-	115,280,200	16,348
カナダ・ドル	-	-	-	-	109,487,616	-	109,478,400	9,216
ユーロ	-	-	-	-	497,844,480	-	497,826,000	18,480
合計	534,711,398	-	535,463,600	752,202	2,719,286,282	-	2,719,140,100	146,182

## （注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
  3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 株式関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成29年2月27日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	2,204,383,417	-	2,205,728,146	1,344,729	6,123,241,477	-	6,212,675,577	89,434,100
合計	2,204,383,417	-	2,205,728,146	1,344,729	6,123,241,477	-	6,212,675,577	89,434,100

#### (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28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	2.4314円	2.9901円
(1万口当たり純資産額)	(24,314円)	(29,901円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成29年2月27日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,084	845.240	25,428,200.160	
	ABBOTT LABORATORIES	127,914	45.680	5,843,111.520	
	AES CORP	45,579	11.930	543,757.470	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,924	181.350	12,318,017.400	
	ADOBE SYSTEMS INC	37,684	119.310	4,496,078.040	
	CHUBB LTD	34,845	138.410	4,822,896.450	
	AGCO CORP	5,610	61.730	346,305.300	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,671	140.860	2,207,417.060	
	ALLEGHANY CORP	1,054	649.490	684,562.460	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	65,207	79.810	5,204,170.670	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	79.210	372,524.630	
	ALLSTATE CORP	27,316	80.910	2,210,137.560	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	53,883	125.030	6,736,991.490	
	AMGEN INC	55,670	174.560	9,717,755.200	
	HESS CORP	20,421	52.490	1,071,898.290	
	AMERICAN EXPRESS CO	58,349	79.760	4,653,916.240	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,960	67.150	2,481,864.000	
	AFLAC INC	30,673	71.710	2,199,560.830	
	AMERICAN INTL GROUP	79,535	63.630	5,060,812.050	
	AMERCO	551	384.190	211,688.690	
	ANALOG DEVICES	23,069	81.680	1,884,275.920	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	64.770	2,655,764.310	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,266	131.540	2,271,169.640	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	68,862	41.820	2,879,808.840	
	TIME WARNER	57,964	97.280	5,638,737.920	
	JONES LANG LASALLE INC	3,815	113.930	434,642.950	
	VALERO ENERGY CORP	35,405	66.720	2,362,221.600	
	APACHE CORP	28,309	53.410	1,511,983.690	
	ANSYS INC	5,619	104.500	587,185.500	
	APPLE INC	402,214	136.660	54,966,565.240	
	APPLIED MATERIALS INC	82,900	36.300	3,009,270.000	
	ALBEMARLE CORP	7,904	92.930	734,518.720	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,421	45.260	2,010,494.460	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	81.440	637,756.640		
AMEREN CORP	17,312	54.580	944,888.960		

ARROW ELECTRONICS INC	7,403	73.490	544,046.470	
AUTOLIV INC	6,197	104.610	648,268.170	
AUTODESK INC	14,259	87.550	1,248,375.450	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,227	103.000	3,525,381.000	
AUTOZONE INC	2,229	732.750	1,633,299.750	
AVERY DENNISON CORP	7,368	80.250	591,282.000	
AVNET INC	10,288	46.410	477,466.080	
BAKER HUGHES INC	30,916	59.800	1,848,776.800	
BALL CORP	12,162	73.070	888,677.340	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	91,251	170.220	15,532,745.220	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,107	47.090	3,725,148.630	
CR BARD INC	5,309	245.180	1,301,660.620	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,687	50.490	1,902,816.630	
BED BATH & BEYOND INC	10,744	41.040	440,933.760	
BECTON DICKINSON & CO	15,808	183.420	2,899,503.360	
AMETEK INC	16,775	54.630	916,418.250	
BE AEROSPACE INC	8,229	63.130	519,496.770	
VERIZON COMM INC	305,099	50.600	15,438,009.400	
WR BERKLEY CORP	8,134	71.520	581,743.680	
BEST BUY CO INC	21,033	45.560	958,263.480	
YUM! BRANDS INC	28,494	65.950	1,879,179.300	
FIRSTENERGY CORP	30,796	32.320	995,326.720	
H&R BLOCK INC	16,114	20.050	323,085.700	
BOEING CO	44,146	177.440	7,833,266.240	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	47.960	520,174.160	
BORGWARNER INC	14,648	41.530	608,331.440	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,578	24.780	2,492,322.840	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	80.130	792,806.220	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	475.460	873,895.480	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	124,492	56.440	7,026,328.480	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	168.030	636,497.640	
INGREDION INC	5,305	122.760	651,241.800	
ONEOK INC	16,401	53.160	871,877.160	
UNITED RENTALS INC	6,332	124.150	786,117.800	
SEMPRA ENERGY	18,176	109.090	1,982,819.840	
FEDEX CORP	18,672	193.110	3,605,749.920	
VERISIGN INC	6,321	83.310	526,602.510	
AMPHENOL CORP	23,304	70.180	1,635,474.720	
BROWN-FORMAN CORP	16,642	48.880	813,460.960	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,337	57.610	1,286,834.570	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.120	650,711.040	
CSX CORP	69,449	48.480	3,366,887.520	



CABOT OIL & GAS CORP	38,049	22.450	854,200.050	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	59.110	830,495.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	47.750	1,109,662.250	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,081	158.850	2,077,916.850	
CARDINAL HEALTH INC	24,212	82.140	1,988,773.680	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	27,339	56.030	1,531,804.170	
CATERPILLAR INC	44,065	95.480	4,207,326.200	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	99.450	977,792.400	
CELGENE CORP	57,620	118.230	6,812,412.600	
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	114.190	412,454.280	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	80.180	873,641.280	
CENTURYLINK INC	39,384	24.580	968,058.720	
CERNER CORP	23,765	55.610	1,321,571.650	
JPMORGAN CHASE & CO	269,975	90.330	24,386,841.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	49.530	932,253.660	
CIGNA CORP	19,066	147.040	2,803,464.640	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	73.490	807,067.180	
CINTAS CORP	6,282	119.070	747,997.740	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	96,233	3.370	324,305.210	
CISCO SYSTEMS INC	375,461	34.320	12,885,821.520	
CLOROX COMPANY	9,331	136.370	1,272,468.470	
COCA-COLA CO/THE	306,559	41.780	12,808,035.020	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,128	73.350	4,630,438.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	25,301	87.080	2,203,211.080	
COMERICA INC	12,068	71.200	859,241.600	
COMCAST CORP-CL A	359,104	37.890	13,606,450.560	
CA INC	22,732	32.630	741,745.160	
COMPUTER SCIENCES CORP	10,556	69.100	729,419.600	
CONAGRA BRANDS INC	31,942	41.160	1,314,732.720	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,660	76.610	1,812,592.600	
CMS ENERGY CORP	22,372	44.680	999,580.960	
COOPER COS INC	3,794	199.720	757,737.680	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	101.020	1,399,632.100	
CORNING INC	79,197	27.730	2,196,132.810	
WR GRACE & CO	5,923	71.050	420,829.150	
SEALED AIR CORP	16,041	47.260	758,097.660	
CUMMINS INC	12,194	149.940	1,828,368.360	
DR HORTON INC	24,498	31.390	768,992.220	
DANAHER CORP	46,324	86.080	3,987,569.920	
MOODY'S CORP	12,924	113.290	1,464,159.960	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,469	59.500	2,705,405.500	
TARGET CORP	40,245	66.510	2,676,694.950	
DEERE & CO	20,474	108.620	2,223,885.880	

MORGAN STANLEY	106,341	45.530	4,841,705.730	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	61.350	1,065,956.250	
COSTAR GROUP INC	2,278	201.340	458,652.520	
THE WALT DISNEY CO	113,984	110.320	12,574,714.880	
DOLLAR TREE INC	17,493	79.410	1,389,119.130	
DOVER CORP	10,736	80.060	859,524.160	
DOW CHEMICAL	83,895	63.550	5,331,527.250	
OMNICOM GROUP	16,993	86.160	1,464,116.880	
DTE ENERGY CO	13,122	101.090	1,326,502.980	
DUKE ENERGY CORP	51,765	81.960	4,242,659.400	
FLOWERVE CORP	8,406	47.720	401,134.320	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	75.460	712,040.560	
EBAY INC	82,914	34.060	2,824,050.840	
BANK OF AMERICA CORP	761,401	24.230	18,448,746.230	
CITIGROUP INC	216,601	59.560	12,900,755.560	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	80.160	817,070.880	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	36.790	689,444.600	
EATON CORP PLC	34,800	72.390	2,519,172.000	
EATON VANCE CORP	9,184	46.960	431,280.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	31.290	653,241.330	
DISH NETWORK CORP	16,150	62.540	1,010,021.000	
ECOLAB INC	20,098	125.500	2,522,299.000	
ELECTRONIC ARTS INC	23,105	86.540	1,999,506.700	
SALESFORCE.COM INC	49,119	81.780	4,016,951.820	
EMERSON ELECTRIC CO	48,079	60.480	2,907,817.920	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	78.180	642,717.780	
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	5.570	392,350.800	
ENTERGY CORP	13,984	75.800	1,059,987.200	
EOG RESOURCES INC	42,707	96.300	4,112,684.100	
EQUIFAX INC	8,495	129.380	1,099,083.100	
EQT CORP	13,874	59.940	831,607.560	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	83.750	1,351,222.500	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	56.700	809,619.300	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	47,994	71.550	3,433,970.700	
EXXON MOBIL CORP	309,835	81.080	25,121,421.800	
FMC CORP	10,694	58.130	621,642.220	
NEXTERA ENERGY INC	34,612	130.960	4,532,787.520	
ASSURANT INC	4,960	98.760	489,849.600	
FASTENAL CO	21,654	50.100	1,084,865.400	
FIFTH THIRD BANCORP	57,732	27.320	1,577,238.240	
M&T BANK CORP	10,664	168.670	1,798,696.880	
FISERV INC	15,880	116.300	1,846,844.000	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	36.720	426,796.560	
MACY'S INC	24,512	33.170	813,063.040	
FORD MOTOR CO	279,141	12.470	3,480,888.270	
FRANKLIN RESOURCES INC	27,510	42.740	1,175,777.400	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	13.250	1,282,759.000	
FLEX LTD	44,363	16.730	742,192.990	

ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	56.860	692,327.360	
TEGNA INC	16,963	24.800	420,682.400	
GAP INC/THE	18,295	24.700	451,886.500	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	62.790	1,097,380.830	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,255	189.630	3,651,325.650	
GENERAL MILLS INC	43,879	61.370	2,692,854.230	
GENUINE PARTS CO	11,094	96.250	1,067,797.500	
GILEAD SCIENCES INC	98,271	69.940	6,873,073.740	
GARTNER INC	6,829	103.710	708,235.590	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	35.360	639,909.920	
MCKESSON CORP	16,986	150.850	2,562,338.100	
NVIDIA CORP	39,760	101.460	4,034,049.600	
GENERAL ELECTRIC CO	669,933	30.190	20,225,277.270	
WW GRAINGER INC	4,486	250.240	1,122,576.640	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	17.050	379,123.800	
HALLIBURTON CO	64,633	52.870	3,417,146.710	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	43.550	1,285,683.100	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,115	247.350	6,706,895.250	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	56.560	729,680.560	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,679	111.440	632,867.760	
HARRIS CORP	8,954	111.100	994,789.400	
HASBRO INC	8,909	97.780	871,122.020	
HENRY SCHEIN INC	5,713	173.530	991,376.890	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	67.530	487,093.890	
HERSHEY FOODS CORP	11,306	108.900	1,231,223.400	
HP INC	131,066	17.650	2,313,314.900	
F5 NETWORKS INC	4,874	144.410	703,854.340	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,481	53.330	612,281.730	
REYNOLDS AMERICAN INC	63,698	61.500	3,917,427.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	146.710	505,709.370	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.420	788,370.800	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	28.940	401,918.720	
HOLOGIC INC	17,500	40.820	714,350.000	
UNUM GROUP	16,000	48.480	775,680.000	
HOME DEPOT INC	92,204	145.950	13,457,173.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	87.510	1,127,741.370	
HORMEL FOODS CORP	23,322	34.660	808,340.520	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.020	863,343.040	
HUMANA INC	11,580	207.280	2,400,302.400	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	99.820	591,633.140	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	14.180	1,065,782.980	
RED HAT INC	13,472	84.860	1,143,233.920	
BIOGEN INC	16,273	285.130	4,639,920.490	

ILLINOIS TOOL WORKS	23,599	131.680	3,107,516.320	
INTUIT INC	17,739	128.010	2,270,769.390	
IDEXX LABORATORIES INC	7,050	143.060	1,008,573.000	
INGERSOLL-RAND PLC	19,490	81.320	1,584,926.800	
INTEL CORP	353,216	36.530	12,902,980.480	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	125.000	697,250.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	52.620	1,493,092.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	24.560	716,095.920	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	56.030	444,373.930	
INCYTE CORP	12,360	131.210	1,621,755.600	
JOHNSON & JOHNSON	204,804	122.730	25,135,594.920	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,304	48.620	1,424,760.480	
KLA-TENCOR CORP	11,724	90.290	1,058,559.960	
DEVON ENERGY CORP	34,184	42.810	1,463,417.040	
WESTAR ENERGY INC	9,911	53.800	533,211.800	
KELLOGG CO	18,922	75.230	1,423,502.060	
KEYCORP	81,264	18.740	1,522,887.360	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,663	133.660	3,563,776.580	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,030	389.160	3,514,114.800	
KOHL'S CORP	14,862	42.990	638,917.380	
KROGER CO	69,381	33.290	2,309,693.490	
LAM RESEARCH CORP	11,522	118.790	1,368,698.380	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,455	93.450	696,669.750	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	62.870	793,545.140	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	49.430	473,934.840	
LENNAR CORP	14,850	47.430	704,335.500	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	25.690	551,358.780	
ELI LILLY & CO	74,120	82.870	6,142,324.400	
L BRANDS INC	18,583	50.990	947,547.170	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,276	70.820	1,223,486.320	
LINEAR TECH CORP	17,456	64.540	1,126,610.240	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,738	106.180	5,493,540.840	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	51.740	1,255,522.840	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,723	266.000	5,246,318.000	
LOEWS CORP	21,346	47.230	1,008,171.580	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	27.640	378,585.080	
LOWE'S COS INC	65,195	76.100	4,961,339.500	
DOMINION RESOURCES INC/VA	47,031	77.000	3,621,387.000	
SCANA CORP	10,902	68.920	751,365.840	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	26.390	849,705.220	
MCCORMICK & CO INC	9,163	99.330	910,160.790	

MCDONALD'S CORPORATION	63,662	128.650	8,190,116.300	
S&P GLOBAL INC	20,295	130.820	2,654,991.900	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	235.030	769,018.160	
MANPOWERGROUP INC	5,703	97.360	555,244.080	
MARKEL CORPORATION	989	976.980	966,233.220	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	94.760	1,494,933.760	
MARSH & MCLENNAN COS	38,323	73.510	2,817,123.730	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,056	74.690	302,942.640	
MASCO CORP	23,043	34.020	783,922.860	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	210.050	921,489.350	
MATTEL INC	24,003	25.760	618,317.280	
METLIFE INC	70,719	52.490	3,712,040.310	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	45.060	916,610.520	
MEDTRONIC PLC	104,227	81.030	8,445,513.810	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,373	45.550	1,975,640.150	
CVS HEALTH CORP	79,353	81.480	6,465,682.440	
MERCK & CO. INC.	206,907	66.160	13,688,967.120	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	142.890	1,025,378.640	
MICROSOFT CORP	553,414	64.620	35,761,612.680	
MICRON TECH INC	76,146	23.240	1,769,633.040	
MIDDLEBY CORP	4,100	139.050	570,105.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,176	72.830	1,105,268.080	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,922	16.010	559,101.220	
3M CO	45,218	187.410	8,474,305.380	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,759	225.960	1,075,343.640	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,150	80.270	895,010.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,789	88.330	776,332.370	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	28.150	350,270.450	
ENDO INTERNATIONAL PLC	16,587	13.150	218,119.050	
MYLAN NV	34,754	42.160	1,465,228.640	
ILLUMINA INC	11,255	160.000	1,800,800.000	
XCEL ENERGY INC	37,554	43.340	1,627,590.360	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	39.790	1,071,863.020	
NETAPP INC	20,641	40.950	845,248.950	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	36.740	504,807.600	
NEWELL BRANDS INC	32,324	48.670	1,573,209.080	
DUN & BRADSTREET CORP	3,012	105.600	318,067.200	
NEWMONT MINING CORP	38,093	36.080	1,374,395.440	
NIKE INC-CL B	99,876	57.860	5,778,825.360	
NOBLE ENERGY INC	31,005	36.780	1,140,363.900	
NORDSTROM INC	9,487	46.460	440,766.020	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,604	120.080	2,714,288.320	

EVERSOURCE ENERGY	23,085	59.030	1,362,707.550	
NISOURCE INC	22,198	24.010	532,973.980	
COACH INC	19,175	38.020	729,033.500	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	87.050	1,400,634.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,620	245.050	3,092,531.000	
WELLS FARGO & CO	358,022	57.810	20,697,251.820	
NUCOR CORP	23,780	60.860	1,447,250.800	
MONSANTO CO	33,243	112.960	3,755,129.280	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	47.460	755,895.420	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,294	92.610	3,453,797.340	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,546	64.890	3,669,269.940	
OGE ENERGY CORP	16,028	36.110	578,771.080	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,017	268.730	1,885,678.410	
ORACLE CORP	231,390	43.170	9,989,106.300	
PACCAR INC	26,578	67.420	1,791,888.760	
EXELON CORP	69,607	37.180	2,587,988.260	
PARKER HANNIFIN CORP	9,981	155.040	1,547,454.240	
PATTERSON COS INC	7,169	45.220	324,182.180	
PAYCHEX INC	23,141	61.810	1,430,345.210	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	68.940	449,902.440	
MEDNAX INC	7,824	71.170	556,834.080	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	102.890	540,686.950	
PPL CORPORATION	49,957	36.830	1,839,916.310	
PEPSICO INC	107,608	109.830	11,818,586.640	
PENTAIR PLC	11,775	58.150	684,716.250	
PFIZER INC	453,602	34.260	15,540,404.520	
CONOCOPHILLIPS	91,766	47.040	4,316,672.640	
PVH CORP	6,682	91.570	611,870.740	
PG&E CORP	37,651	66.330	2,497,390.830	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,977	185.360	2,405,416.720	
ALTRIA GROUP INC	146,055	74.430	10,870,873.650	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,446	126.880	4,624,268.480	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	86.290	432,312.900	
GARMIN LTD	7,795	53.030	413,368.850	
AETNA INC	26,111	128.970	3,367,535.670	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	55.090	541,038.890	
PPG INDUSTRIES INC	19,289	103.310	1,992,746.590	
PRAXAIR INC	21,868	118.110	2,582,829.480	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,574	177.560	5,783,839.440	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,304	71.950	1,316,972.800	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	97.310	1,009,883.180	
PROCTER & GAMBLE CO	191,488	91.050	17,434,982.400	
PROGRESSIVE CORP	44,358	39.050	1,732,179.900	

PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	45.610	1,692,815.150	
PULTE GROUP INC	25,477	21.730	553,615.210	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	39,870	15.400	613,998.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	78.970	850,427.930	
QUALCOMM INC	109,993	57.220	6,293,799.460	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	78.490	799,577.630	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	146.280	517,099.800	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	361.010	2,042,955.590	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	129.400	600,674.800	
AUTONATION INC	5,772	46.830	270,302.760	
RESMED INC	11,376	71.960	818,616.960	
US BANCORP	127,815	55.100	7,042,606.500	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	62.730	458,995.410	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	94.540	820,039.960	
RITE AID CORP	85,598	5.970	511,020.060	
ROSS STORES INC	30,542	69.010	2,107,703.420	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,820	209.910	1,641,496.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,667	151.140	1,461,070.380	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,567	96.150	1,304,467.050	
RAYTHEON COMPANY	21,940	153.480	3,367,351.200	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,399	244.810	1,076,919.190	
ACCENTURE PLC-CL A	46,433	123.430	5,731,225.190	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	115,309	45.380	5,232,722.420	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,919	128.090	1,270,524.710	
ROCKWELL COLLINS INC	9,535	94.560	901,629.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,229	122.270	2,595,669.830	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	23,052	83.840	1,932,679.680	
PRICELINE GROUP INC	3,670	1,631.620	5,988,045.400	
SCHLUMBERGER LTD	103,570	80.150	8,301,135.500	
SCHWAB (CHARLES) CORP	88,020	41.110	3,618,502.200	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,255	116.920	1,783,614.600	
BUNGE LTD	11,367	81.050	921,295.350	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	50.940	565,790.580	
ANTHEM INC	19,543	163.830	3,201,729.690	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,348	92.160	1,322,311.680	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	62.750	1,345,485.500	

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	312.650	1,862,768.700	
CENTENE CORP	13,899	70.610	981,408.390	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	50.560	483,606.400	
ACUITY BRANDS INC	3,087	218.130	673,367.310	
SNAP-ON INC	3,932	171.360	673,787.520	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,142	109.960	3,534,334.320	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	157.330	829,601.090	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,997	7.350	286,627.950	
EDISON INTERNATIONAL	24,139	78.870	1,903,842.930	
SOUTHERN CO	73,354	50.500	3,704,377.000	
BB&T CORP	59,828	48.110	2,878,325.080	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	58.540	664,546.080	
AT&T INC	460,498	42.360	19,506,695.280	
CHEVRON CORP	140,802	110.120	15,505,116.240	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,590	127.770	1,480,854.300	
STAPLES INC	52,662	9.280	488,703.360	
STATE STREET CORP	29,122	78.950	2,299,181.900	
STARBUCKS CORP	108,982	57.480	6,264,285.360	
STRYKER CORP	25,117	129.270	3,246,874.590	
NETFLIX INC	31,878	143.250	4,566,523.500	
STERICYCLE INC	6,853	82.930	568,319.290	
SUNTRUST BANKS INC	37,716	59.290	2,236,181.640	
SYMANTEC CORP	46,581	28.840	1,343,396.040	
SYNOPSIS INC	10,656	72.060	767,871.360	
SYSCO CORP	40,782	53.200	2,169,602.400	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,837	736.860	2,090,471.820	
TELEFLEX INC	3,203	189.790	607,897.370	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	67,717	35.380	2,395,827.460	
TESORO CORP	9,395	87.950	826,290.250	
TEXAS INSTRUMENTS INC	74,880	77.240	5,783,731.200	
TEXTRON INC	19,076	47.170	899,814.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,340	158.980	4,664,473.200	
TIFFANY & CO	8,733	91.730	801,078.090	
TOLL BROTHERS INC	13,356	33.740	450,631.440	
TORCHMARK CORP	7,699	77.550	597,057.450	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	55.180	622,375.220	
DAVITA INC	12,245	69.040	845,394.800	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	71.170	660,172.920	
TRIMBLE INC	20,073	31.400	630,292.200	
TYSON FOODS INC	21,621	62.680	1,355,204.280	
UGI CORP	12,068	48.170	581,315.560	
MARATHON OIL CORP	66,702	15.730	1,049,222.460	
UNION PACIFIC CORP	62,006	107.740	6,680,526.440	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	59,230	112.460	6,661,005.800	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,272	163.060	11,621,612.320	



UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	125.980	800,098.980	
VALSPAR CORP	6,122	111.450	682,296.900	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	84.720	580,162.560	
VF CORP	24,309	53.060	1,289,835.540	
CBS CORP	31,152	66.970	2,086,249.440	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,957	86.070	1,631,628.990	
VULCAN MATERIALS CO	9,977	117.820	1,175,490.140	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,696	87.610	6,018,456.560	
WAL-MART STORES INC	116,011	72.390	8,398,036.290	
WASTE MANAGEMENT INC	34,095	73.150	2,494,049.250	
WATERS CORP	5,963	156.400	932,613.200	
ALLERGAN PLC	29,478	245.370	7,233,016.860	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	141.180	1,236,030.900	
WESTERN DIGITAL CORP	22,106	74.650	1,650,212.900	
WABTEC CORP	7,363	79.450	584,990.350	
WHIRLPOOL CORP	5,553	180.160	1,000,428.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	94.700	1,281,196.300	
WYNN RESORTS LTD	6,279	94.010	590,288.790	
WHOLE FOODS MARKET INC	22,675	31.560	715,623.000	
NASDAQ INC	9,132	71.450	652,481.400	
CME GROUP INC	25,149	122.620	3,083,770.380	
WILLIAMS COS INC	54,722	27.970	1,530,574.340	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	49.240	368,758.360	
LKQ CORP	22,948	31.880	731,582.240	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	39.520	647,456.160	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	59.490	1,375,230.330	
FOOT LOCKER INC	9,476	75.010	710,794.760	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	43.410	808,771.710	
CARMAX INC	13,513	65.830	889,560.790	
XEROX CORP	69,821	7.540	526,450.340	
XILINX INC	18,777	58.990	1,107,655.230	
YAHOO! INC	66,277	45.550	3,018,917.350	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	126.030	882,588.090	
TJX COMPANIES INC	48,566	78.250	3,800,289.500	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	6.820	645,854.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,000	62.950	1,259,000.000	
SIGNATURE BANK	4,171	156.920	654,513.320	
CBRE GROUP INC	20,976	35.270	739,823.520	
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	36.990	594,540.270	
REGIONS FINANCIAL CORP	94,000	15.200	1,428,800.000	
DOMINO'S PIZZA INC	3,935	186.280	733,011.800	

T-MOBILE US INC	21,188	62.210	1,318,105.480	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,734	52.170	1,759,902.780	
MOSAIC CO/THE	26,525	31.420	833,415.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	30,914	30.230	934,530.220	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	79,925	30.610	2,446,504.250	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	75.670	414,141.910	
CELANESE CORP	10,766	88.790	955,913.140	
DEXCOM INC	6,161	78.500	483,638.500	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	29.270	305,081.210	
EXPEDIA INC	9,786	119.160	1,166,099.760	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	31.150	575,496.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,627	129.830	1,509,533.410	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	50,537	36.200	1,829,439.400	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,298	58.300	2,699,173.400	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	21.810	320,519.760	
VIACOM INC-CLASS B	27,527	43.890	1,208,160.030	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,089	420.900	879,260.100	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	75.080	464,820.280	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	250.990	956,773.880	
MASTERCARD INC	72,464	111.000	8,043,504.000	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	20.010	590,915.310	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	83.870	623,657.320	
HANESBRANDS INC	27,619	21.380	590,494.220	
WESTERN UNION CO	35,222	20.170	710,427.740	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	45.350	525,425.100	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,099	16.060	290,669.940	
SPECTRA ENERGY CORP	51,646	40.680	2,100,959.280	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	70.360	586,098.800	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,440	19.250	354,970.000	
DELTA AIR LINES INC	14,611	50.460	737,271.060	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	44.640	283,642.560	
DISCOVER FINANCIAL	30,804	71.220	2,193,860.880	
TE CONNECTIVITY LTD	27,026	74.300	2,008,031.800	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	133.280	1,406,370.560	
WABCO HOLDING INC	4,379	112.870	494,257.730	

LULULEMON ATHLETICA INC	9,052	65.320	591,276.640	
VMWARE INC	5,491	91.010	499,735.910	
MERCADOLIBRE INC	2,861	207.790	594,487.190	
ULTA BEAUTY INC	4,332	276.330	1,197,061.560	
INVESCO LTD	29,824	32.660	974,051.840	
MSCI INC	6,462	95.540	617,379.480	
CALPINE CORP NPR	27,876	11.760	327,821.760	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,885	107.720	12,483,132.200	
VISA INC	141,188	88.430	12,485,254.840	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,377	94.790	1,362,795.830	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,301	76.300	1,091,166.300	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	80.760	531,804.600	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	73.800	449,811.000	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,085	28.550	459,226.750	
MARATHON PETROLEUM CORP	39,747	50.030	1,988,542.410	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	57.400	667,217.600	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	137.270	250,655.020	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	140,475	21.240	2,983,689.000	
XYLEM INC	11,630	47.900	557,077.000	
ALKERMES PLC	12,053	52.980	638,567.940	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,049	92.430	2,500,139.070	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	216.980	754,873.420	
SPLUNK INC	10,674	62.800	670,327.200	
HCA HOLDINGS INC	23,320	87.070	2,030,472.400	
VERISK ANALYTICS INC	12,227	83.950	1,026,456.650	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,846	136.110	659,589.060	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	168.700	1,103,972.800	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,697	87.890	1,203,829.330	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,555	95.290	1,005,785.950	
CIT GROUP INC	16,266	42.780	695,859.480	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	102.830	2,329,305.160	
TARGA RESOURCES CORP	12,532	56.380	706,554.160	
LEAR CORP	5,132	141.360	725,459.520	
DOLLAR GENERAL CORP	21,500	77.350	1,663,025.000	
FORTINET INC	11,399	37.150	423,472.850	
AON PLC	20,606	116.560	2,401,835.360	

TESLA INC	9,875	257.000	2,537,875.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	41.280	470,261.760	
GENERAL MOTORS CO	105,443	36.900	3,890,846.700	
VANTIV INC	12,141	65.790	798,756.390	
TRIPADVISOR INC	9,263	42.620	394,789.060	
ALLY FINANCIAL INC	35,251	22.770	802,665.270	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	37.300	444,727.900	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	41.680	563,722.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,532	76.690	1,574,599.080	
PHILLIPS 66	34,686	78.030	2,706,548.580	
FACEBOOK INC	173,536	135.440	23,503,715.840	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	11,968	77.640	929,195.520	
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,616	100.410	563,902.560	
SERVICENOW INC	12,640	91.820	1,160,604.800	
WHITELAVE FOODS CO	14,444	55.200	797,308.800	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	153.010	1,078,414.480	
WORKDAY INC	8,710	89.660	780,938.600	
ABBVIE INC	121,323	62.090	7,532,945.070	
ZOETIS INC	34,481	53.880	1,857,836.280	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	50.020	611,444.480	
COTY INC	38,871	18.660	725,332.860	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.100	396,445.300	
MALLINCKRODT PLC	9,419	53.380	502,786.220	
CDW CORP	9,877	59.380	586,496.260	
SPRINT CORP	63,882	8.940	571,105.080	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	46.280	472,009.720	
ARCONIC INC	34,259	29.320	1,004,473.880	
ENVISION HEALTHCARE CORP	4,730	71.390	337,674.700	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	39.050	195,484.300	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	18,330	38.710	709,554.300	
XL GROUP LTD	20,259	41.120	833,050.080	
BROADCOM LTD	29,475	210.370	6,200,655.750	
DELL TECHNOLOGIES INC	17,283	64.240	1,110,259.920	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	19.830	305,580.300	
TECHNIPFMC LTD	14,816	32.300	478,556.800	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	24.000	315,912.000	
TWITTER INC	43,692	15.980	698,198.160	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	31.830	249,451.710	
PERRIGO CO PLC	10,322	84.430	871,486.460	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	57.780	854,912.880	
ARAMARK	17,307	35.810	619,763.670	
SABRE CORP	17,624	21.790	384,026.960	
NAVIENT CORP	22,636	15.380	348,141.680	

PARSLEY ENERGY INC	10,949	29.490	322,886.010	
IHS MARKIT LTD	26,741	40.080	1,071,779.280	
FNF GROUP	20,571	38.490	791,777.790	
SYNCHRONY FINANCIAL	62,691	36.480	2,286,967.680	
MOBILEYE NV	14,001	47.080	659,167.080	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	39,020	36.650	1,430,083.000	
CDK GLOBAL INC	8,309	66.630	553,628.670	
QORVO INC	10,599	66.190	701,547.810	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	31.080	353,970.120	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	86.380	675,318.840	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	29.380	432,179.800	
LIBERTY LILAC GROUP-C	6,305	25.270	159,327.350	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	45.160	1,212,094.400	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,128	121.870	624,949.360	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	34.950	562,345.500	
WESTROCK CO	17,744	53.430	948,061.920	
KRAFT HEINZ CO	45,382	93.080	4,224,156.560	
FORTIVE CORP	23,758	57.790	1,372,974.820	
WASTE CONNECTIONS INC	10,157	87.330	887,010.810	
ALPHABET INC-CL A	21,999	847.810	18,650,972.190	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	22.960	2,791,706.400	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,567	43.070	3,470,020.690	
FIRST DATA CORP	22,035	16.270	358,509.450	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	35.170	286,072.780	
ALPHABET INC-CL C	23,139	828.640	19,173,900.960	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	167.140	984,788.880	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	16,119	326.750	5,266,883.250	
アメリカ・ドル 小計	23,435,804		1,559,878,886.130 (174,987,213,445)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.661	189,838.400	
ANTOFAGASTA PLC	25,905	8.075	209,182.870	
ASHTAD GROUP	35,233	16.350	576,059.550	
SEVERN TRENT PLC	14,897	23.450	349,334.650	
BHP BILLITON PLC	153,323	13.080	2,005,464.840	
BARCLAYS PLC	1,247,081	2.259	2,817,155.970	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,682	5.135	424,572.070	
BT GROUP PLC	621,220	3.329	2,068,041.380	
SKY PLC	72,210	9.980	720,655.800	
BUNZL PLC	26,929	21.710	584,628.590	
EASYJET PLC	13,628	9.315	126,944.820	
CAPITA PLC	54,894	5.570	305,759.580	
AVIVA PLC	306,804	5.035	1,544,758.140	

CRODA INTERNATIONAL	10,965	33.100	362,941.500	
DIAGEO PLC	186,418	22.715	4,234,484.870	
SCHRODERS PLC	7,188	30.080	216,215.040	
DCC PLC	7,281	68.050	495,472.050	
NATIONAL GRID PLC	280,203	9.777	2,739,544.730	
GKN PLC	134,180	3.451	463,055.180	
KINGFISHER PLC	165,680	3.238	536,471.840	
BAE SYSTEMS PLC	241,905	6.150	1,487,715.750	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	29.200	350,020.400	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	138,548	50.700	7,024,383.600	
COBHAM PLC	142,739	1.182	168,717.490	
NEXT PLC	9,731	37.910	368,902.210	
IMPERIAL BRANDS PLC	70,388	38.365	2,700,435.620	
IMI PLC	21,218	12.110	256,949.980	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	30.130	377,438.510	
ANGLO AMERICAN PLC	105,010	12.525	1,315,250.250	
COMPASS GROUP PLC	119,716	14.670	1,756,233.720	
HSBC HOLDINGS PLC	1,486,352	6.503	9,665,747.050	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.472	1,047,260.320	
CENTRICA PLC	392,766	2.257	886,472.860	
UNILEVER PLC	97,369	37.730	3,673,732.370	
MEGGITT PLC	62,181	4.108	255,439.540	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.445	380,642.490	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	9.790	544,314.210	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.950	481,140.800	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	26.110	660,791.880	
PEARSON PLC	65,009	6.570	427,109.130	
PERSIMMON PLC	23,150	20.250	468,787.500	
PRUDENTIAL PLC	194,275	16.090	3,125,884.750	
RIO TINTO PLC	90,216	33.155	2,991,111.480	
VODAFONE GROUP PLC	1,974,479	2.028	4,004,243.410	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	46,978	73.110	3,434,561.580	
RELX PLC	80,689	14.940	1,205,493.660	
OLD MUTUAL PLC	389,986	2.187	852,899.380	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	146,260	7.635	1,116,695.100	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.382	665,630.840	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.850	443,591.400	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	15.080	306,983.560	
SSE PLC	73,043	15.470	1,129,975.210	
BP PLC	1,397,956	4.471	6,250,261.270	
SHIRE PLC	68,023	48.440	3,295,034.120	

SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.425	547,866.170	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.820	470,090.400	
STANDARD CHARTERED PLC	251,434	7.305	1,836,725.370	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,885,554	0.692	3,380,803.360	
TATE & LYLE PLC	39,915	7.365	293,973.970	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.771	448,101.960	
TESCO PLC	624,703	1.900	1,186,935.700	
3I GROUP PLC	78,491	6.875	539,625.620	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.060	797,829.300	
GLAXOSMITHKLINE PLC	363,678	16.395	5,962,500.810	
WEIR GROUP	18,336	18.100	331,881.600	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,907	31.250	778,343.750	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	8.840	188,309.680	
WPP PLC	97,555	18.720	1,826,229.600	
WOLSELEY PLC	18,238	48.730	888,737.740	
ASTRAZENECA PLC	94,192	46.090	4,341,309.280	
WHITBREAD PLC	12,159	38.000	462,042.000	
CARNIVAL PLC	13,153	43.460	571,629.380	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.283	394,912.070	
INTERTEK GROUP PLC	10,500	34.450	361,725.000	
WILLIAM HILL PLC	72,474	2.685	194,592.690	
BURBERRY GROUP PLC	35,774	16.610	594,206.140	
INVESTEC PLC	50,655	5.755	291,519.520	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,187	37.600	571,031.200	
ITV PLC	247,210	2.021	499,611.410	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.656	290,592.960	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	76.500	535,347.000	
G4S PLC	122,250	2.571	314,304.750	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	18.700	297,199.100	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	29.060	311,697.560	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	324,139	20.730	6,719,401.470	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	277,839	21.660	6,017,992.740	
INMARSAT PLC	34,127	7.020	239,571.540	
PETROFAC LTD	21,809	8.565	186,794.080	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	21.090	241,628.130	
TUI AG-DI	19,394	11.250	218,182.500	
STANDARD LIFE PLC	155,609	3.694	574,819.640	
EXPERIAN PLC	71,516	15.930	1,139,249.880	
MONDI PLC	30,200	18.650	563,230.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	13.210	281,240.900	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	15.250	238,494.750	
GLENCORE PLC	899,043	3.275	2,944,365.820	

	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	3.006	254,424.830	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.646	410,882.320	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	7.375	225,793.000	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	19.360	259,540.160	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	4.083	224,809.980	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.983	249,334.370	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.998	305,239.300	
	WORLDPAY GROUP PLC	112,202	2.714	304,516.220	
イギリス・ポンド	小計	22,276,564		135,199,620.030 (18,827,899,086)	
イスラエル・シケル	BANK HAPOLIM BM	78,428	22.360	1,753,650.080	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	15.710	1,952,281.700	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	6.538	1,230,647.740	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	437.100	769,296.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	202.400	526,240.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.840	782,670.240	
	NICE LTD	5,638	255.000	1,437,690.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	60.100	627,684.400	
イスラエル・シケル	小計	460,781		9,080,160.160 (275,946,067)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	69.350	770,825.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	221,660	30.960	6,862,593.600	
	AMCOR LTD	80,741	14.190	1,145,714.790	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	248,237	34.090	8,462,399.330	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	11.510	351,849.190	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	6.570	749,801.250	
	TELSTRA CORP LTD	314,574	4.810	1,513,100.940	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	12.290	479,482.060	
	AMP LTD	200,498	4.880	978,430.240	
	ASX LTD	16,354	51.520	842,558.080	
	BHP BILLITON LTD	241,614	25.060	6,054,846.840	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	29.060	608,690.760	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	13.390	509,355.600	
	CSL LIMITED	33,499	117.740	3,944,172.260	
	REA GROUP LTD	4,119	55.850	230,046.150	
	TRANSURBAN GROUP	149,591	11.120	1,663,451.920	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.640	517,114.640	
	COCHLEAR LTD	3,992	130.200	519,758.400	
	ORIGIN ENERGY LTD	143,330	6.600	945,978.000	



COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	127,579	83.020	10,591,608.580	
BORAL LIMITED	60,188	5.920	356,312.960	
RIO TINTO LIMITED	31,897	62.880	2,005,683.360	
APA GROUP	73,253	8.400	615,325.200	
ARISTOCRAT LEISU	44,406	15.870	704,723.220	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.130	1,051,117.230	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.400	183,801.600	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,706	29.860	140,521.160	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	19.250	688,957.500	
ORICA LTD	25,308	18.400	465,667.200	
CIMIC GROUP LTD	8,709	37.810	329,287.290	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.050	515,036.500	
MACQUARIE GROUP LTD	21,869	86.310	1,887,513.390	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.260	1,235,580.060	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	200,714	31.900	6,402,776.600	
NEWCREST MINING LTD	61,110	23.530	1,437,918.300	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.220	676,622.300	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.680	502,047.680	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	12.300	1,173,297.000	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	11.810	539,799.670	
SANTOS LTD	133,862	3.910	523,400.420	
SONIC HEALTHCARE	26,192	21.570	564,961.440	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.290	303,629.040	
WESFARMERS LTD	86,331	43.000	3,712,233.000	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.865	344,303.240	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	32.010	1,854,115.230	
WOOLWORTHS LTD	92,344	26.500	2,447,116.000	
DUET GROUP	207,776	2.730	567,228.480	
SEEK LTD	25,899	15.840	410,240.160	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	56.080	256,902.480	
TATTS GROUP LTD	109,937	4.060	446,344.220	
AUSNET SERVICES	165,066	1.645	271,533.570	
AGL ENERGY LTD	46,315	23.730	1,099,054.950	
BRAMBLES LTD	115,255	9.520	1,097,227.600	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.240	402,218.640	
VOCUS GROUP LTD	43,023	4.580	197,045.340	
AURIZON HOLDINGS LTD	171,522	5.350	917,642.700	
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	12.250	783,044.500	
HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.330	347,279.510	
MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.820	662,274.180	

	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	2.460	1,062,786.420	
オーストラリア・ドル	小計	5,860,008		86,924,347.220 (7,479,840,078)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	59.390	958,613.990	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	60.160	1,848,596.480	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	25.590	2,140,552.320	
	ATCO LTD	7,193	45.470	327,065.710	
	BANK OF MONTREAL	47,743	99.980	4,773,345.140	
	BANK OF NOVA SCOTIA	89,436	80.350	7,186,182.600	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	57.830	1,373,809.480	
	BCE INC	11,568	58.160	672,794.880	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,043	47.620	3,097,347.660	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	21.200	547,362.800	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.400	363,876.000	
	SAPUTO INC	20,680	46.250	956,450.000	
	BLACKBERRY LTD	39,652	9.240	366,384.480	
	CGI GROUP INC	15,228	61.700	939,567.600	
	CCL INDUSTRIES INC	2,268	290.160	658,082.880	
	CAE INC	23,000	19.940	458,620.000	
	CAMECO CORP	32,627	14.380	469,176.260	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	56.360	1,463,500.120	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,159	118.520	3,574,444.680	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	84,339	37.730	3,182,110.470	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	155.040	753,804.480	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	36.020	328,466.380	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,306	92.360	5,292,782.160	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.780	237,245.260	
	AGRIUM INC	9,382	130.240	1,221,911.680	
	YAMANA GOLD INC	67,520	3.660	247,123.200	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	33.510	466,794.300	
	OPEN TEXT CORP	19,756	43.870	866,695.720	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.220	197,453.800	
	EMPIRE CO LTD	15,093	17.290	260,957.970	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.990	497,707.590	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	25.360	250,861.120	
	FORTIS INC	29,002	42.730	1,239,255.460	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	14.000	774,144.000	
	TELUS CORP	18,945	43.450	823,160.250	
	GREAT WEST LIFECO INC	24,837	36.960	917,975.520	
	IMPERIAL OIL LTD	21,542	41.250	888,607.500	
	ENBRIDGE INC	68,827	54.200	3,730,423.400	
	IGM FINANCIAL INC	8,426	41.330	348,246.580	

TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	4.460	392,457.700	
MANULIFE FINANCIAL CORP	144,196	23.850	3,439,074.600	
LINAMAR CORP	3,827	59.750	228,663.250	
LOBLAW CO LTD	17,936	70.330	1,261,438.880	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	56.530	368,801.720	
MAGNA INTERNATIONAL INC	29,208	56.430	1,648,207.440	
SUN LIFE FINANCIAL INC	46,405	48.210	2,237,185.050	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,805	600.310	1,083,559.550	
METRO INC	19,350	39.710	768,388.500	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.500	445,609.500	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	14.990	599,480.080	
METHANEX CORP	7,381	68.020	502,055.620	
ONEX CORP	6,646	94.650	629,043.900	
GOLDCORP INC	67,652	21.700	1,468,048.400	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	23.410	1,429,789.160	
POWER CORP OF CANADA	25,052	31.460	788,135.920	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	35.100	613,688.400	
ROYAL BANK OF CANADA	110,868	96.610	10,710,957.480	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,459	54.590	680,136.810	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	194.070	2,058,500.490	
SHAW COMM INC-B	34,029	27.800	946,006.200	
SUNCOR ENERGY INC	126,273	41.240	5,207,498.520	
ENCANA CORP	69,257	14.680	1,016,692.760	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	27.160	1,113,994.560	
THOMSON REUTERS CORP	25,128	55.980	1,406,665.440	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	138,562	69.260	9,596,804.120	
TRANSCANADA CORP	62,895	60.660	3,815,210.700	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	53.880	306,900.480	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	111.620	346,580.100	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	95.380	1,022,282.840	
SILVER WHEATON CORP	33,943	27.710	940,560.530	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	625.120	933,929.280	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	13,919	86.270	1,200,792.130	
WASTE CONNECTIONS INC	2,429	114.410	277,901.890	
CI FINANCIAL CORP	20,695	27.090	560,627.550	
VERESEN INC	24,982	13.680	341,753.760	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	29.550	466,269.450	
KEYERA CORP	13,728	39.400	540,883.200	
ALTAGAS LTD	12,538	30.940	387,925.720	

	PEMBINA PIPELINE CORP	30,719	42.520	1,306,171.880	
	DOLLARAMA INC	9,286	103.790	963,793.940	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	59,124	16.950	1,002,151.800	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	51.580	427,649.780	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	20.040	460,859.880	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	27.160	393,629.880	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	14.040	430,059.240	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	28.380	683,475.540	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	29.900	447,333.900	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	24.360	419,747.160	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,390	72.740	1,264,948.600	
	HYDRO ONE LTD	16,612	23.680	393,372.160	
カナダ・ドル 小計		3,085,509		124,677,195.360 (10,664,887,291)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.690	461,250.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	3.270	266,178.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.460	428,002.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.400	276,856.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	133,100	18.870	2,511,597.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	9.530	276,370.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	40.620	416,111.280	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.000	211,500.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.560	520,884.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.630	698,466.450	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.005	418,482.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	6.950	829,135.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.430	432,297.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	249,053	9.600	2,390,908.800	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.960	2,344,011.120	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.860	468,350.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	21.700	2,050,650.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	151,000	3.700	558,700.000	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	145,700	0.915	133,315.500		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	2.750	473,275.000		
シンガポール・ドル 小計		3,663,574		16,166,339.150 (1,290,073,864)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	145,106	15.030	2,180,943.180	

SYNGENTA AG	6,872	428.100	2,941,903.200		
NESTLE SA-REGISTERED	232,379	74.500	17,312,235.500		
CIE FINANC RICHEMONT	39,674	75.000	2,975,550.000		
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	52,476	245.200	12,867,115.200		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	193.500	548,572.500		
SIKA INHABER	151	5,605.000	846,355.000		
SGS SA-REG	405	2,131.000	863,055.000		
NOVARTIS AG-REG SHS	166,725	77.600	12,937,860.000		
BALOISE HOLDING AG -R	4,127	130.100	536,922.700		
BARRY CALLEBAUT AG	144	1,304.000	187,776.000		
SWISSCOM AG-REG	1,795	449.600	807,032.000		
ABB LTD	137,622	22.620	3,113,009.640		
ADECCO GROUP AG-REG	10,926	70.500	770,283.000		
GEBERIT AG	2,801	426.600	1,194,906.600		
LONZA GROUP AG-REG	4,373	179.900	786,702.700		
LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,635.000	422,625.000		
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	6	64,190.000	385,140.000		
GIVAUDAN-REG	692	1,821.000	1,260,132.000		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,053	275.500	3,045,101.500		
LAFARGEHOLCIM LTD	20,941	55.650	1,165,366.650		
ACTELION	7,435	269.800	2,005,963.000		
SONOVA HOLDING AG	4,519	130.100	587,921.900		
KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	141.500	630,099.500		
THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	342.200	669,001.000		
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	66.600	305,827.200		
SCHINDLER NAMEN	1,663	189.600	315,304.800		
SWISS LIFE HOLDING AG	2,618	314.600	823,622.800		
GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,149.000	350,445.000		
EMS-CHEMIE HOLDING	553	578.500	319,910.500		
SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.750	519,632.500		
DUFREY GROUP	3,566	143.400	511,364.400		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,474	526.000	775,324.000		
ARYZTA AG	7,191	32.150	231,190.650		
JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	48.630	740,489.010		
SWISS RE LTD	23,838	90.700	2,162,106.600		
UBS GROUP AG	277,078	15.450	4,280,855.100		
スイス・フラン 小計	1,203,635		82,377,645.330 (9,170,279,478)		
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	293.100	14,179,298.700	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	264.100	7,700,363.700	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	58.400	12,950,083.200	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	149.100	1,961,112.300	
	LUNDBERGS B	2,606	585.000	1,524,510.000	
	SKF AB-B SHS	32,306	169.700	5,482,328.200	

	SANDVIK AB	75,199	122.000	9,174,278.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	121,939	103.600	12,632,880.400	
	SKANSKA AB-B SHS	27,150	214.500	5,823,675.000	
	SWEDBANK AB	66,507	224.100	14,904,218.700	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,024	277.300	12,762,455.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	127.400	15,149,006.600	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	117.700	13,379,194.400	
	SWEDISH MATCH AB	15,807	284.300	4,493,930.100	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	81.200	2,190,451.200	
	NORDEA AB	229,457	106.500	24,437,170.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	242.100	4,646,141.100	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	133.900	3,226,722.200	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	358.900	11,991,566.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	72,617	238.500	17,319,154.500	
	ASSA ABLOY AB-B	75,670	176.400	13,348,188.000	
	TELIA CO AB	184,927	36.130	6,681,412.510	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	185.700	3,117,903.000	
	BOLIDEN AB	21,855	273.200	5,970,786.000	
	ALFA LAVAL AB	24,553	162.900	3,999,683.700	
	KINNEVIK AB-B	18,310	244.400	4,474,964.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	490.000	2,612,680.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	292.000	1,728,640.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	77.000	2,594,284.000	
	HEXAGON AB	16,702	361.100	6,031,092.200	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,742,056		246,488,174.210 (3,058,918,242)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	8,601	616.000	5,298,216.000	
	A P MOLLER A/S	481	11,300.000	5,435,300.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	10,800.000	2,948,400.000	
	DANSKE BANK A/S	52,545	235.200	12,358,584.000	
	GENMAB A/S	4,633	1,371.000	6,351,843.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	268.000	4,262,272.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,139	249.300	35,435,252.700	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	520.500	8,228,064.000	
	TDC A/S	68,939	37.870	2,610,719.930	
	COLOPLAST-B	8,286	496.000	4,109,856.000	
	DSV A/S	15,601	342.300	5,340,222.300	
	WILLIAM DEMANT	6,537	141.500	924,985.500	
	TRYG A/S	11,107	129.200	1,435,024.400	
	PANDORA A/S	8,251	836.500	6,901,961.500	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	415.200	3,200,361.600	
	ISS A/S	11,125	265.600	2,954,800.000	
	DONG ENERGY A/S	6,575	252.600	1,660,845.000	

デンマーク・クローネ 小計		384,513		109,456,707.930 (1,744,739,925)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.950	681,044.400	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	9.700	730,225.700	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.565	749,223.960	
ニュージーランド・ドル 小計		383,434		2,160,494.060 (174,308,661)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	31,839	145.200	4,623,022.800	
	DNB ASA	70,426	138.400	9,746,958.400	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	46.500	4,272,373.500	
	TELENOR ASA	53,178	136.400	7,253,479.200	
	SCHIBSTED ASA	9,131	221.500	2,022,516.500	
	ORKLA ASA	61,421	75.250	4,621,930.250	
	STATOIL ASA	81,414	147.100	11,975,999.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,576	312.400	4,553,542.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	131.300	2,190,477.900	
ノルウェー・クローネ 小計		430,547		51,260,300.350 (686,888,024)	
ユーロ	CRH PLC	62,222	31.435	1,955,948.570	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	102.050	637,404.300	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	72.640	840,880.640	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.225	494,693.320	
	UMICORE	7,660	50.030	383,229.800	
	AIR LIQUIDE	28,615	102.150	2,923,022.250	
	AIRBUS SE	42,705	68.350	2,918,886.750	
	AXA	146,095	22.195	3,242,578.520	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	15.125	523,657.750	
	ADIDAS AG	14,302	151.900	2,172,473.800	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	14.100	1,212,529.500	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	41,829	13.885	580,795.660	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,060.000	166,420.000	
	DANONE	43,220	62.650	2,707,733.000	
	SAFRAN SA	23,731	65.500	1,554,380.500	
	INTESA SANPAOLO	934,915	2.076	1,940,883.540	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	1.995	224,367.670	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,055	84.250	2,026,633.750	
	ACCOR SA	10,385	37.285	387,204.720	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	33.575	253,927.720	
	BOUYGUES	13,996	35.700	499,657.200	
	BNP PARIBAS	78,591	54.680	4,297,355.880	
	RELX NV	70,826	16.730	1,184,918.980	
THALES SA	8,128	89.110	724,286.080		
CAP GEMINI SA	11,481	80.950	929,386.950		

CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	50.240	214,223.360	
CHRISTIAN DIOR SE	3,940	201.450	793,713.000	
INGENICO GROUP	4,334	84.950	368,173.300	
UNICREDIT SPA	37,824	12.160	459,939.840	
NATIXIS	70,166	5.150	361,354.900	
KONINKLIJKE DSM NV	12,285	61.400	754,299.000	
COMMERZBANK AG	72,573	7.098	515,123.150	
EIFFAGE	4,777	66.440	317,383.880	
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	75.670	2,281,904.520	
UNITED INTERNET	9,882	39.130	386,682.660	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	43.530	241,417.380	
PUBLICIS GROUPE	15,068	62.930	948,229.240	
MAN SE	3,396	96.820	328,800.720	
IBERDROLA SA	424,273	6.280	2,664,434.440	
ENI SPA	188,983	14.300	2,702,456.900	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.105	294,804.280	
KBC GROUPE	18,378	57.020	1,047,913.560	
HANNOVER RUECK SE	5,050	107.300	541,865.000	
WARTSILA OYJ	11,645	48.740	567,577.300	
L'OREAL	18,815	175.550	3,302,973.250	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,036	190.700	4,011,565.200	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	23.520	225,792.000	
GEA GROUP AG	14,635	36.905	540,104.670	
BOLLORE	71,347	3.640	259,703.080	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.445	315,697.780	
MICHELIN(CGDE)-B	13,125	106.550	1,398,468.750	
CONTINENTAL AG	8,310	192.050	1,595,935.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	74,274	32.185	2,390,508.690	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	37.390	351,428.610	
AXEL SPRINGER SE	3,067	48.700	149,362.900	
OMV AG	9,766	36.095	352,503.770	
PERNOD-RICARD	16,110	107.950	1,739,074.500	
PEUGEOT SA	32,906	17.930	590,004.580	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,066	52.670	635,516.220	
RENAULT SA	14,360	83.910	1,204,947.600	
REPSOL SA	80,153	13.820	1,107,714.460	
REMY COINTREAU	1,860	84.390	156,965.400	
MERCK KGAA	8,752	103.200	903,206.400	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	44.370	1,584,275.220	
SAIPEM	465,751	0.420	195,615.420	
RWE AG	39,183	13.220	517,999.260	
SEB SA	1,405	123.700	173,798.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	49.360	572,674.720	
SOCIETE GENERALE-A	56,243	41.430	2,330,147.490	
VINCI S.A.	37,818	67.490	2,552,336.820	



SODEXO	7,368	102.750	757,062.000	
SOLVAY SA	5,991	111.950	670,692.450	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,136	64.030	2,633,938.080	
VIVENDI SA	78,086	16.320	1,274,363.520	
SAP SE	73,292	87.970	6,447,497.240	
TELEFONICA S.A	347,856	9.610	3,342,896.160	
TOTAL SA	167,398	47.735	7,990,743.530	
VALEO	17,731	58.600	1,039,036.600	
E.ON SE	142,688	7.143	1,019,220.380	
VOEST-ALPINE AG	9,875	39.755	392,580.620	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	27.500	420,255.000	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	102.750	885,088.500	
METRO AG	10,774	29.325	315,947.550	
SIEMENS AG-REG	56,800	121.750	6,915,400.000	
UPM-KYMMENE OYJ	41,826	22.340	934,392.840	
ING GROEP NV-CVA	286,593	13.030	3,734,306.790	
BAYER AG	61,471	104.250	6,408,351.750	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	10.040	424,722.120	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,253	119.000	1,577,107.000	
DAIMLER AG	71,139	68.760	4,891,517.640	
BASF SE	67,970	87.360	5,937,859.200	
BEIERSDORF AG	6,780	86.520	586,605.600	
HOCHTIEF AG	1,707	142.700	243,588.900	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	85.790	944,462.110	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,452	77.660	1,277,662.320	
ORANGE	152,528	14.420	2,199,453.760	
SAMPO OYJ-A SHS	33,059	43.560	1,440,050.040	
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	54.180	422,278.920	
ALLIANZ SE	33,800	163.750	5,534,750.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.887	551,688.370	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	98,527	20.225	1,992,708.570	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	37.350	657,434.700	
HERMES INTL	1,875	414.050	776,343.750	
ENDESA S.A.	21,037	19.885	418,320.740	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	13.710	270,745.080	
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	27.900	650,739.600	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,354	178.150	2,200,865.100	
ARCELOR MITTAL (NL)	130,747	8.295	1,084,546.360	
SOCIETE BIC SA	2,478	116.200	287,943.600	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,673	76.460	816,057.580	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,724	29.325	343,806.300	
HEINEKEN NV	17,373	77.710	1,350,055.830	
AKZO NOBEL	18,209	62.750	1,142,614.750	
ASML HOLDING NV	27,566	115.650	3,188,007.900	

AEGON NV	144,321	4.955	715,110.550	
BANKINTER S.A.	57,960	7.230	419,050.800	
VOLKSWAGEN AG	2,794	145.950	407,784.300	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,131	141.250	1,996,003.750	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	481,507	6.074	2,924,673.510	
KERING	5,479	229.650	1,258,252.350	
CNP ASSURANCES	13,987	17.740	248,129.380	
FORTUM OYJ	37,132	14.280	530,244.960	
AGEAS	12,993	36.300	471,645.900	
UCB SA	10,367	66.330	687,643.110	
THYSSENKRUPP AG	29,215	23.900	698,238.500	
UNILEVER NV-CVA	121,112	44.480	5,387,061.760	
CARREFOUR SA	43,732	22.160	969,101.120	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	18.180	527,401.800	
ATOS SE	7,050	108.800	767,040.000	
NOKIA OYJ	442,720	4.816	2,132,139.520	
TUI AG	19,196	13.275	254,826.900	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,794	27.975	2,008,437.150	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	38.400	789,427.200	
SANOFI	86,452	80.580	6,966,302.160	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	14.160	649,462.560	
ELISA OYJ	9,517	31.560	300,356.520	
BANCO SANTANDER SA	1,078,026	5.049	5,442,953.270	
METSO OYJ	8,585	27.760	238,319.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.075	590,726.700	
QIAGEN N.V.	13,642	26.510	361,649.420	
LINDE AG	14,183	152.450	2,162,198.350	
DEUTSCHE BANK AG-REG	104,836	18.140	1,901,725.040	
BMW VORZUG	4,116	70.320	289,437.120	
K & S	14,982	21.725	325,483.950	
ENEL SPA	581,747	4.000	2,326,988.000	
COLRUYT NV	4,673	44.700	208,883.100	
VOPAK (KON.)	5,364	39.280	210,697.920	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	242,088	16.430	3,977,505.840	
BANCO POPULAR ESPANOL	277,768	0.796	221,103.320	
LEONARDO SPA	34,431	12.250	421,779.750	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	16.910	1,382,798.340	
KONINKLIJKE KPN NV	276,563	2.694	745,060.720	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	411.000	326,334.000	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.965	180,764.280	
EURAZEO	4,063	57.960	235,491.480	
BANCO SABADELL	428,014	1.385	592,799.390	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	79.490	462,154.860	
FRAPORT AG	3,149	58.030	182,736.470	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	71.730	574,844.220	
INDITEX	83,755	30.205	2,529,819.770	

JC DECAUX SA	6,058	29.680	179,801.440	
ANDRITZ AG	6,265	49.285	308,770.520	
MAPFRE SA	84,474	2.870	242,440.380	
ESSILOR INTL	16,004	108.750	1,740,435.000	
SNAM SPA	186,129	3.728	693,888.910	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	11.215	959,835.770	
ENAGAS	18,095	23.225	420,256.370	
WENDEL	2,220	104.550	232,101.000	
TENARIS SA	38,237	15.530	593,820.610	
TELECOM ITALIA SPA	672,896	0.758	510,055.160	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.618	307,514.320	
ATLANTIA SPA	27,920	21.690	605,584.800	
ILIAD SA	2,102	196.400	412,832.800	
PROXIMUS	13,498	28.375	383,005.750	
SES FDR	30,439	19.625	597,365.370	
TERNA SPA	117,108	4.370	511,761.960	
GRIFOLS SA	25,309	20.820	526,933.380	
FERROVIAL SA	35,610	16.950	603,589.500	
LANXESS AG	6,856	63.930	438,304.080	
NESTE OYJ	10,692	34.040	363,955.680	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	21.120	203,617.920	
KONE OYJ	23,717	41.510	984,492.670	
ENGIE	110,924	11.225	1,245,121.900	
ALSTOM	12,046	25.350	305,366.100	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.055	226,445.810	
ELECTRICITE DE FRANCE	20,751	8.952	185,762.950	
DEUTSCHE WOHNEN AG	26,714	32.435	866,468.590	
ARKEMA SA	4,241	91.120	386,439.920	
LEGRAND SA	19,920	53.360	1,062,931.200	
ADP	2,313	105.500	244,021.500	
ORION OYJ	8,051	47.000	378,397.000	
RTL GROUP SA	3,446	72.730	250,627.580	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	13.845	525,016.240	
SYMRISE AG	7,926	58.910	466,920.660	
SCOR SE	13,875	34.075	472,790.620	
REXEL SA	23,245	14.960	347,745.200	
PRYSMIAN SPA	14,925	24.000	358,200.000	
CAIXABANK	229,231	3.211	736,060.740	
BUREAU VERITAS SA	21,480	18.000	386,640.000	
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	8.805	331,473.030	
SUEZ SA	25,406	14.010	355,938.060	
ENGIE	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT GROUP SA	33,099	43.330	1,434,179.670	
BRENTTAG AG	12,331	53.890	664,517.590	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	68,448	6.226	426,157.240	

	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	5.005	241,766.520	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.365	351,474.870	
	EDENRED	18,682	21.300	397,926.600	
	BANKIA SA	370,638	0.916	339,504.400	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.110	252,933.510	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	67.840	353,989.120	
	OSRAM LICHT AG	7,017	56.300	395,057.100	
	GEMALTO	6,103	56.230	343,171.690	
	VONOVIA SE	35,271	33.250	1,172,760.750	
	UNICREDIT SPA-RTS	37,820	12.350	467,077.000	
	FERRARI NV	8,338	61.200	510,285.600	
	DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	83.940	1,162,065.360	
	INNOGY SE	9,769	33.815	330,338.730	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	8.650	680,279.250	
	SFR GROUP SA	8,774	27.660	242,688.840	
	NN GROUP NV	21,965	28.760	631,713.400	
	ZALANDO SE	6,674	37.795	252,243.830	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	10.150	711,616.500	
	AENA SA	5,256	134.950	709,297.200	
	ABN AMRO GROUP NV	19,363	21.450	415,336.350	
	EXOR NV	9,441	43.920	414,648.720	
	ALTICE NV-A	38,525	19.940	768,188.500	
	COVESTRO AG	5,966	70.340	419,648.440	
	TECHNIPFMC PLC	17,740	30.380	538,941.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,644	102.850	5,825,835.400	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	5.940	237,689.100	
	SCHAEFFLER AG	12,644	14.960	189,154.240	
	LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	52.310	737,832.550	
	UNIPER SE	16,058	13.280	213,250.240	
ユーロ 小計		17,338,831		265,910,474.940 (31,518,368,595)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	99.500	1,651,700.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.860	3,257,040.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	32.900	2,508,954.000	
	CLP HOLDINGS LTD	130,500	77.850	10,159,425.000	
	PCCW LTD	331,000	4.690	1,552,390.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	92,000	11.420	1,050,640.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	3.530	1,879,372.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	64.100	3,140,900.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	89,540	198.000	17,728,920.000	
	MTR CORP	118,500	41.350	4,899,975.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	31.750	2,000,250.000	

HANG SENG BANK LTD	56,000	160.000	8,960,000.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	94,222	45.200	4,258,834.400	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	112,500	69.750	7,846,875.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	61.850	5,922,137.500	
HONG KONG & CHINA GAS	616,588	14.980	9,236,488.240	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	37.000	6,993,000.000	
KERRY PROPERTIES LTD	43,000	24.150	1,038,450.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	287,000	31.050	8,911,350.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	28.150	1,421,575.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	10.180	4,492,087.880	
SINO LAND CO	255,400	13.380	3,417,252.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	113,000	114.400	12,927,200.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	81.000	3,442,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	28.400	3,223,400.000	
WHEELOCK & CO LTD	56,000	51.000	2,856,000.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	13.660	1,699,304.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	13.920	902,016.000	
AIA GROUP LTD	892,627	48.750	43,515,566.250	
HKT TRUST / HKT LTD	214,000	10.380	2,221,320.000	
SANDS CHINA LTD	198,000	32.150	6,365,700.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.500	2,448,700.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	6.780	1,559,400.000	
WH GROUP LTD	530,500	6.060	3,214,830.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	94.500	18,836,874.000	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	198,832	53.450	10,627,570.400	
香港・ドル 小計	6,985,717		226,167,996.670 (3,268,127,551)	
合計	87,250,973		263,147,490,307 (263,147,490,307)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成29年2月27日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	63,819.000	589,049.370	
		GOODMAN GROUP	143,627.000	1,088,692.660	
		GPT GROUP	144,955.000	710,279.500	
		LENLEASE GROUP	37,363.000	553,719.660	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	630,017.790	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,669,042.800	
		STOCKLAND	193,279.000	912,276.880	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	781,580.270	
	WESTFIELD CORP	140,035.000	1,232,308.000		
	オーストラリア・ドル	小計	1,672,992.000	8,166,966.930 (702,767,504)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	495,990.820	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	324,940.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	390,040.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	332,333.000	
	シンガポール・ドル	小計	802,906.000	1,543,303.820 (123,155,645)	
	投資信託受益証券	合計	2,475,898	825,923,149 (825,923,149)	
	投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	502,979.140
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT			5,587.000	671,557.400	
AMERICAN TOWER CORP			31,665.000	3,574,661.850	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT			77,528.000	856,684.400	
AVALONBAY COMMUNITIES INC			10,191.000	1,865,564.460	
BOSTON PROPERTIES INC			11,168.000	1,542,524.160	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC			21,975.000	517,731.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST			6,285.000	529,448.400	
COLONY NORTHSTAR INC			39,311.000	560,967.970	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP			25,117.000	2,325,583.030	
DIGITAL REALTY TRUST INC			11,787.000	1,270,992.210	
DUKE REALTY TRUST			24,470.000	630,591.900	
EQUINIX INC			5,241.000	1,989,693.240	
EQUITY RESIDENTIAL			27,070.000	1,699,454.600	
ESSEX PROPERTY TRUST INC			5,283.000	1,227,505.050	
EXTRA SPACE STORAGE INC			9,980.000	793,310.200	
FEDERAL REALTY INVS TRUST			5,741.000	817,173.940	
GGP INC			43,463.000	1,088,748.150	
HCP INC			34,130.000	1,114,003.200	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	1,047,209.460	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	710,878.500	
	KIMCO REALTY	32,980.000	804,052.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	461,999.340	
	MID AMERICA	8,123.000	828,952.150	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	484,075.040	
	PROLOGIS INC	38,966.000	1,990,383.280	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,546,999.910	
	REALTY INCOME CORP	20,047.000	1,266,769.930	
	REGENCY CENTERS CORP	7,365.000	524,314.350	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,156.000	1,017,780.960	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,516.000	4,333,763.640	
	SL GREEN	7,722.000	862,856.280	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	605,830.940	
	UDR INC	21,797.000	789,051.400	
	VENTAS INC	27,031.000	1,756,474.380	
	VEREIT INC	59,654.000	535,692.920	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	1,344,797.430	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,857,710.960	
	WEYERHAEUSER CO	57,008.000	1,908,057.760	
アメリカ・ドル 小計		893,594.000	49,256,825.330 (5,525,630,665)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	442,006.650	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	346,127.480	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	218,980.870	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	674,674.770	
	SEGRO PLC	50,928.000	252,450.090	
イギリス・ポンド 小計		319,358.000	1,934,239.860 (269,362,243)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	249,568.560	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	259,290.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,582.000	86,367.900	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	595,226.460 (50,915,671)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	181,348.200	
	GECINA SA	3,212.000	386,564.200	
	ICADE	2,234.000	150,504.580	
	KLEPIERRE	17,042.000	604,224.110	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,565,873.850	
ユーロ 小計		32,052.000	2,888,514.940 (342,375,675)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	8,829,000.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	8,829,000.000	

			(127,579,051)	
投資証券 合計		1,431,509	6,315,863,305 (6,315,863,305)	
合計			7,141,786,454 (7,141,786,454)	

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 600銘柄	63.88%	-%	-%	66.79%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	2.02%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	6.87%	-%	-%	7.07%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.10%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 60銘柄	2.73%	-%	-%	3.03%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.26%	-%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	3.89%	-%	-%	3.96%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.47%	-%	-%	0.52%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	3.35%	-%	-%	3.39%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.12%	-%	-%	1.13%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.64%	-%	-%	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.25%	-%	-%	0.25%
ユーロ	株式 234銘柄	11.51%	-%	-%	11.79%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
香港・ドル	株式 36銘柄	1.19%	-%	-%	1.26%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,674,514,331	2,516,479,320
金銭信託		273,381,282	-
コール・ローン		-	1,346,029,738
国債証券		258,776,560,149	241,910,908,444
派生商品評価勘定		325,815	-
未収利息		2,367,321,596	2,166,219,241
前払費用		46,246,607	28,959,700
流動資産合計		265,138,349,780	247,968,596,443
資産合計		265,138,349,780	247,968,596,443
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,539,709	6,975,641
未払解約金		936,520,000	191,711,000
流動負債合計		938,059,709	198,686,641
負債合計		938,059,709	198,686,641
純資産の部			
元本等			
元本	1	149,167,353,470	143,480,057,319
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		115,032,936,601	104,289,852,483
元本等合計		264,200,290,071	247,769,909,802
純資産合計		264,200,290,071	247,769,909,802
負債純資産合計		265,138,349,780	247,968,596,443

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27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	183,852,928,058円	149,167,353,470円
同期中追加設定元本額	22,714,623,570円	30,520,903,400円
同期中一部解約元本額	57,400,198,158円	36,208,199,551円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	4,608,868,777円	5,128,943,378円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	17,135,667円	13,691,042円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	49,601,868円	44,704,339円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	84,885,603円	62,814,032円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	40,812,730円	39,527,953円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	41,966,921円	42,616,554円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	31,685,325円	39,345,731円
たわらノーロード 先進国債券	154,189,800円	526,660,107円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	- 円	606,412円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,589,345,800円	4,778,857,729円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	381,621,256円	447,249,853円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,283,530,211円	1,429,659,466円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,366,997,870円	1,468,558,554円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	325,115,189円	361,249,152円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	702,091,373円	744,657,416円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	505,339,054円	555,306,358円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27,849,563円	25,651,436円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	568,221,729円	563,298,507円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,844,770円	6,021,349円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	8,241,243円	13,825,526円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	14,982,115円	23,935,984円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	29,626,646円	46,434,072円
クルーズコントロール DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	416,028,978円	1,781,261,902円
DIAM DC バランス・F(成長型)	25,339,893円	44,703,644円
クルーズコントロール<DC年金>	25,127,893円	64,833,181円
104,666円		656,988円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,004,878円	8,685,786円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	5,367,737円	28,434,647円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	336,463円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,803,256,689円	1,570,963,668円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,936,738,041円	7,162,874,811円

D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,671,354,435円	4,298,221,851円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,389,669,712円	3,975,487,139円
D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	195,054,050円	411,883,612円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	- 円	577,394,424円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	125,179,732円	114,026,758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)	2,536,469,224円	1,328,163,674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)	833,903,203円	815,717,319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)	100,546,922円	83,054,540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)	183,536,447円	153,614,760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)	43,892,957円	38,607,745円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,332,413円	13,058,720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)	8,626,781,465円	1,656,036,644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)	2,181,728,841円	497,398,018円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,129,506,277円	4,483,992,277円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,858,417,978円	2,756,191,387円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,576,434,371円	4,587,547,137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)	881,138,244円	895,832,183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)	3,273,256,957円	1,987,647,480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)	4,397,691,775円	4,199,114,002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)	16,100,828,427円	15,062,291,264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)	56,954,254円	19,119,506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)	2,193,691,472円	2,036,987,121円
D I A M世界バランス ファンド3 5 V A (適格 機関投資家限定)	10,833,445,814円	11,186,558,463円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	15,360,947,657円	16,133,768,314円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	19,589,996,575円	20,496,046,357円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	14,748,909円	26,346,082円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	19,587,305円	270,776円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	6,546,806円	6,037,223円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	17,612,128,830円	18,350,730,818円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	124,173,768円	120,985,005円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	129,091,817円	141,168,530円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	33,261,642円	237,910円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	132,906円	154,240円
計	149,167,353,470円	143,480,057,319円
2 . 受益権の総数	149,167,353,470口	143,480,057,319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27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左



(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成28年2月25日現在	平成29年2月27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	485,021,012	1,483,683,375
合計	485,021,012	1,483,683,375

(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28年2月23日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月22日から平成29年2月27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28年2月25日 現在				平成29年2月27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	973,770,226	-	974,984,120	1,213,894	-	-	-	-
アメリカ・ドル	486,997,104	-	487,778,840	781,736	-	-	-	-
イギリス・ポンド	86,047,075	-	85,726,350	320,725	-	-	-	-
ユーロ	400,726,047	-	401,478,930	752,883	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,647,316,001	-	1,640,340,360	6,975,641
アメリカ・ドル	-	-	-	-	741,545,528	-	738,975,960	2,569,568
イギリス・ポンド	-	-	-	-	164,494,992	-	162,922,500	1,572,492
ユーロ	-	-	-	-	741,275,481	-	738,441,900	2,833,581
合計	973,770,226	-	974,984,120	1,213,894	1,647,316,001	-	1,640,340,360	6,975,641

(注) 時価の算定方法

- 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。
- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.7712円	1.7269円
(1万口当たり純資産額)	(17,712円)	(17,269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29年2月27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 0.75 02/28/18	13,500,000.000	13,481,505.000	
		US T N/B 0.75 04/15/18	3,000,000.000	2,993,880.000	
		US T N/B 0.875 07/15/18	10,000,000.000	9,986,300.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	6,937,070.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	10,000,000.000	10,005,400.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,406,040.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	4,961,900.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,441,305.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,977,120.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,757,772.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	6,986,840.000	
		US T N/B 1.25 12/15/18	15,000,000.000	15,039,150.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	2,000,000.000	1,999,760.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	13,058,370.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,289,164.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,970,000.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,488,240.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	14,000,000.000	13,435,520.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	35,500,000.000	35,688,505.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,000,000.000	4,784,350.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	12,000,000.000	11,160,000.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	12,700,000.000	12,790,170.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,120,700.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	10,500,000.000	9,919,140.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	15,135,900.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	11,500,000.000	10,840,475.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	15,000,000.000	14,776,050.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,365,750.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	4,932,400.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	3,000,000.000	2,986,380.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	15,000,000.000	14,906,250.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	15,000,000.000	14,746,800.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	4,948,400.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,037,920.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,040,770.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,136,620.000	
US T N/B 1.875 08/31/22	7,000,000.000	6,979,700.000			
US T N/B 2.0 02/15/22	2,500,000.000	2,520,975.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,504,370.000			
US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,341,160.000			

US T N/B 2.0 02/28/21	11,000,000.000	11,148,610.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,143,400.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	12,000,000.000	11,747,760.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,095,100.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,499,528.000	
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,651,725.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,146,800.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	10,398,255.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,613,525.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	21,000,000.000	21,329,700.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,060,000.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,153,100.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,930,476.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,064,960.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,759,555.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	7,500,000.000	6,432,375.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,500,000.000	10,536,855.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,000,000.000	9,967,900.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	15,000,000.000	15,281,700.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,026,469.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,536,633.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	6,000,000.000	5,456,700.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	7,000,000.000	6,352,500.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,217,260.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	5,000,000.000	4,537,500.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,210,000.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,109,675.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,226,860.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	12,000,000.000	12,372,600.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	7,000,000.000	7,288,190.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,890,000.000	3,748,987.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,410,900.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,273,282.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,211,700.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	6,070,000.000	5,977,493.200	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,400,000.000	6,282,944.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	2,500,000.000	2,457,800.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,294,811.100	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,500,000.000	6,541,080.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,800,000.000	5,841,180.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	6,000,000.000	6,035,100.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,860,876.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,600,000.000	4,745,544.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,544,830.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,460,000.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,100,000.000	6,292,516.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,861,020.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,690,000.000	7,223,594.400	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,219,840.000	

US T N/B 3.5 02/15/18	2,000,000.000	2,050,220.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,000,000.000	2,222,960.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,890,260.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	17,000,000.000	18,106,870.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,921,520.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,637,100.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,285,900.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	5,860,140.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,980,000.000	3,415,586.600	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	6,565,203.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,285,280.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,570,000.000	3,001,477.300	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	12,527,280.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,010,360.500	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,467,020.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	946,170.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,499,469.100	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,450,000.000	3,081,830.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,081,341.200	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,563,420.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,833,188.500	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,784,776.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	4,800,158.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	3,970,290.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	1,943,899.100	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,931,250.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,447,641.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,355,462.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,167,488.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,898,190.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	2,001,174.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	6,000,000.000	7,537,920.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,683,720.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,664,200.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,609,840.000	
アメリカ・ドル 小計	950,710,000.000 (106,650,647,800)	973,505,935.000 (109,207,895,788)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 1.25 07/22/18	3,000,000.000	3,049,200.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	3,200,000.000	3,348,416.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,200,000.000	1,244,760.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,700,000.000	4,885,415.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,520,440.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,500,000.000	1,589,670.000	

UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,900,000.000	3,153,431.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,500,000.000	3,857,560.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,700,000.000	2,182,069.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,800,000.000	3,198,580.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,300,000.000	4,300,890.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	3,250,000.000	4,443,075.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,480,000.000	4,064,720.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,600,000.000	3,998,800.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,403,720.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,262,790.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,200,000.000	3,691,744.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,200,000.000	3,785,980.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,714,000.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,350,000.000	4,740,250.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,450,000.000	3,360,910.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,850,000.000	2,696,560.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,160,000.000	2,834,568.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,500,000.000	3,692,000.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,400,000.000	3,751,440.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,359,817.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,990,000.000	5,183,165.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,400,000.000	2,616,960.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,100,000.000	4,454,390.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,800,000.000	4,365,760.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	5,400,000.000	6,153,300.000	

	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,200,000.000	3,123,120.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,400,000.000	3,706,560.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	900,000.000	945,180.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,880,000.000	3,807,648.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,216,470.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	2,000,000.000	2,658,600.000	
	イギリス・ポンド 小計	97,530,000.000 (13,582,027,800)	126,361,958.000 (17,597,166,271)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,738,316.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,500,000.000	4,810,995.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,241,051.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,372,904.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,000,000.000	945,700.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	3,958,929.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	827,532.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,533,675.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,200,000.000	3,181,280.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	800,000.000	695,256.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,000,000.000	4,185,400.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	1,963,479.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	700,000.000	669,445.000	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	2,400,000.000	2,459,544.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	1,728,622.500	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,100,000.000	5,746,425.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,102,364.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,900,000.000	4,594,512.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,533,130.000	

	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,000,000.000	4,705,400.000	
オーストラリア・ドル 小計		54,750,000.000 (4,711,237,500)	58,993,959.500 (5,076,430,215)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,588,730.000	
	CANADA 0.5 11/01/18	4,600,000.000	4,583,578.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,384,688.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,600,000.000	1,610,288.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,450,000.000	2,470,359.500	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,822,590.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,684,445.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,900,000.000	1,937,829.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,904,904.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,500,000.000	2,691,475.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,218,864.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,000,000.000	1,094,100.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	900,000.000	1,014,588.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	5,135,502.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,300,000.000	4,655,825.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,300,000.000	2,839,235.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,945,606.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,350,000.000	3,059,183.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	5,500,000.000	5,746,840.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,860,000.000	2,673,582.600	
CANADA 5.75 06/01/29	1,800,000.000	2,552,598.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,800,000.000	2,685,564.000		
カナダ・ドル 小計		55,860,000.000 (4,778,264,400)	62,300,374.100 (5,329,174,001)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	880,000.000	875,600.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	814,880.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	310,000.000	328,234.200	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	610,000.000	645,075.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	419,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	481,822.400	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	861,840.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,711,200.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,421,472.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	539,040.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,105,000.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,550,000.000	1,617,735.000	
	シンガポール・ドル 小計		10,240,000.000 (817,152,000)	10,821,298.600 (863,539,628)
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	5,000,000.000	5,212,700.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,602,003.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,800,000.000	13,877,272.000	



	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,400,000.000	8,719,552.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	11,870,000.000	14,157,586.400	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	12,300,000.000	13,543,899.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	13,746,083.400	
スウェーデン・クローナ	小計	68,480,000.000 (849,836,800)	79,859,095.800 (991,051,379)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	4,000,000.000	4,066,880.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,103,900.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	13,470,000.000	15,291,548.100	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	15,094,950.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	13,900,000.000	15,666,690.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	17,000,000.000	29,377,700.000	
デンマーク・クローネ	小計	66,870,000.000 (1,065,907,800)	85,601,668.100 (1,364,490,590)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	2,000,000.000	1,990,240.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,876,684.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,952,032.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,400,000.000	8,220,808.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	9,100,000.000	10,159,240.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	7,124,816.000	
ノルウェー・クローネ	小計	36,460,000.000 (488,564,000)	39,323,820.000 (526,939,188)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,912,400.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,094,840.000	
	POLAND 10/25/18	2,000,000.000	1,934,400.000	
	POLAND 2.5 07/25/18	1,500,000.000	1,514,850.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	3,809,610.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,138,154.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,166,387.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	5,000,000.000	5,124,500.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,212,995.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,485,985.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,899,820.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,185,920.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,520,400.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,122,336.000	
ポーランド・ズロチ	小計	48,470,000.000 (1,331,955,600)	50,122,597.000 (1,377,368,966)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,933,460.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,190,707.800	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,195,644.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,394,777.400	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	3,700,000.000	3,720,054.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,121,319.100	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	783,328.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,756,630.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,599,110.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,449,748.300	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	2,300,000.000	2,324,012.000	

	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,765,744.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,135,636.600	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,813,194.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,538,085.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,730,592.000	
マレーシア・リンギット 小計		37,430,000.000 (944,733,200)	37,452,042.700 (945,289,558)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	16,500,000.000	20,374,860.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	41,000,000.000	48,083,160.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	41,500,000.000	40,538,445.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	21,000,000.000	20,042,610.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,513,000.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	10,000,000.000	9,762,100.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	37,422,020.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	10,124,900.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,175,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	20,079,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,072,240.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	31,035,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,702,100.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	33,654,220.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,253,850.000	
MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	15,000,000.000	15,466,350.000		
メキシコ・ペソ 小計		325,000,000.000 (1,836,250,000)	339,299,555.000 (1,917,042,486)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	200,000.000	205,334.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	800,000.000	823,280.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,700,000.000	1,836,034.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	50,000.000	51,291.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,398,687.500	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,574,720.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,488,578.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,103,679.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,070,000.000	1,525,477.600	

AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,815,870.000	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,100,000.000	2,480,100.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,446,600.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	570,000.000	988,391.400	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,250,000.000	2,597,737.500	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,800,000.000	2,779,200.000	
AUSTRIA 4.35 03/15/19	2,300,000.000	2,542,489.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,500,000.000	2,112,855.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,830,512.500	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,700,000.000	2,790,450.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,400,000.000	1,457,484.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,287,780.000	
BELGIUM 1.25 06/22/18	1,600,000.000	1,639,808.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	879,597.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	700,000.000	764,827.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	400,000.000	412,160.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	2,000,000.000	2,299,460.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,059,134.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,094,443.000	
BELGIUM 3.0 09/28/19	2,100,000.000	2,296,350.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,400,000.000	2,085,832.000	
BELGIUM 3.75 09/28/20	3,000,000.000	3,464,430.000	
BELGIUM 4.0 03/28/18	500,000.000	525,345.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,950,000.000	2,138,643.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,300,000.000	2,812,049.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,200,000.000	1,693,872.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,400,000.000	3,773,592.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,615,926.500	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,879,830.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,176,608.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,700,000.000	4,395,033.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,050,000.000	4,618,737.000	
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,039,060.000	
BUNDESOBL 0.5 02/23/18	2,500,000.000	2,536,125.000	
BUNDESOBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,197,681.000	
BUNDESOBL 04/09/21	3,200,000.000	3,299,104.000	
BUNDESOBL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,857,528.000	
BUNDESSCHAT 06/15/18	2,300,000.000	2,328,773.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,900,000.000	4,105,257.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,200,000.000	4,382,322.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,600,000.000	2,571,270.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,843,412.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,492,896.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,000,000.000	1,119,780.000	

DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,265,956.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	3,800,000.000	4,293,126.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,200,000.000	2,453,308.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,719,120.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,500,000.000	3,940,300.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	3,300,000.000	3,729,231.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	3,100,000.000	3,592,001.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,662,756.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,500,000.000	3,974,250.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,700,000.000	3,047,085.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,800,000.000	3,863,356.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,780,000.000	3,884,382.800	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	4,500,000.000	5,091,885.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	7,700,000.000	8,630,391.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,800,000.000	4,470,092.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,050,000.000	3,158,230.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	5,900,000.000	6,525,990.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	4,900,000.000	5,333,650.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,100,000.000	5,002,346.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	5,200,000.000	5,567,900.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,200,000.000	3,769,194.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,600,000.000	2,405,408.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,100,000.000	5,241,418.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,200,000.000	4,052,752.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,200,000.000	3,706,406.000	

DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,360,000.000	3,735,030.400	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,400,000.000	2,039,884.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,500,000.000	2,613,600.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,750,000.000	2,889,477.500	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	516,960.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	700,000.000	709,184.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	448,020.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	315,807.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	400,000.000	411,964.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,270,000.000	1,399,413.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	442,220.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	800,000.000	913,856.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	888,795.600	
FINLAND 2.75 07/04/28	780,000.000	970,990.800	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,130,000.000	1,272,843.300	
FINLAND 3.5 04/15/21	800,000.000	934,072.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,010,000.000	1,334,533.200	
FINLAND 4.375 07/04/19	810,000.000	908,261.100	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	2,200,000.000	3,306,622.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	1,500,000.000	1,407,090.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,300,000.000	4,262,547.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,135,188.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	513,100.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	2,500,000.000	2,548,175.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,757,834.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	1,200,000.000	1,232,352.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	4,700,000.000	4,807,630.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,800,000.000	1,688,400.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,700,000.000	3,797,828.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,812,852.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	150,000.000	133,620.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	6,460,000.000	7,075,831.800	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,200,000.000	3,622,432.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	5,268,042.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,300,000.000	4,971,703.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,700,000.000	10,710,352.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,940,000.000	6,968,748.600	

FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,123,090.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,550,000.000	4,607,261.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,800,000.000	9,026,862.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,323,307.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,940,000.000	8,573,676.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	7,200,000.000	8,397,360.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,347,450.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	3,900,000.000	4,105,764.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,662,400.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	2,874,227.200	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,010,000.000	5,753,788.600	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	6,200,000.000	6,839,344.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,452,690.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,600,000.000	8,321,346.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,300,000.000	6,639,587.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,100,000.000	6,247,334.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,100,000.000	6,142,415.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,600,000.000	7,475,506.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,205,105.100	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	5,208,798.000	
IRISH 0.8 03/15/22	800,000.000	834,864.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,000,000.000	1,008,000.000	
IRISH 2.0 02/18/45	1,210,000.000	1,207,773.600	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,233,056.000	
IRISH 3.4 03/18/24	1,030,000.000	1,240,583.500	
IRISH 3.9 03/20/23	800,000.000	979,032.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,130,000.000	1,256,492.200	
IRISH 4.5 04/18/20	1,450,000.000	1,672,821.500	
IRISH 4.5 10/18/18	740,000.000	800,058.400	
IRISH 5.0 10/18/20	1,400,000.000	1,676,920.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,600,000.000	2,188,720.000	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,109,780.500	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,612,240.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,435,250.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,036,760.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	500,000.000	459,925.000	

ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,500,000.000	1,514,955.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,418,150.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,433,400.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,100,000.000	2,772,795.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,686,473.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,000,000.000	1,052,300.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,000,000.000	920,300.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,174,480.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,350,000.000	1,210,815.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	921,360.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,300,000.000	2,310,580.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,100,000.000	3,424,632.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	2,100,000.000	2,224,845.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,699,102.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,579,680.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	4,500,000.000	5,065,200.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,148,919.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,350,000.000	5,025,120.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	4,921,840.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,207,242.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,200,000.000	5,786,040.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	7,017,600.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	4,400,000.000	4,590,960.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,030,550.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,583,350.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,365,260.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,287,240.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,645,490.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	6,200,000.000	6,598,040.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,100,000.000	6,101,640.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,558,320.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,230,000.000	3,960,044.600	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,026,544.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	6,200,000.000	7,353,820.000	

ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,430,000.000	5,428,743.500	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,500,000.000	4,538,450.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	3,888,000.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,950,000.000	3,807,565.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,000,000.000	5,160,000.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	5,000,000.000	6,116,700.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,064,975.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,270,000.000	4,532,220.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,200,000.000	5,868,660.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	4,000,000.000	5,544,800.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,200,000.000	3,160,520.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	2,400,000.000	3,514,080.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,213,618.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,500,000.000	2,515,575.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,724,140.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,300,000.000	1,326,884.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	2,060,000.000	2,141,019.800	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,400,000.000	2,707,344.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,299,340.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,773,169.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,206,720.200	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,650,000.000	2,360,424.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,180,000.000	2,551,908.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,270,000.000	2,595,404.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,200,000.000	2,735,700.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,120,000.000	3,440,887.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,150,000.000	3,396,785.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	2,838,220.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,422,436.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,000,000.000	3,070,000.000	



	SPAIN 0.25 01/31/19	1,400,000.000	1,409,842.000	
	SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,734,782.000	
	SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,175,054.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	1,800,000.000	1,752,462.000	
	SPAIN 1.4 01/31/20	400,000.000	415,872.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,546,725.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,200,000.000	3,309,376.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,662,740.000	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,740,088.000	
	SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,124,020.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,400,000.000	3,770,940.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,294,267.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	500,000.000	516,310.000	
	SPAIN 3.75 10/31/18	2,700,000.000	2,881,791.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	3,400,000.000	4,020,806.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,495,680.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,565,482.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,265,106.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,600,000.000	6,240,136.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,544,119.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	2,500,000.000	2,610,875.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	4,700,000.000	5,227,481.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,600,000.000	4,520,916.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,832,480.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,755,038.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,397,002.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,200,000.000	3,029,400.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	2,928,420.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,800,000.000	2,578,968.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,200,000.000	4,067,488.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	4,200,000.000	5,117,364.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,000,000.000	4,389,450.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,669,252.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,800,000.000	3,858,372.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,322,250.000	
	ユーロ 小計	678,060,000.000 (80,370,451,800)	805,092,545.000 (95,427,619,359)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,923,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,637,214.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,458,497.600	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	19,660,000.000	18,899,158.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,631,480.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	4,000,000.000	3,908,640.000	

	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,009,284.400	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	7,000,000.000	7,050,820.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,176,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,960,611.800	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,243,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	15,646,970.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	2,857,950.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	3,000,000.000	2,856,660.000	
	南アフリカ・ランド 小計	160,740,000.000 (1,395,223,200)	148,260,485.800 (1,286,901,017)	
国債証券 合計		218,822,251,900 (218,822,251,900)	241,910,908,444 (241,910,908,444)	
合計		218,822,251,900 (218,822,251,900)	241,910,908,444 (241,910,908,444)	

- (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 124銘柄	44.08%	45.14%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.10%	7.27%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	2.05%	2.10%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	2.15%	2.20%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.40%	0.41%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.55%	0.56%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.21%	0.22%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.56%	0.57%
マレーシア・リングgit	国債証券 16銘柄	0.38%	0.39%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.77%	0.79%
ユーロ	国債証券 250銘柄	38.51%	39.45%
南アフリカ・ランド	国債証券 14銘柄	0.52%	0.53%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## DIAM DC バランス30インデックスファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	4,195,740,165円
負債総額	92,955円
純資産総額（ - ）	4,195,647,210円
発行済数量	3,262,729,775口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2859円

## DIAM DC バランス50インデックスファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	7,846,017,314円
負債総額	517,980円
純資産総額（ - ）	7,845,499,334円
発行済数量	6,132,368,145口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2794円

## DIAM DC バランス70インデックスファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	4,952,291,827円
負債総額	2,048,497円
純資産総額（ - ）	4,950,243,330円
発行済数量	3,967,678,726口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2476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29年2月28日現在

資産総額	285,751,486,377円
負債総額	145,698,012円
純資産総額（ - ）	285,605,788,365円
発行済数量	125,683,153,541口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2724円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	384,151,722,288円
負債総額	5,464,009,000円
純資産総額（ - ）	378,687,713,288円
発行済数量	295,826,992,761口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2801円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	278,058,539,794円
負債総額	266,565,758円
純資産総額( - )	277,791,974,036円
発行済数量	92,524,255,653口
1口当たり純資産額( / )	3.0024円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	249,260,132,577円
負債総額	131,395,000円
純資産総額( - )	249,128,737,577円
発行済数量	143,891,315,652口
1口当たり純資産額( / )	1.7314円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【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（平成29年2月28日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（平成29年2月28日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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



## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,159,521,637,173
追加型株式投資信託	864	11,794,936,154,039
単位型公社債投資信託	56	310,769,912,650
単位型株式投資信託	107	760,943,242,478
合計	1,065	14,026,170,946,340

### 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31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28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32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28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。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に變更いたしました。

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,051,921	12,951,736
金銭の信託	14,169,657	13,094,914
前払費用	57,309	44,951
未収委託者報酬	4,622,292	4,460,404
未収運用受託報酬	1,737,052	1,859,778
未収投資助言報酬	2 312,206	2 277,603
未収収益	260,845	205,097
繰延税金資産	411,797	341,078
その他	46,782	40,689
流動資産計	33,669,865	33,276,255
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 138,967	1 29,219
車両運搬具	1 941	1 549
器具備品	1 243,908	1 184,683
建設仮勘定	49,116	444,155
無形固定資産		
商標権	1 101	1 7
ソフトウェア	1 1,702,633	1 1,645,861
ソフトウェア仮勘定	202,399	53,036
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 188	1 146
投資その他の資産		
投資有価証券	4,343,365	6,497,772
関係会社株式	613,137	458,701
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
繰延税金資産	582,861	679,092
差入保証金	733,907	2,040,945
その他	96,862	89,835
固定資産計	6,688,771	8,862,580
資産合計	40,358,637	42,138,836

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,605,579	966,681
未払金	2,515,377	2,055,332
未払償還金	49,873	49,873
未払手数料	1,836,651	1,744,274
その他未払金	628,852	261,185
未払費用	2 2,196,267	2 3,076,566
未払法人税等	1,539,263	1,223,957
未払消費税等	671,243	352,820
賞与引当金	722,343	728,769
その他	30,000	-
流動負債計	9,280,074	8,404,128
固定負債		
退職給付引当金	868,928	997,396
役員退職慰労引当金	110,465	154,535
固定負債計	979,394	1,151,932
負債合計	10,259,468	9,556,060
（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	25,417,784	28,000,340
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	19,480,000	22,030,000
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	5,314,491	5,347,047
株主資本計	29,846,262	32,428,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	252,905	153,956
評価・換算差額等計	252,905	153,956
純資産合計	30,099,168	32,582,775
負債・純資産合計	40,358,637	42,138,836

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	28,170,831		30,188,445	
運用受託報酬	7,064,021		7,595,678	
投資助言報酬	1,032,659		993,027	
その他営業収益	828,240		724,211	
営業収益計		37,095,752		39,501,363
営業費用				
支払手数料	12,416,659		12,946,176	
広告宣伝費	527,620		468,931	
公告費	288		258	
調査費	6,317,052		7,616,390	
調査費	4,129,778		4,969,812	
委託調査費	2,187,273		2,646,578	
委託計算費	385,121		412,257	
営業雑経費	488,963		548,183	
通信費	34,089		34,855	
印刷費	414,215		436,756	
協会費	24,177		23,698	
諸会費	37		40	
支払販売手数料	16,443		52,833	
営業費用計		20,135,705		21,992,198
一般管理費				
給料	5,260,910		5,382,757	
役員報酬	242,666		242,446	
給料・手当	4,378,307		4,431,015	
賞与	639,936		709,295	
交際費	37,625		43,975	
寄付金	2,697		2,628	
旅費交通費	242,164		254,276	
租税公課	127,947		180,892	
不動産賃借料	686,770		1,128,367	
退職給付費用	218,863		226,460	
固定資産減価償却費	628,056		902,248	
福利厚生費	33,310		36,173	
修繕費	13,807		31,617	
賞与引当金繰入額	722,343		728,769	
役員退職慰労引当金繰入額	50,327		49,320	
役員退職慰労金	25,501		5,250	
機器リース料	87		140	
事務委託費	231,303		251,913	
事務用消耗品費	67,208		70,839	
器具備品費	5,869		14,182	
諸経費	135,032		214,532	
一般管理費計		8,489,827		9,524,346
営業利益		8,470,220		7,984,819

(単位:千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		17,346		25,274
受取利息		2,404		2,079
時効成立分配金・償還金		974		-
為替差益		652		3,996
雑収入		1,822		6,693
営業外収益計		23,200		38,044
営業外費用				
金銭の信託運用損		163,033		305,368
時効成立後支払分配金・償還金		65		-
外国税支払損失		47,515		-
営業外費用計		210,614		305,368
経常利益		8,282,806		7,717,494
特別利益				
投資有価証券売却益		-		3,377
特別利益計		-		3,377
特別損失				
固定資産除却損	1	12,988	1	624
固定資産売却損	2	-	2	2,653
ゴルフ会員権売却損		1,080		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,307
関係会社株式評価損		202,477		-
特別損失計		216,547		9,584
税引前当期純利益		8,066,259		7,711,286
法人税、住民税及び事業税		2,969,684		2,557,305
法人税等調整額		29,428		27,424
法人税等合計		2,940,256		2,584,730
当期純利益		5,126,003		5,126,556

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第30期(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変 更による累積 的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の 積立				2,350,000			2,350,000	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変 更による累積 的影響額		131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	243,159	27,291,419
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
会計方針の変更による累積的影響額									
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の積立				2,550,000			2,550,000	-	-
当期純利益							5,126,556	5,126,556	5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556	2,582,556	2,582,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	252,905	30,099,168
会計方針の変更による累積的影響額		
会計方針の変更を反映した当期首残高	252,905	30,099,168
当期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の積立		-
当期純利益		5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	98,949	98,949
当期変動額合計	98,949	2,483,607
当期末残高	153,956	32,582,775



## 重要な会計方針

項目	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法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以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</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31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

**（1）概要**

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

**（2）適用予定日**

平成28年4月1日以後に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**

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

**会計上の見積りの変更**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

**追加情報**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne 株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 8 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

**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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
建物	582,075	767,802
車両運搬具	3,981	4,374
器具備品	735,461	562,853
商標権	836	930
ソフトウェア	2,015,473	2,613,791
電信電話専用施設利用権	1,408	1,451

## 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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	311,994	276,211
流動負債	未払費用	492,035	622,004

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	0	182
ソフトウェア	12,988	442

## 2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	-	2,653

## (株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日至平成27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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

## (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27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

第31期(自平成27年4月1日至平成28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27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

ず。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、株価指数先物取引及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及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30期（平成27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	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

## 第31期（平成28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	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	26,427,656	26,427,656	-
(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

## （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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
非上場株式	80,246	77,696
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
差入保証金	733,907	2,040,945

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。

前事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィス等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30期(平成27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	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

第31期(平成28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	12,951,736	-	-	-
合計	12,951,736	-	-	-

(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30期の貸借対照表計上額2,316,596千円、第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. その他有価証券

第30期（平成27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	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

（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31期（平成28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	365,683	146,101	219,581
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）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  
 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）  
 該当事項はありません。

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他有価証券	5,927	3,377	-

7. 減損処理を行った有価証券  
 該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第30期（平成27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	14,169,657	2,544,066

第31期（平成28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	13,094,914	825,986

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(非積立型制度であります)を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
会計方針の変更による累積的影響額	203,600	-
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

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

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	89,550	79,449
未認識過去勤務費用	14,556	9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項  
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
割引率	0.89%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期事業年度43,461千円、第31期事業年度44,193千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	118,238	79,702
未払事業所税	5,527	5,581
賞与引当金	239,095	224,898
未払法定福利費	30,557	28,395
未払確定拠出年金掛金	2,650	2,500
外国税支払損失	15,727	-
資産除去債務	-	13,244
減価償却超過額（一括償却資産）	2,158	3,389
減価償却超過額	130,844	136,503
繰延資産償却超過額（税法上）	2,710	1,339
退職給付引当金	281,232	305,591
役員退職慰労引当金	35,724	47,318
ゴルフ会員権評価損	1,940	3,768
関係会社株式評価損	176,106	166,740
その他有価証券評価差額金	-	1,196
繰延税金資産合計	1,042,515	1,020,171
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	47,855	-
繰延税金負債合計	47,855	-
差引繰延税金資産の純額	994,659	1,020,171

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

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

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

#### （資産除去債務関係）

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

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

#### （セグメント情報等）

##### 1. セグメント情報

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

##### 2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

（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31期(自平成27年4月1日 至平成28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	30,188,445	8,588,706	724,211	39,501,363

(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30期(自平成26年4月1日 至平成27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	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28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	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

## 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30期（自平成26年4月1日 至平成27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	658,756	未払費用	235,583
	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	383,980	未払費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-

## 第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	9,000 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  増資の引受	800,617  912,600	未払 費用  -	308,974  -
	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	473,948	未払 費用	157,130

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	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	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
	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	-	兼務 1名	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	407,531	未払 費用	240,725
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	6,501
	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)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		



## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28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	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	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	3,023,040	未払 手数料	372,837
								預金の預入 (純額)	879,733	現金・ 預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収 収益	123
その他の 関係会 社の子 会社	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	-	兼務 1名	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	557,013	未払 費用	292,861
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻 (純額)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の 支払	8,336		

## 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) 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4) 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5) 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30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,254,132円02銭	1,357,615円66銭
1株当たり当期純利益金額	213,583円46銭	213,606円51銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
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32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,605,537
金銭の信託		11,792,364
前払費用		122,161
未収委託者報酬		4,755,701
未収運用受託報酬		2,465,934
未収投資助言報酬		261,221
未収収益		181,959
繰延税金資産		329,236
その他		122,804
	流動資産計	31,636,922
固定資産		
有形固定資産		1,541,889
建物	1	6,517
器具備品	1	152,176
建設仮勘定		1,383,196
無形固定資産		1,613,174
ソフトウェア		1,421,245
ソフトウェア仮勘定		184,656
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権		124
投資その他の資産		6,281,765
投資有価証券		441,519
関係会社株式		3,229,196
繰延税金資産		713,716
差入保証金		1,808,323
その他		89,010
	固定資産計	9,436,830
	資産合計	41,073,753

(単位:千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,080,224
未払金	2,651,649
未払償還金	49,873
未払手数料	1,865,871
その他未払金	735,905
未払費用	2,673,720
未払法人税等	907,554
未払消費税等	69,484
賞与引当金	724,711
訴訟損失引当金	30,000
その他	21,000
	流動負債計
	8,158,344
固定負債	
退職給付引当金	1,027,049
	固定負債計
	1,027,049
負債合計	9,185,394
(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	27,317,845
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	24,580,000
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	2,114,551
	株主資本計
	31,746,323
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	142,035
	評価・換算差額等計
	142,035
純資産合計	31,888,358
負債・純資産合計	41,073,753

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	14,454,974	
運用受託報酬	3,732,759	
投資助言報酬	456,986	
その他営業収益	323,793	
	営業収益計	18,968,513
営業費用		
支払手数料	6,111,449	
広告宣伝費	108,789	
公告費	428	
調査費	3,764,163	
調査費	2,639,714	
委託調査費	1,124,449	
委託計算費	216,712	
営業雑経費	278,529	
通信費	17,844	
印刷費	212,004	
協会費	11,277	
諸会費	18	
支払販売手数料	37,384	
	営業費用計	10,480,072
一般管理費		
給料	2,330,263	
役員報酬	124,419	
給料・手当	2,205,843	
交際費	16,973	
寄付金	13,268	
旅費交通費	100,973	
租税公課	148,041	
不動産賃借料	1,329,821	
退職給付費用	121,590	
固定資産減価償却費	1 353,322	
福利厚生費	11,020	
修繕費	10,082	
賞与引当金繰入額	724,711	
役員退職慰労金	63,072	
機器リース料	146	
事務委託費	182,857	
事務用消耗品費	37,442	
器具備品費	236,524	
諸経費	58,359	
	一般管理費計	5,738,473
営業利益		2,749,968

（単位：千円）

	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日至平成28年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	7,882	
受取利息	341	
為替差益	32,301	
雑収入	4,836	
	営業外収益計	45,361
営業外費用		
金銭の信託運用損	59,768	
	営業外費用計	59,768
経常利益		2,735,561
特別損失		
固定資産除却損	2,820	
固定資産売却損	1,780	
訴訟損失引当金繰入額	30,000	
	特別損失計	34,601
税引前中間純利益		2,700,960
法人税、住民税及び事業税		856,976
法人税等調整額		17,520
法人税等合計		839,455
中間純利益		1,861,504

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発積 立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							1,861,504	1,861,504	1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	3,232,495	682,495	682,495
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	24,580,000	300,000	200,000	2,114,551	27,317,845	31,746,323

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証 券評価差額金	
当期首残高	153,956	32,582,775
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	11,921	11,921
当中間期変動額 合計	11,921	694,416
当中間期末残高	142,035	31,888,358

## 重要な会計方針

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28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 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。



## 会計方針の変更

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。</p>

## 追加情報

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。 2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)		
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	790,504千円
	器具備品	...	596,199千円

(中間損益計算書関係)

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1. 減価償却実施額	有形固定資産	...	57,752千円
	無形固定資産	...	295,570千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28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28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

## (金融商品関係)

第32期中間会計期間末(平成28年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,605,537	11,605,537	-
(2) 金銭の信託	11,792,364	11,792,364	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	363,823	363,823	-
資産計	23,761,725	23,761,725	-
(1) 未払法人税等	907,554	907,554	-
負債計	907,554	907,554	-

## (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	77,696
関係会社株式	3,229,196
差入保証金	1,808,323

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、時価開示の対象としておりません。

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、時価開示の対象としておりません。

## (有価証券関係)

第32期中間会計期間末  
(平成28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3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
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	349,644	146,101	203,542
債券	-	-	-
その他(投資信託)	14,179	13,000	1,179
小計	363,823	159,101	204,721
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	363,823	159,101	204,721

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額77,696千円)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32期中間会計期間末  
(平成28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。

## (資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28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	14,454,974	4,189,745	323,793	18,968,513

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益 (千円)
第一生命グループ	1,928,739

(注) 第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

## （1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,328,681円	62銭
1株当たり中間純利益金額	77,562円	67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32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
中間純利益	1,861,504千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,861,504千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第32期中間会計期間  
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

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

## 1．結合当事企業

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

## 2．企業結合日

平成28年10月1日

## 3．企業結合の方法

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

## 4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5．交付した株式数

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種種類株式15,510株を交付しました。

## 6．企業結合の主な目的

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

## 7．取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 8．実施予定の会計処理

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

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「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条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度(自平成27年4月1日至平成28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により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28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により中間監査を受けております。



## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社  
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	江見 睦生 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子 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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28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。

#### 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 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、当社が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。

2.XBRL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28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28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28年4月1日から平成28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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

## (1)貸借対照表

	（単位： 千円）	
	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>		
建物（純額）	124,850	100,000
工具、器具及び備品（純額）	71,443	90,655
リース資産（純額）	2,140	818
有形固定資産合計	1 198,434	1 191,474
<b>無形固定資産</b>		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033
未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
<b>固定負債</b>		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,045,600	2,045,600

資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	<u>4,716,474</u>	<u>4,716,474</u>
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	<u>17,872,927</u>	<u>19,042,177</u>
自己株式	-	377,863
株主資本合計	<u>24,635,002</u>	<u>25,426,389</u>
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	<u>726,935</u>	<u>137,791</u>
純資産合計	<u>25,361,937</u>	<u>25,564,180</u>
負債純資産合計	<u>29,973,099</u>	<u>29,654,112</u>

## (2)損益計算書

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405
営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767

営業外費用合計		85,321	9,688
経常利益		1,975,847	2,600,528
特別利益			
投資有価証券売却益		10,500	-
特別利益合計		10,500	-
特別損失			
減損損失	1	51,292	-
事業再構築費用	2	125,173	-
外国税負担損失	3	53,547	-
貸倒引当金繰入		19,534	-
特別損失合計		249,548	-
税引前当期純利益		1,736,799	2,600,528
法人税、住民税及び事業税		616,760	839,827
法人税等調整額		16,247	40,166
法人税等合計		633,008	879,993
当期純利益		1,103,790	1,720,534

## (3)株主資本等変動計算書

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位: 千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本						株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	
		その他利益剰余金					
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	6,988,395	17,121,579	23,883,654
当期変動額							
剰余金の配当					352,443	352,443	352,443
当期純利益					1,103,790	1,103,790	1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)							
当期変動額合計					751,347	751,347	751,347
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	24,635,002

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41,248	41,248	23,842,406
当期変動額			
剰余金の配当			352,443
当期純利益			1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	768,183	768,183	768,183
当期変動額合計	768,183	768,183	1,519,530
当期末残高	726,935	726,935	25,361,937



当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位: 千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本							自己株式	株主資本合計
	利益剰余金						利益剰余金合計		
	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計			
配当準備積立金		退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金					
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	-	24,635,002	
当期変動額									
剰余金の配当					551,284	551,284		551,284	
当期純利益					1,720,534	1,720,534		1,720,534	
自己株式の取得							377,863	377,863	
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計					1,169,250	1,169,250	377,863	791,386	
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177	377,863	25,426,389	

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	726,935	726,935	25,361,937
当期変動額			
剰余金の配当			551,284
当期純利益			1,720,534
自己株式の取得			377,863
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	589,143	589,143	589,143
当期変動額合計	589,143	589,143	202,242
当期末残高	137,791	137,791	25,564,180

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

## (3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日において発生していると認められる額を計上しております。

## (4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

## (5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

## 5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 6. ヘッジ会計の方法

## (1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

## (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

## (3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

## (4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

## 7. その他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。

## 未適用の会計基準等

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

## 1. 概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

## 2. 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

## 3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

## 会計上の見積りの変更に関する注記

当社は、「追加情報」に記載のとおり、当社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ27,598千円減少しております。

## 追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 西 恵正）、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 - 8 - 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

## 注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物 111,156千円		建物 136,006千円
	工具、器具及び備品 277,249千円		工具、器具及び備品 226,657千円
	リース資産 16,185千円		リース資産 17,508千円

## (損益計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額（千円）
本社（東京都港区）	除却対象資産	建物	23,139
本社（東京都港区）	除却対象資産	工具器具備品	4,253
本社（東京都港区）	除却対象資産	原状回復費用	23,900

レイアウト変更により現行オフィス内部造作等の除却が決定した資産につき、「除却対象資産」としてグルーピングを行い、平成27年3月31日時点の帳簿価額および原状回復費用を減損損失（51,292千円）として特別損失に計上しました。

## 2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

## 3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

## 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 （円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発効日
平成26年6月11日 第51回定時株主総会	普通株式	352,443,450	335	平成26年3月31日	平成26年6月12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	配当金の総額 （円）	配当の原資	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	利益剰余金	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

## 2 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	-	13,662	-	13,662

## (変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

## 3. 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 (円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

## (リース取引関係)

## 1. ファイナンス・リース取引（借主側）

## 所有権移転外ファイナンス・リース取引

## リース資産の内容

## 有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

## リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

## 市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的な時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,801,864	20,801,864	-
(2) 未収委託者報酬	1,827,951	1,827,951	-
(3) 未収運用受託報酬	1,812,198	1,812,198	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	4,054,289	4,054,289	-
資産計	28,496,304	28,496,304	-
(1) 未払手数料	819,341	819,341	-
負債計	819,341	819,341	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(3,601)	(3,601)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	327	327	-
デリバティブ取引計	(3,274)	(3,274)	-

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,903,257	20,903,257	-
(2) 未収委託者報酬	2,183,032	2,183,032	-
(3) 未収運用受託報酬	1,713,643	1,713,643	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,282,026	3,282,026	-
資産計	28,081,960	28,081,960	-
(1) 未払手数料	838,064	838,064	-
負債計	838,064	838,064	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(220)	(220)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1,564)	(1,564)	-
デリバティブ取引計	(1,784)	(1,784)	-

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負 債

(1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	60,720	60,720

上記については、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ため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,800,853	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,827,951	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,812,198	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	127,840	-	-	-	-	3,300,657
合計	24,568,844	-	-	-	-	3,300,657

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,902,546	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	2,183,032	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,713,643	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

## (有価証券関係)

## 1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	3,740,183	2,664,442	1,075,740
小計	3,740,183	2,664,442	1,075,740
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	314,105	316,720	2,615
小計	314,105	316,720	2,615
合計	4,054,289	2,981,163	1,073,125

## 当事業年度(平成28年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	2,698,875	2,500,000	198,875
小計	2,698,875	2,500,000	198,875
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	583,151	583,423	271
小計	583,151	583,423	271
合計	3,282,026	3,083,423	198,603

2 当事業年度中に売却したその他有価証券  
該当するものではありません。

3 当事業年度中に解約・償還したその他有価証券  
前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	102,729	953	2,197
合計	102,729	953	2,197

## 当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	738,178	106,977	2,920
合計	738,178	106,977	2,920

(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  
株式関連  
前事業年度(平成27年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	197,054	-	3,601	3,601
	合計	197,054	-	3,601	3,601

## 当事業年度(平成28年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	148,005	-	220	220
	合計	148,005	-	220	220

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。



## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 株式関連

前事業年度(平成27年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	131,145	-	3,325
	買建	投資有価証券	277,953	-	3,652
合計			409,098	-	327

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度(平成28年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	117,467	-	147
	買建	投資有価証券	179,836	-	1,711
合計			297,303	-	1,564

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	357,258千円	331,766千円
退職給付費用	150,018	51,208
退職給付の支払額	21,349	-
制度への拠出額	103,177	66,102
退職給付引当金の期末残高	331,766	346,659

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	669,318千円	727,842千円
年金資産	1,001,084	1,074,502
貸借対照表に計上された前払年金費用	331,766	346,659

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度58,362千円 当事業年度51,208千円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円
ソフトウェア償却超過額	69,263	52,651
賞与引当金損金算入限度超過額	108,734	98,134
社会保険料損金不算入額	15,665	14,233
役員退職慰労引当金	34,461	45,488
未払事業税	30,421	39,817
その他	93,137	58,782
繰延税金資産小計	356,479	313,659
評価性引当額	24,103	22,331
繰延税金資産合計	332,375	291,328
<b>繰延税金負債</b>		
前払年金費用	107,027	106,147
その他有価証券評価差額金	346,190	60,812
繰延税金負債合計	453,218	166,959
繰延税金資産の純額	120,843	124,368

## 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な項目別の内訳

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

## 3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）及び当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [ 関連情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	2,629,803	資産運用業

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	3,061,207	資産運用業

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,833,692	未払手数料	361,219
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	13,851,610	未収委託者報酬	1,661,682

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,542,264	未払手数料	336,556
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	14,108,529	未収委託者報酬	2,053,638

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	24,106.70円	24,618.62円
1株当たり当期純利益金額	1,049.16円	1,639.16円

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

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。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
普通株式に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
期中平均株式数(株)	1,052,070	1,049,643

## (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54期中間会計期間  
(平成28年9月30日)

資産の部	
流動資産	
現金及び預金	4,120,018
未収委託者報酬	2,064,997
未収運用受託報酬	1,959,028
繰延税金資産	140,728
その他	398,383
貸倒引当金	1,207
流動資産合計	8,681,950
固定資産	
有形固定資産	
工具、器具及び備品(純額)	62,971
有形固定資産合計	1 62,971
無形固定資産	
投資その他の資産	12,767
投資有価証券	815,525
繰延税金資産	73,719
その他	638,830
貸倒引当金	19,404
投資その他の資産合計	1,508,671
固定資産合計	1,584,410
資産合計	10,266,360
負債の部	
流動負債	
未払金	793,859
未払費用	1,675,771
未払法人税等	253,697
賞与引当金	319,200
その他	221,869
流動負債合計	3,264,398
固定負債	
役員退職慰労引当金	57,860
時効後支払損引当金	7,256
固定負債合計	65,116
負債合計	3,329,515
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,045,600
資本剰余金	
資本準備金	2,266,400
その他資本剰余金	1,103,259
資本剰余金合計	3,369,659
利益剰余金	
利益準備金	128,584
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	1,777,567
利益剰余金合計	1,906,152
自己株式	377,863
株主資本合計	6,943,548
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	6,703
評価・換算差額等合計	6,703
純資産合計	6,936,845
負債純資産合計	10,266,360

## (2) 中間損益計算書

(単位: 千円)

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		7,935,613
運用受託報酬		2,105,866
営業収益合計		10,041,479
営業費用及び一般管理費	1	9,415,997
営業利益		625,482
営業外収益		
受取配当金		19,694
受取利息		439
有価証券解約益		76,483
有価証券償還益		3,474
時効到来償還金等		727
雑収入		17,708
営業外収益合計		118,528
営業外費用		
有価証券解約損		96
有価証券償還損		12
雑損失		6,303
営業外費用合計		6,412
経常利益		737,598
特別利益		700
特別損失		11,641
税引前中間純利益		726,657
法人税、住民税及び事業税		236,054
法人税等調整額		26,308
法人税等合計		209,746
中間純利益		516,910

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当中間期変動額				
積立金取崩				
剰余金の配当			1,346,815	1,346,815
中間純利益				
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				
当中間期変動額合計			1,346,815	1,346,815
当中間期末残高	2,045,600	2,266,400	1,103,259	3,369,659

	株主資本					
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計
		その他利益剰余金				
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177
当中間期変動額						
積立金取崩		104,600	100,000	9,800,000	10,004,600	-
剰余金の配当					17,652,936	17,652,936
中間純利益					516,910	516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計		104,600	100,000	9,800,000	7,131,425	17,136,025
当中間期末残高	128,584	-	-	-	1,777,567	1,906,152

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	自己株式	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	377,863	25,426,389	137,791	137,791	25,564,180
当中間期変動額					
積立金取崩		-			-
剰余金の配当		18,999,751			18,999,751
中間純利益		516,910			516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			144,494	144,494	144,494
当中間期変動額合計		18,482,840	144,494	144,494	18,627,334
当中間期末残高	377,863	6,943,548	6,703	6,703	6,936,845

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、中間決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、中間決算日において発生していると認められる額を計上しております。

## (4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

## (5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

## 4. 外貨建資産・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。

## 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## 追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

	第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	476,786千円



## (中間損益計算書関係)

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1 減価償却実施額	有形固定資産 114,327千円 無形固定資産 15千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

## 1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

## 2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	13,662	-	-	13,662

## 3 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 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

## (金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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、次表には含まれておりません。(注2)を参照ください。)

(単位： 千円)

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	4,120,018	4,120,018	-
(2) 未収委託者報酬	2,064,997	2,064,997	-
(3) 未収運用受託報酬	1,959,028	1,959,028	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	754,805	754,805	-
資産計	8,898,851	8,898,851	-
(1) 未払手数料	785,089	785,089	-
負債計	785,089	785,089	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## 資 産

## (1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

## (4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。  
また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

## 負債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	60,720

上記については、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ため、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## (有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

## 1 其他有価証券

種類	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			
証券投資信託	151,830	150,000	1,830
小計	151,830	150,000	1,830
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
証券投資信託	602,975	614,467	11,491
小計	602,975	614,467	11,491
合計	754,805	764,467	9,661

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

## 1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## 2 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

## 3 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益(千円)	関連するセグメント名
適格機関投資家A	1,177,474	資産運用業

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	6,680.26円

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1株当たり中間純利益金額	497.79円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	516,910
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	516,910
普通株式の期中平均株式数(株)	1,038,408

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

(重要な後発事象)

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

1. 企業結合日  
平成28年10月1日
2. 企業結合の方法

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

（参考）新光投信株式会社の経理状況

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第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。

当社の中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条および第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、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。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社  
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 伊藤 志保

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 福村 寛

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」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56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、新光投信株式会社の平成28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。

### 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の統合基本合意書に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 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

- ( ) 1. 上記は、当社が、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。
2. XBR 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28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、新光投信株式会社の平成28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28年4月1日から平成28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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
流動資産合計	20,404,659	21,767,367
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 12,687	2 0
構築物（純額）	2 1,444	2 0
器具・備品（純額）	2 86,688	2 44,868
有形固定資産合計	100,820	44,868
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
無形固定資産合計	86,278	57,152
投資その他の資産		
投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098



(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
<b>固定負債</b>		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	4,524,300	4,524,300
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	360,493	360,493
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744

評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		35,876,795		39,283,623
運用受託報酬		238,412		232,145
営業収益合計		36,115,207		39,515,769
営業費用				
支払手数料	1	18,252,669	1	19,472,734
広告宣伝費		456,430		507,020
公告費		548		469
調査費				
調査費		623,792		841,825
委託調査費		5,966,340		7,419,125
図書費		5,254		4,879
調査費合計		6,595,388		8,265,830
委託計算費		1,352,318		1,711,366
営業雑経費				
通信費		32,335		30,454
印刷費		103,093		1,022
協会費		18,150		19,367
諸会費		3,300		3,117
その他		41,594		44,518
営業雑経費合計		198,475		98,480
営業費用合計		26,855,830		30,055,901
一般管理費				
給料				
役員報酬		96,445		91,205
給料・手当		1,368,552		1,480,875
賞与		336,076		428,776
給料合計		1,801,073		2,000,857
交際費		11,426		10,708
寄付金		3,198		2,346
旅費交通費		100,386		109,240
租税公課		68,508		90,795
不動産賃借料		206,753		205,671
賞与引当金繰入		451,000		547,750
役員賞与引当金繰入		66,000		22,000
役員退職慰労引当金繰入		24,930		22,210
退職給付費用		191,900		169,238
減価償却費		70,676		102,532

諸経費	573,824	647,510
一般管理費合計	3,569,678	3,930,859
営業利益	5,689,698	5,529,008

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		163,006		65,772
有価証券利息		3,853		3,333
受取利息		10,741		10,751
時効成立分配金・償還金		5,080		923
受取保険金		-		10,300
雑益		487		2,845
営業外収益合計		183,170		93,926
営業外費用				
支払利息		26		3
時効成立後支払分配金・償還金		3,083		5,532
雑損		3,261		556
営業外費用合計		6,371		6,092
経常利益		5,866,496		5,616,842
特別利益				
投資有価証券売却益		68,179		225,965
外国税支払損失引当金戻入益		-		43,200
特別利益合計		68,179		269,166
特別損失				
固定資産除却損		3,177		13,017
投資有価証券売却損		54,613		60,150
投資有価証券評価損		10,952		62,800
外国税支払損失引当金繰入額		184,111		-
訴訟損失引当金繰入額		30,000		10,000
合併関連費用	2	-	2	164,657
その他特別損失		22,227		-
特別損失合計		305,082		310,625
税引前当期純利益		5,629,593		5,575,383
法人税、住民税及び事業税		2,111,379		1,832,729
法人税等調整額		66,999		19,773
法人税等合計		2,044,380		1,852,503
当期純利益		3,585,212		3,722,880

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による累積 的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した当期 首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自 己 株 式	株 主 資 本 合 計	その他有価証 券評価差額金	
	利 益 剰余金 合 計				
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積 的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期 首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 別途積立金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益						
自己株式の消却			72,415	72,415		
利益剰余金から 資本剰余金への振替			72,415	72,415		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-
当期末残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
当期首残高	3,981,245	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	3,446,341	3,446,341		3,446,341		3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880
自己株式の消却			72,415	-		-
利益剰余金から資本剰余金への振替	72,415	72,415		-		-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				-	187,941	187,941
当期変動額合計	204,122	204,122	72,415	276,538	187,941	88,597
当期末残高	4,185,368	13,445,861	-	20,731,861	94,744	20,826,605

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 関連会社株式

総平均法による原価法

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20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）に基づく定額法により償却しております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

#### (2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

#### (3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

#### (4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

#### (5) 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及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。



#### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

#### （6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

#### （7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

#### 4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、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。

#### 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### （1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

#### （未適用の会計基準）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

##### （1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

##### （2）適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

##### （3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

#### （追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

- 1．商号 アセットマネジメントOne株式会社
- 2．代表者 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
- 3．本店所在地 東京都千代田区丸の内1-8-2
- 4．統合日 平成28年10月1日

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払手数料	777,631千円	570,839千円

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	573,602千円	657,201千円

## (損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
支払手数料	9,189,399千円	8,452,937千円

2. 特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
固定資産・敷金の償却	-千円	140,257千円
その他	-千円	24,400千円
合計	-千円	164,657千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1.発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	-	1,823,250

## 2.自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	9,386	-	-	9,386

## 3.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26年12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1.発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	9,386	1,813,864

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 2.自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	9,386	-	9,386	-

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 3.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27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行ってまいります。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上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ることがあります。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、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

## 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）。

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

## (3) 未収委託者報酬

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

（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（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

## (注)3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 前事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

## 当事業年度(平成28年3月31日)

	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	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

## （有価証券関係）

## 1．関連会社株式

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）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。

当事業年度(平成28年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
	合計	6,159,600	6,023,210	136,389

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3.売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613



当事業年度(平成28年3月31日)

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円(その他有価証券)減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について62,800千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付企業年金制度(キャッシュバランス型)、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,424,739	1,348,083
会計方針の変更による累積的影響額	71,902	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	31,927	53,747
退職給付の支払額	73,269	60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
年金資産の期首残高	1,157,054	1,329,170
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の発生額	108,961	128,633
事業主からの拠出額	78,464	77,164
退職給付の支払額	38,450	28,253
年金資産の期末残高	1,329,170	1,282,678

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

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成27年3月31日)	(平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,111,797	1,185,792
年金資産	1,329,170	1,282,678
	217,373	96,885
非積立型制度の退職給付債務	236,285	253,099
未積立退職給付債務	18,912	156,213
未認識数理計算上の差異	270,020	387,977
未認識過去勤務費用	10,703	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764
退職給付引当金	155,806	146,617
前払年金費用	396,211	378,381
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用(注1)	119,135	124,139
利息費用	9,476	6,074
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の費用処理額	85,138	64,424
過去勤務費用の費用処理額	16,055	10,703
確定給付制度に係る退職給付費用	174,553	150,705

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

## (5)年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%
現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
割引率	0.0720% ~ 1.625%	0.0120% ~ 0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	170,920千円	182,614千円
減価償却超過額	896	25,871
退職給付引当金	70,882	71,201
役員退職慰労引当金	12,688	14,799
投資有価証券評価損	15,033	19,229
非上場株式評価損	25,733	24,425
未払事業税	90,342	57,445
外国税支払損失引当金	60,867	-
訴訟損失引当金	9,918	12,344
その他	87,621	120,305
繰延税金資産小計	544,905	528,236
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	544,905	528,236
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	134,624	56,708
前払年金費用	127,817	115,860
繰延税金負債合計	262,442	172,568
繰延税金資産の純額	282,463	355,668

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	372,215千円	326,063千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	-	29,604
固定負債 - 長期繰延税金負債	89,752	-

## 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な項目別の内訳

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

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については30.62%となります。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 関連当事者情報

## 1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る)等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接 7.73	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,452,937	未払手数料	570,839

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	16,314
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	96,300	その他未払金	8,725
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,163	その他未払金	1,728

(注) 1. 上記(ア)~(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。  
なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## 親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
1株当たり純資産額	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45銭

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

（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。

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813



## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	7,314,360
有価証券	101,520
未収委託者報酬	3,004,856
未収運用受託報酬	74,687
繰延税金資産	281,201
その他	334,195
流動資産合計	11,110,820
固定資産	
有形固定資産	
器具・備品(純額)	31,241
建設仮勘定	3,819
有形固定資産合計	35,061
無形固定資産	
ソフトウェア	52,424
ソフトウェア仮勘定	20,936
その他	91
無形固定資産合計	73,452
投資その他の資産	
投資有価証券	2,589,863
長期繰延税金資産	22,056
前払年金費用	352,195
その他	29,332
投資その他の資産合計	2,993,448
固定資産合計	3,101,961
資産合計	14,212,782

(単位：千円)

当中間会計期間  
(平成28年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	
未払収益分配金	153
未払償還金	4,216
未払手数料	1,406,798
その他未払金	284,198
未払金合計	1,695,367
未払費用	801,111
未払法人税等	850,492
未払消費税等	2 113,638
賞与引当金	382,000
訴訟損失引当金	70,000
流動負債合計	3,912,609
固定負債	
退職給付引当金	160,185
固定負債合計	160,185
負債合計	4,072,794
純資産の部	
株主資本	
資本金	4,524,300
資本剰余金	
資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	2,473,372
利益剰余金合計	2,833,866
株主資本合計	10,119,866
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	20,122
評価・換算差額等合計	20,122
純資産合計	10,139,988
負債純資産合計	14,212,782

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間	
	(自 平成28年4月 1日	
	至 平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		19,468,460
運用受託報酬		95,090
営業収益合計		19,563,551
営業費用及び一般管理費	1	16,721,767
営業利益		2,841,783
営業外収益		
受取配当金		32,758
有価証券利息		522
受取利息		2,296
時効成立分配金・償還金		10
その他		531
営業外収益合計		36,119
営業外費用		
その他		34
営業外費用合計		34
経常利益		2,877,868
特別利益		
固定資産売却益		1,354
投資有価証券売却益		9,179
特別利益合計		10,533
特別損失		
固定資産売却損		3,996
投資有価証券評価損		58,055
固定資産除却損		50
訴訟損失引当金繰入額		30,000
合併関連費用		11,926
特別損失合計		104,028
税引前中間純利益		2,784,373
法人税、住民税及び事業税		795,495
法人税等調整額		85,212
法人税等合計		880,707
中間純利益		1,903,666

## (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別途 積立金	繰越 利益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	4,185,368
当中間期変動額					
別途積立金取崩				8,900,000	8,900,000
剰余金の配当					12,515,661
中間純利益					1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	8,900,000	1,711,995
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	-	2,473,372

	株主資本		評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	株主 資本 合計	その他有価証 券評価差額金	
	利益 剰余金 合計			
当期首残高	13,445,861	20,731,861	94,744	20,826,605
当中間期変動額				
別途積立金取崩	-	-		-
剰余金の配当	12,515,661	12,515,661		12,515,661
中間純利益	1,903,666	1,903,666		1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			74,622	74,622
当中間期変動額合計	10,611,995	10,611,995	74,622	10,686,617
当中間期末残高	2,833,866	10,119,866	20,122	10,139,988

[ 注記事項 ]

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(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）に基づく定額法により償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる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及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、そ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（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

## 4. 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

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

## (中間貸借対照表関係)

## 1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	498,091千円

## 2. 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

## (中間損益計算書関係)

## 1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
有形固定資産	9,695千円
無形固定資産	9,425千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,813,864	-	-	1,813,864

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月15日 取締役会	普通 株式	12,515,661	6,900	平成28年7月5日	平成28年7月27日

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

## （金融商品関係）

## 金融商品の時価等に関する事項

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）。

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金及び預金	7,314,360	7,314,360	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,415,231	2,415,231	-
(3) 未収委託者報酬	3,004,856	3,004,856	-
(4) 未払手数料	1,406,798	1,406,798	-

（注）1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## (1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## (3) 未収委託者報酬

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

## (4) 未払手数料

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

（注）2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## （有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

## 1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

	種類	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	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	921,189	730,244	190,944
	小計	921,189	730,244	190,944
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,494,041	1,656,021	161,979
	小計	1,494,041	1,656,021	161,979
	合計	2,415,231	2,386,265	28,965

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)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。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。



## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	5,590円26銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	10,139,988
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	10,139,988
普通株式の発行済株式数(株)	1,813,864
普通株式の自己株式数(株)	-
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	1,049円50銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載していません。

## （追加情報）

## 役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

## 役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

#### 執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

#### 繰延税金資産

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

#### (重要な後発事象)

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

1. 企業結合日  
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

##### a.名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b.資本金の額

平成28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	60,000	日本において保険業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28年10月1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】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【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。

# 独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

DIAMアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているDIAMアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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、DIAMアセットマネジメント株式会社の平成28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。

### 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年4月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 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DIAM DC バランス30インデックスファンドの平成28年2月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DIAM DC バランス30インデックスファンドの平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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。

XBR 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29年4月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 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DIAM DC バランス50インデックスファンドの平成28年2月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DIAM DC バランス50インデックスファンドの平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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。

XBR 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29年4月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 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DIAM DC バランス70インデックスファンドの平成28年2月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 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、DIAM DC バランス70インデックスファンドの平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

---

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。

XBR 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28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28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28年4月1日から平成28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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。