

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2018年11月26日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	D I A M D C バランス30インデックスファンド D I A M D C バランス50インデックスファンド D I A M D C バランス70インデックスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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：2018年11月27日から2019年5月24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。

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ） 【 その他 】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

なお、海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

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

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

振替受益権について

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

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FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

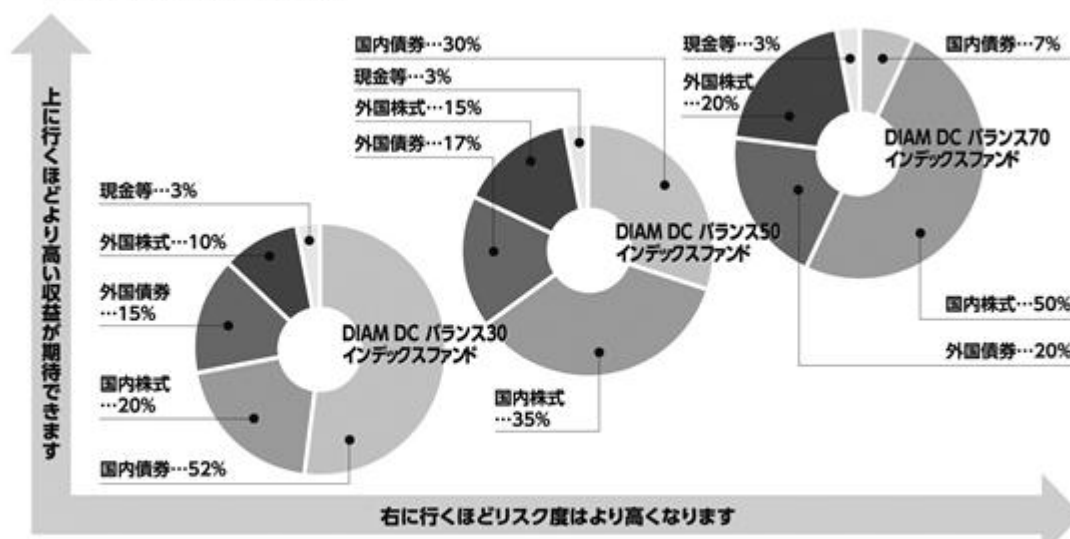
2

●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

3ファンドの基本アロケーション

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



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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

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、 FTSE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

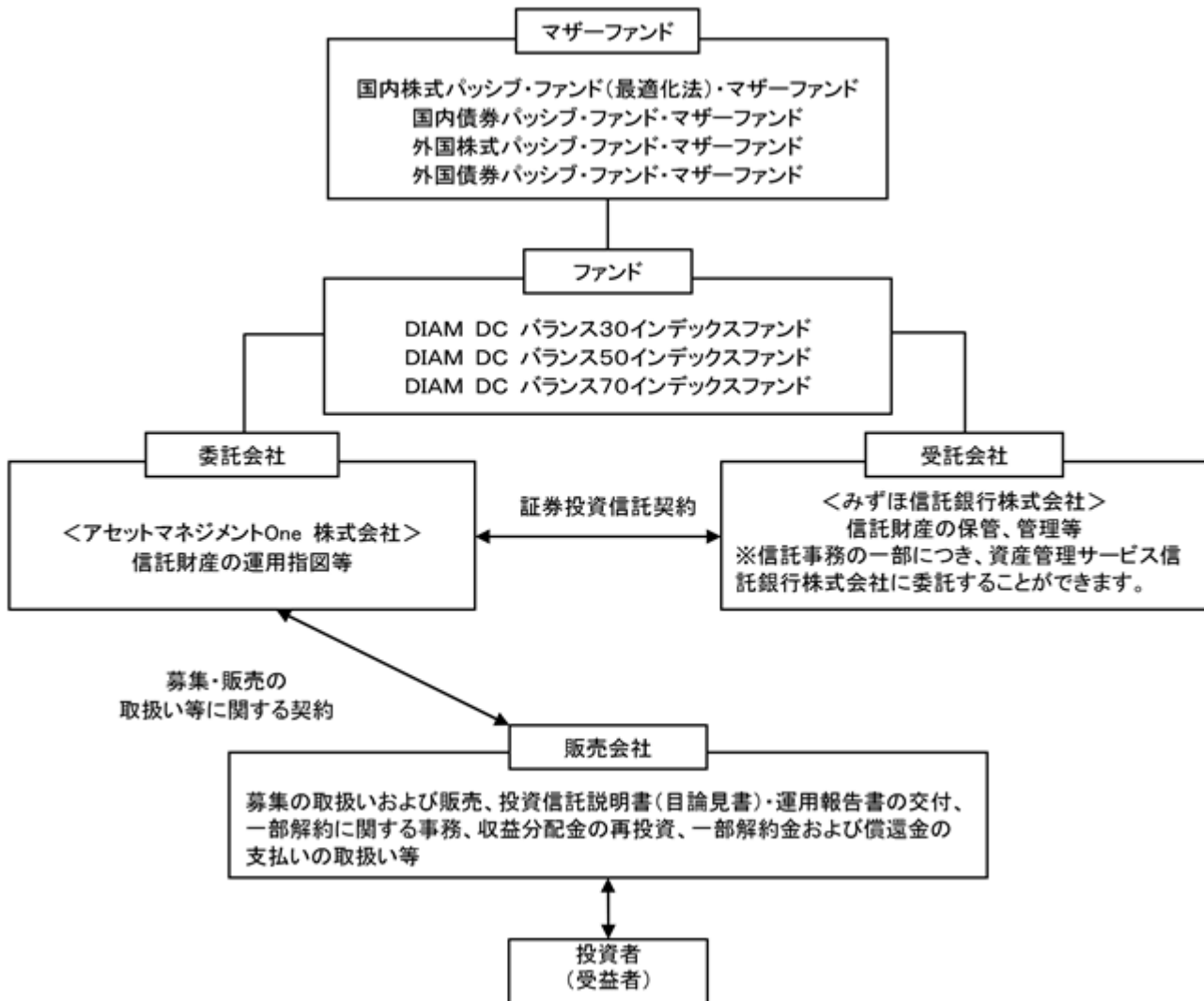
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券) 資産配分固定型))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(株式、債券)を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券)資産配分固定型))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が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】

2006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。

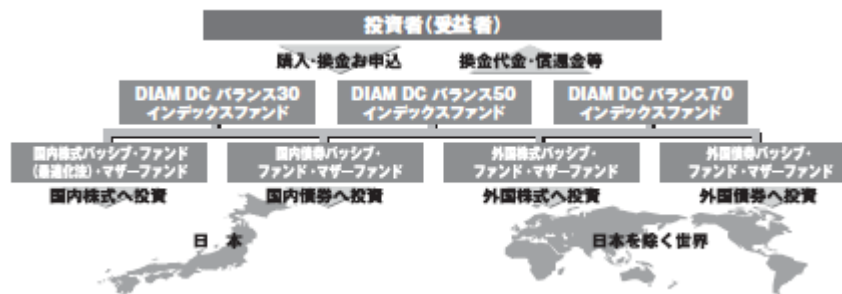
- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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（2018年8月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

(2018年8月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

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

<投資態度>

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

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

(注1) 東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「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、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

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

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

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

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

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

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

(注2) NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

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

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

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

(注4)FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

2.有価証券の指図範囲(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(4)までの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す。）
 - (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す。）
 - (24) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 - (25) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - (26) 外国の者に対する権利で(25)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

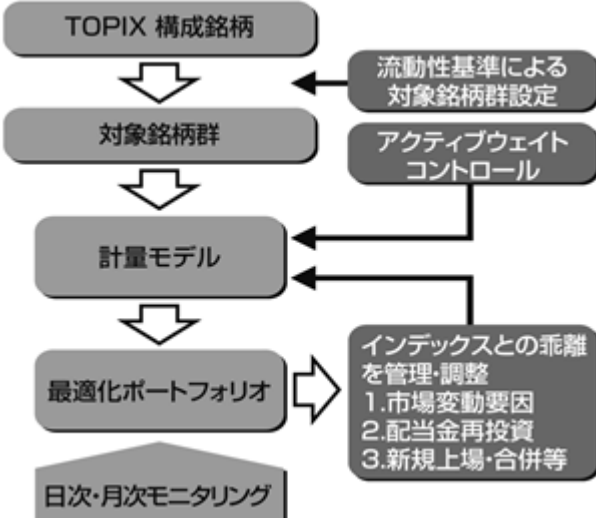
3. 金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

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

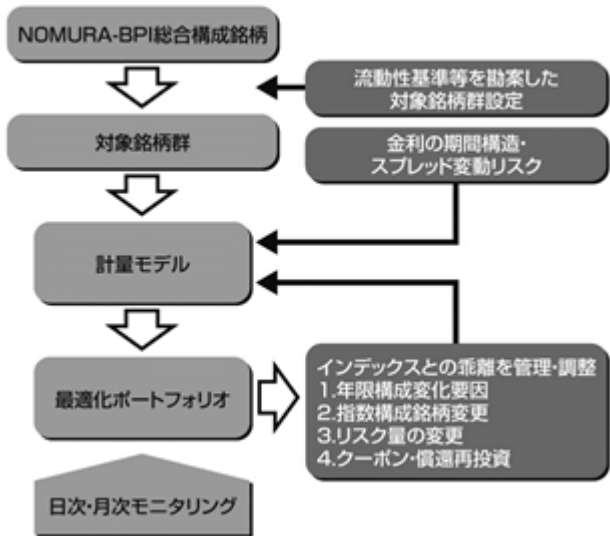
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5) の権利の性質を有するもの
4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3. の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。(約款第17条第3項)

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

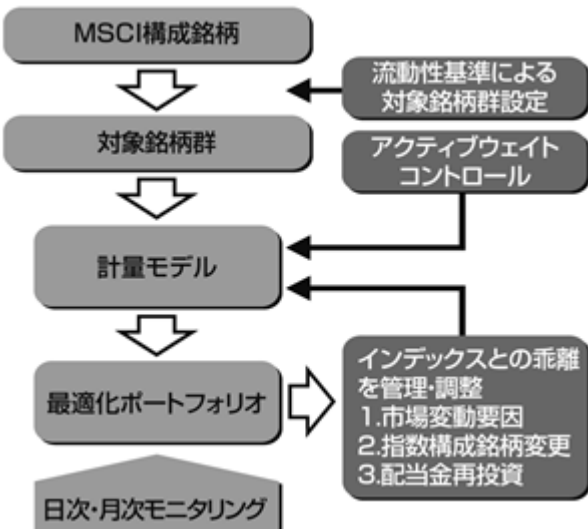
運用プロセス	<p>1. 流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	<p>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因、 が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資 

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。 6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	---

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>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</p> <p>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。</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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
--------	---

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

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

運用プロセス

1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

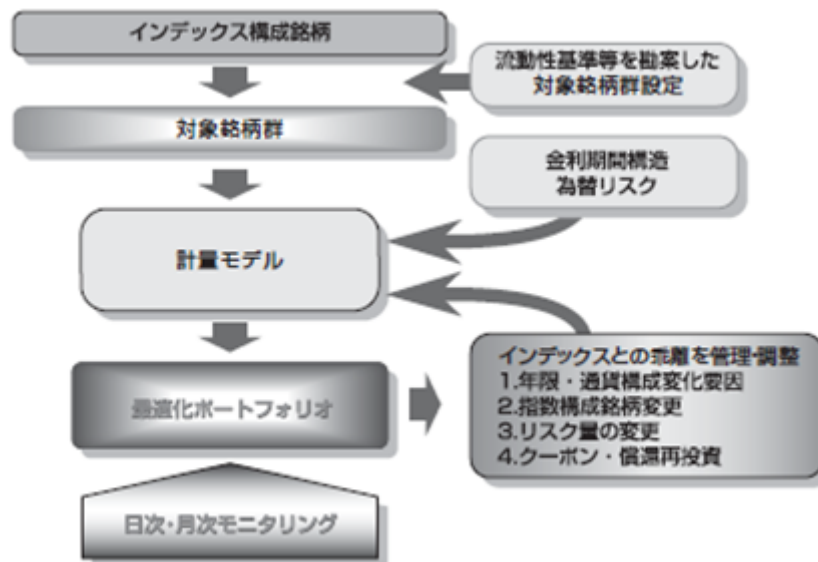
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



(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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2018年8月31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」と言います。)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、)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。

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

(6)投資する株式等の範囲(約款第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。

(7)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。

(8)同一銘柄の転換社債等への投資制限(約款第22条)

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

(b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(9)信用取引の指図範囲(約款第23条)

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。

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

(13) 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。

(14) 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。

(15) 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。

(16) 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。
- (17)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。
- (18)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。
- (19)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。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

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

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

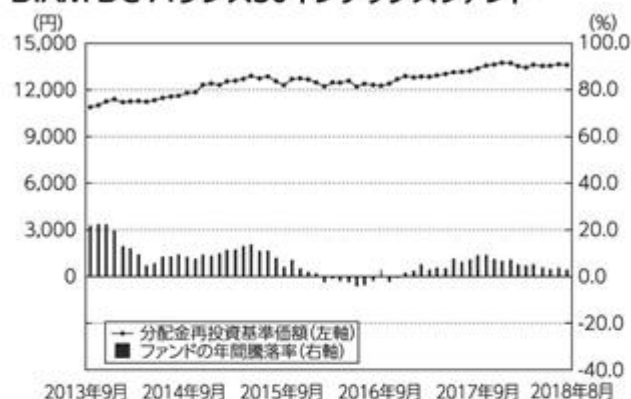


リスク管理体制は2018年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

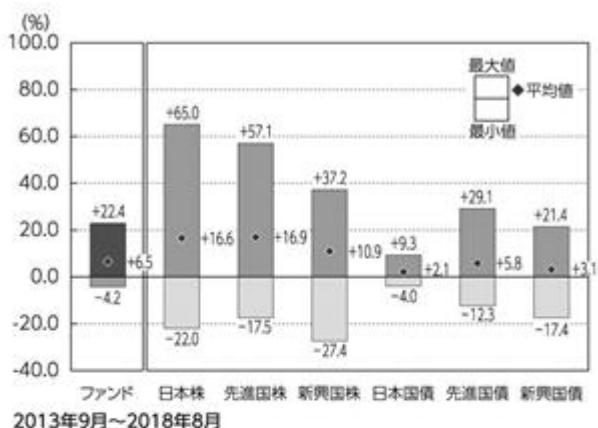
<参考情報>

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

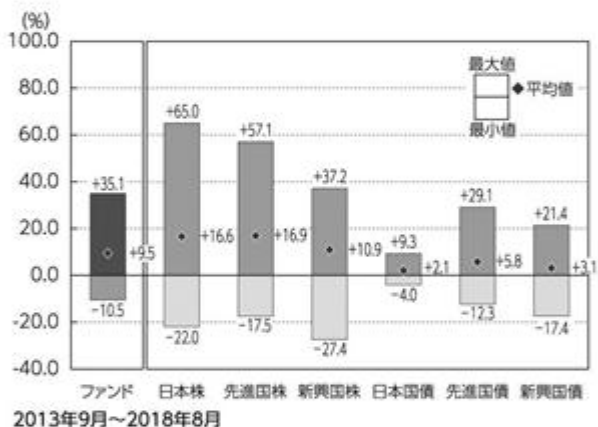
DIAM DC バランス30インデックスファンド



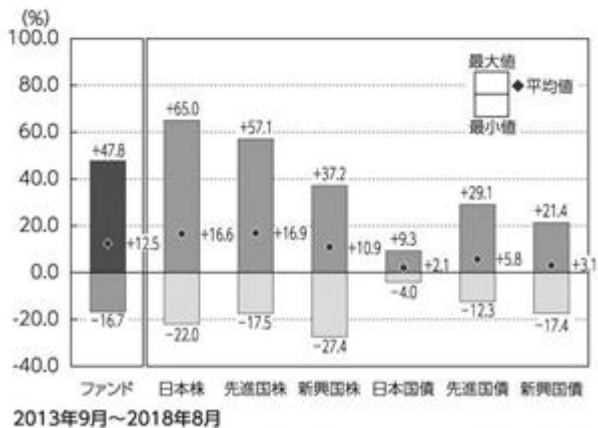
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

ファンド名 ----- 信託報酬 税込（税抜）	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
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、2018年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

平成30年8月31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	4,379,541,560	97.00
内 日本	4,379,541,560	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	135,423,993	3.00
純資産総額	4,514,965,553	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30年8月31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	8,438,856,857	97.00
内 日本	8,438,856,857	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	260,849,566	3.00
純資産総額	8,699,706,423	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30年8月31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	5,616,368,681	97.00
内 日本	5,616,368,681	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	173,469,041	3.00
純資産総額	5,789,837,722	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30年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	287,453,418,570	95.86
内 日本	287,453,418,570	95.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,403,112,143	4.14
純資産総額	299,856,530,713	100.00

その他資産の投資状況

平成30年8月31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）	11,995,820,000	4.00
内 日本	11,995,820,000	4.00

（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。

（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30年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	283,854,610,400	83.22
内 日本	283,854,610,400	83.22
地方債証券	22,208,024,720	6.51
内 日本	22,208,024,720	6.51
特殊債券	17,018,209,482	4.99
内 日本	17,018,209,482	4.99
社債券	15,048,669,410	4.41
内 日本	14,648,845,410	4.29
内 オランダ	200,788,000	0.06
内 フランス	199,036,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,965,324,681	0.87
純資産総額	341,094,838,693	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30年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	307,899,563,635	96.10
内 アメリカ	198,688,736,151	62.01
内 イギリス	19,464,588,317	6.08
内 フランス	11,949,057,458	3.73
内 カナダ	11,771,742,132	3.67
内 ドイツ	11,490,869,773	3.59
内 スイス	10,814,723,332	3.38
内 オーストラリア	7,497,933,368	2.34
内 オランダ	5,968,162,541	1.86
内 アイルランド	4,651,701,167	1.45
内 スペイン	3,546,730,409	1.11
内 スウェーデン	3,147,700,952	0.98
内 香港	2,882,294,130	0.90
内 イタリア	2,171,505,365	0.68
内 デンマーク	2,094,852,390	0.65
内 ジャージー	1,604,516,998	0.50
内 シンガポール	1,403,610,830	0.44

内	バミューダ	1,402,816,022	0.44
内	フィンランド	1,272,633,354	0.40
内	ベルギー	1,250,512,642	0.39
内	ノルウェー	894,653,672	0.28
内	ケイマン諸島	764,548,289	0.24
内	オランダ領キュラソー	736,704,255	0.23
内	イスラエル	662,320,137	0.21
内	ルクセンブルグ	395,669,115	0.12
内	オーストリア	273,826,834	0.09
内	ニュージーランド	270,705,919	0.08
内	パナマ	216,908,096	0.07
内	ポルトガル	203,169,575	0.06
内	リベリア	167,804,177	0.05
内	イギリス領バージン諸島	97,221,097	0.03
内	パプアニューギニア	68,123,476	0.02
内	マン島	57,766,176	0.02
内	モーリシャス	15,455,486	0.00
投資信託受益証券		746,472,883	0.23
	内 オーストラリア	608,568,224	0.19
	内 シンガポール	137,904,659	0.04
投資証券		6,787,379,474	2.12
	内 アメリカ	5,862,437,196	1.83
	内 イギリス	263,726,556	0.08
	内 オランダ	243,970,121	0.08
	内 フランス	190,526,083	0.06
	内 香港	180,339,273	0.06
	内 カナダ	46,380,245	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,957,149,949	1.55
純資産総額		320,390,565,941	100.00

その他資産の投資状況

平成30年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	491,617,840	0.15
-	491,617,840	0.15
株価指数先物取引（買建）	4,352,139,750	1.36
内 アメリカ	3,029,583,528	0.95
内 ドイツ	746,576,544	0.23
内 イギリス	282,173,892	0.09
内 カナダ	166,392,996	0.05
内 オーストラリア	127,412,790	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）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30年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	200,338,605,942	96.97
内 アメリカ	91,109,205,043	44.10
内 フランス	20,190,556,263	9.77
内 イタリア	17,948,978,540	8.69
内 ドイツ	13,741,035,842	6.65
内 イギリス	13,134,783,023	6.36
内 スペイン	12,627,072,306	6.11
内 ベルギー	5,201,525,727	2.52
内 オランダ	4,389,975,378	2.12
内 オーストラリア	4,070,547,743	1.97
内 カナダ	3,958,388,869	1.92
内 オーストリア	3,413,422,528	1.65
内 メキシコ	1,592,324,061	0.77
内 アイルランド	1,564,473,608	0.76
内 フィンランド	1,275,853,805	0.62
内 ポーランド	1,237,424,908	0.60
内 デンマーク	1,122,430,137	0.54
内 南アフリカ	1,070,453,669	0.52
内 マレーシア	901,932,909	0.44
内 シンガポール	744,517,049	0.36
内 スウェーデン	667,524,186	0.32
内 ノルウェー	376,180,348	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,253,033,633	3.03
純資産総額	206,591,639,575	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

平成30年8月31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	1,826,565,537	1.2873 2,351,475,178	1.2831 2,343,666,240	- -	51.91%
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	340,335,442	2.6790 911,772,471	2.6523 902,671,692	- -	19.99%
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	374,417,197	1.7780 665,718,595	1.8047 675,710,715	- -	14.97%
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	125,278,743	3.3810 423,576,231	3.6518 457,492,913	- -	10.13%

(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30年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

平成30年8月31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	1,146,497,591	2.6802 3,072,900,225	2.6523 3,040,855,560	- -	34.95%
2	国内債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,022,563,797	1.2873 2,603,833,329	1.2831 2,595,151,607	- -	29.83%
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	818,524,847	1.7779 1,455,334,245	1.8047 1,477,191,791	- -	16.98%
4	外国株式パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	363,014,924	3.3815 1,227,534,981	3.6518 1,325,657,899	- -	15.24%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

DIAM DC バランス70インデックスファンド

平成30年8月31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	1,084,389,052	2.6806 2,906,863,532	2.6523 2,876,125,082	- -	49.68%
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	323,789,931	3.3809 1,094,722,667	3.6518 1,182,416,070	- -	20.42%
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	640,824,377	1.7782 1,139,546,214	1.8047 1,156,495,753	- -	19.97%
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	312,782,929	1.2873 402,662,760	1.2831 401,331,776	- -	6.93%

(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30年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(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30年8月31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	1,411,200	7,353.87 10,377,786,345	6,930.00 9,779,616,000	- -	3.26%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,972,900	789.07 6,291,203,280	670.80 5,348,221,320	- -	1.78%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	515,800	8,663.60 4,468,688,360	10,300.00 5,312,740,000	- -	1.77%
4	ソニー 日本	株式 電気機器	777,600	5,411.76 4,208,186,809	6,348.00 4,936,204,800	- -	1.65%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	817,500	4,995.06 4,083,466,930	4,950.00 4,046,625,000	- -	1.35%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	866,800	4,791.32 4,153,117,332	4,381.00 3,797,450,800	- -	1.27%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	57,000	64,031.51 3,649,796,094	62,890.00 3,584,730,000	- -	1.20%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,044,500	3,838.03 4,008,829,431	3,292.00 3,438,494,000	- -	1.15%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	15,556,900	199.50 3,103,658,490	195.10 3,035,151,190	- -	1.01%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,003,900	2,674.23 2,684,662,699	2,941.00 2,952,469,900	- -	0.98%
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	856,100	2,477.02 2,120,583,308	3,387.00 2,899,610,700	- -	0.97%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	71,500	44,902.63 3,210,538,396	40,160.00 2,871,440,000	- -	0.96%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	802,300	2,958.44 2,373,562,664	3,171.00 2,544,093,300	- -	0.85%
14	花王 日本	株式 化学	285,500	7,687.57 2,194,801,419	8,625.00 2,462,437,500	- -	0.82%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	110,300	27,144.55 2,994,044,085	21,775.00 2,401,782,500	- -	0.80%
16	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	817,600	2,668.82 2,182,031,540	2,885.00 2,358,776,000	- -	0.79%
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	121,800	15,196.94 1,850,987,684	19,185.00 2,336,733,000	- -	0.78%
18	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	104,000	20,244.20 2,105,397,760	22,315.00 2,320,760,000	- -	0.77%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	431,400	4,965.41 2,142,078,650	5,237.00 2,259,241,800	- -	0.75%
20	日本電産 日本	株式 電気機器	139,700	16,216.97 2,265,510,748	16,105.00 2,249,868,500	- -	0.75%

21	ダイキン工業 日本	株式 機械	158,500	12,218.86 1,936,690,552	14,170.00 2,245,945,000	- -	0.75%
22	キヤノン 日本	株式 電気機器	624,600	4,052.58 2,531,245,392	3,563.00 2,225,449,800	- -	0.74%
23	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	479,200	4,463.47 2,138,896,768	4,525.00 2,168,380,000	- -	0.72%
24	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,141,800	1,468.95 1,677,252,355	1,882.00 2,148,867,600	- -	0.72%
25	信越化学工業 日本	株式 化学	200,400	11,520.24 2,308,656,944	10,425.00 2,089,170,000	- -	0.70%
26	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	206,400	10,438.62 2,154,533,010	10,055.00 2,075,352,000	- -	0.69%
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,787,000	811.45 2,261,513,650	725.50 2,021,968,500	- -	0.67%
28	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	427,800	5,994.30 2,564,363,530	4,653.00 1,990,553,400	- -	0.66%
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	672,700	3,289.46 2,212,826,210	2,922.00 1,965,629,400	- -	0.66%
30	資生堂 日本	株式 化学	230,600	5,713.92 1,317,632,225	7,824.00 1,804,214,400	- -	0.60%

(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30年8月31日現在

種類	投資比率
株式	95.86%
合計	95.86%

(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30年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.27%
輸送用機器		8.22%
情報・通信業		7.61%
化学		7.22%
銀行業		6.55%
機械		4.99%
医薬品		4.72%
小売業		4.60%
卸売業		4.59%
サービス業		4.54%
陸運業		4.04%
食料品		3.83%
建設業		2.79%
不動産業		2.23%
保険業		2.22%
その他製品		2.04%
精密機器		1.71%
電気・ガス業		1.63%
その他金融業		1.15%
鉄鋼		1.01%
ガラス・土石製品		0.94%
証券、商品先物取引業		0.87%
石油・石炭製品		0.82%
非鉄金属		0.78%
ゴム製品		0.70%
繊維製品		0.60%
金属製品		0.59%
空運業		0.54%
鉱業		0.29%
パルプ・紙		0.28%
海運業	0.19%	
倉庫・運輸関連業	0.17%	
水産・農林業	0.10%	
合計		95.86%

(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30年8月31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	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.28 4,011,400,000	0.100000 2019/12/20	1.18%
2	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.16 3,198,092,000	102.85 3,188,474,000	0.400000 2025/9/20	0.93%
3	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.17 3,198,423,500	102.82 3,187,482,000	0.400000 2025/6/20	0.93%
4	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.15 3,125,820,600	0.300000 2025/12/20	0.92%
5	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	100.58 3,118,239,500	100.09 3,102,914,000	0.100000 2028/3/20	0.91%
6	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.64 3,019,320,000	0.100000 2021/12/20	0.89%
7	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	100.64 3,019,200,000	0.100000 2026/3/20	0.89%
8	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	100.58 3,017,490,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
9	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.57 3,017,220,000	0.100000 2021/6/20	0.88%
10	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.53 3,016,050,000	0.100000 2021/3/20	0.88%
11	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.44 3,013,230,000	0.100000 2020/9/20	0.88%
12	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.42 3,012,750,000	0.100000 2027/3/20	0.88%
13	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.47 3,014,100,000	100.33 3,010,170,000	0.100000 2020/3/20	0.88%
14	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	104.00 3,016,047,000	103.57 3,003,588,000	0.800000 2022/9/20	0.88%
15	347回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	100.51 2,914,810,000	100.34 2,910,121,000	0.100000 2027/6/20	0.85%

16	348回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.47 2,913,805,000	100.26 2,907,801,000	0.100000 2027/9/20	0.85%
17	133回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,860,000,000	100.89 2,885,679,000	100.75 2,881,478,600	0.100000 2022/9/20	0.84%
18	344回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	100.68 2,819,100,000	100.56 2,815,708,000	0.100000 2026/9/20	0.83%
19	338回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,650,000,000	103.10 2,732,346,000	102.78 2,723,802,500	0.400000 2025/3/20	0.80%
20	345回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.61 2,716,610,000	100.49 2,713,392,000	0.100000 2026/12/20	0.80%
21	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,600,000,000	104.11 2,706,919,000	103.71 2,696,642,000	0.600000 2024/6/20	0.79%
22	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.99 2,599,920,000	103.61 2,590,300,000	0.600000 2024/3/20	0.76%
23	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	102.64 2,566,200,000	101.84 2,546,075,000	1.300000 2019/12/20	0.75%
24	126回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.59 2,514,950,000	100.49 2,512,350,000	0.100000 2020/12/20	0.74%
25	335回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,350,000,000	103.58 2,434,192,000	103.24 2,426,163,500	0.500000 2024/9/20	0.71%
26	329回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,270,000,000	104.73 2,377,375,100	104.21 2,365,567,000	0.800000 2023/6/20	0.69%
27	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,300,000,000	102.89 2,366,654,000	102.26 2,352,118,000	1.000000 2020/9/20	0.69%
28	349回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,310,000,000	100.48 2,321,187,700	100.18 2,314,250,400	0.100000 2027/12/20	0.68%
29	332回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,210,000,000	103.92 2,296,693,300	103.50 2,287,482,600	0.600000 2023/12/20	0.67%
30	312回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,200,000,000	103.74 2,282,456,000	103.01 2,266,330,000	1.200000 2020/12/20	0.66%

（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30年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.22%
地方債証券	6.51%
特殊債券	4.99%
社債券	4.41%
合計	99.13%

(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30年8月31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	376,469	18,639.60 7,017,232,829	24,991.83 9,408,649,925	- -	2.94%
2	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,466	161,501.38 4,920,301,202	222,384.32 6,775,160,778	- -	2.11%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	542,300	10,103.15 5,478,938,792	12,433.16 6,742,506,464	- -	2.10%
4	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	177,316	19,945.37 3,536,634,212	19,728.69 3,498,213,885	- -	1.09%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,725	12,779.37 3,255,227,206	12,793.00 3,258,697,281	- -	1.02%
6	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	23,300	119,018.14 2,773,122,738	137,616.66 3,206,468,345	- -	1.00%
7	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	22,200	119,347.68 2,649,518,511	139,318.10 3,092,861,962	- -	0.97%
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	198,834	14,408.76 2,864,952,173	14,987.54 2,980,033,920	- -	0.93%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	315,280	8,495.50 2,678,461,901	8,941.44 2,819,057,392	- -	0.88%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	722,337	3,554.52 2,567,564,232	3,443.97 2,487,707,391	- -	0.78%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	348,201	6,609.70 2,301,504,189	6,492.56 2,260,718,530	- -	0.71%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	94,579	22,304.93 2,109,578,475	23,294.83 2,203,202,199	- -	0.69%
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	134,179	13,428.17 1,801,779,551	16,296.94 2,186,707,702	- -	0.68%
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	231,295	8,856.73 2,048,518,542	9,315.93 2,154,728,954	- -	0.67%

15	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	71,700	25,427.59 1,823,158,869	29,807.39 2,137,190,106	- -	0.67%
16	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	440,510	3,917.62 1,725,751,592	4,608.98 2,030,306,184	- -	0.63%
17	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	540,606	3,906.14 2,111,683,245	3,549.47 1,918,868,887	- -	0.60%
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,514	20,512.84 1,774,648,205	22,129.81 1,914,538,866	- -	0.60%
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	141,261	12,616.96 1,782,285,414	13,306.09 1,879,632,794	- -	0.59%
20	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	357,260	4,683.81 1,673,339,669	5,236.47 1,870,784,487	- -	0.58%
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	306,879	5,488.77 1,684,389,070	6,080.53 1,865,988,500	- -	0.58%
22	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	348,219	5,063.24 1,763,118,440	5,357.53 1,865,595,271	- -	0.58%
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	186,535	8,959.78 1,671,313,744	9,263.51 1,727,969,695	- -	0.54%
24	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	69,052	19,174.43 1,324,033,372	23,744.62 1,639,614,052	- -	0.51%
25	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	41,469	38,416.10 1,593,077,296	38,526.71 1,597,664,302	- -	0.50%
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	201,289	6,096.39 1,227,136,586	7,612.05 1,532,222,415	- -	0.48%
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	164,138	9,098.83 1,493,464,990	9,325.10 1,530,604,905	- -	0.48%
28	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	190,608	8,513.85 1,622,808,257	7,936.34 1,512,731,343	- -	0.47%
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	298,559	4,895.55 1,461,612,674	4,992.14 1,490,450,416	- -	0.47%
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	52,431	25,526.69 1,338,389,970	27,722.98 1,453,544,088	- -	0.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
株式	96.10%
投資信託受益証券	0.23%
投資証券	2.12%
合計	98.45%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.62%
石油・ガス・消耗燃料		6.29%
医薬品		5.34%
ソフトウェア		4.83%
保険		3.70%
情報技術サービス		3.49%
インターネットソフトウェア・サービス		3.48%
コンピュータ・周辺機器		3.27%
半導体・半導体製造装置		2.98%
インターネット販売・通信販売		2.87%
資本市場		2.86%
化学		2.47%
ヘルスケア機器・用品		2.43%
航空宇宙・防衛		2.28%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.27%
バイオテクノロジー		2.17%
各種電気通信サービス		1.98%
メディア		1.95%
飲料		1.83%
食品		1.75%
電力		1.74%
ホテル・レストラン・レジャー		1.73%
専門小売り		1.63%
機械		1.54%
食品・生活必需品小売り		1.51%
コングロマリット		1.46%
繊維・アパレル・贅沢品		1.40%
金属・鉱業		1.35%
家庭用品		1.15%
陸運・鉄道		1.03%
タバコ		1.00%
各種金融サービス		0.96%
通信機器		0.95%
総合公益事業		0.95%
自動車		0.88%
電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.70%
専門サービス		0.68%

ライフサイエンス・ツール/サービス	0.67%
航空貨物・物流サービス	0.60%
不動産管理・開発	0.51%
電子装置・機器・部品	0.50%
エネルギー設備・サービス	0.49%
消費者金融	0.48%
商業サービス・用品	0.43%
複合小売り	0.42%
家庭用耐久財	0.39%
自動車部品	0.38%
建設関連製品	0.37%
建設・土木	0.35%
商社・流通業	0.34%
無線通信サービス	0.30%
建設資材	0.29%
容器・包装	0.28%
運送インフラ	0.19%
ガス	0.15%
旅客航空輸送業	0.14%
紙製品・林産品	0.12%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
販売	0.07%
水道	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07%
海運業	0.06%
レジャー用品	0.06%
各種消費者サービス	0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	96.10%

(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30年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,832,490,000	100.65 1,844,437,834	99.95 1,831,702,029	2.625000 2020/8/15	0.89%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,699,218,000	102.61 1,743,686,535	101.47 1,724,230,488	3.625000 2020/2/15	0.83%
3	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,709,213,400	97.89 1,673,285,734	97.58 1,667,935,896	2.000000 2022/2/15	0.81%
4	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,665,900,000	98.41 1,639,478,826	98.58 1,642,277,538	1.250000 2019/10/31	0.79%
5	US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ	国債証券	1,665,900,000	98.12 1,634,714,352	98.42 1,639,662,075	1.000000 2019/9/30	0.79%
6	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,554,840,000	102.59 1,595,157,001	101.42 1,577,058,663	3.500000 2020/5/15	0.76%
7	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,499,310,000	98.22 1,472,652,268	98.55 1,477,689,949	1.000000 2019/8/31	0.72%
8	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,430,452,800	98.43 1,408,094,822	98.06 1,402,845,060	2.125000 2021/12/31	0.68%
9	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,388,250,000	96.21 1,335,635,325	96.16 1,334,996,730	1.750000 2022/9/30	0.65%
10	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,332,720,000	98.51 1,312,875,799	98.14 1,307,984,716	2.000000 2021/5/31	0.63%
11	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,332,720,000	98.01 1,306,265,508	97.97 1,305,745,747	1.375000 2020/4/30	0.63%
12	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証券	1,332,720,000	96.83 1,290,539,412	96.71 1,288,873,512	1.875000 2022/8/31	0.62%
13	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,277,190,000	99.41 1,269,705,666	98.89 1,263,115,366	2.250000 2021/3/31	0.61%
14	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,299,402,000	96.79 1,257,769,159	96.63 1,255,742,092	1.750000 2022/3/31	0.61%
15	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,288,296,000	96.67 1,245,511,689	96.52 1,243,501,948	1.750000 2022/5/15	0.60%
16	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,221,660,000	98.95 1,208,918,086	98.66 1,205,289,756	1.875000 2020/6/30	0.58%
17	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,244,982,600	96.34 1,199,498,754	96.60 1,202,765,240	1.375000 2021/4/30	0.58%
18	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,221,660,000	98.74 1,206,291,517	98.32 1,201,184,978	2.125000 2021/8/15	0.58%
19	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,199,448,000	98.10 1,176,670,482	98.17 1,177,606,051	1.250000 2020/1/31	0.57%
20	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,227,213,000	95.67 1,174,188,242	95.54 1,172,602,021	1.625000 2022/11/15	0.57%
21	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	1,166,130,000	98.96 1,154,002,248	98.53 1,149,092,840	2.000000 2020/11/30	0.56%
22	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,177,236,000	96.53 1,136,491,862	96.84 1,140,070,659	2.250000 2024/11/15	0.55%
23	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,155,024,000	98.12 1,133,401,950	97.80 1,129,659,672	2.000000 2021/11/15	0.55%

24	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,110,600,000	100.15 1,112,332,536	99.92 1,109,811,474	2.750000 2023/11/15	0.54%
25	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,110,600,000	98.62 1,095,329,250	98.25 1,091,164,500	2.125000 2021/9/30	0.53%
26	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,010,568,000	107.59 1,087,310,533	106.52 1,076,467,139	2.500000 2020/10/25	0.52%
27	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	1,110,600,000	95.85 1,064,589,319	95.85 1,064,610,054	1.750000 2023/1/31	0.52%
28	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	1,108,378,800	95.63 1,059,956,464	95.78 1,061,616,298	2.125000 2025/5/15	0.51%
29	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,043,964,000	99.99 1,043,880,482	99.86 1,042,575,527	2.750000 2024/2/15	0.50%
30	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,055,070,000	98.05 1,034,538,337	97.76 1,031,489,185	2.125000 2022/6/30	0.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.97%
合計	96.97%

(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30年8月31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 3009月	買建	692	11,878,899,208	11,995,820,000	4.00%

(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) 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30年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2018年09月	売建	3,200,000	355,292,800	355,296,000	0.11%
		ユーロ売/円買2018年09月	売建	612,000	79,291,944	79,290,720	0.02%
		イギリス・ポンド売/円買2018年09月	売建	188,000	27,173,896	27,173,520	0.01%
		カナダ・ドル売/円買2018年09月	売建	208,000	17,773,184	17,773,600	0.01%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年09月	売建	150,000	12,084,750	12,084,000	0.00%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep 18	買建	188	2,966,461,188	3,029,583,528	0.95%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep 18	買建	168	750,569,583	746,576,544	0.23%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep 18	買建	26	286,183,986	282,173,892	0.09%
	モントルオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep 18	買建	10	166,507,525	166,392,996	0.05%
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep 18	買建	10	125,837,255	127,412,790	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) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成30年8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
第11計算期間末 (平成30年2月26日)	4,448	4,448	1.3537	1.3537
平成29年8月末日	4,393	-	1.3215	-
9月末日	4,420	-	1.3386	-
10月末日	4,485	-	1.3563	-
11月末日	4,489	-	1.3631	-
12月末日	4,523	-	1.3743	-
平成30年1月末日	4,513	-	1.3724	-
2月末日	4,470	-	1.3534	-
3月末日	4,442	-	1.3444	-
4月末日	4,488	-	1.3615	-
5月末日	4,473	-	1.3538	-
6月末日	4,498	-	1.3558	-
7月末日	4,549	-	1.3646	-
8月末日	4,514	-	1.3607	-

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
第11計算期間末 (平成30年2月26日)	8,547	8,547	1.3878	1.3878
平成29年8月末日	8,264	-	1.3308	-
9月末日	8,425	-	1.3611	-
10月末日	8,619	-	1.3920	-
11月末日	8,682	-	1.4019	-
12月末日	8,750	-	1.4190	-
平成30年1月末日	8,771	-	1.4201	-
2月末日	8,571	-	1.3869	-
3月末日	8,467	-	1.3700	-
4月末日	8,610	-	1.3984	-
5月末日	8,589	-	1.3860	-
6月末日	8,605	-	1.3871	-
7月末日	8,723	-	1.4023	-
8月末日	8,699	-	1.3993	-

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
第11計算期間末 (平成30年2月26日)	5,654	5,654	1.3935	1.3935
平成29年8月末日	5,292	-	1.3137	-
9月末日	5,441	-	1.3567	-
10月末日	5,619	-	1.3998	-
11月末日	5,660	-	1.4125	-
12月末日	5,793	-	1.4354	-
平成30年1月末日	5,827	-	1.4388	-
2月末日	5,668	-	1.3919	-
3月末日	5,562	-	1.3676	-
4月末日	5,703	-	1.4071	-
5月末日	5,658	-	1.3896	-
6月末日	5,688	-	1.3900	-
7月末日	5,777	-	1.4116	-
8月末日	5,789	-	1.4097	-

【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
第11計算期間	0.0000
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	-

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
第11計算期間	0.0000
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	-

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
第11計算期間	0.0000
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	-

【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
第11計算期間	5.4
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	0.1

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

	収益率(%)
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
第11計算期間	8.6
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	0.2

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

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
第11計算期間	11.9
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	0.2

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

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
第11計算期間	334,079,343	310,386,979
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	151,614,315	122,626,085

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

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
第11計算期間	505,249,804	478,772,270
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	218,438,558	168,163,030

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

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
第11計算期間	477,082,367	388,424,861
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	181,987,330	143,866,855

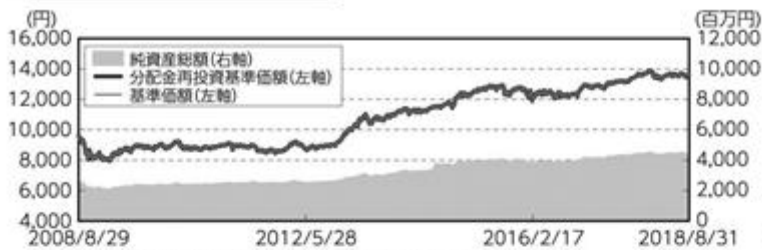
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2018年8月31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 (2008年8月29日～2018年8月31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
第11期	(2018.02.26)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

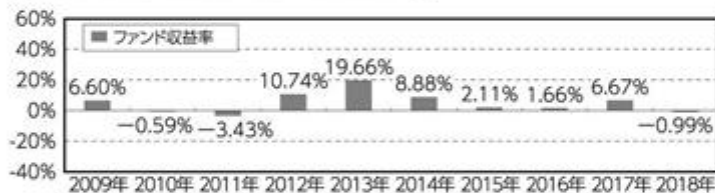
主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	51.91%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.99%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.97%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.13%

※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。

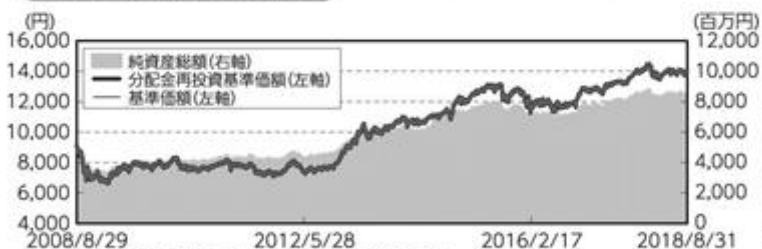
年間収益率の推移(暦年ベース)



※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。
 ※2018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 (2008年8月29日～2018年8月31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
第11期	(2018.02.26)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

○掲載データ等は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:2018年8月31日

主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	34.95%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	29.83%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.98%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.24%

※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。
※2018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70インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (2008年8月29日～2018年8月31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
第11期	(2018.02.26)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	49.68%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.42%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.97%
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.93%

※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。
※2018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:2018年8月31日

各マザーファンドの主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.26%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.78%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.77%
4	ソニー	株式	日本	電気機器	1.65%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.35%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.94%
2	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.11%
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.10%
4	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	1.09%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.02%

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.18%
2	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	0.93%
3	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.93%
4	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.92%
5	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	0.91%

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.89%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.83%
3	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.81%
4	US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	アメリカ	1.250000	2019/10/31	0.79%
5	US T N/B 1.0 09/30/19	国債証券	アメリカ	1.000000	2019/9/30	0.79%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.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 <ul style="list-style-type: none"> ・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】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は2006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

- 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。
- 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。
- 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てします。)に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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11期計算期間(平成29年2月28日から平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	130,902,588	151,104,450
親投資信託受益証券	4,065,657,408	4,315,539,264
未収入金	58,000	-
流動資産合計	4,196,617,996	4,466,643,714
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	122,345	12,351,017
未払受託者報酬	673,488	733,222
未払委託者報酬	4,714,763	5,132,776
その他未払費用	100,952	109,891
流動負債合計	5,611,548	18,326,906
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	1,326,471,331	1,328,163,695
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	928,535,117	1,162,153,113
(分配準備積立金)	776,882,879	913,935,328
元本等合計	4,191,006,448	4,448,316,808
純資産合計		
負債純資産合計		
	4,196,617,996	4,466,643,714

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自	平成28年2月26日 平成29年2月27日	自	平成29年2月28日 平成30年2月26日
営業収益				
受取利息		133		75
有価証券売買等損益		220,228,026		239,036,856
営業収益合計		220,228,159		239,036,931
営業費用				
支払利息		81,341		98,351
受託者報酬		1,311,486		1,414,350
委託者報酬		9,181,089		9,900,895
その他費用		197,716		211,975
営業費用合計		10,771,632		11,625,571
営業利益又は営業損失()		209,456,527		227,411,360
経常利益又は経常損失()		209,456,527		227,411,360
当期純利益又は当期純損失()		209,456,527		227,411,360
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		5,043,554		15,210,704
期首剰余金又は期首欠損金()		697,462,499		928,535,117
剰余金増加額又は欠損金減少額		68,259,627		110,260,285
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		68,259,627		110,260,285
剰余金減少額又は欠損金増加額		41,599,982		88,842,945
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		41,599,982		88,842,945
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		928,535,117		1,162,153,113

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年2月27日、当計算期間末日を平成30年2月26日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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	3,175,190,384円 275,951,706円 188,670,759円	3,262,471,331円 334,079,343円 310,386,979円
2. 受益権の総数	3,262,471,331口	3,286,163,695口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日	第11期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(61,008,222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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(63,667,549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(143,280,746円)、信託約款に規定される収益調整金(386,184,072円)及び分配準備積立金(706,987,033円)より分配対象収益は1,300,119,400円(1万口当たり3,956.34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10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日	第11期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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	209,940,571	214,023,576
合計	209,940,571	214,023,576

(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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額	1.2846円	1.3537円
(1万口当たり純資産額)	(12,846円)	(13,537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30年2月26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	329,271,189	883,072,401	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,822,404,385	2,346,163,405	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	128,651,065	435,033,576	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	366,252,324	651,269,882	
親投資信託受益証券 合計		2,646,578,963	4,315,539,264	
合計		2,646,578,963	4,315,539,264	

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11期計算期間(平成29年2月28日から平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	249,566,663	271,705,995
親投資信託受益証券	7,600,308,363	8,294,702,286
未収入金	-	3,399,000
流動資産合計	7,849,875,026	8,569,807,281
資産合計	7,849,875,026	8,569,807,281
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,838,487	9,415,129
未払受託者報酬	1,247,820	1,409,261
未払委託者報酬	9,982,954	11,274,429
その他未払費用	187,087	211,302
流動負債合計	15,256,348	22,310,121
負債合計	15,256,348	22,310,121
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,132,368,284	1 6,158,845,818
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,702,250,394	2,388,651,342
(分配準備積立金)	1,834,005,540	2,308,810,975
元本等合計	7,834,618,678	8,547,497,160
純資産合計	7,834,618,678	8,547,497,160
負債純資産合計	7,849,875,026	8,569,807,281

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自	平成28年2月26日 平成29年2月27日	自	平成29年2月28日 平成30年2月26日
営業収益				
受取利息		246		141
有価証券売買等損益		695,220,542		705,264,923
営業収益合計		695,220,788		705,265,064
営業費用				
支払利息		149,388		186,452
受託者報酬		2,415,499		2,689,119
委託者報酬		19,324,678		21,513,672
その他費用		364,263		403,188
営業費用合計		22,253,828		24,792,431
営業利益又は営業損失()		672,966,960		680,472,633
経常利益又は経常損失()		672,966,960		680,472,633
当期純利益又は当期純損失()		672,966,960		680,472,633
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()		17,299,980		35,905,939
期首剰余金又は期首欠損金()		1,022,586,656		1,702,250,394
剰余金増加額又は欠損金減少額		94,245,345		175,675,616
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		94,245,345		175,675,616
剰余金減少額又は欠損金増加額		70,248,587		133,841,362
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		70,248,587		133,841,362
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		1,702,250,394		2,388,651,342

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年2月27日、当計算期間末日を平成30年2月26日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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	6,084,762,586円 463,520,203円 415,914,505円	6,132,368,284円 505,249,804円 478,772,270円
2. 受益権の総数	6,132,368,284口	6,158,845,818口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日	第11期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(141,716,297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(469,890,882円)、信託約款に規定される収益調整金(706,246,269円)及び分配準備積立金(1,697,203,796円)より分配対象収益は3,015,057,244円(1万口当たり4,895.49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10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日	第11期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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	668,863,747	661,657,408
合計	668,863,747	661,657,408

(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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額	1.2776円	1.3878円
(1万口当たり純資産額)	(12,776円)	(13,878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30年2月26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	1,119,268,669	3,001,766,643	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,021,440,802	2,602,402,888	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	385,326,790	1,302,982,540	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	780,311,672	1,387,550,215	
親投資信託受益証券 合計		4,306,347,933	8,294,702,286	
合計		4,306,347,933	8,294,702,286	

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11期計算期間(平成29年2月28日から平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	159,790,089	183,138,674
親投資信託受益証券	4,793,978,582	5,486,023,427
流動資産合計	4,953,768,671	5,669,162,101
資産合計	4,953,768,671	5,669,162,101
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,294,717	4,973,550
未払受託者報酬	776,397	921,759
未払委託者報酬	6,987,924	8,296,232
その他未払費用	116,367	138,182
流動負債合計	10,175,405	14,329,723
負債合計	10,175,405	14,329,723
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,969,283,136	1 4,057,940,642
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	974,310,130	1,596,891,736
(分配準備積立金)	1,262,876,375	1,649,139,440
元本等合計	4,943,593,266	5,654,832,378
純資産合計	4,943,593,266	5,654,832,378
負債純資産合計	4,953,768,671	5,669,162,101

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自	平成28年2月26日 平成29年2月27日	自	平成29年2月28日 平成30年2月26日
営業収益				
受取利息		150		91
有価証券売買等損益		601,083,433		608,068,845
営業収益合計		601,083,583		608,068,936
営業費用				
支払利息		92,430		121,069
受託者報酬		1,481,786		1,734,198
委託者報酬		13,336,670		15,608,601
その他費用		223,381		259,964
営業費用合計		15,134,267		17,723,832
営業利益又は営業損失()		585,949,316		590,345,104
経常利益又は経常損失()		585,949,316		590,345,104
当期純利益又は当期純損失()		585,949,316		590,345,104
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()		19,037,635		35,327,722
期首剰余金又は期首欠損金()		383,257,006		974,310,130
剰余金増加額又は欠損金減少額		52,077,718		164,091,387
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		52,077,718		164,091,387
剰余金減少額又は欠損金増加額		27,936,275		96,527,163
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		27,936,275		96,527,163
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		974,310,130		1,596,891,736

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年2月27日、当計算期間末日を平成30年2月26日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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	3,891,233,122円 358,141,987円 280,091,973円	3,969,283,136円 477,082,367円 388,424,861円
2. 受益権の総数	3,969,283,136口	4,057,940,642口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日	第11期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(104,769,238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(398,282,499円)、信託約款に規定される収益調整金(631,856,405円)及び分配準備積立金(1,146,087,703円)より分配対象収益は2,280,995,845円(1万口当たり5,621.07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10期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日	第11期 自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26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	583,658,914	584,049,732
合計	583,658,914	584,049,732

(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10期 平成29年2月27日現在	第11期 平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額	1.2455円	1.3935円
(1万口当たり純資産額)	(12,455円)	(13,935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30年2月26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	1,054,683,588	2,828,555,914	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	317,189,866	408,350,233	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	332,068,806	1,122,890,667	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	633,352,049	1,126,226,613	
親投資信託受益証券 合計		2,337,294,309	5,486,023,427	
合計		2,337,294,309	5,486,023,427	

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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,770,713,779	4,427,951,479
株式	2	280,719,581,820	287,790,562,310
派生商品評価勘定		746,900	55,293,624
未収配当金		549,786,376	501,353,866
前払金		-	66,515,000
流動資産合計		287,040,828,875	292,841,676,279
資産合計		287,040,828,875	292,841,676,279
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		39,445,944	68,935,500
前受金		2,090,100	-
未払解約金		1,869,829,000	17,609,000
流動負債合計		1,911,365,044	86,544,500
負債合計		1,911,365,044	86,544,500
純資産の部			
元本等			
元本	1	125,576,804,116	109,160,728,872
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		159,552,659,715	183,594,402,907
元本等合計		285,129,463,831	292,755,131,779
純資産合計		285,129,463,831	292,755,131,779
負債純資産合計		287,040,828,875	292,841,676,279

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29年2月27日現在	平成30年2月26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	142,969,149,329円	125,576,804,116円
同期中追加設定元本額	31,828,067,138円	22,269,571,713円
同期中一部解約元本額	49,220,412,351円	38,685,646,957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	6,296,121,588円	9,036,126,148円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,669,207,881円	1,870,405,653円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,012,187円	4,013,213円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,048,308円	9,146,230円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	23,525,414円	16,684,426円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	14,468,349円	20,360,996円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,463,058円	15,401,869円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,708,962円	11,840,415円
たわらノーロード TOPIX	- 円	149,657,723円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	14,607,726円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	153,495円

たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	1,393,312円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	4,683,156円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	- 円	14,974円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	237,595円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	811,003円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	550,423円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	1,175,545円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	41,547円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	37,941円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	338,731円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	364,996円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	978,271円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	36,554,930,032円	36,793,469,763円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	816,514,087円	765,964,168円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	2,899,738,685円	2,673,224,321円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	2,949,143,393円	2,791,900,084円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	382,332,675円	329,271,189円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,242,482,131円	1,119,268,669円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,100,776,018円	1,054,683,588円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	59,530,357円	46,713,000円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,318,320,660円	1,161,767,467円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	28,435,219円	24,024,004円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国10)	35,217,725円	39,477,748円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国20)	68,814,338円	97,811,246円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国30)	140,148,670円	189,483,338円
投資のソムリエ	1,146,020,551円	1,008,877,316円
クルーズコントロール	1,099,018,981円	201,841,066円
投資のソムリエ<DC年 金>	36,165,399円	69,455,867円
DIAM 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	114,712,450円	147,946,865円
DIAM DC バラン ス・F(成長型)	122,053,447円	205,022,193円
クルーズコントロール< DC年金>	405,651円	74,862円
DIAMコア資産設計 ファンド(堅実型)	10,061,702円	1,239,139円
DIAMコア資産設計 ファンド(積極型)	32,908,087円	3,802,586円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	13,983,088円	22,937,313円
ダイナミック・ナビゲー ション	1,427,701円	726,871円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド	75,809,247円	355,728,259円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー204 5)	- 円	668,403円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー205 5)	- 円	513,926円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド(DC)	- 円	108,503円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー203 5)	- 円	1,237,938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)	313,751,716円	- 円
DIAMワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	86,560,257円	70,701,371円
DIAMグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	209,554,515円	132,883,832円

D I A Mグローバル・バ ランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	389,570,983円	292,283,119円
D I A M国際分散バラ ンスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	26,792,261円	16,233,373円
D I A M国際分散バラ ンスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	117,532,264円	70,408,344円
D I A M国内重視バラ ンスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	29,346,280円	17,521,498円
D I A M国内重視バラ ンスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	30,052,812円	21,833,378円
D I A M世界バランス ファンド4 0 V A (適格 機関投資家限定)	831,235,040円	31,638,558円
D I A M世界バランス ファンド5 0 V A (適格 機関投資家限定)	374,549,335円	56,259,704円
D I A Mバランスファン ド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	1,451,571,979円	1,071,953,946円
D I A Mバランスファン ド3 7 . 5 V A (適格機 関投資家限定)	1,289,496,820円	1,013,017,452円
D I A Mバランスファン ド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	3,504,438,578円	2,782,258,327円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A (適格機関投資家限定)	275,194,302円	201,418,412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)	426,211,367円	96,974,567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)	793,276,429円	591,732,801円
D I A M世界アセットバ ランスファンドV A (適 格機関投資家向け)	3,115,298,558円	1,652,857,363円
D I A Mグローバル 私 募ファンド(適格機関投 資家向け)	13,741,300円	10,313,671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)	1,034,605,688円	36,951,217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)	4,854,751,930円	1,108,127,625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)	18,487,572,950円	15,040,555,136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)	674,423,695円	541,254,717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)	2,103,188,596円	1,724,496,050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)	11,713,549,624円	9,829,818,156円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	6,605,415円	519,843円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	81,551円	9,093,798円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	4,672,150円	3,718,064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)	10,473,010,652円	8,747,496,476円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	94,419,937円	70,015,367円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	33,859,295円	27,507,643円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	35,633,726円	18,240,489円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	73,509円	15,682,249円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	119,539円	109,957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)	612,913,713円	426,902,115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)	1,622,373,744円	1,323,021,834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)	2,159,696,264円	1,764,382,103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)	91,571,301円	76,281,237円
計		125,576,804,116円	109,160,728,872円
2 .	受益権の総数	125,576,804,116口	109,160,728,872口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,203,000,000円	株式 3,661,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日	自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	3,265,212,730	4,038,133,010
合計	3,265,212,730	4,038,133,010

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月8日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月8日から平成30年2月26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29年2月27日 現在				平成30年2月26日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	4,740,289,900	-	4,701,690,000	38,599,900	5,334,250,000	-	5,320,705,000	13,545,000
合計	4,740,289,900	-	4,701,690,000	38,599,900	5,334,250,000	-	5,320,705,000	13,545,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額	2.2706円	2.6819円
（1万口当たり純資産額）	(22,706円)	(26,819円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年2月26日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,000	3,915.00	19,575,000	
日本水産	143,000	553.00	79,079,000	
マルハニチロ	24,100	3,220.00	77,602,000	
ハウスイ	900	1,181.00	1,062,900	
カネコ種苗	4,400	1,641.00	7,220,400	
サカタのタネ	18,800	3,675.00	69,090,000	
ホクト	12,900	2,108.00	27,193,200	
ホクリヨウ	1,600	1,414.00	2,262,400	
ショーボンドホールディングス	12,000	7,520.00	90,240,000	
ミライト・ホールディングス	39,100	1,715.00	67,056,500	
タマホーム	9,600	1,175.00	11,280,000	
サンヨーホームズ	2,300	946.00	2,175,800	
ファーストコーポレーション	4,300	1,494.00	6,424,200	
ベステラ	1,800	1,892.00	3,405,600	
インベスターズクラウド	11,200	2,171.00	24,315,200	
住石ホールディングス	33,700	164.00	5,526,800	
日鉄鉱業	3,500	7,150.00	25,025,000	
三井松島産業	6,500	1,530.00	9,945,000	
国際石油開発帝石	617,800	1,337.50	826,307,500	
日本海洋掘削	4,400	2,158.00	9,495,200	
石油資源開発	20,100	2,603.00	52,320,300	
K&Oエナジーグループ	7,500	1,727.00	12,952,500	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	1,178.00	3,534,000	
第一カッター興業	1,300	2,425.00	3,152,500	
安藤・間	97,800	788.00	77,066,400	
東急建設	48,900	1,242.00	60,733,800	
コムシスホールディングス	44,700	2,872.00	128,378,400	
ミサワホーム	10,600	901.00	9,550,600	
ピーアールホールディングス	12,600	478.00	6,022,800	
高松コンストラクショングループ	8,200	2,955.00	24,231,000	
東建コーポレーション	4,700	12,110.00	56,917,000	
ソネック	1,600	788.00	1,260,800	
ヤマウラ	6,000	990.00	5,940,000	
大成建設	126,500	5,440.00	688,160,000	
大林組	381,000	1,220.00	464,820,000	
清水建設	388,600	1,019.00	395,983,400	
飛鳥建設	115,900	185.00	21,441,500	
長谷工コーポレーション	148,300	1,584.00	234,907,200	
松井建設	14,000	835.00	11,690,000	
銭高組	1,800	5,670.00	10,206,000	
鹿島建設	558,000	1,029.00	574,182,000	
不動テトラ	96,500	195.00	18,817,500	
大末建設	4,100	1,049.00	4,300,900	

鉄建建設	7,700	3,150.00	24,255,000
西松建設	29,300	2,740.00	80,282,000
三井住友建設	91,600	638.00	58,440,800
大豊建設	46,000	642.00	29,532,000
前田建設工業	90,600	1,289.00	116,783,400
佐田建設	8,400	488.00	4,099,200
ナカノフドー建設	9,700	619.00	6,004,300
奥村組	20,900	4,710.00	98,439,000
東鉄工業	15,300	3,400.00	52,020,000
イチケン	2,300	2,546.00	5,855,800
浅沼組	45,000	454.00	20,430,000
戸田建設	148,000	818.00	121,064,000
熊谷組	19,900	3,210.00	63,879,000
青木あすなろ建設	8,300	1,018.00	8,449,400
北野建設	27,000	443.00	11,961,000
植木組	1,600	2,714.00	4,342,400
三井ホーム	16,000	722.00	11,552,000
矢作建設工業	17,300	834.00	14,428,200
ピーエス三菱	15,100	860.00	12,986,000
日本ハウスホールディングス	24,300	664.00	16,135,200
大東建託	46,000	18,135.00	834,210,000
新日本建設	15,100	1,064.00	16,066,400
N I P P O	29,400	2,577.00	75,763,800
東亜道路工業	2,600	4,280.00	11,128,000
前田道路	40,000	2,388.00	95,520,000
日本道路	3,400	5,880.00	19,992,000
東亜建設工業	10,300	2,298.00	23,669,400
若築建設	6,900	1,732.00	11,950,800
東洋建設	39,900	552.00	22,024,800
五洋建設	151,100	775.00	117,102,500
世紀東急工業	17,200	732.00	12,590,400
福田組	4,100	6,620.00	27,142,000
日本ドライケミカル	1,500	2,556.00	3,834,000
住友林業	81,200	1,852.00	150,382,400
日本基礎技術	14,200	419.00	5,949,800
日成ビルド工業	18,800	1,301.00	24,458,800
ヤマダ・エスバイエルホーム	58,000	84.00	4,872,000
巴コーポレーション	15,900	615.00	9,778,500
大和ハウス工業	375,300	4,016.00	1,507,204,800
ライト工業	24,500	1,186.00	29,057,000
積水ハウス	413,300	1,922.50	794,569,250
日特建設	10,900	671.00	7,313,900
北陸電気工事	7,100	1,157.00	8,214,700
ユアテック	20,000	855.00	17,100,000
西部電気工業	2,100	2,791.00	5,861,100
四電工	1,900	2,795.00	5,310,500
中電工	16,400	3,065.00	50,266,000
関電工	50,600	1,220.00	61,732,000
きんでん	84,500	1,769.00	149,480,500
東京エネシス	14,400	1,215.00	17,496,000

トーエネック	3,600	3,255.00	11,718,000
住友電設	10,100	2,282.00	23,048,200
日本電設工業	19,500	2,228.00	43,446,000
協和エクシオ	45,600	2,881.00	131,373,600
新日本空調	9,800	1,617.00	15,846,600
日本工営	7,300	2,934.00	21,418,200
N D S	2,000	4,470.00	8,940,000
九電工	25,100	5,050.00	126,755,000
三機工業	26,900	1,194.00	32,118,600
日揮	109,400	2,417.00	264,419,800
中外炉工業	3,900	2,473.00	9,644,700
ヤマト	10,500	829.00	8,704,500
太平電業	8,600	2,636.00	22,669,600
高砂熱学工業	35,000	2,003.00	70,105,000
三晃金属工業	1,400	4,225.00	5,915,000
N E C ネットズエスアイ	12,300	2,807.00	34,526,100
朝日工業社	2,600	3,545.00	9,217,000
明星工業	23,000	786.00	18,078,000
大気社	16,800	3,715.00	62,412,000
ダイダン	8,500	2,416.00	20,536,000
日比谷総合設備	14,200	2,031.00	28,840,200
東芝プラントシステム	27,500	2,110.00	58,025,000
日本製粉	37,700	1,650.00	62,205,000
日清製粉グループ本社	139,300	2,125.00	296,012,500
日東富士製粉	800	4,855.00	3,884,000
昭和産業	10,400	2,810.00	29,224,000
鳥越製粉	10,100	988.00	9,978,800
中部飼料	13,900	2,046.00	28,439,400
フィード・ワン	76,600	247.00	18,920,200
東洋精糖	2,000	1,216.00	2,432,000
日本甜菜製糖	6,500	2,409.00	15,658,500
三井製糖	9,000	4,245.00	38,205,000
塩水港精糖	13,700	287.00	3,931,900
日新製糖	5,400	2,254.00	12,171,600
L I F U L L	37,700	1,115.00	42,035,500
ジェイエイシーリクルートメント	8,700	2,310.00	20,097,000
日本M&Aセンター	37,500	6,840.00	256,500,000
メンバーズ	2,700	1,049.00	2,832,300
中広	1,200	734.00	880,800
タケエイ	11,300	1,276.00	14,418,800
トラスト・テック	4,900	3,325.00	16,292,500
コシダカホールディングス	5,700	7,190.00	40,983,000
パソナグループ	10,300	2,271.00	23,391,300
C D S	3,000	1,344.00	4,032,000
リンクアンドモチベーション	19,900	1,121.00	22,307,900
G C A	12,400	958.00	11,879,200
エス・エム・エス	21,400	4,345.00	92,983,000
パーソルホールディングス	100,000	2,758.00	275,800,000
リニカル	7,000	1,497.00	10,479,000
クックパッド	34,100	602.00	20,528,200

エスクリ	3,800	980.00	3,724,000
アイ・ケイ・ケイ	6,400	766.00	4,902,400
森永製菓	26,700	4,970.00	132,699,000
中村屋	2,900	4,805.00	13,934,500
江崎グリコ	31,800	5,270.00	167,586,000
名糖産業	5,500	1,566.00	8,613,000
井村屋グループ	4,500	4,120.00	18,540,000
不二家	7,300	2,561.00	18,695,300
山崎製パン	93,100	2,150.00	200,165,000
第一屋製パン	2,000	1,141.00	2,282,000
モロゾフ	1,900	6,730.00	12,787,000
亀田製菓	7,100	5,160.00	36,636,000
寿スピリッツ	11,000	6,040.00	66,440,000
カルビー	51,800	3,650.00	189,070,000
森永乳業	22,800	4,325.00	98,610,000
六甲バター	5,700	2,329.00	13,275,300
ヤクルト本社	68,100	7,720.00	525,732,000
明治ホールディングス	75,300	7,940.00	597,882,000
雪印メグミルク	27,400	2,859.00	78,336,600
プリマハム	80,000	646.00	51,680,000
日本ハム	98,000	2,435.00	238,630,000
林兼産業	4,100	838.00	3,435,800
丸大食品	61,000	505.00	30,805,000
S Foods	8,000	4,365.00	34,920,000
伊藤ハム米久ホールディングス	73,300	908.00	66,556,400
学情	5,000	1,623.00	8,115,000
スタジオアリス	5,400	2,691.00	14,531,400
シミックホールディングス	6,000	2,656.00	15,936,000
システナ	8,900	4,395.00	39,115,500
N J S	2,700	1,666.00	4,498,200
デジタルアーツ	5,500	3,945.00	21,697,500
新日鉄住金ソリューションズ	17,500	2,848.00	49,840,000
総合警備保障	43,100	4,995.00	215,284,500
キューブシステム	6,500	837.00	5,440,500
いちご	159,800	456.00	72,868,800
エイジア	1,700	1,548.00	2,631,600
日本駐車場開発	135,100	186.00	25,128,600
コア	4,700	1,325.00	6,227,500
カカクコム	83,300	1,849.00	154,021,700
アイロムグループ	3,700	3,150.00	11,655,000
セントケア・ホールディング	4,600	743.00	3,417,800
サイネックス	1,600	898.00	1,436,800
ルネサンス	5,300	1,782.00	9,444,600
ディップ	15,300	3,245.00	49,648,500
S B Sホールディングス	11,200	1,426.00	15,971,200
オプトホールディング	7,600	1,246.00	9,469,600
新日本科学	13,200	556.00	7,339,200
ツクイ	25,500	845.00	21,547,500
キャリアデザインセンター	2,500	2,151.00	5,377,500
エムスリー	114,000	4,210.00	479,940,000

ツカダ・グローバルホールディング	8,700	625.00	5,437,500
プラス	600	1,078.00	646,800
アウトソーシング	32,300	2,253.00	72,771,900
ウェルネット	11,000	1,172.00	12,892,000
ワールドホールディングス	3,600	3,985.00	14,346,000
ディー・エヌ・エー	58,400	1,956.00	114,230,400
博報堂DYホールディングス	150,600	1,574.00	237,044,400
ぐるなび	17,200	1,496.00	25,731,200
エスアールジータカミヤ	12,800	674.00	8,627,200
ジャパンベストレスキューシステム	13,500	800.00	10,800,000
ファンコミュニケーションズ	30,200	750.00	22,650,000
ライク	4,300	1,970.00	8,471,000
ビジネス・ブレークスルー	5,200	486.00	2,527,200
WDBホールディングス	5,000	4,105.00	20,525,000
ティア	5,700	1,035.00	5,899,500
CDG	1,000	1,812.00	1,812,000
バリューコマース	9,700	1,339.00	12,988,300
インフォマート	54,800	928.00	50,854,400
サッポロホールディングス	41,600	3,200.00	133,120,000
アサヒグループホールディングス	238,400	5,518.00	1,315,491,200
キリンホールディングス	547,000	2,833.00	1,549,651,000
宝ホールディングス	85,200	1,335.00	113,742,000
オエノンホールディングス	32,500	436.00	14,170,000
養命酒製造	3,500	2,338.00	8,183,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	79,900	4,045.00	323,195,500
サントリー食品インターナショナル	87,000	5,030.00	437,610,000
ダイドーグループホールディングス	5,800	6,620.00	38,396,000
伊藤園	37,700	4,580.00	172,666,000
キーコーヒー	11,200	2,138.00	23,945,600
ユニカフェ	3,500	1,168.00	4,088,000
ジャパンフーズ	1,600	1,502.00	2,403,200
日清オイリオグループ	13,400	2,935.00	39,329,000
不二製油グループ本社	30,800	3,165.00	97,482,000
かどや製油	1,200	6,620.00	7,944,000
J-オイルミルズ	5,900	3,710.00	21,889,000
ローソン	28,300	7,160.00	202,628,000
サンエー	8,400	5,440.00	45,696,000
カワチ薬品	8,700	2,645.00	23,011,500
エービーシー・マート	20,300	6,860.00	139,258,000
ハードオフコーポレーション	4,900	1,157.00	5,669,300
高千穂交易	4,300	1,253.00	5,387,900
アスクル	9,700	3,895.00	37,781,500
ゲオホールディングス	20,400	1,974.00	40,269,600
アダストリア	17,200	2,304.00	39,628,800
ジーフット	6,700	760.00	5,092,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	722.00	1,083,000
伊藤忠食品	2,700	5,840.00	15,768,000
くらコーポレーション	6,600	6,520.00	43,032,000
キャンドウ	5,300	1,760.00	9,328,000

エレマテック	5,200	2,553.00	13,275,600
パルグループホールディングス	5,700	3,005.00	17,128,500
JALUX	3,200	3,230.00	10,336,000
エディオン	43,400	1,298.00	56,333,200
あらた	5,500	5,030.00	27,665,000
サーラコーポレーション	19,200	683.00	13,113,600
ワッツ	4,500	1,058.00	4,761,000
トーメンデバイス	1,700	2,915.00	4,955,500
ハローズ	4,200	2,468.00	10,365,600
J Pホールディングス	34,100	317.00	10,809,700
あみやき亭	2,400	5,280.00	12,672,000
東京エレクトロン デバイス	4,000	2,154.00	8,616,000
ひらまつ	15,400	560.00	8,624,000
フィールズ	8,500	1,195.00	10,157,500
双日	660,700	351.00	231,905,700
アルフレッサ ホールディングス	124,100	2,377.00	294,985,700
大黒天物産	2,700	5,260.00	14,202,000
ハニーズホールディングス	10,800	1,039.00	11,221,200
ファーマライズホールディングス	2,600	610.00	1,586,000
キッコーマン	88,900	4,285.00	380,936,500
味の素	261,700	1,962.00	513,455,400
キュービー	63,400	2,972.00	188,424,800
ハウス食品グループ本社	43,400	3,670.00	159,278,000
カゴメ	45,600	3,645.00	166,212,000
焼津水産化学工業	5,500	1,218.00	6,699,000
アリアケジャパン	10,400	8,520.00	88,608,000
ピエトロ	1,500	1,687.00	2,530,500
エバラ食品工業	2,500	2,165.00	5,412,500
ニチレイ	54,200	2,721.00	147,478,200
横浜冷凍	27,000	1,116.00	30,132,000
東洋水産	62,400	4,210.00	262,704,000
イトアアンド	3,200	2,191.00	7,011,200
大冷	1,300	2,213.00	2,876,900
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	1,707.00	2,901,900
日清食品ホールディングス	49,600	7,380.00	366,048,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,505.00	18,060,000
一正蒲鉾	4,400	1,278.00	5,623,200
フジッコ	12,300	2,365.00	29,089,500
ロック・フィールド	12,300	2,141.00	26,334,300
日本たばこ産業	704,100	3,066.00	2,158,770,600
ケンコーマヨネーズ	7,500	3,695.00	27,712,500
わらべや日洋ホールディングス	7,500	2,558.00	19,185,000
なとり	6,400	1,996.00	12,774,400
イフジ産業	2,000	789.00	1,578,000
ピククルスコーポレーション	1,700	1,866.00	3,172,200
北の達人コーポレーション	32,700	736.00	24,067,200
ユーグレナ	43,900	1,000.00	43,900,000
片倉工業	13,700	1,385.00	18,974,500
ゲンゼ	8,900	5,830.00	51,887,000
ヒューリック	233,500	1,208.00	282,068,000

神栄	1,500	1,470.00	2,205,000
ラサ商事	5,000	948.00	4,740,000
アルペン	8,600	2,468.00	21,224,800
ハブ	2,100	1,250.00	2,625,000
ラクーン	6,600	758.00	5,002,800
クオール	12,300	2,289.00	28,154,700
アルコニックス	11,800	2,449.00	28,898,200
神戸物産	7,200	4,320.00	31,104,000
ソリトンシステムズ	3,700	1,445.00	5,346,500
ジーンズ	7,600	5,420.00	41,192,000
ビックカメラ	64,700	1,625.00	105,137,500
DCMホールディングス	60,200	1,070.00	64,414,000
ペッパーフードサービス	6,000	4,855.00	29,130,000
Monotaro	39,700	3,510.00	139,347,000
東京一番フーズ	2,400	754.00	1,809,600
DDホールディングス	2,500	3,650.00	9,125,000
あいホールディングス	17,900	2,864.00	51,265,600
ディービーエクス	4,000	1,273.00	5,092,000
きちり	3,100	735.00	2,278,500
アークランドサービスホールディングス	9,300	2,290.00	21,297,000
J.フロントリテイリング	133,400	1,957.00	261,063,800
ドトール・日レスホールディングス	19,600	2,514.00	49,274,400
マツモトキヨシホールディングス	46,200	4,515.00	208,593,000
ブロンコビリー	5,800	3,355.00	19,459,000
スタートトゥデイ	109,700	2,904.00	318,568,800
トレジャー・ファクトリー	3,300	845.00	2,788,500
物語コーポレーション	3,200	10,010.00	32,032,000
ココカラファイン	11,700	6,950.00	81,315,000
三越伊勢丹ホールディングス	208,800	1,261.00	263,296,800
東洋紡	43,900	2,088.00	91,663,200
ユニチカ	34,600	718.00	24,842,800
富士紡ホールディングス	6,600	4,430.00	29,238,000
日清紡ホールディングス	69,300	1,637.00	113,444,100
倉敷紡績	120,000	358.00	42,960,000
ダイワボウホールディングス	9,500	4,265.00	40,517,500
シキボウ	6,000	1,386.00	8,316,000
日東紡績	16,900	2,509.00	42,402,100
トヨタ紡織	33,000	2,344.00	77,352,000
マクニカ・富士エレホールディングス	20,700	2,906.00	60,154,200
Hamee	2,800	1,910.00	5,348,000
ラクト・ジャパン	1,600	3,835.00	6,136,000
ウエルシアホールディングス	29,500	4,735.00	139,682,500
クリエイトSDホールディングス	16,500	2,720.00	44,880,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,000	1,028.00	21,588,000
八洲電機	8,700	899.00	7,821,300
メディアスホールディングス	1,800	2,970.00	5,346,000
UKCホールディングス	7,200	2,336.00	16,819,200
ジューテックホールディングス	2,600	1,307.00	3,398,200

丸善CHIホールディングス	13,000	343.00	4,459,000
大光	2,600	918.00	2,386,800
OCHIホールディングス	3,200	1,517.00	4,854,400
TOKAIホールディングス	59,000	1,161.00	68,499,000
ミサワ	1,800	447.00	804,600
ティーライフ	1,500	1,294.00	1,941,000
大阪工機	1,700	1,096.00	1,863,200
エー・ピーカンパニー	2,200	821.00	1,806,200
三洋貿易	6,100	2,364.00	14,420,400
チムニー	3,400	2,939.00	9,992,600
シュッピン	6,800	1,291.00	8,778,800
ビューティガレージ	1,500	2,168.00	3,252,000
ウイン・パートナーズ	8,100	1,838.00	14,887,800
ネクステージ	11,400	1,052.00	11,992,800
ジョイフル本田	16,400	3,660.00	60,024,000
鳥貴族	4,100	3,030.00	12,423,000
キリン堂ホールディングス	3,900	1,930.00	7,527,000
ホットランド	6,500	1,290.00	8,385,000
すかいらく	69,300	1,485.00	102,910,500
綿半ホールディングス	4,200	3,890.00	16,338,000
日本毛織	33,400	1,093.00	36,506,200
ダイトウボウ	18,800	117.00	2,199,600
トーア紡コーポレーション	5,100	589.00	3,003,900
ダイドーリミテッド	13,500	479.00	6,466,500
ヨシックス	1,800	3,920.00	7,056,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,100	1,096.00	40,661,600
三栄建築設計	4,500	2,183.00	9,823,500
スター・マイカ	4,100	2,011.00	8,245,100
野村不動産ホールディングス	74,400	2,649.00	197,085,600
三重交通グループホールディングス	22,700	523.00	11,872,100
サムティ	9,500	1,930.00	18,335,000
ディア・ライフ	11,300	560.00	6,328,000
コーセーアールイー	1,900	1,119.00	2,126,100
エー・ディー・ワークス	150,000	44.00	6,600,000
日本商業開発	6,300	1,900.00	11,970,000
プレサンスコーポレーション	15,300	1,643.00	25,137,900
ユニゾホールディングス	13,100	2,889.00	37,845,900
THEグローバル社	5,300	924.00	4,897,200
日本管理センター	7,400	1,757.00	13,001,800
サンセイランディック	3,300	1,382.00	4,560,600
エストラスト	1,600	983.00	1,572,800
フージャースホールディングス	27,200	828.00	22,521,600
オープンハウス	18,200	6,690.00	121,758,000
東急不動産ホールディングス	270,800	817.00	221,243,600
飯田グループホールディングス	93,300	2,015.00	187,999,500
ムゲンエステート	6,900	1,356.00	9,356,400
帝国繊維	12,400	1,987.00	24,638,800
ブックオフコーポレーション	6,400	849.00	5,433,600
日本コークス工業	96,100	116.00	11,147,600

ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	1,012.00	4,554,000
ミタチ産業	2,600	1,641.00	4,266,600
B E E N O S	1,500	1,686.00	2,529,000
あさひ	8,300	1,358.00	11,271,400
日本調剤	3,900	3,590.00	14,001,000
コスモス薬品	5,600	19,970.00	111,832,000
シップヘルスケアホールディングス	23,300	3,750.00	87,375,000
トーエル	5,500	1,021.00	5,615,500
一六堂	2,500	449.00	1,122,500
ソフトクリエイイトホールディングス	5,400	1,501.00	8,105,400
オンリー	1,700	925.00	1,572,500
セブン&アイ・ホールディングス	468,100	4,448.00	2,082,108,800
薬王堂	4,900	3,515.00	17,223,500
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	30,000	1,209.00	36,270,000
明治電機工業	3,800	2,019.00	7,672,200
ツルハホールディングス	24,200	15,500.00	375,100,000
デリカフーズホールディングス	2,200	1,445.00	3,179,000
スターティア	2,500	1,056.00	2,640,000
サンマルクホールディングス	8,000	3,260.00	26,080,000
フェリシモ	2,900	1,265.00	3,668,500
トリドールホールディングス	13,800	3,770.00	52,026,000
帝人	97,000	2,140.00	207,580,000
東レ	861,500	1,100.50	948,080,750
クラレ	199,900	1,874.00	374,612,600
旭化成	740,700	1,381.00	1,022,906,700
サカイオーベックス	3,100	2,739.00	8,490,900
T O K Y O B A S E	6,600	1,432.00	9,451,200
稲葉製作所	6,300	1,374.00	8,656,200
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,392.00	7,654,400
トーカロ	31,200	1,451.00	45,271,200
アルファ	4,000	1,889.00	7,556,000
S U M C O	103,300	2,807.00	289,963,100
川田テクノロジーズ	2,300	6,030.00	13,869,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,600	8,080.00	12,928,000
ファーストブラザーズ	3,100	1,443.00	4,473,300
ハウズドゥ	1,800	2,917.00	5,250,600
シーアールイー	1,800	1,678.00	3,020,400
ケイアイスター不動産	4,000	2,836.00	11,344,000
住江織物	3,000	2,955.00	8,865,000
日本フェルト	6,400	531.00	3,398,400
イチカワ	8,000	382.00	3,056,000
エコナックホールディングス	21,700	129.00	2,799,300
日東製網	1,300	1,819.00	2,364,700
芦森工業	2,400	2,407.00	5,776,800
アツギ	7,900	1,212.00	9,574,800
コメダホールディングス	20,600	2,078.00	42,806,800
サツドラホールディングス	1,500	1,919.00	2,878,500
ダイユー・リックホールディングス	5,200	1,265.00	6,578,000
パロックジャパンリミテッド	8,900	926.00	8,241,400

クスリのアオキホールディングス	8,900	6,020.00	53,578,000
ダイニック	4,600	1,087.00	5,000,200
共和レザー	6,900	996.00	6,872,400
スシローグローバルホールディングス	10,700	4,815.00	51,520,500
L I X I L ビバ	10,600	2,169.00	22,991,400
セーレン	27,300	2,121.00	57,903,300
ソトー	4,400	1,079.00	4,747,600
東海染工	1,700	1,580.00	2,686,000
小松精練	18,200	1,133.00	20,620,600
ワコールホールディングス	32,800	3,175.00	104,140,000
ホギメディカル	7,500	8,570.00	64,275,000
レナウン	32,300	187.00	6,040,100
クラウドシアホールディングス	2,900	564.00	1,635,600
T S I ホールディングス	44,800	768.00	34,406,400
マツオカコーポレーション	2,100	3,910.00	8,211,000
T I S	37,100	3,960.00	146,916,000
ネオス	3,400	425.00	1,445,000
電算システム	3,900	1,984.00	7,737,600
グリー	59,600	683.00	40,706,800
コーエーテックモホールディングス	18,900	2,255.00	42,619,500
三菱総合研究所	4,800	3,455.00	16,584,000
ボルテージ	2,100	992.00	2,083,200
電算	1,300	2,636.00	3,426,800
A G S	6,300	859.00	5,411,700
ファインデックス	9,300	744.00	6,919,200
ヒト・コミュニケーションズ	2,500	1,931.00	4,827,500
ブレインパッド	2,400	2,393.00	5,743,200
K L a b	21,600	1,642.00	35,467,200
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,100	2,281.00	18,476,100
イーブクイニシアティブジャパン	1,800	983.00	1,769,400
ネクソン	124,000	3,990.00	494,760,000
アイスタイル	27,900	1,574.00	43,914,600
エムアップ	3,700	1,139.00	4,214,300
エイチーム	7,600	2,638.00	20,048,800
テクノスジャパン	10,100	963.00	9,726,300
e n i s h	3,300	1,044.00	3,445,200
コロブラ	36,100	989.00	35,702,900
モバイルクリエイト	8,600	369.00	3,173,400
オルトプラス	5,400	959.00	5,178,600
ブロードリーフ	27,600	1,219.00	33,644,400
ハーツユナイテッドグループ	5,900	1,595.00	9,410,500
メディアドゥホールディングス	3,600	1,938.00	6,976,800
ブイキューブ	6,900	507.00	3,498,300
サイバーリンクス	1,800	1,327.00	2,388,600
ディー・エル・イー	5,100	478.00	2,437,800
フィックスターズ	1,900	8,340.00	15,846,000
VOYAGE GROUP	5,700	1,261.00	7,187,700
オブティム	1,900	2,472.00	4,696,800
セレス	3,400	1,846.00	6,276,400

特種東海製紙	6,500	4,220.00	27,430,000
ベリサーブ	1,400	3,235.00	4,529,000
ティーガイア	11,100	3,005.00	33,355,500
セック	1,100	3,375.00	3,712,500
日本アジアグループ	11,700	544.00	6,364,800
豆蔵ホールディングス	8,300	1,210.00	10,043,000
テクマトリックス	6,100	1,744.00	10,638,400
プロシップ	1,600	2,283.00	3,652,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	301,700	390.00	117,663,000
GMOペイメントゲートウェイ	7,800	9,010.00	70,278,000
ザッパラス	5,500	390.00	2,145,000
システムリサーチ	1,100	2,373.00	2,610,300
インターネットイニシアティブ	18,100	2,293.00	41,503,300
さくらインターネット	13,300	770.00	10,241,000
GMOクラウド	2,500	2,442.00	6,105,000
SRAホールディングス	5,900	3,445.00	20,325,500
MINORIソリューションズ	2,200	1,576.00	3,467,200
システムインテグレート	1,600	1,102.00	1,763,200
朝日ネット	10,200	525.00	5,355,000
eBASE	2,200	1,241.00	2,730,200
アドソル日進	4,300	1,345.00	5,783,500
フリービット	7,400	923.00	6,830,200
コムチュア	5,700	3,565.00	20,320,500
サイバーコム	2,000	1,314.00	2,628,000
王子ホールディングス	500,000	714.00	357,000,000
日本製紙	53,200	2,158.00	114,805,600
三菱製紙	16,900	685.00	11,576,500
北越紀州製紙	66,300	706.00	46,807,800
中越パルプ工業	4,700	1,900.00	8,930,000
巴川製紙所	18,000	311.00	5,598,000
大王製紙	47,300	1,545.00	73,078,500
阿波製紙	2,900	648.00	1,879,200
メディカル・データ・ビジョン	4,200	3,275.00	13,755,000
gumi	12,800	1,041.00	13,324,800
ショーケース・ティービー	2,200	1,599.00	3,517,800
モバイルファクトリー	2,100	1,357.00	2,849,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	1,700	3,285.00	5,584,500
PCIホールディングス	1,900	3,275.00	6,222,500
パイプドHD	1,800	1,485.00	2,673,000
アイビーシー	1,200	1,714.00	2,056,800
オーブンドア	4,400	2,302.00	10,128,800
マイネット	2,200	1,481.00	3,258,200
アカツキ	2,200	6,130.00	13,486,000
LINE	33,600	4,340.00	145,824,000
レンゴー	114,500	938.00	107,401,000
トーモク	6,800	2,085.00	14,178,000
ザ・バック	8,400	3,770.00	31,668,000
シンクロ・フード	900	4,720.00	4,248,000

オークネット	3,500	1,450.00	5,075,000
AOI TYO HOLDINGS	9,100	1,243.00	11,311,300
マクロミル	10,400	2,895.00	30,108,000
昭和電工	79,100	5,250.00	415,275,000
住友化学	874,000	668.00	583,832,000
住友精化	4,900	5,470.00	26,803,000
日産化学工業	69,100	4,170.00	288,147,000
ラサ工業	4,200	2,417.00	10,151,400
クレハ	10,300	7,590.00	78,177,000
多木化学	1,600	4,445.00	7,112,000
テイカ	9,100	2,809.00	25,561,900
石原産業	21,300	1,553.00	33,078,900
片倉コープアグリ	2,900	1,279.00	3,709,100
日東エフシー	6,900	781.00	5,388,900
日本曹達	82,000	669.00	54,858,000
東ソー	171,700	2,269.00	389,587,300
トクヤマ	34,500	3,270.00	112,815,000
セントラル硝子	24,200	2,441.00	59,072,200
東亜合成	69,700	1,242.00	86,567,400
大阪ソーダ	10,700	2,878.00	30,794,600
関東電化工業	28,400	1,250.00	35,500,000
デンカ	43,600	3,940.00	171,784,000
イビデン	69,400	1,758.00	122,005,200
信越化学工業	197,800	11,460.00	2,266,788,000
日本カーバイド工業	3,800	2,254.00	8,565,200
堺化学工業	8,100	3,050.00	24,705,000
エア・ウォーター	97,900	2,161.00	211,561,900
大陽日酸	91,500	1,569.00	143,563,500
日本化学工業	4,400	3,375.00	14,850,000
東邦アセチレン	1,700	1,565.00	2,660,500
日本パーカライズン	60,700	1,928.00	117,029,600
高圧ガス工業	17,600	909.00	15,998,400
チタン工業	1,300	2,847.00	3,701,100
四国化成工業	17,100	1,549.00	26,487,900
戸田工業	2,400	3,745.00	8,988,000
ステラ ケミファ	6,100	2,839.00	17,317,900
保土谷化学工業	3,900	4,885.00	19,051,500
日本触媒	18,700	7,560.00	141,372,000
大日精化工業	9,200	4,655.00	42,826,000
カネカ	160,000	1,098.00	175,680,000
協和発酵キリン	142,100	2,341.00	332,656,100
三菱瓦斯化学	97,900	2,626.00	257,085,400
三井化学	108,000	3,300.00	356,400,000
J S R	119,400	2,451.00	292,649,400
東京応化工業	20,600	4,085.00	84,151,000
大阪有機化学工業	7,700	1,556.00	11,981,200
三菱ケミカルホールディングス	795,400	1,098.50	873,746,900
K Hネオケム	18,200	3,115.00	56,693,000
ダイセル	160,200	1,202.00	192,560,400
住友ベークライト	96,000	935.00	89,760,000

積水化学工業	246,700	2,024.00	499,320,800
日本ゼオン	100,200	1,584.00	158,716,800
アイカ工業	33,300	4,115.00	137,029,500
宇部興産	59,800	3,310.00	197,938,000
積水樹脂	18,300	2,482.00	45,420,600
タキロンシーアイ	24,000	746.00	17,904,000
旭有機材	7,000	2,127.00	14,889,000
日立化成	58,700	2,425.00	142,347,500
ニチパン	5,800	3,240.00	18,792,000
リケンテクノス	25,600	536.00	13,721,600
大倉工業	28,000	576.00	16,128,000
積水化成品工業	14,900	1,190.00	17,731,000
群栄化学工業	2,800	3,565.00	9,982,000
タイガースポリマー	5,900	887.00	5,233,300
ミライアル	3,900	2,068.00	8,065,200
ダイキアクシス	4,000	1,699.00	6,796,000
ダイキョーニシカワ	23,400	1,855.00	43,407,000
竹本容器	1,300	2,500.00	3,250,000
森六ホールディングス	4,500	3,040.00	13,680,000
日本化薬	77,100	1,383.00	106,629,300
カーリットホールディングス	11,000	1,185.00	13,035,000
E P Sホールディングス	16,300	2,296.00	37,424,800
ソルクシーズ	4,300	1,116.00	4,798,800
レグス	2,700	928.00	2,505,600
プレステージ・インターナショナル	22,500	1,417.00	31,882,500
フェイス	3,900	1,168.00	4,555,200
ハイマックス	1,500	1,857.00	2,785,500
アミューズ	7,200	4,105.00	29,556,000
野村総合研究所	74,400	4,670.00	347,448,000
ドリームインキュベータ	3,600	2,796.00	10,065,600
サイバネットシステム	9,200	760.00	6,992,000
クイック	6,700	2,040.00	13,668,000
T A C	6,700	326.00	2,184,200
C Eホールディングス	3,200	897.00	2,870,400
ケネディクス	143,500	692.00	99,302,000
日本システム技術	1,400	1,403.00	1,964,200
電通	132,000	4,995.00	659,340,000
インテージホールディングス	12,800	1,191.00	15,244,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	1,030.00	5,253,000
東邦システムサイエンス	3,800	822.00	3,123,600
ぴあ	3,600	5,510.00	19,836,000
イオンファンタジー	3,500	4,815.00	16,852,500
ソースネクスト	15,700	673.00	10,566,100
シーティーエス	11,100	811.00	9,002,100
ネクシィーズグループ	4,300	1,760.00	7,568,000
メディカルシステムネットワーク	12,700	566.00	7,188,200
日本精化	9,900	1,292.00	12,790,800
扶桑化学工業	8,400	3,035.00	25,494,000
A D E K A	51,100	1,962.00	100,258,200
日油	45,900	3,000.00	137,700,000

ミヨシ油脂	4,400	1,422.00	6,256,800
新日本理化	18,900	273.00	5,159,700
ハリマ化成グループ	9,200	901.00	8,289,200
花王	278,800	7,841.00	2,186,070,800
第一工業製薬	23,000	795.00	18,285,000
日華化学	3,800	1,187.00	4,510,600
ニイタカ	1,700	1,854.00	3,151,800
三洋化成工業	7,500	5,370.00	40,275,000
武田薬品工業	417,700	6,064.00	2,532,932,800
アステラス製薬	1,165,400	1,569.00	1,828,512,600
大日本住友製薬	84,100	1,670.00	140,447,000
塩野義製薬	162,200	5,688.00	922,593,600
田辺三菱製薬	138,400	2,293.00	317,351,200
わかもと製薬	14,000	282.00	3,948,000
あすか製薬	12,900	2,172.00	28,018,800
日本新薬	29,700	5,970.00	177,309,000
ビオフェルミン製薬	1,900	2,897.00	5,504,300
中外製薬	118,200	5,540.00	654,828,000
科研製薬	20,500	6,030.00	123,615,000
エーザイ	135,700	5,746.00	779,732,200
理研ビタミン	4,300	4,085.00	17,565,500
ロート製薬	62,300	3,015.00	187,834,500
小野薬品工業	267,800	3,060.00	819,468,000
久光製薬	33,500	7,710.00	258,285,000
有機合成薬品工業	8,000	298.00	2,384,000
持田製薬	7,900	7,840.00	61,936,000
参天製薬	214,700	1,737.00	372,933,900
扶桑薬品工業	4,000	2,859.00	11,436,000
日本ケミファ	1,500	4,585.00	6,877,500
ツムラ	40,500	3,600.00	145,800,000
日医工	29,900	1,716.00	51,308,400
テルモ	173,800	5,620.00	976,756,000
みらかホールディングス	32,300	4,165.00	134,529,500
キッセイ薬品工業	21,000	2,949.00	61,929,000
生化学工業	22,000	2,093.00	46,046,000
栄研化学	9,200	5,130.00	47,196,000
日水製薬	4,800	1,347.00	6,465,600
鳥居薬品	7,100	2,979.00	21,150,900
JCRファーマ	8,000	5,410.00	43,280,000
東和薬品	5,400	6,830.00	36,882,000
富士製薬工業	3,900	4,445.00	17,335,500
沢井製薬	22,800	5,130.00	116,964,000
ゼリア新薬工業	24,300	2,141.00	52,026,300
第一三共	324,500	3,875.00	1,257,437,500
キョーリン製薬ホールディングス	31,700	2,093.00	66,348,100
大幸薬品	6,000	2,118.00	12,708,000
ダイト	6,600	3,545.00	23,397,000
大塚ホールディングス	235,700	5,361.00	1,263,587,700
大正製薬ホールディングス	25,400	9,850.00	250,190,000
ペプチドリーム	50,800	5,020.00	255,016,000

大日本塗料	13,600	1,597.00	21,719,200
日本ペイントホールディングス	91,700	3,875.00	355,337,500
関西ペイント	124,800	2,705.00	337,584,000
神東塗料	9,000	255.00	2,295,000
中国塗料	34,100	1,112.00	37,919,200
日本特殊塗料	7,500	2,007.00	15,052,500
藤倉化成	15,000	689.00	10,335,000
太陽ホールディングス	9,100	4,845.00	44,089,500
D I C	46,900	3,985.00	186,896,500
サカタインクス	24,200	1,403.00	33,952,600
東洋インキS Cホールディングス	117,000	686.00	80,262,000
T & K T O K A	7,900	1,390.00	10,981,000
アルプス技研	9,500	2,325.00	22,087,500
サニックス	17,400	279.00	4,854,600
ダイオーズ	2,200	1,335.00	2,937,000
日本空調サービス	11,400	762.00	8,686,800
オリエンタルランド	128,000	10,640.00	1,361,920,000
フォーカスシステムズ	6,300	939.00	5,915,700
ダスキン	29,100	2,647.00	77,027,700
パーク24	62,000	2,566.00	159,092,000
明光ネットワークジャパン	13,700	1,305.00	17,878,500
ファルコホールディングス	5,600	1,789.00	10,018,400
クレスコ	2,500	3,770.00	9,425,000
フジ・メディア・ホールディングス	116,500	1,856.00	216,224,000
秀英予備校	2,400	491.00	1,178,400
田谷	2,000	704.00	1,408,000
ラウンドワン	33,600	1,825.00	61,320,000
リゾートトラスト	45,900	2,425.00	111,307,500
オービック	35,100	8,690.00	305,019,000
ジャストシステム	18,100	2,359.00	42,697,900
T D C ソフト	4,900	1,186.00	5,811,400
ヤフー	802,300	535.00	429,230,500
ピー・エム・エル	13,900	2,739.00	38,072,100
ワタベウェディング	1,800	605.00	1,089,000
トレンドマイクロ	54,300	6,090.00	330,687,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,355.00	23,170,500
インフォメーション・ディベロプメント	3,500	1,424.00	4,984,000
リソー教育	18,400	817.00	15,032,800
日本オラクル	18,000	8,420.00	151,560,000
早稲田アカデミー	1,600	1,683.00	2,692,800
アルファシステムズ	3,700	2,382.00	8,813,400
フューチャー	15,100	1,244.00	18,784,400
C A C H o l d i n g s	8,400	1,124.00	9,441,600
ソフトバンク・テクノロジー	4,700	2,081.00	9,780,700
トーセ	3,000	1,908.00	5,724,000
ユー・エス・エス	132,300	2,203.00	291,456,900
オービックビジネスコンサルタント	5,700	6,240.00	35,568,000
伊藤忠テクノソリューションズ	25,300	4,370.00	110,561,000
アイティフォー	13,600	785.00	10,676,000

東京個別指導学院	3,800	1,304.00	4,955,200
東計電算	2,000	3,375.00	6,750,000
サイバーエージェント	71,200	4,430.00	315,416,000
楽天	555,600	950.20	527,931,120
エクスネット	1,800	897.00	1,614,600
クリーク・アンド・リバー社	5,600	988.00	5,532,800
テー・オー・ダブリュー	9,700	918.00	8,904,600
大塚商会	33,400	9,910.00	330,994,000
総合メディカル	4,900	6,250.00	30,625,000
サイボウズ	14,900	547.00	8,150,300
ソフトブレーン	8,900	460.00	4,094,000
セントラルスポーツ	4,000	3,905.00	15,620,000
パラカ	3,600	2,414.00	8,690,400
電通国際情報サービス	6,900	2,660.00	18,354,000
デジタルガレージ	20,000	3,240.00	64,800,000
イーエムシステムズ	7,800	1,210.00	9,438,000
ウェザーニューズ	3,800	3,270.00	12,426,000
C I J	8,800	704.00	6,195,200
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,759.00	1,934,900
日本エンタープライズ	11,700	236.00	2,761,200
WOWOW	5,300	3,420.00	18,126,000
スカラ	7,800	873.00	6,809,400
フルキャストホールディングス	9,500	2,599.00	24,690,500
富士フイルムホールディングス	235,500	4,403.00	1,036,906,500
コニカミノルタ	265,400	987.00	261,949,800
資生堂	211,200	6,384.00	1,348,300,800
ライオン	158,000	2,065.00	326,270,000
高砂香料工業	7,100	3,230.00	22,933,000
マンダム	22,100	3,730.00	82,433,000
ミルボン	15,200	4,500.00	68,400,000
ファンケル	27,500	3,735.00	102,712,500
コーセー	19,200	20,230.00	388,416,000
コタ	4,900	1,950.00	9,555,000
シーズ・ホールディングス	15,400	6,080.00	93,632,000
シーボン	1,400	3,425.00	4,795,000
ポーラ・オルビスホールディングス	48,400	4,455.00	215,622,000
ノエビアホールディングス	7,200	7,950.00	57,240,000
アジュバンコスメジャパン	2,600	1,144.00	2,974,400
エステー	8,100	2,336.00	18,921,600
アグロ カネショウ	4,600	2,316.00	10,653,600
コニシ	18,600	1,849.00	34,391,400
長谷川香料	15,000	2,042.00	30,630,000
星光PMC	6,500	1,125.00	7,312,500
小林製薬	31,800	6,950.00	221,010,000
荒川化学工業	10,200	2,006.00	20,461,200
メック	7,800	1,784.00	13,915,200
日本高純度化学	3,100	2,565.00	7,951,500
タカラバイオ	29,700	2,008.00	59,637,600
JCU	7,000	5,320.00	37,240,000
新田ゼラチン	7,800	819.00	6,388,200

O A Tアグリオ	1,600	2,898.00	4,636,800
デクセリアルズ	29,000	1,398.00	40,542,000
アース製薬	8,500	5,300.00	45,050,000
北興化学工業	11,700	764.00	8,938,800
大成ラミック	3,500	3,175.00	11,112,500
クミアイ化学工業	51,600	668.00	34,468,800
日本農薬	29,600	634.00	18,766,400
昭和シェル石油	106,100	1,419.00	150,555,900
富士興産	4,100	633.00	2,595,300
ニチレキ	14,500	1,455.00	21,097,500
ユシロ化学工業	6,400	1,878.00	12,019,200
ビーピー・カストロール	4,900	1,785.00	8,746,500
富士石油	27,600	450.00	12,420,000
MORESCO	4,100	1,907.00	7,818,700
出光興産	95,200	4,105.00	390,796,000
J X T Gホールディングス	1,809,700	674.30	1,220,280,710
コスモエネルギーホールディングス	32,800	3,865.00	126,772,000
横浜ゴム	65,600	2,653.00	174,036,800
東洋ゴム工業	67,200	2,013.00	135,273,600
ブリヂストン	400,800	4,812.00	1,928,649,600
住友ゴム工業	116,700	2,102.00	245,303,400
藤倉ゴム工業	9,900	837.00	8,286,300
オカモト	39,000	1,123.00	43,797,000
アキレス	8,600	2,238.00	19,246,800
フコク	5,000	1,058.00	5,290,000
ニッタ	11,700	4,125.00	48,262,500
クリエートメディック	3,800	1,177.00	4,472,600
住友理工	22,000	1,093.00	24,046,000
三ツ星ベルト	28,000	1,192.00	33,376,000
バンドー化学	21,600	1,223.00	26,416,800
旭硝子	115,900	4,555.00	527,924,500
日本板硝子	57,300	875.00	50,137,500
石塚硝子	1,500	2,724.00	4,086,000
有沢製作所	19,000	1,100.00	20,900,000
日本山村硝子	47,000	185.00	8,695,000
日本電気硝子	49,000	3,325.00	162,925,000
オハラ	4,500	2,950.00	13,275,000
住友大阪セメント	220,000	495.00	108,900,000
太平洋セメント	71,600	4,000.00	286,400,000
リソルホールディングス	1,200	4,530.00	5,436,000
日本ヒューム	11,400	814.00	9,279,600
日本コンクリート工業	24,500	478.00	11,711,000
三谷セキサン	5,900	2,591.00	15,286,900
アジアパイルホールディングス	14,700	682.00	10,025,400
東海カーボン	103,000	1,884.00	194,052,000
日本カーボン	5,800	6,250.00	36,250,000
東洋炭素	7,400	4,090.00	30,266,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,700	5,430.00	36,381,000
TOTO	87,200	5,760.00	502,272,000
日本碍子	138,400	2,017.00	279,152,800

日本特殊陶業	97,300	2,731.00	265,726,300
ダントーホールディングス	9,000	149.00	1,341,000
MARUWA	3,900	8,420.00	32,838,000
品川リフラクトリーズ	3,000	3,050.00	9,150,000
黒崎播磨	2,200	5,090.00	11,198,000
ヨータイ	6,800	887.00	6,031,600
イソライト工業	5,800	929.00	5,388,200
東京窯業	14,500	456.00	6,612,000
ニッカトー	3,900	1,103.00	4,301,700
フジインコーポレーテッド	10,100	2,600.00	26,260,000
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,242.00	3,105,000
ニチアス	62,000	1,429.00	88,598,000
新日鐵住金	501,800	2,626.00	1,317,726,800
神戸製鋼所	205,300	1,222.00	250,876,600
中山製鋼所	15,500	708.00	10,974,000
合同製鐵	6,100	2,090.00	12,749,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	302,800	2,518.00	762,450,400
日新製鋼	30,900	1,434.00	44,310,600
東京製鐵	60,100	880.00	52,888,000
共英製鋼	12,600	1,887.00	23,776,200
大和工業	23,800	3,140.00	74,732,000
東京鐵鋼	4,600	1,745.00	8,027,000
大阪製鐵	7,400	2,179.00	16,124,600
淀川製鋼所	16,400	3,130.00	51,332,000
東洋鋼鈹	28,400	713.00	20,249,200
丸一鋼管	39,700	3,375.00	133,987,500
モリ工業	3,700	3,770.00	13,949,000
大同特殊鋼	19,900	5,850.00	116,415,000
日本高周波鋼業	4,200	835.00	3,507,000
日本冶金工業	92,800	329.00	30,531,200
山陽特殊製鋼	12,900	2,388.00	30,805,200
愛知製鋼	6,300	4,635.00	29,200,500
日立金属	120,800	1,392.00	168,153,600
日本金属	2,800	2,764.00	7,739,200
大平洋金属	6,900	3,330.00	22,977,000
新日本電工	67,200	387.00	26,006,400
栗本鐵工所	5,700	2,124.00	12,106,800
虹 技	1,700	2,074.00	3,525,800
日本鑄鉄管	12,000	170.00	2,040,000
日本製鋼所	36,600	3,360.00	122,976,000
三菱製鋼	8,300	2,680.00	22,244,000
日亜鋼業	16,500	358.00	5,907,000
日本精線	1,800	4,955.00	8,919,000
大紀アルミニウム工業所	18,500	840.00	15,540,000
日本軽金属ホールディングス	327,400	293.00	95,928,200
三井金属鉱業	30,300	5,110.00	154,833,000
東邦亜鉛	6,200	5,750.00	35,650,000
三菱マテリアル	74,100	3,395.00	251,569,500
住友金属鉱山	143,300	5,021.00	719,509,300

DOWAホールディングス	28,400	4,035.00	114,594,000
古河機械金属	18,500	2,270.00	41,995,000
エス・サイエンス	53,400	83.00	4,432,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	2,739.00	32,046,300
東邦チタニウム	20,100	1,507.00	30,290,700
UACJ	17,000	2,595.00	44,115,000
古河電気工業	37,300	5,910.00	220,443,000
住友電気工業	419,200	1,702.00	713,478,400
フジクラ	135,400	778.00	105,341,200
昭和電線ホールディングス	14,100	1,033.00	14,565,300
東京特殊電線	1,400	3,340.00	4,676,000
タツタ電線	22,300	721.00	16,078,300
カナレ電気	1,900	2,207.00	4,193,300
平河ヒューテック	5,600	1,227.00	6,871,200
リョービ	13,800	2,960.00	40,848,000
アーレスティ	13,800	1,017.00	14,034,600
アサヒホールディングス	18,800	2,043.00	38,408,400
東洋製罐グループホールディングス	76,600	1,593.00	122,023,800
ホッカンホールディングス	28,000	393.00	11,004,000
コロナ	6,200	1,385.00	8,587,000
横河ブリッジホールディングス	20,900	2,561.00	53,524,900
OSJBホールディングス	56,300	313.00	17,621,900
駒井ハルテック	2,500	2,712.00	6,780,000
高田機工	1,000	4,215.00	4,215,000
三和ホールディングス	107,500	1,487.00	159,852,500
文化シャッター	33,000	1,009.00	33,297,000
三協立山	15,500	1,547.00	23,978,500
アルインコ	8,200	1,181.00	9,684,200
東洋シャッター	2,900	615.00	1,783,500
LIXILグループ	165,300	2,655.00	438,871,500
日本フィルコン	8,700	681.00	5,924,700
ノーリツ	25,000	1,917.00	47,925,000
長府製作所	12,600	2,490.00	31,374,000
リンナイ	20,000	9,760.00	195,200,000
ユニプレス	21,900	2,575.00	56,392,500
ダイニチ工業	6,000	907.00	5,442,000
日東精工	15,500	609.00	9,439,500
三洋工業	1,400	2,175.00	3,045,000
岡部	22,700	1,004.00	22,790,800
ジーテクト	12,400	2,125.00	26,350,000
中国工業	1,700	748.00	1,271,600
東プレ	20,900	3,220.00	67,298,000
高周波熱錬	21,600	1,096.00	23,673,600
東京製網	8,100	2,090.00	16,929,000
サンコール	6,300	793.00	4,995,900
モリテックスチール	6,600	1,010.00	6,666,000
パイオラックス	16,600	2,992.00	49,667,200
エイチワン	8,300	1,521.00	12,624,300
日本発条	111,700	1,109.00	123,875,300
中央発条	1,300	3,625.00	4,712,500

アドバネクス	1,800	4,270.00	7,686,000
三浦工業	48,500	3,035.00	147,197,500
タクマ	38,000	1,283.00	48,754,000
テクノプロ・ホールディングス	19,300	6,280.00	121,204,000
アトラ	1,900	903.00	1,715,700
インターワークス	2,400	1,137.00	2,728,800
Keeper 技研	3,500	1,363.00	4,770,500
ファーストロジック	1,700	952.00	1,618,400
三機サービス	1,200	2,248.00	2,697,600
Gunosy	4,900	2,669.00	13,078,100
デザインワン・ジャパン	2,100	1,156.00	2,427,600
イー・ガーディアン	5,500	3,280.00	18,040,000
リブセンス	7,100	553.00	3,926,300
ジャパンマテリアル	29,700	1,430.00	42,471,000
ベクトル	13,000	2,183.00	28,379,000
ウチヤマホールディングス	5,400	651.00	3,515,400
ライクキッズネクスト	1,100	1,958.00	2,153,800
キャリアリンク	3,100	560.00	1,736,000
I B J	8,600	1,213.00	10,431,800
アサンテ	3,900	1,920.00	7,488,000
N・フィールド	6,100	2,016.00	12,297,600
パリュールHR	2,500	2,211.00	5,527,500
M&Aキャピタルパートナーズ	2,200	8,270.00	18,194,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,131.00	4,976,400
ERIホールディングス	3,100	957.00	2,966,700
アピスト	1,500	4,905.00	7,357,500
シグマクシス	4,300	1,715.00	7,374,500
ウィルグループ	4,700	1,599.00	7,515,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,900	478.00	7,122,200
日本ビューホテル	2,400	1,530.00	3,672,000
リクルートホールディングス	835,900	2,667.50	2,229,763,250
エラン	2,700	1,550.00	4,185,000
ツガミ	30,000	1,461.00	43,830,000
オークマ	13,100	6,800.00	89,080,000
東芝機械	63,000	776.00	48,888,000
アマダホールディングス	173,000	1,456.00	251,888,000
アイダエンジニアリング	28,500	1,473.00	41,980,500
滝澤鉄工所	3,500	2,198.00	7,693,000
富士機械製造	33,600	2,193.00	73,684,800
牧野フライス製作所	56,000	1,093.00	61,208,000
オーエスジー	51,700	2,515.00	130,025,500
ダイジェット工業	1,400	2,104.00	2,945,600
旭ダイヤモンド工業	33,300	1,311.00	43,656,300
DMG森精機	62,100	2,137.00	132,707,700
ソディック	24,400	1,418.00	34,599,200
ディスコ	15,200	24,650.00	374,680,000
日東工器	6,900	2,983.00	20,582,700
日進工具	3,000	3,425.00	10,275,000
パンチ工業	9,400	1,304.00	12,257,600

富士ダイス	4,300	1,108.00	4,764,400
土木管理総合試験所	3,300	712.00	2,349,600
日本郵政	614,800	1,290.00	793,092,000
ベルシステム24ホールディングス	18,200	1,488.00	27,081,600
鎌倉新書	1,500	2,309.00	3,463,500
一蔵	1,400	1,072.00	1,500,800
LITALICO	1,900	1,724.00	3,275,600
グローバルグループ	1,200	1,434.00	1,720,800
エポラブルアジア	2,200	2,236.00	4,919,200
ストライク	1,000	6,310.00	6,310,000
ソラスト	6,500	2,885.00	18,752,500
セラク	1,900	764.00	1,451,600
インソース	1,300	3,610.00	4,693,000
豊田自動織機	91,800	6,900.00	633,420,000
豊和工業	6,200	1,635.00	10,137,000
OKK	4,300	1,192.00	5,125,600
石川製作所	2,900	3,115.00	9,033,500
東洋機械金属	8,800	950.00	8,360,000
津田駒工業	27,000	275.00	7,425,000
エンシュウ	29,000	180.00	5,220,000
島精機製作所	14,200	7,050.00	100,110,000
オプトラン	8,200	4,065.00	33,333,000
NCホールディングス	3,600	769.00	2,768,400
フリー	8,000	1,079.00	8,632,000
ヤマシンフィルタ	15,300	1,328.00	20,318,400
日阪製作所	16,100	1,117.00	17,983,700
やまびこ	21,700	1,708.00	37,063,600
平田機工	3,100	10,200.00	31,620,000
ペガサスミシン製造	10,500	759.00	7,969,500
ナブテスコ	61,700	4,525.00	279,192,500
三井海洋開発	11,900	2,711.00	32,260,900
レオン自動機	10,000	2,362.00	23,620,000
SMC	35,600	46,110.00	1,641,516,000
新川	9,200	1,172.00	10,782,400
ホソカワミクロン	4,200	7,900.00	33,180,000
ユニオンツール	5,100	3,825.00	19,507,500
オイレス工業	14,500	2,387.00	34,611,500
日精エー・エス・ビー機械	3,800	7,960.00	30,248,000
サトーホールディングス	14,800	3,690.00	54,612,000
技研製作所	5,700	2,914.00	16,609,800
日本エアーテック	3,900	955.00	3,724,500
日精樹脂工業	9,400	1,693.00	15,914,200
オカダアイヨン	3,300	1,675.00	5,527,500
ワイエイシイホールディングス	3,800	974.00	3,701,200
小松製作所	547,500	3,990.00	2,184,525,000
住友重機械工業	64,900	4,240.00	275,176,000
日立建機	53,000	4,730.00	250,690,000
日工	3,100	2,475.00	7,672,500
巴工業	4,800	1,983.00	9,518,400
井関農機	11,300	2,230.00	25,199,000

T O W A	8,800	1,691.00	14,880,800
丸山製作所	2,500	1,872.00	4,680,000
北川鉄工所	5,400	2,839.00	15,330,600
シンニッタン	8,700	944.00	8,212,800
ローツェ	5,600	2,519.00	14,106,400
タカキタ	3,600	832.00	2,995,200
クボタ	608,200	2,000.00	1,216,400,000
荏原実業	3,300	2,184.00	7,207,200
東洋エンジニアリング	15,000	1,030.00	15,450,000
三菱化工機	3,900	2,234.00	8,712,600
月島機械	22,500	1,566.00	35,235,000
帝国電機製作所	7,900	1,702.00	13,445,800
東京機械製作所	4,500	591.00	2,659,500
新東工業	26,900	1,256.00	33,786,400
澁谷工業	9,900	4,255.00	42,124,500
アイチコーポレーション	19,600	746.00	14,621,600
小森コーポレーション	28,500	1,429.00	40,726,500
鶴見製作所	9,500	2,022.00	19,209,000
住友精密工業	19,000	411.00	7,809,000
酒井重工業	2,100	4,960.00	10,416,000
荏原製作所	46,600	3,935.00	183,371,000
石井鐵工所	1,800	2,110.00	3,798,000
西島製作所	11,600	1,006.00	11,669,600
北越工業	12,800	1,242.00	15,897,600
千代田化工建設	82,500	1,028.00	84,810,000
ダイキン工業	154,800	12,690.00	1,964,412,000
オルガノ	4,100	3,325.00	13,632,500
トーヨーカネツ	4,800	3,465.00	16,632,000
栗田工業	61,400	3,230.00	198,322,000
椿本チエイン	67,000	904.00	60,568,000
大同工業	4,300	1,573.00	6,763,900
日機装	39,200	1,217.00	47,706,400
木村化工機	9,600	524.00	5,030,400
新興プランテック	24,500	1,022.00	25,039,000
アネスト岩田	19,100	1,160.00	22,156,000
ダイフク	57,700	6,990.00	403,323,000
サムコ	3,100	1,269.00	3,933,900
加藤製作所	5,400	2,672.00	14,428,800
油研工業	2,200	3,265.00	7,183,000
タダノ	54,700	1,716.00	93,865,200
フジテック	36,300	1,425.00	51,727,500
C K D	31,500	2,725.00	85,837,500
キトー	8,600	2,110.00	18,146,000
平和	35,100	2,349.00	82,449,900
理想科学工業	11,200	2,255.00	25,256,000
S A N K Y O	28,400	3,830.00	108,772,000
日本金銭機械	10,500	1,318.00	13,839,000
マースエンジニアリング	7,200	2,517.00	18,122,400
福島工業	7,000	4,750.00	33,250,000
オーイズミ	4,800	539.00	2,587,200

ダイコク電機	5,200	1,732.00	9,006,400
竹内製作所	19,000	2,485.00	47,215,000
アマノ	35,100	2,990.00	104,949,000
J U K I	16,800	1,674.00	28,123,200
サンデンホールディングス	13,800	1,703.00	23,501,400
蛇の目マシン工業	10,300	771.00	7,941,300
ブラザー工業	138,500	2,648.00	366,748,000
マックス	17,400	1,521.00	26,465,400
モリタホールディングス	18,200	2,005.00	36,491,000
グローリー	33,800	4,045.00	136,721,000
新晃工業	11,500	1,967.00	22,620,500
大和冷機工業	18,200	1,238.00	22,531,600
セガサミーホールディングス	112,500	1,593.00	179,212,500
日本ピストンリング	4,100	2,451.00	10,049,100
リケン	5,200	6,310.00	32,812,000
T P R	12,700	3,070.00	38,989,000
ツバキ・ナカシマ	11,400	3,210.00	36,594,000
ホシザキ	35,700	9,680.00	345,576,000
大豊工業	9,200	1,584.00	14,572,800
日本精工	232,900	1,620.00	377,298,000
N T N	262,400	470.00	123,328,000
ジェイテクト	120,800	1,683.00	203,306,400
不二越	105,000	677.00	71,085,000
ミネベアミツミ	210,500	2,403.00	505,831,500
日本トムソン	36,300	812.00	29,475,600
T H K	70,700	4,755.00	336,178,500
ユーシン精機	5,000	3,590.00	17,950,000
前澤給装工業	4,400	1,932.00	8,500,800
イーグル工業	14,000	1,993.00	27,902,000
前澤工業	7,800	434.00	3,385,200
日本ピラー工業	11,500	1,677.00	19,285,500
キッツ	50,500	887.00	44,793,500
日立製作所	2,723,000	827.50	2,253,282,500
三菱電機	1,133,900	1,821.00	2,064,831,900
富士電機	342,000	814.00	278,388,000
東洋電機製造	4,500	1,762.00	7,929,000
安川電機	131,400	4,895.00	643,203,000
シンフォニア テクノロジー	73,000	375.00	27,375,000
明電舎	96,000	416.00	39,936,000
オリジン電気	3,300	1,888.00	6,230,400
山洋電気	5,500	8,150.00	44,825,000
デンヨー	10,500	1,821.00	19,120,500
キャリアインデックス	1,100	2,161.00	2,377,100
M S - J a p a n	800	6,410.00	5,128,000
三櫻工業	14,400	777.00	11,188,800
マキタ	147,900	5,030.00	743,937,000
東芝テック	81,000	656.00	53,136,000
芝浦メカトロニクス	17,000	502.00	8,534,000
マブチモーター	31,600	5,440.00	171,904,000
日本電産	136,500	16,755.00	2,287,057,500

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,100	2,872.00	11,775,200
東光高岳	5,700	1,662.00	9,473,400
ダブル・スコープ	16,500	1,502.00	24,783,000
宮越ホールディングス	4,300	719.00	3,091,700
ダイヘン	62,000	845.00	52,390,000
田淵電機	15,800	286.00	4,518,800
ヤーマン	16,400	1,736.00	28,470,400
JVCケンウッド	83,300	385.00	32,070,500
ミマキエンジニアリング	10,200	929.00	9,475,800
第一精工	5,300	2,846.00	15,083,800
日新電機	26,600	1,061.00	28,222,600
大崎電気工業	24,300	819.00	19,901,700
オムロン	120,500	6,290.00	757,945,000
日東工業	18,200	1,867.00	33,979,400
I D E C	14,000	2,879.00	40,306,000
不二電機工業	1,300	1,363.00	1,771,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	204,000	599.00	122,196,000
サクサホールディングス	2,900	2,198.00	6,374,200
メルコホールディングス	5,500	3,600.00	19,800,000
テクノメディカ	2,700	1,966.00	5,308,200
日本電気	146,700	3,245.00	476,041,500
富士通	1,166,000	649.50	757,317,000
沖電気工業	46,000	1,482.00	68,172,000
岩崎通信機	5,000	790.00	3,950,000
電気興業	6,400	3,335.00	21,344,000
サンケン電気	66,000	841.00	55,506,000
ナカヨ	2,200	2,055.00	4,521,000
アイホン	6,400	1,778.00	11,379,200
ルネサスエレクトロニクス	58,700	1,210.00	71,027,000
セイコーエプソン	168,800	2,069.00	349,247,200
ワコム	88,000	553.00	48,664,000
アルバック	26,100	6,260.00	163,386,000
アクセル	4,700	842.00	3,957,400
E I Z O	10,400	5,080.00	52,832,000
ジャパンディスプレイ	233,000	223.00	51,959,000
日本信号	31,300	1,078.00	33,741,400
京三製作所	27,000	769.00	20,763,000
能美防災	15,000	2,310.00	34,650,000
ホーチキ	8,200	1,998.00	16,383,600
エレコム	9,800	2,366.00	23,186,800
パナソニック	1,295,400	1,670.50	2,163,965,700
シャープ	79,000	3,730.00	294,670,000
アンリツ	82,700	1,344.00	111,148,800
富士通ゼネラル	34,600	2,074.00	71,760,400
ソニー	757,500	5,382.00	4,076,865,000
T D K	59,300	9,700.00	575,210,000
帝国通信工業	5,000	1,409.00	7,045,000
タムラ製作所	43,700	819.00	35,790,300
アルプス電気	97,700	2,841.00	277,565,700
池上通信機	36,000	172.00	6,192,000

パイオニア	189,000	195.00	36,855,000	
日本電波工業	10,300	704.00	7,251,200	
鈴木	4,500	1,257.00	5,656,500	
日本トリム	2,400	5,670.00	13,608,000	
ローランド ディー・ジー・	5,800	2,786.00	16,158,800	
フォスター電機	13,300	2,985.00	39,700,500	
クラリオン	60,000	348.00	20,880,000	
S M K	29,000	471.00	13,659,000	
ヨコオ	7,400	2,139.00	15,828,600	
ティアック	84,000	46.00	3,864,000	
ホシデン	28,600	1,556.00	44,501,600	
ヒロセ電機	18,300	15,550.00	284,565,000	
日本航空電子工業	29,000	1,581.00	45,849,000	
T O A	12,200	1,412.00	17,226,400	
マクセルホールディングス	22,500	2,132.00	47,970,000	
古野電気	13,500	758.00	10,233,000	
ユニデンホールディングス	31,000	312.00	9,672,000	
アルパイン	27,000	2,189.00	59,103,000	
スミダコーポレーション	11,600	1,657.00	19,221,200	
アイコム	6,300	2,746.00	17,299,800	
リオン	4,800	2,961.00	14,212,800	
本多通信工業	8,800	1,224.00	10,771,200	
船井電機	11,500	762.00	8,763,000	
横河電機	113,500	2,193.00	248,905,500	
新電元工業	4,000	8,180.00	32,720,000	
アズビル	34,000	4,770.00	162,180,000	
東亜ディーケーケー	5,600	1,303.00	7,296,800	
日本光電工業	47,400	2,965.00	140,541,000	
チノー	3,900	1,676.00	6,536,400	
共和電業	13,000	451.00	5,863,000	
日本電子材料	4,500	741.00	3,334,500	
堀場製作所	22,500	7,950.00	178,875,000	
アドバンテスト	63,200	2,242.00	141,694,400	
小野測器	4,800	820.00	3,936,000	
エスベック	10,100	2,623.00	26,492,300	
キーエンス	55,700	65,570.00	3,652,249,000	
日置電機	5,900	3,510.00	20,709,000	
シスメックス	88,200	8,820.00	777,924,000	
日本マイクロニクス	19,700	1,129.00	22,241,300	
メガチップス	8,900	3,695.00	32,885,500	
O B A R A G R O U P	6,600	6,550.00	43,230,000	
イマジカ・ロボット ホールディング ス	9,400	1,201.00	11,289,400	
澤藤電機	1,200	2,206.00	2,647,200	
デンソー	251,600	6,305.00	1,586,338,000	
コーセル	15,700	1,650.00	25,905,000	
イリソ電子工業	9,500	7,010.00	66,595,000	
新日本無線	6,900	886.00	6,113,400	
オブテックスグループ	9,200	5,630.00	51,796,000	
千代田インテグレ	5,500	2,488.00	13,684,000	

アイ・オー・データ機器	4,700	1,148.00	5,395,600
レーザーテック	23,200	4,275.00	99,180,000
スタンレー電気	86,700	4,205.00	364,573,500
岩崎電気	4,400	1,694.00	7,453,600
ウシオ電機	68,800	1,467.00	100,929,600
岡谷電機産業	6,100	756.00	4,611,600
ヘリオス テクノ ホールディング	9,700	1,088.00	10,553,600
日本セラミック	11,500	2,915.00	33,522,500
遠藤照明	5,800	1,131.00	6,559,800
古河電池	8,100	1,044.00	8,456,400
双信電機	5,000	711.00	3,555,000
山一電機	8,200	1,875.00	15,375,000
図研	7,400	1,819.00	13,460,600
日本電子	41,000	853.00	34,973,000
カシオ計算機	91,200	1,574.00	143,548,800
ファナック	107,800	27,380.00	2,951,564,000
日本シイエムケイ	20,000	991.00	19,820,000
エンプラス	5,100	3,800.00	19,380,000
大真空	4,200	1,394.00	5,854,800
ローム	50,900	11,100.00	564,990,000
浜松ホトニクス	82,600	4,140.00	341,964,000
三井ハイテック	15,000	2,056.00	30,840,000
新光電気工業	42,800	873.00	37,364,400
京セラ	186,100	6,283.00	1,169,266,300
協栄産業	1,400	2,005.00	2,807,000
太陽誘電	50,900	1,839.00	93,605,100
村田製作所	119,000	14,860.00	1,768,340,000
ユーシン	17,100	756.00	12,927,600
双葉電子工業	18,500	2,309.00	42,716,500
日東電工	85,600	8,882.00	760,299,200
北陸電気工業	4,600	1,764.00	8,114,400
東海理化電機製作所	29,800	2,326.00	69,314,800
ニチコン	35,700	1,343.00	47,945,100
日本ケミコン	9,200	2,857.00	26,284,400
K O A	15,700	2,274.00	35,701,800
三井造船	41,000	1,950.00	79,950,000
日立造船	89,900	543.00	48,815,700
三菱重工業	190,000	4,404.00	836,760,000
川崎重工業	88,200	3,980.00	351,036,000
I H I	87,100	3,595.00	313,124,500
名村造船所	34,000	637.00	21,658,000
サノヤスホールディングス	13,800	260.00	3,588,000
日本車輛製造	41,000	307.00	12,587,000
三菱ロジスネクスト	13,500	948.00	12,798,000
近畿車輛	1,700	2,675.00	4,547,500
F P G	39,100	1,430.00	55,913,000
島根銀行	2,400	1,417.00	3,400,800
じもとホールディングス	75,700	189.00	14,307,300
全国保証	31,500	4,695.00	147,892,500
めぶきフィナンシャルグループ	581,100	437.00	253,940,700

東京ＴＹフィナンシャルグループ	15,100	2,760.00	41,676,000	
九州フィナンシャルグループ	183,400	607.00	111,323,800	
かんぽ生命保険	42,200	2,711.00	114,404,200	
ゆうちょ銀行	316,800	1,473.00	466,646,400	
富山第一銀行	28,500	512.00	14,592,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	680,000	633.00	430,440,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	75,800	1,327.00	100,586,600	
マーキュリアインベストメント	2,300	1,280.00	2,944,000	
アルヒ	9,600	1,504.00	14,438,400	
日産自動車	1,337,300	1,129.00	1,509,811,700	
いすゞ自動車	328,600	1,720.50	565,356,300	
トヨタ自動車	1,378,500	7,323.00	10,094,755,500	*
日野自動車	161,800	1,437.00	232,506,600	
三菱自動車工業	419,700	850.00	356,745,000	
エフテック	7,300	1,339.00	9,774,700	
レシップホールディングス	4,100	903.00	3,702,300	
GMB	1,900	1,796.00	3,412,400	
ファルテック	2,000	1,441.00	2,882,000	
武蔵精密工業	12,100	3,745.00	45,314,500	
日産車体	44,300	1,053.00	46,647,900	
新明和工業	49,300	948.00	46,736,400	
極東開発工業	21,100	1,690.00	35,659,000	
日信工業	23,000	1,904.00	43,792,000	
トピー工業	9,300	3,275.00	30,457,500	
ティラド	4,100	4,050.00	16,605,000	
曙ブレーキ工業	52,700	309.00	16,284,300	
タチエス	19,200	1,916.00	36,787,200	
NOK	60,900	2,285.00	139,156,500	
フタバ産業	34,700	957.00	33,207,900	
KYB	11,800	5,580.00	65,844,000	
市光工業	17,000	1,139.00	19,363,000	
大同メタル工業	14,300	1,325.00	18,947,500	
プレス工業	60,200	673.00	40,514,600	
ミクニ	14,400	706.00	10,166,400	
太平洋工業	23,700	1,500.00	35,550,000	
ケーヒン	26,000	2,211.00	57,486,000	
河西工業	13,900	1,463.00	20,335,700	
アイシン精機	93,400	6,300.00	588,420,000	
マツダ	355,900	1,504.50	535,451,550	
今仙電機製作所	10,500	1,216.00	12,768,000	
本田技研工業	1,020,400	3,893.00	3,972,417,200	
スズキ	224,700	6,073.00	1,364,603,100	
SUBARU	352,000	3,778.00	1,329,856,000	
安永	5,500	2,538.00	13,959,000	
ヤマハ発動機	160,100	3,455.00	553,145,500	
ショーワ	29,400	1,662.00	48,862,800	
小糸製作所	67,900	7,450.00	505,855,000	
TBK	13,500	547.00	7,384,500	

エクセディ	13,700	3,435.00	47,059,500
ミツバ	20,900	1,428.00	29,845,200
豊田合成	41,200	2,644.00	108,932,800
愛三工業	19,900	1,246.00	24,795,400
盟和産業	1,700	1,383.00	2,351,100
日本プラスト	4,600	976.00	4,489,600
ヨロズ	11,500	1,949.00	22,413,500
エフ・シー・シー	18,500	3,080.00	56,980,000
新家工業	2,600	2,470.00	6,422,000
シマノ	45,700	15,750.00	719,775,000
テイ・エス テック	26,300	4,325.00	113,747,500
ジャムコ	5,700	2,394.00	13,645,800
小野建	9,700	1,992.00	19,322,400
はるやまホールディングス	5,200	1,105.00	5,746,000
ノジマ	19,600	2,544.00	49,862,400
佐島電機	8,200	1,109.00	9,093,800
カップ・クリエイト	13,900	1,295.00	18,000,500
エコートレーディング	2,500	721.00	1,802,500
伯東	6,800	1,700.00	11,560,000
コンドーテック	8,900	981.00	8,730,900
中山福	6,400	765.00	4,896,000
ライトオン	9,400	937.00	8,807,800
ナガイレーベン	14,800	2,871.00	42,490,800
ジーンズメイト	3,400	848.00	2,883,200
三菱食品	12,300	3,085.00	37,945,500
良品計画	14,800	35,700.00	528,360,000
三城ホールディングス	13,800	529.00	7,300,200
松田産業	8,100	2,006.00	16,248,600
第一興商	16,600	5,660.00	93,956,000
メディバルホールディングス	111,900	2,171.00	242,934,900
アドヴァン	11,400	1,074.00	12,243,600
S P K	2,400	3,065.00	7,356,000
萩原電気	3,800	3,455.00	13,129,000
アルビス	2,500	3,225.00	8,062,500
アズワン	8,700	7,200.00	62,640,000
スズデン	3,900	1,802.00	7,027,800
尾家産業	3,300	1,343.00	4,431,900
シモジマ	6,800	1,128.00	7,670,400
ドウシシャ	11,800	2,397.00	28,284,600
小津産業	2,500	2,218.00	5,545,000
コナカ	14,300	590.00	8,437,000
高速	6,600	1,242.00	8,197,200
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,815.00	2,541,000
G - 7ホールディングス	3,300	2,558.00	8,441,400
たけびし	3,900	1,865.00	7,273,500
イオン北海道	11,200	787.00	8,814,400
コジマ	19,300	356.00	6,870,800
ヒマラヤ	3,100	1,298.00	4,023,800
コーナン商事	15,900	2,530.00	40,227,000
ネットワンシステムズ	45,400	1,623.00	73,684,200

エコス	4,500	1,241.00	5,584,500
ワタミ	13,200	1,323.00	17,463,600
マルシェ	3,000	824.00	2,472,000
リックス	2,500	2,104.00	5,260,000
システムソフト	26,500	142.00	3,763,000
ドンキホーテホールディングス	72,400	5,940.00	430,056,000
丸文	9,900	1,102.00	10,909,800
西松屋チェーン	24,500	1,243.00	30,453,500
ゼンショーホールディングス	57,900	2,242.00	129,811,800
ハピネット	7,600	1,736.00	13,193,600
幸楽苑ホールディングス	7,100	1,922.00	13,646,200
ハークスレイ	2,700	1,092.00	2,948,400
橋本総業ホールディングス	2,300	1,848.00	4,250,400
日本ライフライン	31,800	3,435.00	109,233,000
サイゼリヤ	16,600	3,000.00	49,800,000
エクセル	4,500	2,707.00	12,181,500
V Tホールディングス	37,800	586.00	22,150,800
マルカキカイ	3,600	2,102.00	7,567,200
アルゴグラフィックス	5,100	3,595.00	18,334,500
魚力	3,100	1,209.00	3,747,900
I D O M	33,900	712.00	24,136,800
日本エム・ディ・エム	7,500	1,057.00	7,927,500
ポブラ	3,000	866.00	2,598,000
フジ・コーポレーション	1,900	2,652.00	5,038,800
ユナイテッドアローズ	13,800	4,360.00	60,168,000
進和	6,600	2,312.00	15,259,200
エスケイジャパン	2,400	671.00	1,610,400
ダイترون	5,100	2,417.00	12,326,700
ハイデイ日高	14,640	2,751.00	40,274,640
シークス	7,100	5,060.00	35,926,000
京都きもの友禅	7,300	797.00	5,818,100
コロワイド	37,100	2,483.00	92,119,300
ピーシーデポコーポレーション	16,700	793.00	13,243,100
田中商事	3,500	729.00	2,551,500
オーハシテクニカ	6,300	1,804.00	11,365,200
壱番屋	7,900	4,490.00	35,471,000
白銅	4,000	2,493.00	9,972,000
トップカルチャー	4,100	497.00	2,037,700
P L A N T	2,600	1,364.00	3,546,400
スギホールディングス	24,500	5,820.00	142,590,000
島津製作所	135,500	2,760.00	373,980,000
J M S	10,500	627.00	6,583,500
クボテック	2,500	541.00	1,352,500
長野計器	8,900	1,270.00	11,303,000
プイ・テクノロジー	2,700	25,130.00	67,851,000
スター精密	18,200	2,173.00	39,548,600
東京計器	7,200	1,252.00	9,014,400
愛知時計電機	1,500	4,510.00	6,765,000
インターアクション	4,400	1,084.00	4,769,600
オーバル	11,200	312.00	3,494,400

東京精密	20,500	4,460.00	91,430,000
マニー	13,800	4,030.00	55,614,000
ニコン	197,600	2,205.00	435,708,000
トプコン	60,900	2,354.00	143,358,600
オリンパス	168,900	4,240.00	716,136,000
理研計器	10,800	2,372.00	25,617,600
S C R E E Nホールディングス	21,500	9,600.00	206,400,000
キヤノン電子	10,400	2,550.00	26,520,000
タムロン	9,100	2,511.00	22,850,100
H O Y A	230,900	5,511.00	1,272,489,900
シード	1,200	5,400.00	6,480,000
ノーリツ鋼機	11,500	2,447.00	28,140,500
エー・アンド・デイ	10,400	675.00	7,020,000
キヤノン	610,400	4,033.00	2,461,743,200
リコー	340,900	1,161.00	395,784,900
シチズン時計	135,300	814.00	110,134,200
リズム時計工業	4,300	2,276.00	9,786,800
大研医器	10,100	766.00	7,736,600
メニコン	15,600	2,724.00	42,494,400
中本パックス	2,200	2,301.00	5,062,200
スノーピーク	3,500	1,211.00	4,238,500
パラマウントベッドホールディングス	12,000	5,590.00	67,080,000
トランザクション	5,100	1,079.00	5,502,900
S H O B I	3,900	417.00	1,626,300
ニホンフラッシュ	5,300	2,738.00	14,511,400
前田工織	11,400	1,977.00	22,537,800
永大産業	15,000	564.00	8,460,000
アートネイチャー	12,100	780.00	9,438,000
バンダイナムコホールディングス	117,200	3,545.00	415,474,000
アイフィスジャパン	2,400	716.00	1,718,400
共立印刷	18,900	370.00	6,993,000
S H O E I	5,100	4,665.00	23,791,500
フランスベッドホールディングス	13,400	996.00	13,346,400
マーベラス	18,900	921.00	17,406,900
パイロットコーポレーション	19,800	5,580.00	110,484,000
萩原工業	6,300	1,847.00	11,636,100
エイベックス	20,600	1,610.00	33,166,000
トッパン・フォームズ	24,300	1,233.00	29,961,900
フジシールインターナショナル	25,400	3,555.00	90,297,000
タカラトミー	47,500	1,161.00	55,147,500
廣済堂	10,600	522.00	5,533,200
A s - m e エステール	3,400	979.00	3,328,600
アーク	47,900	129.00	6,179,100
レック	6,700	3,115.00	20,870,500
タカノ	5,000	963.00	4,815,000
プロネクサス	10,600	1,328.00	14,076,800
ホクシン	8,200	190.00	1,558,000
ウッドワン	3,800	1,457.00	5,536,600
大建工業	8,800	2,774.00	24,411,200
きもと	19,400	418.00	8,109,200

凸版印刷	320,000	940.00	300,800,000
大日本印刷	148,400	2,269.00	336,719,600
図書印刷	7,600	957.00	7,273,200
共同印刷	3,500	3,190.00	11,165,000
N I S S H A	23,300	2,907.00	67,733,100
光村印刷	1,000	2,449.00	2,449,000
藤森工業	9,500	3,655.00	34,722,500
ヴィア・ホールディングス	9,800	750.00	7,350,000
宝印刷	5,900	1,910.00	11,269,000
前澤化成工業	7,800	1,199.00	9,352,200
アシックス	112,600	1,738.00	195,698,800
ツツミ	3,500	2,157.00	7,549,500
J S P	6,600	3,285.00	21,681,000
ニチハ	17,100	4,250.00	72,675,000
エフピコ	9,300	6,080.00	56,544,000
小松ウオール工業	3,800	2,603.00	9,891,400
ヤマハ	76,400	4,755.00	363,282,000
河合楽器製作所	3,800	3,710.00	14,098,000
クリナップ	10,500	846.00	8,883,000
ピジョン	68,500	4,365.00	299,002,500
天馬	8,800	2,189.00	19,263,200
兼松サステック	900	2,044.00	1,839,600
キングジム	9,400	999.00	9,390,600
リンテック	26,900	3,095.00	83,255,500
信越ポリマー	23,300	1,244.00	28,985,200
東リ	28,200	395.00	11,139,000
イトーキ	23,900	726.00	17,351,400
任天堂	69,800	48,770.00	3,404,146,000
三菱鉛筆	18,700	2,412.00	45,104,400
松風	5,600	1,441.00	8,069,600
タカラスタンダード	23,400	1,802.00	42,166,800
コクヨ	54,400	1,989.00	108,201,600
ナカバヤシ	11,100	625.00	6,937,500
ニフコ	20,800	7,680.00	159,744,000
立川ブラインド工業	5,000	1,618.00	8,090,000
グローブライト	5,100	2,437.00	12,428,700
岡村製作所	39,600	1,512.00	59,875,200
日本バルカー工業	9,200	3,175.00	29,210,000
M U T O Hホールディングス	1,600	2,543.00	4,068,800
伊藤忠商事	819,600	2,069.50	1,696,162,200
丸紅	917,800	828.30	760,213,740
スクロール	17,400	461.00	8,021,400
高島	1,900	2,264.00	4,301,600
ヨンドシーホールディングス	11,400	2,685.00	30,609,000
三陽商会	6,200	2,442.00	15,140,400
長瀬産業	67,300	1,876.00	126,254,800
ナイガイ	4,400	549.00	2,415,600
蝶理	7,100	1,985.00	14,093,500
豊田通商	124,600	4,135.00	515,221,000
オンワードホールディングス	70,900	913.00	64,731,700

三共生興	18,900	534.00	10,092,600
兼松	47,600	1,465.00	69,734,000
美津濃	11,200	3,190.00	35,728,000
ツカモトコーポレーション	2,000	1,303.00	2,606,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	35,700	8,030.00	286,671,000
ルックホールディングス	20,000	326.00	6,520,000
三井物産	948,700	1,979.50	1,877,951,650
日本紙パルプ商事	5,800	4,375.00	25,375,000
東京エレクトロン	75,600	20,650.00	1,561,140,000
日立ハイテクノロジーズ	38,800	5,100.00	197,880,000
カメイ	14,500	1,679.00	24,345,500
東都水産	1,700	2,001.00	3,401,700
OUGホールディングス	1,800	2,678.00	4,820,400
スターゼン	4,400	5,400.00	23,760,000
セイコーホールディングス	17,500	2,914.00	50,995,000
山善	43,600	1,211.00	52,799,600
椿本興業	2,500	3,365.00	8,412,500
住友商事	704,400	1,906.00	1,342,586,400
日本ユニシス	30,900	2,214.00	68,412,600
内田洋行	5,100	3,355.00	17,110,500
三菱商事	783,700	3,029.00	2,373,827,300
第一実業	5,100	3,260.00	16,626,000
キャノンマーケティングジャパン	31,900	2,939.00	93,754,100
西華産業	6,900	2,730.00	18,837,000
佐藤商事	10,000	1,161.00	11,610,000
菱洋エレクトロ	10,400	1,896.00	19,718,400
東京産業	11,100	603.00	6,693,300
ユアサ商事	10,600	3,790.00	40,174,000
神鋼商事	2,500	3,700.00	9,250,000
小林産業	7,600	358.00	2,720,800
阪和興業	20,900	4,920.00	102,828,000
正栄食品工業	6,200	4,045.00	25,079,000
カナデン	10,700	1,369.00	14,648,300
菱電商事	8,000	1,868.00	14,944,000
ニプロ	78,500	1,590.00	124,815,000
フルサト工業	6,100	1,817.00	11,083,700
岩谷産業	24,800	4,160.00	103,168,000
すてきナイスグループ	4,800	1,458.00	6,998,400
昭光通商	40,000	122.00	4,880,000
ニチモウ	1,700	1,836.00	3,121,200
極東貿易	16,000	480.00	7,680,000
イワキ	16,000	446.00	7,136,000
兼松エレクトロニクス	7,100	3,355.00	23,820,500
三愛石油	30,000	1,506.00	45,180,000
稲畑産業	26,800	1,624.00	43,523,200
G S Iクレオス	3,000	1,844.00	5,532,000
明和産業	10,400	499.00	5,189,600
キムラタン	55,500	44.00	2,442,000
ゴールドウイン	3,400	12,140.00	41,276,000

ユニ・チャーム	240,400	3,002.00	721,680,800
デサント	27,100	1,709.00	46,313,900
キング	5,800	649.00	3,764,200
ワキタ	23,800	1,284.00	30,559,200
ヤマトインターナショナル	8,100	476.00	3,855,600
東邦ホールディングス	33,100	2,534.00	83,875,400
サンゲツ	37,700	2,254.00	84,975,800
ミツウロコグループホールディングス	16,200	777.00	12,587,400
シナネンホールディングス	5,300	2,702.00	14,320,600
伊藤忠エネクス	24,700	1,054.00	26,033,800
サンリオ	31,400	1,975.00	62,015,000
サンワテクノス	6,600	2,159.00	14,249,400
リョーサン	14,000	4,015.00	56,210,000
新光商事	12,300	1,982.00	24,378,600
トーヨー	5,000	2,485.00	12,425,000
三信電気	10,300	1,962.00	20,208,600
東陽テクニカ	12,900	974.00	12,564,600
モスフードサービス	14,600	3,265.00	47,669,000
加賀電子	10,100	2,753.00	27,805,300
三益半導体工業	8,700	2,014.00	17,521,800
ソーダニッカ	11,600	702.00	8,143,200
立花エレテック	7,600	2,220.00	16,872,000
木曽路	13,700	2,727.00	37,359,900
S R Sホールディングス	13,200	971.00	12,817,200
千趣会	20,200	628.00	12,685,600
タカキュー	9,000	218.00	1,962,000
ケーヨー	20,700	628.00	12,999,600
上新電機	13,200	3,820.00	50,424,000
日本瓦斯	20,500	4,580.00	93,890,000
ロイヤルホールディングス	19,800	2,852.00	56,469,600
東天紅	800	1,868.00	1,494,400
いなげや	12,400	1,796.00	22,270,400
島忠	27,000	3,565.00	96,255,000
チヨダ	13,200	2,745.00	36,234,000
ライフコーポレーション	8,500	2,839.00	24,131,500
リンガーハット	13,800	2,412.00	33,285,600
さが美グループホールディングス	10,000	120.00	1,200,000
MrMaxHD	14,000	737.00	10,318,000
テンアライド	10,600	481.00	5,098,600
AOKIホールディングス	22,300	1,720.00	38,356,000
オークワ	16,000	1,104.00	17,664,000
コメリ	17,200	3,130.00	53,836,000
青山商事	21,400	4,485.00	95,979,000
しまむら	13,000	12,740.00	165,620,000
はせがわ	5,900	487.00	2,873,300
高島屋	175,000	1,089.00	190,575,000
松屋	22,500	1,547.00	34,807,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	52,900	2,092.00	110,666,800
近鉄百貨店	4,300	3,885.00	16,705,500
パルコ	10,700	1,482.00	15,857,400

丸井グループ	107,000	2,042.00	218,494,000
クレディセゾン	84,900	1,883.00	159,866,700
アクシアル リテイリング	9,300	4,260.00	39,618,000
井筒屋	6,300	400.00	2,520,000
イオン	429,700	1,826.00	784,632,200
イズミ	20,200	6,940.00	140,188,000
東武ストア	1,300	3,015.00	3,919,500
フォーバル	4,900	961.00	4,708,900
平和堂	22,700	2,458.00	55,796,600
フジ	13,100	2,212.00	28,977,200
ヤオコー	12,700	5,770.00	73,279,000
ゼビオホールディングス	15,200	2,151.00	32,695,200
ケースホールディングス	47,300	2,980.00	140,954,000
PALTAC	15,700	5,390.00	84,623,000
三谷産業	12,100	451.00	5,457,100
Olympicグループ	6,600	592.00	3,907,200
日産東京販売ホールディングス	16,400	404.00	6,625,600
新生銀行	96,800	1,711.00	165,624,800
あおぞら銀行	66,600	4,430.00	295,038,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,901,700	769.60	6,081,148,320
りそなホールディングス	1,227,400	622.60	764,179,240
三井住友トラスト・ホールディングス	219,900	4,371.00	961,182,900
三井住友フィナンシャルグループ	846,500	4,721.00	3,996,326,500
第四銀行	13,700	4,980.00	68,226,000
北越銀行	11,200	2,456.00	27,507,200
千葉銀行	401,000	900.00	360,900,000
群馬銀行	227,100	661.00	150,113,100
武蔵野銀行	17,800	3,665.00	65,237,000
千葉興業銀行	30,800	506.00	15,584,800
筑波銀行	46,600	366.00	17,055,600
七十七銀行	35,100	2,717.00	95,366,700
青森銀行	8,700	3,415.00	29,710,500
秋田銀行	7,200	2,916.00	20,995,200
山形銀行	12,600	2,382.00	30,013,200
岩手銀行	7,800	4,350.00	33,930,000
東邦銀行	99,900	408.00	40,759,200
東北銀行	5,800	1,491.00	8,647,800
みちのく銀行	7,200	1,805.00	12,996,000
ふくおかフィナンシャルグループ	454,000	564.00	256,056,000
静岡銀行	295,000	1,114.00	328,630,000
十六銀行	15,000	2,921.00	43,815,000
スルガ銀行	114,400	1,875.00	214,500,000
八十二銀行	202,400	654.00	132,369,600
山梨中央銀行	69,000	446.00	30,774,000
大垣共立銀行	17,700	2,810.00	49,737,000
福井銀行	9,600	2,609.00	25,046,400
北國銀行	12,700	4,495.00	57,086,500
清水銀行	3,800	3,015.00	11,457,000
富山銀行	2,200	3,970.00	8,734,000
滋賀銀行	105,000	566.00	59,430,000

南都銀行	13,100	3,020.00	39,562,000
百五銀行	107,300	537.00	57,620,100
京都銀行	42,700	6,080.00	259,616,000
紀陽銀行	42,000	1,781.00	74,802,000
三重銀行	5,000	2,353.00	11,765,000
ほくほくフィナンシャルグループ	74,400	1,575.00	117,180,000
広島銀行	165,100	853.00	140,830,300
山陰合同銀行	66,300	1,031.00	68,355,300
中国銀行	77,300	1,353.00	104,586,900
鳥取銀行	3,600	1,742.00	6,271,200
伊予銀行	159,600	874.00	139,490,400
百十四銀行	119,000	366.00	43,554,000
四国銀行	17,100	1,564.00	26,744,400
阿波銀行	90,000	677.00	60,930,000
大分銀行	6,400	4,175.00	26,720,000
宮崎銀行	7,400	3,505.00	25,937,000
佐賀銀行	6,800	2,542.00	17,285,600
十八銀行	69,000	291.00	20,079,000
沖縄銀行	10,900	4,405.00	48,014,500
琉球銀行	21,700	1,641.00	35,609,700
セブン銀行	419,500	378.00	158,571,000
みずほフィナンシャルグループ	15,195,200	201.20	3,057,274,240
高知銀行	4,100	1,407.00	5,768,700
山口フィナンシャルグループ	105,000	1,301.00	136,605,000
アクリーティブ	6,300	336.00	2,116,800
芙蓉総合リース	12,800	7,170.00	91,776,000
興銀リース	21,000	2,797.00	58,737,000
東京センチュリー	22,500	6,060.00	136,350,000
SBIホールディングス	126,500	2,436.00	308,154,000
日本証券金融	45,800	664.00	30,411,200
アイフル	187,800	376.00	70,612,800
日本アジア投資	10,100	365.00	3,686,500
長野銀行	3,700	1,902.00	7,037,400
名古屋銀行	9,000	4,005.00	36,045,000
北洋銀行	168,600	376.00	63,393,600
愛知銀行	3,800	5,450.00	20,710,000
第三銀行	6,300	1,656.00	10,432,800
中京銀行	4,600	2,331.00	10,722,600
大光銀行	3,800	2,402.00	9,127,600
愛媛銀行	15,600	1,322.00	20,623,200
トマト銀行	4,300	1,570.00	6,751,000
みなと銀行	10,100	2,091.00	21,119,100
京葉銀行	99,000	504.00	49,896,000
関西アーバン銀行	15,600	1,429.00	22,292,400
栃木銀行	57,900	443.00	25,649,700
北日本銀行	3,500	3,030.00	10,605,000
東和銀行	19,600	1,425.00	27,930,000
福島銀行	10,600	805.00	8,533,000
大東銀行	5,400	1,403.00	7,576,200
リコーリース	8,800	3,640.00	32,032,000

イオンフィナンシャルサービス	79,400	2,555.00	202,867,000
アコム	224,900	486.00	109,301,400
ジャックス	13,600	2,511.00	34,149,600
オリエントコーポレーション	242,100	173.00	41,883,300
日立キャピタル	30,800	2,832.00	87,225,600
アプラスフィナンシャル	54,400	111.00	6,038,400
オリックス	746,000	1,941.50	1,448,359,000
三菱UFJリース	283,900	687.00	195,039,300
ジャフコ	16,100	5,390.00	86,779,000
九州リースサービス	4,800	883.00	4,238,400
トモニホールディングス	92,200	504.00	46,468,800
大和証券グループ本社	957,000	732.30	700,811,100
野村ホールディングス	1,924,000	666.00	1,281,384,000
岡三証券グループ	95,000	698.00	66,310,000
丸三証券	35,600	1,054.00	37,522,400
東洋証券	40,000	318.00	12,720,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,800	802.00	99,287,600
光世証券	2,700	1,421.00	3,836,700
水戸証券	34,700	431.00	14,955,700
いちよし証券	23,500	1,284.00	30,174,000
松井証券	54,700	1,078.00	58,966,600
SOMPOホールディングス	219,300	4,142.00	908,340,600
だいこう証券ビジネス	5,500	683.00	3,756,500
日本取引所グループ	328,600	1,862.00	611,853,200
マネックスグループ	118,700	392.00	46,530,400
カブドットコム証券	71,600	385.00	27,566,000
極東証券	15,000	1,577.00	23,655,000
岩井コスモホールディングス	11,400	1,436.00	16,370,400
藍澤證券	20,900	801.00	16,740,900
フィデアホールディングス	108,600	200.00	21,720,000
池田泉州ホールディングス	118,600	424.00	50,286,400
アニコムホールディングス	7,600	3,470.00	26,372,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	292,400	3,352.00	980,124,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	91,900	1,985.00	182,421,500
マネーパートナーズグループ	14,300	409.00	5,848,700
小林洋行	3,300	299.00	986,700
第一生命ホールディングス	632,700	2,124.00	1,343,854,800
東京海上ホールディングス	421,300	4,942.00	2,082,064,600
アドバンテッジリスクマネジメント	2,700	1,409.00	3,804,300
イー・ギャランティ	3,000	4,115.00	12,345,000
アサックス	1,600	1,928.00	3,084,800
NECキャピタルソリューション	4,600	2,143.00	9,857,800
T&Dホールディングス	345,900	1,784.50	617,258,550
アドバンスクリエイト	2,600	1,953.00	5,077,800
三井不動産	558,500	2,638.00	1,473,323,000
三菱地所	832,500	1,913.00	1,592,572,500
平和不動産	19,800	2,064.00	40,867,200

東京建物	122,200	1,722.00	210,428,400
ダイビル	28,800	1,357.00	39,081,600
京阪神ビルディング	18,600	872.00	16,219,200
住友不動産	268,000	3,963.00	1,062,084,000
太平洋興発	4,700	1,079.00	5,071,300
大京	17,800	2,299.00	40,922,200
テオーシー	38,600	867.00	33,466,200
東京楽天地	1,800	5,190.00	9,342,000
レオパレス21	133,500	831.00	110,938,500
スターツコーポレーション	15,200	2,840.00	43,168,000
フジ住宅	14,300	886.00	12,669,800
空港施設	11,700	640.00	7,488,000
明和地所	6,200	837.00	5,189,400
ゴールドクレスト	8,800	2,252.00	19,817,600
リログループ	59,300	3,045.00	180,568,500
日本エスリード	4,400	2,277.00	10,018,800
日神不動産	14,900	809.00	12,054,100
日本エスコン	20,100	1,004.00	20,180,400
タカラレーベン	52,400	488.00	25,571,200
サンヨーハウジング名古屋	5,800	1,240.00	7,192,000
イオンモール	72,100	2,192.00	158,043,200
ファースト住建	4,200	1,756.00	7,375,200
ランド	241,400	16.00	3,862,400
カチタス	11,400	3,055.00	34,827,000
東祥	6,700	4,035.00	27,034,500
トーセイ	13,600	1,362.00	18,523,200
穴吹興産	1,200	3,075.00	3,690,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	69,500	1,345.00	93,477,500
サンフロンティア不動産	12,600	1,227.00	15,460,200
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	897.00	7,714,200
インテリックス	3,200	1,138.00	3,641,600
ランドビジネス	6,900	333.00	2,297,700
グランディハウス	9,900	491.00	4,860,900
東武鉄道	121,200	3,340.00	404,808,000
相鉄ホールディングス	36,300	2,871.00	104,217,300
東京急行電鉄	308,000	1,753.00	539,924,000
京浜急行電鉄	155,300	1,952.00	303,145,600
小田急電鉄	168,600	2,191.00	369,402,600
京王電鉄	63,400	4,715.00	298,931,000
京成電鉄	78,900	3,535.00	278,911,500
富士急行	15,500	2,786.00	43,183,000
新京成電鉄	2,900	2,210.00	6,409,000
東日本旅客鉄道	203,700	10,125.00	2,062,462,500
西日本旅客鉄道	102,300	7,482.00	765,408,600
東海旅客鉄道	101,500	20,185.00	2,048,777,500
西武ホールディングス	144,500	1,849.00	267,180,500
鴻池運輸	16,000	1,901.00	30,416,000
西日本鉄道	31,400	2,912.00	91,436,800
ハマキョウレックス	8,000	3,575.00	28,600,000
サカイ引越センター	6,000	5,660.00	33,960,000

近鉄グループホールディングス	107,400	4,155.00	446,247,000
阪急阪神ホールディングス	143,200	3,980.00	569,936,000
南海電気鉄道	50,900	2,731.00	139,007,900
京阪ホールディングス	47,800	3,420.00	163,476,000
神戸電鉄	2,600	3,980.00	10,348,000
名古屋鉄道	83,300	2,769.00	230,657,700
山陽電気鉄道	8,300	2,766.00	22,957,800
トランコム	3,000	6,960.00	20,880,000
日本通運	42,200	7,360.00	310,592,000
ヤマトホールディングス	188,300	2,796.50	526,580,950
山九	27,600	5,160.00	142,416,000
日新	9,300	2,815.00	26,179,500
丸運	6,000	365.00	2,190,000
丸全昭和運輸	38,000	521.00	19,798,000
センコーグループホールディングス	64,600	786.00	50,775,600
トナミホールディングス	2,600	5,630.00	14,638,000
ニッコンホールディングス	40,800	2,753.00	112,322,400
日本石油輸送	1,300	3,330.00	4,329,000
福山通運	15,700	4,670.00	73,319,000
セイノーホールディングス	80,400	1,868.00	150,187,200
神奈川中央交通	2,700	3,700.00	9,990,000
日立物流	23,600	2,647.00	62,469,200
丸和運輸機関	5,700	3,790.00	21,603,000
C & F ロジホールディングス	11,800	1,579.00	18,632,200
日本郵船	89,800	2,350.00	211,030,000
商船三井	67,900	3,420.00	232,218,000
川崎汽船	49,600	2,627.00	130,299,200
NSユナイテッド海運	5,100	2,333.00	11,898,300
明治海運	11,400	463.00	5,278,200
飯野海運	54,700	565.00	30,905,500
共栄タンカー	800	2,073.00	1,658,400
九州旅客鉄道	90,100	3,365.00	303,186,500
SGホールディングス	76,100	2,324.00	176,856,400
日本航空	199,200	4,057.00	808,154,400
ANAホールディングス	210,500	4,291.00	903,255,500
パスコ	10,000	339.00	3,390,000
西本Wismettacホールディングス	2,300	4,540.00	10,442,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,498.00	1,348,200
Genky DrugStores	4,400	3,520.00	15,488,000
三菱倉庫	37,100	2,522.00	93,566,200
三井倉庫ホールディングス	61,000	361.00	22,021,000
住友倉庫	74,000	743.00	54,982,000
澁澤倉庫	5,900	1,937.00	11,428,300
ヤマタネ	5,600	1,987.00	11,127,200
東陽倉庫	19,500	378.00	7,371,000
乾汽船	8,300	808.00	6,706,400
日本トランスシティ	26,000	441.00	11,466,000
ケイヒン	2,100	1,777.00	3,731,700
中央倉庫	6,600	1,102.00	7,273,200

川西倉庫	2,200	2,023.00	4,450,600
安田倉庫	9,700	1,031.00	10,000,700
東洋埠頭	3,200	1,764.00	5,644,800
宇徳	9,400	511.00	4,803,400
上組	67,600	2,360.00	159,536,000
サンリツ	2,800	819.00	2,293,200
キムラユニティー	2,900	1,167.00	3,384,300
キューソー流通システム	3,100	2,596.00	8,047,600
近鉄エクスプレス	20,300	2,078.00	42,183,400
東海運	6,100	418.00	2,549,800
エーアイテイ	7,700	1,130.00	8,701,000
内外トランスライン	3,800	1,844.00	7,007,200
日本コンセプト	2,100	1,551.00	3,257,100
東京放送ホールディングス	67,000	2,441.00	163,547,000
日本テレビホールディングス	102,200	2,051.00	209,612,200
朝日放送	11,000	909.00	9,999,000
テレビ朝日ホールディングス	30,500	2,338.00	71,309,000
スカパーJ S A Tホールディングス	84,900	490.00	41,601,000
テレビ東京ホールディングス	9,100	2,751.00	25,034,100
日本BS放送	3,800	1,370.00	5,206,000
ビジョン	2,900	2,868.00	8,317,200
USEN-NEXT HOLDINGS	2,900	979.00	2,839,100
ワイヤレスゲート	5,200	1,189.00	6,182,800
コネクシオ	7,900	2,368.00	18,707,200
日本通信	100,800	130.00	13,104,000
クロップス	2,400	925.00	2,220,000
日本電信電話	798,500	4,976.00	3,973,336,000
KDDI	1,001,900	2,673.50	2,678,579,650
光通信	13,400	15,740.00	210,916,000
NTTドコモ	823,700	2,740.00	2,256,938,000
エムティーアイ	15,000	636.00	9,540,000
GMOインターネット	40,500	1,894.00	76,707,000
アイドママーケティングコミュニケーション	1,800	747.00	1,344,600
カドカワ	32,400	1,251.00	40,532,400
学研ホールディングス	3,700	4,990.00	18,463,000
ゼンリン	13,500	3,450.00	46,575,000
昭文社	5,100	775.00	3,952,500
インプレスホールディングス	9,500	238.00	2,261,000
東京電力ホールディングス	905,100	416.00	376,521,600
中部電力	346,900	1,462.00	507,167,800
関西電力	462,700	1,339.50	619,786,650
中国電力	156,700	1,265.00	198,225,500
北陸電力	111,100	862.00	95,768,200
東北電力	265,500	1,414.00	375,417,000
四国電力	102,100	1,224.00	124,970,400
九州電力	250,400	1,217.00	304,736,800
北海道電力	113,700	637.00	72,426,900
沖縄電力	18,300	2,875.00	52,612,500

電源開発	90,200	2,756.00	248,591,200
エフオン	5,700	1,204.00	6,862,800
イーレックス	17,800	812.00	14,453,600
東京瓦斯	241,900	2,716.50	657,121,350
大阪瓦斯	220,000	2,184.50	480,590,000
東邦瓦斯	56,200	3,265.00	183,493,000
北海道瓦斯	31,000	300.00	9,300,000
広島ガス	23,400	415.00	9,711,000
西部瓦斯	13,800	2,834.00	39,109,200
静岡ガス	32,200	898.00	28,915,600
メタウォーター	6,400	3,205.00	20,512,000
アイネット	6,300	1,544.00	9,727,200
松竹	7,400	15,230.00	112,702,000
東宝	73,200	3,470.00	254,004,000
エイチ・アイ・エス	16,900	3,925.00	66,332,500
東映	4,200	11,570.00	48,594,000
ラックランド	2,100	2,183.00	4,584,300
エヌ・ティ・ティ・データ	345,600	1,100.00	380,160,000
共立メンテナンス	19,300	4,670.00	90,131,000
イチネンホールディングス	12,100	1,498.00	18,125,800
建設技術研究所	7,500	1,378.00	10,335,000
スペース	7,000	1,381.00	9,667,000
長 大	3,300	851.00	2,808,300
アインホールディングス	15,000	7,220.00	108,300,000
燦ホールディングス	2,600	2,649.00	6,887,400
ピー・シー・エー	1,700	1,861.00	3,163,700
スバル興業	800	6,530.00	5,224,000
東京テアトル	4,500	1,475.00	6,637,500
タナベ経営	2,100	1,839.00	3,861,900
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	1,929.00	3,665,100
ナガワ	2,200	4,480.00	9,856,000
よみうりランド	2,400	4,715.00	11,316,000
東京都競馬	8,100	3,745.00	30,334,500
常磐興産	4,400	1,894.00	8,333,600
カナモト	16,500	3,430.00	56,595,000
東京ドーム	43,900	1,008.00	44,251,200
D T S	11,600	3,820.00	44,312,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,700	4,580.00	236,786,000
シーイーシー	6,600	3,280.00	21,648,000
カブコン	23,800	4,425.00	105,315,000
西尾レントオール	9,500	3,390.00	32,205,000
アイ・エス・ビー	2,200	1,381.00	3,038,200
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	62,000	38.00	2,356,000
日本空港ビルデング	32,700	4,070.00	133,089,000
トランス・コスモス	12,000	2,868.00	34,416,000
乃村工藝社	25,300	2,144.00	54,243,200
ジャステック	6,500	1,286.00	8,359,000
S C S K	25,700	4,365.00	112,180,500

藤田観光	4,300	3,235.00	13,910,500
KNT-CTホールディングス	6,700	1,806.00	12,100,200
日本管財	11,600	2,113.00	24,510,800
トーカイ	10,500	2,527.00	26,533,500
白洋舎	1,200	3,365.00	4,038,000
セコム	115,000	7,850.00	902,750,000
日本システムウエア	3,700	2,592.00	9,590,400
セントラル警備保障	5,200	2,644.00	13,748,800
アイネス	14,100	1,094.00	15,425,400
丹青社	22,200	1,077.00	23,909,400
メイテック	12,700	6,100.00	77,470,000
TKC	10,400	4,585.00	47,684,000
富士ソフト	15,400	4,045.00	62,293,000
応用地質	12,200	1,552.00	18,934,400
船井総研ホールディングス	22,500	2,118.00	47,655,000
NSD	18,300	2,231.00	40,827,300
進学会ホールディングス	5,000	608.00	3,040,000
丸紅建材リース	11,000	235.00	2,585,000
オオバ	8,600	678.00	5,830,800
コナミホールディングス	45,500	5,740.00	261,170,000
いであ	2,200	1,123.00	2,470,600
学究社	3,000	1,745.00	5,235,000
ベネッセホールディングス	39,700	3,980.00	158,006,000
イオンディライト	13,400	3,820.00	51,188,000
ナック	7,300	1,002.00	7,314,600
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,413.00	7,721,600
ニチイ学館	20,600	1,193.00	24,575,800
ダイセキ	18,200	3,185.00	57,967,000
ステップ	4,000	1,791.00	7,164,000
日鉄住金物産	8,700	6,150.00	53,505,000
泉州電業	3,700	2,960.00	10,952,000
元気寿司	2,800	2,703.00	7,568,400
トラスコ中山	23,200	2,832.00	65,702,400
ヤマダ電機	374,300	690.00	258,267,000
オートバックスセブン	44,400	2,109.00	93,639,600
モリト	8,900	972.00	8,650,800
アークランドサカモト	18,900	1,767.00	33,396,300
ニトリホールディングス	44,300	17,565.00	778,129,500
グルメ杵屋	8,000	1,173.00	9,384,000
愛眼	9,100	494.00	4,495,400
ケーユーホールディングス	5,800	1,112.00	6,449,600
吉野家ホールディングス	36,700	1,915.00	70,280,500
加藤産業	17,400	3,690.00	64,206,000
イノテック	9,700	1,280.00	12,416,000
イエローハット	10,500	3,255.00	34,177,500
松屋フーズ	5,400	3,975.00	21,465,000
JBCホールディングス	8,800	1,147.00	10,093,600
JKホールディングス	11,200	913.00	10,225,600
サガミチェーン	14,900	1,408.00	20,979,200
日伝	9,300	2,196.00	20,422,800

関西スーパーマーケット	8,400	1,131.00	9,500,400	
ミロク情報サービス	9,800	3,190.00	31,262,000	
北沢産業	9,500	359.00	3,410,500	
杉本商事	6,000	1,877.00	11,262,000	
因幡電機産業	14,700	5,010.00	73,647,000	
王将フードサービス	8,200	5,110.00	41,902,000	
プレナス	12,500	2,086.00	26,075,000	
ミニストップ	8,300	2,167.00	17,986,100	
アークス	20,900	2,500.00	52,250,000	
バローホールディングス	26,000	2,939.00	76,414,000	
バイテックホールディングス	5,100	1,776.00	9,057,600	
東テク	3,700	2,429.00	8,987,300	
ミスミグループ本社	129,600	3,105.00	402,408,000	
藤久	900	1,690.00	1,521,000	
アルテック	9,600	348.00	3,340,800	
ベルク	5,000	6,030.00	30,150,000	
大 庄	6,000	1,653.00	9,918,000	
タキヒヨー	3,700	2,240.00	8,288,000	
ファーストリテイリング	18,700	43,330.00	810,271,000	
ソフトバンクグループ	503,700	9,050.00	4,558,485,000	
蔵王産業	1,800	1,863.00	3,353,400	
スズケン	50,900	4,290.00	218,361,000	
サンドラッグ	47,300	4,935.00	233,425,500	
サックスパー ホールディングス	10,500	1,163.00	12,211,500	
ジェコス	7,700	1,275.00	9,817,500	
ヤマザワ	2,300	1,721.00	3,958,300	
やまや	2,300	2,974.00	6,840,200	
ルネサスイーストン	10,200	762.00	7,772,400	
ベルーナ	27,400	1,265.00	34,661,000	
合計	137,498,640		287,790,562,310	

*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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,480,771,002	1,759,043,801
国債証券		317,647,724,400	295,128,432,800
地方債証券		23,951,302,530	22,904,593,464
特殊債券		18,324,582,251	15,762,062,689
社債券		16,594,570,860	16,876,083,640
未収入金		-	3,043,919,000
未収利息		1,174,107,807	1,052,224,327
前払費用		14,204,595	11,392,773
流動資産合計		381,187,263,445	356,537,752,494
資産合計		381,187,263,445	356,537,752,494
負債の部			
流動負債			
未払解約金		3,333,561,000	3,707,675,000
流動負債合計		3,333,561,000	3,707,675,000
負債合計		3,333,561,000	3,707,675,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	295,190,206,036	274,056,741,701
剰余金			
剰余金又は欠損金()		82,663,496,409	78,773,335,793
元本等合計		377,853,702,445	352,830,077,494
純資産合計		377,853,702,445	352,830,077,494
負債純資産合計		381,187,263,445	356,537,752,494

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29年2月27日現在	平成30年2月26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	311,246,557,550円 65,544,715,948円 81,601,067,462円	295,190,206,036円 61,855,153,624円 82,988,617,959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	10,994,419,624円	14,134,325,523円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	141,332,941円	133,630,997円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	123,053,964円	110,362,927円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	42,096,310円	35,282,821円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	408,295,789円	683,723,247円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	117,006,883円	186,801,804円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	26,386,628円	25,093,209円
たわらノーロード 国内債券	1,032,184,471円	3,053,849,271円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円	754,493円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	28,763,462円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	2,797,390円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	6,736,262円
たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	1,846,591円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	- 円	427,592円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	- 円	2,978,010円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	4,270,909円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	1,180,680円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	401,500円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	1,023,651円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	371,890円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	1,490,812円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	457,571円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	61,604円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,135,343,680円	12,519,073,028円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	4,912,270,839円	5,538,860,716円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	6,923,494,244円	8,094,578,747円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,718,978,952円	3,297,220,345円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,657,494,852円	1,822,404,385円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,744,690,480円	2,021,440,802円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	247,785,929円	317,189,866円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	98,517,017円	88,286,247円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,182,976,967円	2,216,731,348円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,831,280円	2,224,336円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	356,002,601円	474,201,213円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	254,997,478円	434,763,343円

D I A M D C 8 資産 バランスファンド(新興 国30)	63,187,247円	99,374,518円
投資のソムリエ	7,588,674,489円	3,477,837,094円
クルーズコントロール	2,463,848,090円	444,343,713円
投資のソムリエ<DC年 金>	240,441,643円	239,353,124円
D I A M 8 資産バラン スファンドN<DC年金 >	1,159,116,457円	1,836,523,487円
D I A M D C バラン ス・F(成長型)	121,311,364円	232,011,746円
クルーズコントロール< DC年金>	909,502円	165,091円
D I A Mコア資産設計 ファンド(堅実型)	6,058,111円	1,123,528円
D I A Mコア資産設計 ファンド(積極型)	19,630,847円	3,353,398円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	145,993,757円	479,665,477円
ダイナミック・ナビゲー ション	460,972円	187,857円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド	797,399,737円	7,432,216,368円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー204 5)	- 円	627,520円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー205 5)	- 円	487,386円
リスク抑制世界8資産バ ランスファンド(DC)	- 円	2,441,185円
投資のソムリエ(ター ゲット・イヤー203 5)	- 円	1,160,053円
みずほエマージングボン ドオープン	10,801,911円	- 円
D I A M高金利通貨ファ ンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債 券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	31,037,609,957円	22,730,596,257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)	548,565,885円	- 円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	511,856,892円	496,308,197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)	452,644,236円	341,395,897円

D I A Mグローバル・バ ランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	278,222,935円	250,881,142円
D I A M国際分散バラ ンスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	113,027,666円	79,938,561円
D I A M国際分散バラ ンスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	315,455,060円	223,396,523円
D I A M国内重視バラ ンスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	131,854,367円	92,500,119円
D I A M国内重視バラ ンスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	72,187,907円	59,711,189円
D I A M世界バランス ファンド4 0 V A (適格 機関投資家限定)	2,253,845,204円	100,150,915円
D I A M世界バランス ファンド5 0 V A (適格 機関投資家限定)	1,015,599,225円	178,394,585円
D I A Mバランスファン ド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	6,998,400,243円	6,083,808,272円
D I A Mバランスファン ド3 7 . 5 V A (適格機 関投資家限定)	3,474,267,418円	3,221,440,007円
D I A Mバランスファン ド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	6,265,110,925円	5,882,071,810円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A (適格機関投資家限定)	734,607,542円	647,151,905円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	1,931,112,724円	512,238,067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)	4,285,930,749円	3,765,931,500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)	5,583,515,787円	3,503,037,017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)	273,887,149円	194,752,933円
D I A M世界バランス ファンド5 5 V A (適格 機関投資家限定)	5,572,131,426円	229,020,962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)	6,745,903,203円	1,835,245,523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)	88,332,879,239円	85,219,076,699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)	1,204,275,501円	1,149,665,356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)	7,547,500,500円	7,349,516,600円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	27,992,746,964円	28,046,381,699円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	95,642,492円	8,994,522円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	369,888円	49,160,062円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	8,244,501円	8,006,452円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	31,327,804,436円	31,135,137,178円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	547,765,920円	497,599,388円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	139,363,216円	137,417,719円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	640,261,286円	395,041,757円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	454,852円	118,842,206円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	351,483円	393,617円
計	295,190,206,036円	274,056,741,701円
2 . 受益権の総数	295,190,206,036口	274,056,741,701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28年2月26日 至 平成29年2月27日	自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,861,783,300	405,859,100
地方債証券	52,629,642	14,402,409
特殊債券	14,982,365	5,464,632
社債券	25,950,390	5,513,390
合計	1,955,345,697	431,239,531

(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29年2月15日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月15日から平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額	1.2800円	1.2874円
(1万口当たり純資産額)	(12,800円)	(12,874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30年2月26日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	375回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,870,000	
	376回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,006,160,000	
	377回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,504,950,000	
	378回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,510,000	
	379回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,505,595,000	
	381回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,160,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,014,760,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,716,465,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,507,965,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,007,480,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,016,640,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,014,520,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,021,720,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,700,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,516,200,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,021,150,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,022,890,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,528,140,000	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,025,230,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,531,360,000	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,019,040,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,860,000,000	2,888,171,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,010,390,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	834,906,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	838,914,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,123,624,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	945,042,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	927,304,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,012,816,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,055,844,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,025,414,500	
	10回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	903,915,000	
	301回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,349,381,000	
	303回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,331,265,000	
	305回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,565,025,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,547,595,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	826,656,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,028,690,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,367,022,000	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,282,456,000	

313回	利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,868,777,900
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,566,510,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,043,970,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,040,400,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,570,605,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,564,860,000
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,614,600,000
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,079,640,000
325回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,562,535,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	519,700,000
327回	利付国庫債券(10年)	620,000,000	647,422,600
328回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,553,730,000
329回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,886,418,000
330回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,260,012,000
332回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,560,420,000
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,082,740,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,189,817,000
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,075,100,000
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,557,945,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,332,448,000
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,065,180,000
339回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,859,400,000
340回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,583,400,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,590,370,000
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,029,040,000
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,027,420,000
344回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,529,925,000
345回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,527,720,000
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,021,690,000
347回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,522,715,000
348回	利付国庫債券(10年)	3,360,000,000	3,380,798,400
349回	利付国庫債券(10年)	380,000,000	382,040,600
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	130,703,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,773,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,910,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,178,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,848,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,434,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	385,518,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	243,698,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	482,660,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	380,553,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	376,401,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	659,815,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,570,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	536,284,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,084,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,073,880,200
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,570,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	404,688,000

21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	394,755,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	635,660,900	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	812,154,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	406,731,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	528,776,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	937,909,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	953,673,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,230,327,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,217,646,000	
30回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,204,011,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,189,647,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,481,535,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,674,933,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,601,832,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,684,358,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,687,894,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,791,482,000	
38回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,132,758,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,026,240,000	
40回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	768,807,400	
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	990,016,000	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	990,472,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	990,928,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	992,496,000	
45回	利付国庫債券(30年)	750,000,000	894,517,500	
46回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,073,538,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,218,890,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,286,802,000	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,158,042,600	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,017,480,000	
51回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	977,570,000	
52回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,031,668,000	
53回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	789,922,400	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	912,906,000	
55回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	810,584,000	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	910,881,000	
57回	利付国庫債券(30年)	630,000,000	636,892,200	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	900,841,400	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	947,007,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	527,080,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,006,886,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	537,095,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	828,648,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	642,372,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	593,670,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	762,125,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	880,194,600	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,228,547,300	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	655,404,000	
60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	633,211,600	

6 1 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	844,920,000	
6 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	838,408,000	
6 4 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	666,888,000	
6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,227,446,000	
6 7 回	利付国庫債券(20年)	870,000,000	974,800,200	
7 0 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,445,575,000	
7 2 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,428,250,000	
7 3 回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	901,247,800	
7 5 回	利付国庫債券(20年)	870,000,000	1,002,779,400	
7 8 回	利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,016,522,400	
8 1 回	利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,188,403,700	
8 3 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	909,667,200	
8 5 回	利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,217,871,200	
8 8 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,430,448,000	
9 0 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,425,948,000	
9 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,539,096,000	
9 3 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	825,643,000	
9 4 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	950,824,000	
9 5 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,453,476,000	
9 7 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,689,562,000	
9 9 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,680,938,000	
1 0 0 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,578,044,000	
1 0 2 回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,312,725,200	
1 0 5 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,575,769,000	
1 0 7 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,822,725,000	
1 0 9 回	利付国庫債券(20年)	1,320,000,000	1,579,789,200	
1 1 1 回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,443,089,700	
1 1 3 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,838,595,000	
1 1 4 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,843,650,000	
1 1 6 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,990,720,000	
1 1 7 回	利付国庫債券(20年)	210,000,000	258,793,500	
1 1 8 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,222,810,000	
1 1 9 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,078,785,000	
1 2 1 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,820,205,000	
1 2 3 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,109,955,000	
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,772,158,500	
1 2 8 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	854,798,000	
1 2 9 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	845,719,000	
1 3 0 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,815,615,000	
1 3 2 回	利付国庫債券(20年)	1,260,000,000	1,509,895,800	
1 3 3 回	利付国庫債券(20年)	180,000,000	218,111,400	
1 3 4 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,092,375,000	
1 3 5 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	960,104,000	
1 3 7 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,357,254,300	
1 3 8 回	利付国庫債券(20年)	100,000,000	117,347,000	
1 4 0 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,924,544,000	
1 4 1 回	利付国庫債券(20年)	1,650,000,000	1,987,375,500	
1 4 2 回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	304,680,000	
1 4 3 回	利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	2,047,969,600	
1 4 4 回	利付国庫債券(20年)	260,000,000	305,819,800	

145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,689,310,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,691,354,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,028,950,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,531,894,000	
149回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,240,518,000	
150回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,745,145,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,034,792,000	
152回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,469,559,000	
153回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,947,639,000	
154回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,692,705,000	
155回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,749,408,000	
156回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,482,525,000	
157回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,236,664,000	
158回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,502,550,000	
159回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,525,785,000	
160回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,342,887,000	
161回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,153,976,400	
162回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,212,732,000	
163回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	817,233,300	
国債証券 合計		269,120,000,000	295,128,432,800	
地方債証券	680回 東京都公募公債	200,000,000	205,592,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	512,750,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	204,676,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	517,920,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	724,010,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	518,630,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	313,380,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	416,004,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	114,404,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	238,364,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	356,157,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	204,710,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	207,384,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	306,234,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	311,046,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	309,162,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	205,970,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	310,467,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	207,924,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	310,362,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	314,397,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	359,520,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,218,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	319,365,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	201,263,080	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	205,150,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	207,632,000	
	1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	115,564,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	205,580,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	521,570,000	

25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	312,828,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	206,034,000	
21年度4回	埼玉県公募公債	200,000,000	204,056,000	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	207,546,000	
26年度5回	埼玉県公募公債	400,000,000	413,956,000	
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	204,552,000	
25年度11回	福岡県公募公債	200,000,000	207,642,000	
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	204,352,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	310,320,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	208,714,000	
80回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,266,000	
94回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,536,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	726,635,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,082,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,295,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	726,145,000	
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,105,000	
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,700,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	827,688,384	
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,920,000	
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,476,000	
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,010,000	
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,715,000	
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,285,000	
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,116,000	
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,460,000	
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,460,000	
166回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,655,000	
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	465,520,500	
4回	京都市公募公債 20年	100,000,000	120,040,000	
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	205,842,000	
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	206,910,000	
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	467,014,500	
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	418,216,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	208,066,000	
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	103,718,000	
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	204,850,000	
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	208,462,000	
地方債証券 合計		22,040,900,000	22,904,593,464	
特殊債券	48回	高速道路機構債	700,000,000	712,663,000
	96回	高速道路機構債	700,000,000	723,611,000
	116回	高速道路機構債	100,000,000	103,527,000
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,960,000
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	323,541,000
	78回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	711,739,000
	82回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,041,000

89回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	306,351,000	
149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	415,580,000	
180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,036,960,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,440,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	523,985,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	346,595,700	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,855,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	801,816,000	
8回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	663,329,940	
3回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,269,470	
5回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,590,000	
8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,578,000	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	513,575,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,100,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,749,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,520,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,886,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	416,916,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,795,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	566,205,720	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,272,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	306,549,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	48,447,000	51,333,472	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,120,000	36,131,715	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,051,000	54,080,876	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	53,952,000	57,541,426	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,292,000	22,046,588	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	107,395,000	110,583,557	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,908,000	32,188,790	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,246,000	19,417,575	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,000,000	73,275,930	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,321,000	54,291,972	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,180,000	93,892,271	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,215,000	192,372,965	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	317,256,000	336,665,722	
い第769号 利付商工債	200,000,000	200,398,000	
い第779号 利付商工債	200,000,000	200,440,000	
293回 利附信金中金債	400,000,000	400,948,000	
302回 利附信金中金債	300,000,000	300,888,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	399,236,000	

	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	519,330,000	
特殊債券 合計		15,296,383,000	15,762,062,689	
社債券	337回 東京交通債	200,000,000	213,312,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,974,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	307,830,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	102,580,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,650,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	102,456,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,460,000	
	6回 JXホールディングス社債	100,000,000	104,586,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,612,000	
	23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,736,000	
	30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,756,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,138,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	101,530,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	100,870,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	208,426,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,880,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	104,195,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	103,566,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	103,237,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,514,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	103,001,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	219,638,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	207,184,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,314,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	208,198,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	313,686,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,419,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,877,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	206,568,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	104,582,000	
	12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,287,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,784,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	103,270,000	
	20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	205,850,000	
	22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,628,000	
	23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	416,392,000	
	14回 みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	206,368,000	
	15回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	208,312,000	
	47回 日立キャピタル社債	200,000,000	205,960,000	
	164回 オリックス社債	100,000,000	101,427,000	
	14回 大和証券グループ本社社債	100,000,000	102,388,000	
	26回 野村ホールディングス社債	100,000,000	103,587,000	
	42回 野村ホールディングス社債	200,000,000	204,972,000	
	46回 野村ホールディングス社債	200,000,000	200,860,000	
	38回 三井不動産社債	200,000,000	205,610,000	

72回	三菱地所社債	100,000,000	113,175,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	204,148,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	101,304,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	319,617,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,172,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,846,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	341,220,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	229,132,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	218,046,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	332,016,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,953,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,228,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	315,315,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	221,942,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,507,000	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,600,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	141,494,400	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	309,861,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	514,380,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,076,000	
492回	関西電力社債	200,000,000	201,226,000	
493回	関西電力社債	200,000,000	201,358,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	419,564,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	304,830,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	105,077,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,863,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,831,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	420,968,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	304,641,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	208,486,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	202,848,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	210,948,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	418,476,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	203,076,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	167,092,240	
340回	北海道電力社債	300,000,000	301,188,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	224,966,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	312,579,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	314,265,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	106,588,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,711,000	
社債券 合計		16,181,000,000	16,876,083,640	
合計		322,638,283,000	350,671,172,593	

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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,507,142,684	5,233,816,584
コール・ローン		681,046,972	174,163,954
株式		263,147,490,307	276,085,959,059
投資信託受益証券		825,923,149	727,049,262
投資証券		6,315,863,305	5,736,905,378
派生商品評価勘定		90,791,280	94,011,486
未収入金		2,417,530	3,784,281
未収配当金		565,567,832	478,226,822
差入委託証拠金		1,456,599,809	1,981,931,156
流動資産合計		274,592,842,868	290,515,847,982
資産合計		274,592,842,868	290,515,847,982
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,503,362	96,094,864
未払解約金		658,103,000	13,251,000
流動負債合計		659,606,362	109,345,864
負債合計		659,606,362	109,345,864
純資産の部			
元本等			
元本	1	91,611,980,480	85,879,794,434
剰余金			
剰余金又は欠損金()		182,321,256,026	204,526,707,684
元本等合計		273,933,236,506	290,406,502,118
純資産合計		273,933,236,506	290,406,502,118
負債純資産合計		274,592,842,868	290,515,847,982

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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
<p>1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p> <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p>	<p>101,062,929,782円</p> <p>17,462,001,997円</p> <p>26,912,951,299円</p>	<p>91,611,980,480円</p> <p>20,138,120,617円</p> <p>25,870,306,663円</p>

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,957,218,700円	1,845,103,642円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,597,665円	3,104,022円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	12,813,496円	7,162,575円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	27,139,952円	19,381,505円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	13,284,546円	15,872,931円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	12,182,802円	12,125,945円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,970,640円	13,759,108円
たわらノーロード 先進国株式	2,401,466,878円	5,915,663,164円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	425,695円	424,744円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	95,071,790円	540,654,638円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	- 円	11,463,145円
たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	346,989円
たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	4,082,551円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	10,904,902円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	- 円	14,227円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	588,618円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	1,820,571円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	1,168,664円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	2,375,189円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	6,182円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	35,270円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	325,553円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	349,076円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,079,503円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 >	35,537,387,647円	37,329,263,860円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	169,317,804円	155,272,827円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	929,041,840円	854,160,900円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,088,784,171円	1,042,632,432円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	151,198,377円	128,651,065円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	421,382,473円	385,326,790円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	340,601,324円	332,068,806円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	42,243,439円	32,623,606円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	932,693,027円	811,105,505円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	215,631,374円	186,981,108円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国10)	27,054,593円	31,116,597円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国20)	52,812,992円	76,880,278円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国30)	106,602,334円	149,320,860円
投資のソムリエ	1,447,959,597円	525,467,955円
クルーズコントロール	423,103,664円	81,781,664円
投資のソムリエ< D C 年金 >	44,003,627円	36,100,432円
D I A M 8 資産バランスファンドN< D C 年金 >	88,624,580円	116,625,994円
D I A M D C バランス・F(成長型)	44,097,862円	76,361,478円
クルーズコントロール< D C 年金 >	156,043円	30,467円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	2,581,654円	402,135円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	8,454,381円	1,245,127円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	19,173,147円	18,021,302円
ダイナミック・ナビゲーション	1,575,046円	395,905円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	104,007,220円	279,057,463円
ワールドアセットバランス(基本コース)	111,316,911円	621,453,988円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	145,454,314円	2,329,368,925円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	-円	765,901円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	-円	590,045円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	-円	86,101円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	1,328,385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)	163,368,838円	94,665,820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)	3,207,285,574円	2,918,652,247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)	180,603,347円	-円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	392,000円	161,164,985円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	-円	208,761,652円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	28,887,946円	23,652,082円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	161,611,237円	103,714,081円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	298,410,591円	228,512,241円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	20,377,575円	12,671,338円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	135,252,737円	82,511,736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)	11,414,013円	6,831,650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)	15,373,489円	11,417,217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)	632,259,643円	24,714,283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)	427,409,243円	65,916,546円
D I A Mバランスマ ンド25VA(適格機関 投資家限定)	743,979,293円	557,553,761円
D I A Mバランスマ ンド37.5VA(適格機 関投資家限定)	870,032,675円	691,799,410円
D I A Mバランスマ ンド50VA(適格機関 投資家限定)	2,693,426,272円	2,171,548,593円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスマ ンドVA(適格機関 投資家限定)	1,053,591,911円	786,997,339円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスマ ンド2VA(適格機関 投資家限定)	980,540,194円	225,669,532円
D I A M アクサ グ ローバル バランスマ ンド30VA(適格機関 投資家限定)	1,217,509,769円	924,836,705円
D I A M世界アセット バランスマンドVA(適 格機関投資家向け)	799,238,075円	430,329,218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)	3,672,039円	2,754,975円
D I A M世界バラン スファンド55VA(適格 機関投資家限定)	3,561,322,538円	128,701,947円
D I A M世界バラン スファンド35VA(適格 機関投資家限定)	1,507,107,240円	349,183,417円
D I A M世界アセット バランスマンド2VA (適格機関投資家 限定)	9,475,846,807円	7,824,134,623円
D I A M世界アセット バランスマンド40VA (適格機関投資家 限定)	519,886,797円	422,676,347円
D I A M世界アセット バランスマンド25VA (適格機関投資家 限定)	1,623,806,982円	1,345,791,625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)	6,051,606,509円	5,115,080,431円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	25,152,055円	2,032,372円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	239,046円	28,378,177円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	13,078,140円	10,651,080円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	8,108,064,369円	6,827,085,597円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	84,358,582円	42,301,326円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	169,337円	36,544,094円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	274,012円	257,372円
計	91,611,980,480円	85,879,794,434円
2 . 受益権の総数	91,611,980,480口	85,879,794,434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28年2月26日 至 平成29年2月27日	自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26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	1,851,257,751	4,722,071,531
投資信託受益証券	1,845,255	12,729,300
投資証券	145,524,021	91,277,789
合計	1,994,936,517	4,826,078,620

（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29年2月16日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月16日から平成30年2月26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29年2月27日 現在				平成30年2月26日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	42,579,342	-	42,579,000	342
イギリス・債券	-	-	-	-	42,579,342	-	42,579,000	342
買 建	2,719,286,282	-	2,719,140,100	146,182	328,600,107	-	328,448,150	151,957
アメリカ・ドル	1,783,590,450	-	1,783,503,000	87,450	240,630,998	-	240,535,060	95,938
イギリス・債券	213,067,188	-	213,052,500	14,688	7,468,550	-	7,470,000	1,450
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	9,609,349	-	9,623,880	14,531
ユーロ	497,844,480	-	497,826,000	18,480	70,891,210	-	70,819,210	72,000
合計	2,719,286,282	-	2,719,140,100	146,182	371,179,449	-	371,027,150	151,615

（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の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の発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成29年2月27日 現在				平成30年2月26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	6,123,241,477	-	6,212,675,577	89,434,100	7,903,918,528	-	7,901,986,765	1,931,763
合計	6,123,241,477	-	6,212,675,577	89,434,100	7,903,918,528	-	7,901,986,765	1,931,763

(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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額	2.9901円	3.3815円
(1万口当たり純資産額)	(29,901円)	(33,815円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年2月26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	28,829	1,500.000	43,243,500.000	
	ABBOTT LABORATORIES	122,602	59.710	7,320,565.420	
	AES CORP	45,579	10.490	478,123.710	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,373	155.520	9,700,248.960	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	12.070	718,515.030	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,138	209.740	7,369,844.120	
	CHUBB LTD	32,773	144.010	4,719,639.730	
	AGCO CORP	5,610	68.440	383,948.400	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,019	164.270	2,467,171.130	
	ALLEGHANY CORP	1,054	605.660	638,365.640	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	108.530	379,529.410	
	ALLSTATE CORP	25,754	94.370	2,430,404.980	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	51,441	155.120	7,979,527.920	
	AMGEN INC	51,512	186.670	9,615,745.040	
	HESS CORP	20,421	47.870	977,553.270	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	98.800	5,293,802.800	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	67.370	2,348,450.830	
	AFLAC INC	28,218	89.570	2,527,486.260	
	AMERICAN INTL GROUP	63,448	60.070	3,811,321.360	
	AMERCO	551	353.630	194,850.130	
	ANALOG DEVICES	25,869	90.370	2,337,781.530	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	38,791	60.820	2,359,268.620	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	118.930	1,904,663.950	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	64,578	38.820	2,506,917.960	
	TIME WARNER	54,567	94.700	5,167,494.900	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	160.000	450,880.000	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	92.460	2,968,428.300	
	APACHE CORP	25,025	36.130	904,153.250	
	ANSYS INC	5,619	160.890	904,040.910	
	APPLE INC	364,593	175.500	63,986,071.500	
APPLIED MATERIALS INC	75,304	57.010	4,293,081.040		
ALBEMARLE CORP	7,904	118.750	938,600.000		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	38,303	42.570	1,630,558.710		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	80.150	627,654.650		
AMEREN CORP	17,312	56.350	975,531.200		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	82.840	476,827.040	
AUTOLIV INC	6,197	146.830	909,905.510	
AUTODESK INC	14,259	115.030	1,640,212.770	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,205	117.650	3,671,268.250	
AUTOZONE INC	2,015	725.000	1,460,875.000	
AVERY DENNISON CORP	6,262	119.130	745,992.060	
AVNET INC	10,288	42.620	438,474.560	
BALL CORP	24,324	39.730	966,392.520	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	89,717	202.760	18,191,018.920	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	56.900	4,196,318.100	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	68.360	2,384,123.360	
BECTON DICKINSON & CO	18,586	220.340	4,095,239.240	
AMETEK INC	16,775	76.760	1,287,649.000	
VERIZON COMM INC	287,466	48.290	13,881,733.140	
WR BERKLEY CORP	8,134	69.040	561,571.360	
BEST BUY CO INC	19,210	73.170	1,405,595.700	
YUM! BRANDS INC	23,738	79.800	1,894,292.400	
FIRSTENERGY CORP	30,796	33.800	1,040,904.800	
H&R BLOCK INC	16,114	26.820	432,177.480	
BOEING CO	39,546	356.660	14,104,476.360	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	57.850	471,940.300	
BORGWARNER INC	14,648	52.320	766,383.360	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,541	27.200	2,653,115.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	92.630	916,481.220	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,233	111.650	807,564.450	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	636.100	1,169,151.800	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,634	67.950	7,925,280.300	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	190.010	719,757.880	
INGREDION INC	5,305	128.730	682,912.650	
ONEOK INC	26,177	58.020	1,518,789.540	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,418	112.440	496,759.920	
UNITED RENTALS INC	6,332	179.090	1,133,997.880	
SEMPRA ENERGY	16,912	109.570	1,853,047.840	
FEDEX CORP	18,103	252.220	4,565,938.660	
VERISIGN INC	6,321	117.640	743,602.440	
AMPHENOL CORP	21,490	90.830	1,951,936.700	
BROWN-FORMAN CORP	13,612	69.550	946,714.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.270	796,866.840	
CSX CORP	63,992	55.840	3,573,313.280	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	24.460	789,104.060	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	44.120	619,886.000	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	53.290	1,098,466.770	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	217.460	2,661,710.400	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	69.310	1,533,483.750	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	68.760	1,713,224.160	
CATERPILLAR INC	42,278	162.410	6,866,369.980	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	104.310	1,025,575.920	
CELGENE CORP	54,731	95.610	5,232,830.910	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	92.810	1,011,257.760	
CENTURYLINK INC	63,680	18.210	1,159,612.800	
CERNER CORP	20,809	64.530	1,342,804.770	
JPMORGAN CHASE & CO	248,945	117.310	29,203,737.950	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	49.120	924,536.640	
CIGNA CORP	17,595	194.790	3,427,330.050	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	75.800	832,435.600	
CINTAS CORP	6,282	169.990	1,067,877.180	
CISCO SYSTEMS INC	354,512	44.000	15,598,528.000	
CLOROX COMPANY	9,331	129.430	1,207,711.330	
COCA-COLA CO/THE	286,256	44.040	12,606,714.240	
COGNEX CORP	11,508	54.200	623,733.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,819	70.300	4,205,275.700	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,436	142.170	3,189,726.120	
COMERICA INC	12,068	98.680	1,190,870.240	
COMCAST CORP-CL A	333,255	39.500	13,163,572.500	
CA INC	22,732	35.430	805,394.760	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	36.280	1,027,558.440	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	77.630	1,688,452.500	
CMS ENERGY CORP	19,291	43.860	846,103.260	
COOPER COS INC	3,794	230.540	874,668.760	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	78.660	1,089,834.300	
CORNING INC	65,641	29.300	1,923,281.300	
WR GRACE & CO	3,314	67.720	224,424.080	
SEALED AIR CORP	13,870	42.660	591,694.200	
CUMMINS INC	11,239	169.530	1,905,347.670	
DR HORTON INC	24,498	44.470	1,089,426.060	
DANAHER CORP	44,524	99.330	4,422,568.920	
MOODY'S CORP	11,822	169.300	2,001,464.600	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	41,589	82.530	3,432,340.170	
TARGET CORP	37,486	75.410	2,826,819.260	
DEERE & CO	19,364	166.240	3,219,071.360	
MORGAN STANLEY	96,261	56.070	5,397,354.270	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	66.400	1,153,700.000	
COSTAR GROUP INC	2,278	354.910	808,484.980	
THE WALT DISNEY CO	108,774	107.250	11,666,011.500	
DOLLAR TREE INC	17,493	106.610	1,864,928.730	

DOVER CORP	10,736	102.730	1,102,909.280	
OMNICOM GROUP	16,993	77.310	1,313,728.830	
DTE ENERGY CO	13,122	104.700	1,373,873.400	
DUKE ENERGY CORP	49,292	77.220	3,806,328.240	
FLOWSERVE CORP	8,406	44.260	372,049.560	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	95.350	899,722.600	
EBAY INC	70,731	43.680	3,089,530.080	
BANK OF AMERICA CORP	708,728	32.030	22,700,557.840	
CITIGROUP INC	193,450	77.080	14,911,126.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	103.440	1,054,363.920	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	51.380	962,861.200	
EATON CORP PLC	32,234	82.220	2,650,279.480	
EATON VANCE CORP	9,184	55.450	509,252.800	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	39.740	829,651.980	
DISH NETWORK CORP	16,150	44.480	718,352.000	
ECOLAB INC	19,009	130.840	2,487,137.560	
ELECTRONIC ARTS INC	21,766	127.100	2,766,458.600	
SALESFORCE.COM INC	48,240	114.960	5,545,670.400	
EMERSON ELECTRIC CO	45,625	72.190	3,293,668.750	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	82.590	678,972.390	
ENTERGY CORP	12,199	77.740	948,350.260	
EOG RESOURCES INC	39,963	108.830	4,349,173.290	
EQUIFAX INC	8,495	115.400	980,323.000	
EQT CORP	17,149	52.080	893,119.920	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	142.390	2,297,320.260	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	65.520	822,276.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	38,911	77.000	2,996,147.000	
EXXON MOBIL CORP	298,736	77.530	23,161,002.080	
FMC CORP	8,970	85.720	768,908.400	
NEXTERA ENERGY INC	33,513	156.260	5,236,741.380	
ASSURANT INC	4,089	88.560	362,121.840	
FASTENAL CO	21,654	55.200	1,195,300.800	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	33.450	1,745,186.850	
M&T BANK CORP	9,799	193.510	1,896,204.490	
FISERV INC	14,095	146.190	2,060,548.050	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	48.490	563,599.270	
MACY'S INC	19,266	26.740	515,172.840	
FORD MOTOR CO	261,895	10.700	2,802,276.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	39.310	877,163.340	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	19.550	1,892,674.600	
FLEX LTD	35,913	17.960	644,997.480	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	68.990	840,022.240	
GAP INC/THE	18,295	32.690	598,063.550	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	57.670	1,007,898.590	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,942	221.000	3,965,182.000	
GENERAL MILLS INC	38,727	52.980	2,051,756.460	
GENUINE PARTS CO	9,785	94.530	924,976.050	
GILEAD SCIENCES INC	91,960	80.910	7,440,483.600	

GARTNER INC	7,153	116.990	836,829.470	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	29.520	534,223.440	
MCKESSON CORP	15,054	152.650	2,297,993.100	
NVIDIA CORP	42,645	245.930	10,487,684.850	
GENERAL ELECTRIC CO	608,018	14.490	8,810,180.820	
WW GRAINGER INC	3,832	266.190	1,020,040.080	
HALLIBURTON CO	61,528	48.450	2,981,031.600	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	65.880	1,944,909.360	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,381	266.770	6,770,889.370	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	46.610	601,315.610	
HARRIS CORP	8,954	158.800	1,421,895.200	
HASBRO INC	7,736	97.470	754,027.920	
HENRY SCHEIN INC	11,426	68.050	777,539.300	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	66.860	482,261.180	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	96.950	982,297.400	
HP INC	122,725	22.130	2,715,904.250	
F5 NETWORKS INC	4,874	147.330	718,086.420	
CROWN HOLDINGS INC NPR	7,781	50.870	395,819.470	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	118.040	406,883.880	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.120	724,568.800	
HOLLYFRONTIER CORP	11,051	45.000	497,295.000	
HOLOGIC INC	19,133	39.210	750,204.930	
UNUM GROUP	16,000	51.730	827,680.000	
HOME DEPOT INC	83,442	188.350	15,716,300.700	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	83.050	1,070,265.350	
HORMEL FOODS CORP	19,345	32.640	631,420.800	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.730	886,028.960	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	209.710	490,092.270	
HUMANA INC	10,468	271.190	2,838,816.920	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	121.110	717,818.970	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	15.990	1,201,824.390	
RED HAT INC	12,098	146.620	1,773,808.760	
BIOGEN INC	14,861	292.780	4,351,003.580	
IDEX CORP	4,699	140.240	658,987.760	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,032	163.960	3,612,366.720	
INTUIT INC	16,934	171.780	2,908,922.520	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	187.610	1,173,500.550	
INGERSOLL-RAND PLC	16,730	90.150	1,508,209.500	
INTEL CORP	331,236	47.730	15,809,894.280	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	145.820	813,383.960	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	59.500	1,688,312.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	24.240	706,765.680	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	62.350	494,497.850	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,173	121.950	508,897.350	
INCYTE CORP	12,360	87.800	1,085,208.000	
JOHNSON & JOHNSON	189,511	132.020	25,019,242.220	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	54.040	1,379,641.200	
KLA-TENCOR CORP	11,724	110.470	1,295,150.280	
DEVON ENERGY CORP	34,184	31.430	1,074,403.120	
WESTAR ENERGY INC	9,911	50.760	503,082.360	
KELLOGG CO	18,922	68.540	1,296,913.880	
EAST WEST BANCORP INC	8,509	66.270	563,891.430	
KEYCORP	71,550	20.970	1,500,403.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	24,202	113.650	2,750,557.300	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,616	549.750	4,736,646.000	
KOHL'S CORP	11,357	66.470	754,899.790	
KROGER CO	62,093	27.420	1,702,590.060	
LAM RESEARCH CORP	11,522	193.100	2,224,898.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	119.360	734,899.520	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	67.360	850,217.920	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	44.770	429,254.760	
LENNAR CORP	16,200	59.040	956,448.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	24.970	535,906.140	
ELI LILLY & CO	70,283	78.750	5,534,786.250	
L BRANDS INC	16,262	48.710	792,122.020	
LINCOLN NATIONAL CORP	14,163	78.020	1,104,997.260	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,982	105.610	5,067,379.020	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	22,357	70.700	1,580,639.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,240	358.690	6,542,505.600	
LOEWS CORP	21,346	50.340	1,074,557.640	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	13.450	184,224.650	
LOWE'S COS INC	58,178	97.490	5,671,773.220	
DOMINION ENERGY INC	45,131	75.520	3,408,293.120	
SCANA CORP	10,902	39.290	428,339.580	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	35.380	1,139,165.240	
MCCORMICK & CO INC	7,476	106.220	794,100.720	
MCDONALD'S CORPORATION	57,515	163.060	9,378,395.900	
S&P GLOBAL INC	18,409	191.670	3,528,453.030	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	242.940	693,593.700	
MANPOWERGROUP INC	4,257	122.580	521,823.060	
MARKEL CORPORATION	989	1,121.900	1,109,559.100	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	14,774	135.640	2,003,945.360	
MARSH & MCLENNAN COS	35,821	83.570	2,993,560.970	
MASCO CORP	23,043	43.020	991,309.860	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	211.580	928,201.460	
MATTEL INC	24,003	16.640	399,409.920	
METLIFE INC	64,937	47.470	3,082,559.390	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	62.000	1,261,204.000	
MEDTRONIC PLC	95,177	80.390	7,651,279.030	
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,052	72.070	3,607,247.640	
CVS HEALTH CORP	71,913	68.160	4,901,590.080	
MERCK & CO. INC.	193,111	54.870	10,596,000.570	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	172.370	1,236,927.120	
MICROSOFT CORP	516,674	94.060	48,598,356.440	
MICRON TECH INC	76,146	46.530	3,543,073.380	
MIDDLEBY CORP	4,100	134.350	550,835.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,331	85.160	1,305,587.960	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	23.250	615,264.750	
3M CO	42,407	237.020	10,051,307.140	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,042	251.390	1,016,118.380	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,582	106.730	1,129,416.860	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	108.820	788,618.540	
MYLAN NV	31,344	41.450	1,299,208.800	
ILLUMINA INC	10,453	233.840	2,444,329.520	
XCEL ENERGY INC	37,554	44.770	1,681,292.580	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	36.070	971,653.660	
NETAPP INC	18,387	59.620	1,096,232.940	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	24.660	338,828.400	
NEWELL BRANDS INC	36,206	26.800	970,320.800	
NEWMONT MINING CORP	38,093	38.690	1,473,818.170	
NVR INC	236	2,998.800	707,716.800	
NIKE INC-CL B	92,505	68.160	6,305,140.800	
NOBLE ENERGY INC	31,005	30.660	950,613.300	
NORDSTROM INC	9,487	53.560	508,123.720	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,973	142.620	2,848,549.260	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	59.470	1,372,864.950	
NISOURCE INC	22,198	23.600	523,872.800	
TAPESTRY INC	19,175	50.650	971,213.750	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	106.560	1,714,550.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,569	351.510	4,066,619.190	
WELLS FARGO & CO	332,695	59.170	19,685,563.150	
NUCOR CORP	23,780	66.940	1,591,833.200	
MONSANTO CO	30,856	121.740	3,756,409.440	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	55.710	887,293.170	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,007	99.040	3,269,013.280	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,121	68.320	3,697,546.720	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,814	139.510	532,091.140	
OGE ENERGY CORP	16,028	32.950	528,122.600	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	254.130	1,620,078.750	
ORACLE CORP	218,956	50.500	11,057,278.000	
PACCAR INC	24,457	71.320	1,744,273.240	
EXELON CORP	69,910	38.240	2,673,358.400	
PARKER HANNIFIN CORP	8,808	183.570	1,616,884.560	
PAYCHEX INC	23,141	66.470	1,538,182.270	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	49.790	324,929.540	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	265.070	1,392,942.850	
PPL CORPORATION	45,666	30.340	1,385,506.440	
PEPSICO INC	100,305	109.680	11,001,452.400	
PENTAIR PLC	11,775	71.390	840,617.250	
PFIZER INC	419,744	36.260	15,219,917.440	
CONOCOPHILLIPS	86,115	57.050	4,912,860.750	
PVH CORP	5,387	148.860	801,908.820	
PG&E CORP	34,361	41.140	1,413,611.540	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	180.000	2,188,440.000	
ALTRIA GROUP INC	135,928	64.590	8,779,589.520	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,538	160.090	5,529,188.420	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	117.040	450,018.800	
GARMIN LTD	7,795	60.350	470,428.250	
AETNA INC	23,744	175.550	4,168,259.200	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	58.150	571,091.150	
PPG INDUSTRIES INC	17,674	117.460	2,075,988.040	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	242.170	591,136.970	
PRAXAIR INC	20,519	155.620	3,193,166.780	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,869	189.810	5,859,244.890	
T ROWE PRICE GROUP INC	16,303	112.300	1,830,826.900	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	102.600	1,064,782.800	
PROCTER & GAMBLE CO	179,972	81.050	14,586,730.600	
PROGRESSIVE CORP	41,336	57.710	2,385,500.560	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	50.530	1,875,420.950	
PULTE GROUP INC	21,209	29.270	620,787.430	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	14.070	427,559.160	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	114.460	1,232,619.740	
QUALCOMM INC	104,228	63.320	6,599,716.960	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	91.470	931,804.890	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	129.850	331,117.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	323.860	1,832,723.740	

REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	156.330	725,683.860	
AUTONATION INC	5,772	52.460	302,799.120	
RESMED INC	9,394	95.420	896,375.480	
US BANCORP	118,641	55.490	6,583,389.090	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	55.350	404,995.950	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	87.980	763,138.520	
ROSS STORES INC	28,189	78.870	2,223,266.430	
ROLLINS INC	5,357	51.180	274,171.260	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,983	281.140	1,963,200.620	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	185.470	1,644,562.490	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	130.200	1,600,548.600	
RAYTHEON COMPANY	20,463	218.240	4,465,845.120	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	242.090	931,562.320	
ACCENTURE PLC-CL A	43,740	162.950	7,127,433.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	106,478	43.750	4,658,412.500	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	159.960	1,415,486.040	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	137.130	1,657,353.180	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	139.740	2,760,563.700	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,718	99.820	2,267,710.760	
PRICELINE GROUP INC	3,460	1,907.020	6,598,289.200	
SCHLUMBERGER LTD	98,476	66.500	6,548,654.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	83,988	52.740	4,429,527.120	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	118.850	1,684,698.750	
BUNGE LTD	10,334	76.620	791,791.080	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	73.490	684,559.350	
ANTHEM INC	18,448	235.240	4,339,707.520	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	98.420	1,206,333.940	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	63.150	1,354,062.300	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	398.200	2,372,475.600	
CENTENE CORP	12,713	100.450	1,277,020.850	
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	248.080	860,341.440	
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	153.990	777,649.500	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	66.410	635,211.650	
ACUITY BRANDS INC	3,087	146.560	452,430.720	
SNAP-ON INC	3,932	160.220	629,985.040	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,203	108.980	3,291,522.940	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	116.320	613,355.360	
EDISON INTERNATIONAL	21,963	62.170	1,365,439.710	
SOUTHERN CO	70,353	44.070	3,100,456.710	
BB&T CORP	55,828	55.360	3,090,638.080	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	57.990	658,302.480	

AT&T INC	432,405	36.720	15,877,911.600	
CHEVRON CORP	133,469	112.590	15,027,274.710	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,528	160.940	1,694,376.320	
STATE STREET CORP	27,099	104.500	2,831,845.500	
STARBUCKS CORP	101,469	56.140	5,696,469.660	
STEEL DYNAMICS INC	15,309	47.470	726,718.230	
STRYKER CORP	24,140	161.700	3,903,438.000	
NETFLIX INC	30,587	285.930	8,745,740.910	
STERICYCLE INC	6,853	60.050	411,522.650	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	71.290	2,477,755.240	
SYMANTEC CORP	41,694	27.430	1,143,666.420	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	48.600	475,939.800	
SYNOPSIS INC	10,656	85.240	908,317.440	
SYSCO CORP	35,926	59.680	2,144,063.680	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,788	427.510	3,329,447.880	
TELEFLEX INC	3,203	255.270	817,629.810	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	20.040	1,279,614.120	
ANDEAVOR	11,500	94.530	1,087,095.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	69,626	107.040	7,452,767.040	
TEXTRON INC	19,076	59.280	1,130,825.280	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,065	211.710	5,941,641.150	
TIFFANY & CO	8,733	104.170	909,716.610	
TOLL BROTHERS INC	9,526	46.550	443,435.300	
TORCHMARK CORP	7,699	86.510	666,040.490	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	88.820	1,001,800.780	
DAVITA INC	10,878	73.180	796,052.040	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	65.860	610,917.360	
TRIMBLE INC	20,073	38.670	776,222.910	
TYSON FOODS INC	21,621	75.080	1,623,304.680	
UGI CORP	12,068	44.150	532,802.200	
MARATHON OIL CORP	58,747	15.540	912,928.380	
UNION PACIFIC CORP	56,617	134.970	7,641,596.490	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	53,690	133.150	7,148,823.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,378	230.160	15,737,880.480	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	116.410	739,319.910	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	121.170	829,772.160	
VF CORP	24,309	75.750	1,841,406.750	
CBS CORP	23,781	55.120	1,310,808.720	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	165.900	2,943,397.800	
VULCAN MATERIALS CO	8,964	121.690	1,090,829.160	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	70.360	4,452,802.960	
WALMART INC	106,126	92.890	9,858,044.140	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	85.490	2,754,145.840	
WATERS CORP	5,963	208.470	1,243,106.610	
ALLERGAN PLC	23,313	162.090	3,778,804.170	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	7,671	124.550	955,423.050	
VAIL RESORTS INC	2,598	210.720	547,450.560	
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	89.140	1,828,796.240	
WABTEC CORP	5,497	83.400	458,449.800	
WHIRLPOOL CORP	5,553	171.440	952,006.320	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	108.230	1,464,243.670	
WYNN RESORTS LTD	6,279	167.130	1,049,409.270	
NASDAQ INC	9,132	80.480	734,943.360	
CME GROUP INC	24,203	164.020	3,969,776.060	
WILLIAMS COS INC	61,081	28.740	1,755,467.940	
LKQ CORP	22,948	40.100	920,214.800	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	39.420	645,817.860	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	61.850	1,429,786.450	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	55.480	1,033,647.880	
CARMAX INC	13,513	62.760	848,075.880	
XEROX CORP	17,455	30.870	538,835.850	
XILINX INC	16,837	70.050	1,179,431.850	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	98.700	691,196.100	
TJX COMPANIES INC	43,999	77.960	3,430,162.040	
ZIONS BANCORP	16,584	55.680	923,397.120	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.150	546,260.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	62.120	975,284.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	38.000	649,800.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	121.420	734,712.420	
SIGNATURE BANK	4,171	152.490	636,035.790	
CBRE GROUP INC	20,976	45.950	963,847.200	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	32.270	401,277.450	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	19.650	1,660,149.900	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	228.850	745,135.600	
T-MOBILE US INC	21,188	60.060	1,272,551.280	
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	74.330	2,110,005.710	
MOSAIC CO/THE	26,525	28.740	762,328.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	27,332	37.620	1,028,229.840	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	38.010	2,863,673.400	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	39.760	217,606.480	

CELANESE CORP	9,491	103.950	986,589.450	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- A	10,423	24.010	250,256.230	
EXPEDIA INC	8,709	106.380	926,463.420	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	44.120	815,117.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	160.280	1,695,441.840	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	31.370	1,311,830.660	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	72.480	3,050,320.800	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	17.020	250,125.920	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	33.740	830,408.880	
LIVE NATION	8,864	48.270	427,865.280	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	315.820	570,686.740	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	67.570	418,325.870	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	297.780	1,135,137.360	
MASTERCARD INC	67,015	175.760	11,778,556.400	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	28.460	840,452.260	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	119.590	889,271.240	
HANESBRANDS INC	27,619	19.940	550,722.860	
WESTERN UNION CO	35,222	20.240	712,893.280	
OWENS CORNING	7,333	84.900	622,571.700	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	65.830	613,667.260	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	50.920	589,959.120	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,576	92.390	699,946.640	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	28.270	511,658.730	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	101.380	844,495.400	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	19.690	447,868.740	
DELTA AIR LINES INC	9,473	53.460	506,426.580	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	50.250	319,288.500	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	79.420	2,158,397.340	
TE CONNECTIVITY LTD	24,311	102.270	2,486,285.970	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	152.810	1,612,451.120	
WABCO HOLDING INC	3,176	141.240	448,578.240	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	81.860	547,070.380	
VMWARE INC	5,491	126.420	694,172.220	
MERCADOLIBRE INC	2,861	387.260	1,107,950.860	
ULTA BEAUTY INC	4,332	207.110	897,200.520	
INVESCO LTD	29,824	33.190	989,858.560	

MSCI INC	6,462	144.990	936,925.380	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	108,948	106.110	11,560,472.280	
VISA INC	130,002	122.930	15,981,145.860	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	115.370	1,450,431.640	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	80.630	966,914.960	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	87.750	577,833.750	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,085	22.740	365,772.900	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	66.810	2,450,123.130	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	63.520	738,356.480	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	103.610	189,191.860	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	133,961	17.010	2,278,676.610	
XYLEM INC	12,873	75.930	977,446.890	
ALKERMES PLC	12,053	58.600	706,305.800	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,062	111.600	2,573,719.200	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	265.020	922,004.580	
SPLUNK INC	10,674	95.120	1,015,310.880	
HCA HEALTHCARE INC	20,173	100.840	2,034,245.320	
VERISK ANALYTICS INC	10,053	101.540	1,020,781.620	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	147.460	587,923.020	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	206.180	1,349,241.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	95.280	1,016,447.040	
CIT GROUP INC	9,287	54.140	502,798.180	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	125.440	2,841,466.880	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	46.970	772,421.650	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.360	146,016.000	
LEAR CORP	5,132	189.130	970,615.160	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,040	108.750	765,600.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	50.490	536,860.170	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	97.200	1,881,306.000	
FORTINET INC	11,399	49.870	568,468.130	
AON PLC	18,487	141.910	2,623,490.170	
TESLA INC	9,357	352.050	3,294,131.850	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	54.050	615,737.600	
GENERAL MOTORS CO	91,138	40.910	3,728,455.580	
WORLDPAY INC	10,448	78.020	815,152.960	

TRIPADVISOR INC	9,263	42.300	391,824.900	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	28.060	881,336.540	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	9,958	64.720	644,481.760	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	51.040	690,316.000	
APTIV PLC	19,069	93.060	1,774,561.140	
PHILLIPS 66	30,976	91.830	2,844,526.080	
FACEBOOK INC	167,584	183.290	30,716,471.360	
IQVIA HOLDINGS INC	10,051	99.780	1,002,888.780	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	127.930	902,418.220	
SERVICENOW INC	12,206	160.400	1,957,842.400	
PALO ALTO NETWORKS INC	6,215	165.540	1,028,831.100	
TESARO INC	2,646	60.740	160,718.040	
WORKDAY INC	9,187	127.330	1,169,780.710	
ABBVIE INC	112,299	118.750	13,335,506.250	
ZOETIS INC	34,425	82.790	2,850,045.750	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	57.900	707,769.600	
COTY INC	31,440	20.760	652,694.400	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	16.500	499,339.500	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	36.540	471,037.140	
CDW CORP	10,824	72.040	779,760.960	
SPRINT CORP	63,882	5.300	338,574.600	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	53.390	544,524.610	
ARCONIC INC	27,513	25.130	691,401.690	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	37.190	323,255.480	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,175	34.340	452,429.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	42.290	211,703.740	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	41.990	561,322.320	
XL GROUP LTD	17,166	43.450	745,862.700	
BROADCOM LTD	28,737	253.710	7,290,864.270	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	71.780	1,082,011.720	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	15.300	235,773.000	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	28.030	796,164.120	
TECHNIPFMC LTD	32,556	30.700	999,469.200	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	55.340	348,143.940	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	18.950	249,438.850	
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	61.550	429,619.000	
TWITTER INC	43,692	32.660	1,426,980.720	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	21.530	168,730.610	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	38.730	500,391.600	
ALLEGION PLC	5,402	86.170	465,490.340	
PERRIGO CO PLC	8,553	88.250	754,802.250	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	83.810	1,240,052.760	
ARAMARK	17,307	42.100	728,624.700	

SABRE CORP	17,624	23.810	419,627.440	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	26.210	457,469.340	
ARISTA NETWORKS INC	3,158	245.920	776,615.360	
IHS MARKIT LTD	27,511	47.430	1,304,846.730	
FNF GROUP	17,760	39.720	705,427.200	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	37.150	2,135,567.750	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	46.430	1,617,853.350	
CDK GLOBAL INC	8,309	70.000	581,630.000	
QORVO INC	8,784	80.130	703,861.920	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	36.320	413,648.480	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	91.750	717,301.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	31.810	467,925.100	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	33.260	892,698.400	
TRANSUNION	10,341	58.450	604,431.450	
SQUARE INC	17,376	44.860	779,487.360	
DOWDUPONT INC	165,219	73.260	12,103,943.940	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	14,000	38.760	542,640.000	
WESTROCK CO	17,744	66.110	1,173,055.840	
KRAFT HEINZ CO	43,818	69.020	3,024,318.360	
FORTIVE CORP	21,682	77.140	1,672,549.480	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	71.060	1,341,541.740	
ALPHABET INC-CL A	20,892	1,128.090	23,568,056.280	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	18.140	2,054,209.880	
PAYPAL HOLDINGS INC	81,079	79.690	6,461,185.510	
FIRST DATA CORP	22,035	16.040	353,441.400	
DXC TECHNOLOGY CO	19,649	103.980	2,043,103.020	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	46.690	379,776.460	
ALPHABET INC-CL C	22,297	1,126.790	25,124,036.630	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	213.410	1,257,411.720	
CHEMOURS CO	12,723	51.080	649,890.840	
ATHENE HOLDING LTD	8,984	48.230	433,298.320	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,583	365.060	4,958,609.980	
VISTRA ENERGY CORP	15,825	19.020	300,991.500	
アメリカ・ドル 小計	21,976,886		1,700,394,079.470 (181,806,134,977)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	8.998	233,093.190	
ASHTED GROUP	35,233	20.530	723,333.490	
SEVERN TRENT PLC	14,897	17.660	263,081.020	
BHP BILLITON PLC	153,323	15.160	2,324,376.680	
BARCLAYS PLC	1,164,260	2.098	2,442,617.480	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.494	355,362.900	
BT GROUP PLC	576,686	2.440	1,407,113.840	
SKY PLC	72,210	11.045	797,559.450	

BUNZL PLC	22,241	20.110	447,266.510	
EASYJET PLC	13,628	16.315	222,340.820	
CAPITA PLC	54,894	1.817	99,742.390	
AVIVA PLC	277,861	5.008	1,391,527.880	
CRODA INTERNATIONAL	8,407	45.380	381,509.660	
DIAGEO PLC	179,703	24.775	4,452,141.820	
SCHRODERS PLC	6,697	34.270	229,506.190	
DCC PLC	5,936	67.600	401,273.600	
NATIONAL GRID PLC	229,884	7.580	1,742,520.720	
GKN PLC	134,180	4.265	572,277.700	
KINGFISHER PLC	165,680	3.530	584,850.400	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.650	1,272,244.400	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	162,930	44.600	7,266,678.000	
COBHAM PLC	142,739	1.209	172,571.450	
NEXT PLC	9,731	49.290	479,640.990	
IMPERIAL BRANDS PLC	65,739	26.145	1,718,746.150	
IMI PLC	21,218	12.470	264,588.460	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	31.600	395,853.200	
ANGLO AMERICAN PLC	93,573	17.884	1,673,459.530	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.265	1,757,169.410	
HSBC HOLDINGS PLC	1,415,041	7.234	10,236,406.590	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.593	1,098,521.850	
CENTRICA PLC	392,766	1.441	565,975.800	
UNILEVER PLC	89,305	37.605	3,358,314.520	
MEGGITT PLC	62,181	4.713	293,059.050	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.240	348,727.680	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,714	6.868	238,415.750	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.398	517,367.870	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	26.450	669,396.600	
PEARSON PLC	65,009	7.000	455,063.000	
PERSIMMON PLC	23,150	24.720	572,268.000	
PRUDENTIAL PLC	182,973	18.325	3,352,980.220	
RIO TINTO PLC	85,976	40.015	3,440,329.640	
VODAFONE GROUP PLC	1,906,594	2.038	3,885,638.570	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,231	59.200	2,796,075.200	
RELX PLC	72,305	15.180	1,097,589.900	
OLD MUTUAL PLC	339,296	2.541	862,151.130	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.368	978,771.480	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	246,107	2.684	660,551.180	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.225	458,922.900	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.265	290,392.600	

SSE PLC	73,043	12.515	914,133.140	
BP PLC	1,384,828	4.761	6,593,166.100	
SHIRE PLC	65,457	30.240	1,979,419.680	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.980	595,191.580	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.880	503,713.600	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	8.296	1,970,573.760	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,055,136	0.686	3,467,823.290	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.904	481,753.880	
TESCO PLC	562,988	2.054	1,156,377.350	
3I GROUP PLC	66,784	9.370	625,766.080	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.650	836,860.750	
GLAXOSMITHKLINE PLC	345,537	12.960	4,478,159.520	
WEIR GROUP	18,336	20.040	367,453.440	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	40.560	887,777.280	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.630	141,232.260	
WPP PLC	90,628	13.555	1,228,462.540	
FERGUSON PLC	18,238	52.220	952,388.360	
ASTRAZENECA PLC	88,762	47.520	4,217,970.240	
WHITBREAD PLC	12,159	38.990	474,079.410	
CARNIVAL PLC	13,153	47.970	630,949.410	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.994	360,148.260	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.376	312,347.480	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	49.320	555,984.360	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	15.405	460,501.660	
INVESTEC PLC	50,655	6.350	321,659.250	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	46.290	572,236.980	
ITV PLC	247,210	1.705	421,493.050	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.555	279,542.550	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	60.140	420,859.720	
G4S PLC	122,250	2.609	318,950.250	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.230	305,622.390	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	38.510	413,058.260	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	319,445	22.585	7,214,665.320	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	261,972	22.850	5,986,060.200	
TUI AG-DI	30,153	15.460	466,165.380	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	3.761	692,712.260	
EXPERIAN PLC	62,214	15.630	972,404.820	
MONDI PLC	24,061	18.775	451,745.270	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	17.175	365,655.750	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	13.110	205,027.290	
GLENCORE PLC	865,423	3.962	3,428,805.920	

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.882	437,478.100	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	6.084	186,267.740	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	24.590	329,653.540	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.114	250,297.600	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	5.700	313,842.000	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.445	172,377.460	
	WORLDPAY INC	10,775	55.010	592,732.750	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	20.310	656,866.020	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.625	276,761.500	
イギリス・ポンド	小計	21,463,355		130,494,541.660 (19,497,189,470)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	24.350	1,909,721.800	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	20.640	2,127,179.040	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.406	1,017,571.380	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	510.300	898,128.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	313.700	815,620.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.470	764,388.170	
	NICE LTD	4,035	337.000	1,359,795.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.850	656,405.400	
イスラエル・シュケル	小計	437,969		9,548,808.790 (292,861,966)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	68.070	756,598.050	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	203,883	28.440	5,798,432.520	
	AMCOR LTD	80,741	14.160	1,143,292.560	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	239,994	30.490	7,317,417.060	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	12.740	389,449.060	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	5.180	591,167.500	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.480	949,758.120	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.440	446,320.160	
	AMP LTD	200,498	5.250	1,052,614.500	
	ASX LTD	10,290	58.100	597,849.000	
	BHP BILLITON LTD	232,053	30.680	7,119,386.040	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	34.600	724,731.600	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	4.520	100,262.640	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	18.120	689,284.800	
	CSL LIMITED	32,212	160.910	5,183,232.920	
	REA GROUP LTD	4,119	78.440	323,094.360	

TRANSURBAN GROUP	149,591	11.420	1,708,329.220	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.050	439,839.050	
COCHLEAR LTD	3,992	181.500	724,548.000	
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	9.160	1,114,964.360	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	121,208	75.460	9,146,355.680	
BORAL LIMITED	86,101	7.780	669,865.780	
RIO TINTO LIMITED	26,822	80.850	2,168,558.700	
APA GROUP	73,253	8.260	605,069.780	
ARISTOCRAT LEISU	37,393	24.460	914,632.780	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	7.990	1,370,053.290	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.230	178,919.370	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	56.310	184,415.250	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	23.120	658,665.680	
ORICA LTD	25,308	18.780	475,284.240	
CIMIC GROUP LTD	8,709	46.120	401,659.080	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	15.490	572,216.090	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.470	550,791.100	
MACQUARIE GROUP LTD	21,627	101.970	2,205,305.190	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.500	1,257,943.500	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	29.780	5,744,025.960	
NEWCREST MINING LTD	51,533	22.120	1,139,909.960	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.560	708,485.400	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.800	518,418.800	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.730	1,023,534.700	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.560	574,079.920	
SANTOS LTD	133,862	5.120	685,373.440	
SONIC HEALTHCARE	26,192	24.120	631,751.040	
TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.730	597,626.040	
WESFARMERS LTD	81,021	42.530	3,445,823.130	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.330	430,148.290	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,249	28.580	1,721,916.420	
WOOLWORTHS GROUP LTD	91,294	26.920	2,457,634.480	
SEEK LTD	25,899	20.320	526,267.680	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	41.010	187,866.810	
AUSNET SERVICES	165,066	1.665	274,834.890	
AGL ENERGY LTD	46,315	21.560	998,551.400	
BRAMBLES LTD	115,255	9.640	1,111,058.200	
CROWN RESORTS LTD	32,861	13.400	440,337.400	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.680	651,381.120	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	17.630	895,410.070	

	HEALTHSCOPE LTD	149,047	1.920	286,170.240	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	3.260	577,593.760	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.350	1,229,640.950	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD-RTS	6,694	1.770	11,848.380	
オーストラリア・ドル 小計		5,323,388		85,399,995.510 (7,153,957,624)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	51.390	829,485.990	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	62.410	1,917,734.480	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	15.400	1,288,179.200	
	ATCO LTD	7,193	42.140	303,113.020	
	BANK OF MONTREAL	45,451	99.460	4,520,556.460	
	BANK OF NOVA SCOTIA	84,484	78.390	6,622,700.760	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	63.760	1,514,682.560	
	BCE INC	11,568	56.300	651,278.400	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	57,500	51.190	2,943,425.000	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	23.650	610,619.350	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.980	603,427.700	
	SAPUTO INC	14,101	40.450	570,385.450	
	BLACKBERRY LTD	39,652	15.910	630,863.320	
	CGI GROUP INC	15,228	73.860	1,124,740.080	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	66.100	749,574.000	
	CAE INC	23,000	23.530	541,190.000	
	CAMECO CORP	32,627	11.650	380,104.550	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	58.640	1,522,704.880	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29,471	119.000	3,507,049.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	40.750	3,236,365.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	176.150	856,441.300	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	33.560	306,033.640	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	52,687	97.860	5,155,949.820	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.830	226,399.110	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	37.700	525,161.000	
	OPEN TEXT CORP	19,756	44.840	885,859.040	
	EMPIRE CO LTD	15,093	23.210	350,308.530	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.550	453,821.550	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	34.050	336,822.600	
	FORTIS INC	29,002	42.240	1,225,044.480	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	21.100	1,166,745.600	
	TELUS CORP	15,945	46.570	742,558.650	
	GREAT WEST LIFECO INC	19,248	34.500	664,056.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	34.570	744,706.940		
ENBRIDGE INC	112,614	42.740	4,813,122.360		

IGM FINANCIAL INC	8,426	39.300	331,141.800	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.540	311,502.300	
MANULIFE FINANCIAL CORP	136,517	24.380	3,328,284.460	
LINAMAR CORP	3,827	70.730	270,683.710	
LOBLAW CO LTD	15,354	64.860	995,860.440	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	55.640	362,995.360	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	71.590	1,814,019.010	
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,842	54.220	2,214,453.240	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	644.000	1,278,340.000	
METRO INC	12,389	40.370	500,143.930	
HUSKY ENERGY INC	28,749	16.910	486,145.590	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.540	381,523.680	
METHANEX CORP	7,381	75.010	553,648.810	
ONEX CORP	6,646	92.170	612,561.820	
GOLDCORP INC	51,066	16.270	830,843.820	
POWER CORP OF CANADA	25,052	30.530	764,837.560	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	33.610	587,637.240	
ROYAL BANK OF CANADA	103,945	102.560	10,660,599.200	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	57.250	751,921.500	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	236.400	2,507,494.800	
SHAW COMM INC-B	27,548	25.090	691,179.320	
SUNCOR ENERGY INC	116,895	43.600	5,096,622.000	
LUNDIN MINING CORP	35,268	8.540	301,188.720	
ENCANA CORP	69,257	14.000	969,598.000	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	37.400	1,533,998.400	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	50.480	1,033,275.120	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	131,189	73.970	9,704,050.330	
TRANSCANADA CORP	62,895	58.250	3,663,633.750	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	92.050	524,316.800	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	103.160	320,311.800	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	97.720	1,053,910.200	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	24.770	840,768.110	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	840.510	1,255,721.940	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	12,787	92.960	1,188,679.520	
CI FINANCIAL CORP	20,695	28.830	596,636.850	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	19.820	312,739.780	
KEYERA CORP	13,728	33.560	460,711.680	
ALTAGAS LTD	12,538	26.560	333,009.280	
PEMBINA PIPELINE CORP	30,850	42.490	1,310,816.500	

	DOLLARAMA INC	7,504	153.030	1,148,337.120	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	9.630	775,648.350	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	43.730	362,565.430	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	13.170	302,870.490	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	4.950	151,623.450	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	22.880	551,019.040	
	NUTRIEN LTD	45,351	63.800	2,893,393.800	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	29.490	441,199.890	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	16.120	277,763.720	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	75.300	1,156,080.900	
	SHOPIFY INC	5,021	173.280	870,038.880	
	HYDRO ONE LTD	13,354	21.000	280,434.000	
カナダ・ドル 小計		2,893,366		122,467,991.260 (10,339,972,502)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.390	423,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	3.240	263,736.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.640	326,568.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.360	249,170.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	124,200	29.590	3,675,078.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	12.660	367,140.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	37.830	224,861.520	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.200	219,960.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.530	518,817.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.590	690,769.850	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.300	541,320.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	7.960	783,264.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.000	355,800.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	13.370	3,014,306.610	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.380	2,000,696.360	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.170	530,575.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	28.070	2,652,615.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.380	339,390.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.130	287,960.000		
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.470	277,536.000		
シンガポール・ドル 小計		3,458,374		17,743,313.740 (1,436,498,680)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	167,395	17.440	2,919,368.800	
	NESTLE SA-REGISTERED	219,706	75.760	16,644,926.560	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	84.120	3,149,284.560	

	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	49,663	222.050	11,027,669.150	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	225.000	637,875.000	
	SIKA INHABER	151	7,720.000	1,165,720.000	
	SGS SA-REG	405	2,409.000	975,645.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	157,558	79.380	12,506,954.040	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	149.700	617,811.900	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,929.000	277,776.000	
	CLARIANT AG-REG	12,888	23.570	303,770.160	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	514.000	922,630.000	
	ABB LTD	126,278	23.310	2,943,540.180	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	75.840	935,941.440	
	GEBERIT AG	2,801	427.400	1,197,147.400	
	LONZA GROUP AG-REG	5,389	240.400	1,295,515.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,695.000	427,125.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	68,300.000	614,700.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,158.000	1,493,336.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,843	312.800	3,391,690.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	55.460	1,812,210.960	
	SONOVA HOLDING AG	3,168	147.450	467,121.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	163.250	601,902.750	
	STRAUMANN HOLDING AG	600	654.500	392,700.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	404.500	790,797.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	77.150	354,272.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	218.000	362,534.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	339.800	756,055.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	134.500	410,225.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	616.000	340,648.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	89.000	533,110.000	
	DUFREY GROUP	2,390	137.250	328,027.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	688.500	875,772.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	61.520	936,765.040	
	SWISS RE LTD	20,638	97.440	2,010,966.720	
	UBS GROUP AG	260,639	18.080	4,712,353.120	
スイス・フラン	小計	1,172,858		79,133,889.180 (9,045,003,533)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	353.000	17,077,081.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	25,793	314.200	8,104,160.600	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	55.940	12,404,583.120	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	103.900	1,366,596.700	
	LUNDBERGS B	3,691	636.000	2,347,476.000	
	SKF AB-B SHS	24,866	174.950	4,350,306.700	
	SANDVIK AB	76,781	151.350	11,620,804.350	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	95,918	97.460	9,348,168.280	

	SKANSKA AB-B SHS	21,179	166.850	3,533,716.150	
	SWEDBANK AB	66,507	207.900	13,826,805.300	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	115.500	12,518,814.000	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	157.750	17,931,758.000	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	354.600	4,071,162.600	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	99.160	2,674,940.160	
	NORDEA AB	218,620	94.100	20,572,142.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	200.200	2,282,880.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	275.000	5,277,525.000	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	142.650	3,437,579.700	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	367.800	12,288,933.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	138.500	9,203,048.000	
	ASSA ABLOY AB-B	68,613	183.300	12,576,762.900	
	TELIA CO AB	184,927	38.740	7,164,071.980	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	194.200	3,260,618.000	
	BOLIDEN AB	21,855	290.400	6,346,692.000	
	ALFA LAVAL AB	17,411	200.200	3,485,682.200	
	KINNEVIK AB-B	18,310	298.200	5,460,042.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	564.000	3,007,248.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	298.900	1,769,488.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	88.180	2,970,960.560	
	HEXAGON AB	18,360	491.000	9,014,760.000	
	ESSITY AB-B	39,797	226.300	9,006,061.100	
スウェーデン・クローネ 小計		1,662,709		238,300,868.600 (3,119,358,370)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	744.200	5,454,986.000	
	A P MOLLER A/S	481	10,040.000	4,829,240.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	9,600.000	2,620,800.000	
	DANSKE BANK A/S	50,188	248.600	12,476,736.800	
	GENMAB A/S	3,899	1,241.000	4,838,659.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	317.900	5,055,881.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,728	323.700	42,640,353.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	447.000	7,066,176.000	
	TDC A/S	68,939	49.590	3,418,685.010	
	COLOPLAST-B	8,286	525.400	4,353,464.400	
	DSV A/S	13,040	482.200	6,287,888.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	220.000	1,438,140.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	319.100	1,544,444.000	
	TRYG A/S	11,107	147.300	1,636,061.100	
	PANDORA A/S	8,251	609.600	5,029,809.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	509.000	3,923,372.000	
	ISS A/S	11,125	228.200	2,538,725.000	
	ORSTED A/S	11,600	379.600	4,403,360.000	
デンマーク・クローネ 小計		377,044		119,556,782.110 (2,108,981,636)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.380	625,188.960	
	FISHER & PAYKEL	37,249	13.300	495,411.700	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	6.500	489,326.500	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.370	537,929.510	
ニュージーランド・ドル 小計		370,145		2,147,856.670 (167,253,599)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	24,816	157.700	3,913,483.200	
	DNB ASA	70,426	155.500	10,951,243.000	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	56.160	5,159,924.640	
	TELENOR ASA	53,178	180.050	9,574,698.900	
	ORKLA ASA	61,421	85.780	5,268,693.380	
	STATOIL ASA	81,414	180.950	14,731,863.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	360.500	4,066,079.500	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	144.700	2,414,030.100		
ノルウェー・クローネ 小計		411,096		56,080,016.020 (763,809,819)	
ユーロ	CRH PLC	58,956	28.000	1,650,768.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	95.700	597,742.200	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	81.900	948,074.400	
	UMICORE	15,320	46.180	707,477.600	
	AIR LIQUIDE	29,845	102.850	3,069,558.250	
	AIRBUS SE	41,270	98.300	4,056,841.000	
	AXA	139,550	25.480	3,555,734.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	20.120	696,594.640	
	ADIDAS AG	13,503	181.800	2,454,845.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.365	1,321,313.170	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	38,521	19.560	753,470.760	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,399.000	219,643.000	
	DANONE	43,686	65.820	2,875,412.520	
	SAFRAN SA	22,050	90.300	1,991,115.000	
	INTESA SANPAOLO	934,915	3.083	2,882,342.940	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	3.240	165,816.720	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,705	87.050	1,976,470.250	
	ACCOR SA	10,552	47.270	498,793.040	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	31.630	239,217.690	
	BOUYGUES	13,996	42.840	599,588.640	
	BNP PARIBAS	78,814	64.890	5,114,240.460	
	RELX NV	70,826	17.275	1,223,519.150	
	THALES SA	8,128	92.160	749,076.480	
	CAPGEMINI SA	11,481	101.650	1,167,043.650	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	46.060	196,399.840		
INGENICO GROUP	4,334	73.040	316,555.360		
UNICREDIT SPA	142,664	17.234	2,458,671.370		

NATIXIS	70,166	7.056	495,091.290	
KONINKLIJKE DSM NV	13,216	84.240	1,113,315.840	
COMMERZBANK AG	72,573	12.854	932,853.340	
EIFFAGE	4,777	92.560	442,159.120	
FRESENIUS SE & CO KGAA	28,530	63.480	1,811,084.400	
UNITED INTERNET	9,882	55.760	551,020.320	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	47.080	261,105.680	
PUBLICIS GROUPE	15,068	60.920	917,942.560	
MAN SE	3,396	95.200	323,299.200	
FAURECIA	3,831	69.640	266,790.840	
IBERDROLA SA	416,818	6.104	2,544,257.070	
ENI SPA	177,297	13.790	2,444,925.630	
IMERYS SA	2,256	83.750	188,940.000	
JERONIMO MARTINS	19,517	17.595	343,401.610	
KBC GROUPE	18,378	74.520	1,369,528.560	
HANNOVER RUECK SE	3,642	111.700	406,811.400	
WARTSILA OYJ	11,645	58.560	681,931.200	
L'OREAL	18,067	178.700	3,228,572.900	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	19,742	246.750	4,871,338.500	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	24.420	234,432.000	
GEA GROUP AG	11,838	38.810	459,432.780	
BOLLORE	71,347	4.538	323,772.680	
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.866	418,357.860	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	125.300	1,518,385.400	
CONTINENTAL AG	7,776	226.800	1,763,596.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	37.430	2,618,003.920	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.700	183,210.200	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	38.130	358,383.870	
AXEL SPRINGER SE	3,067	73.200	224,504.400	
OMV AG	9,766	47.000	459,002.000	
PERNOD-RICARD	15,401	134.600	2,072,974.600	
PEUGEOT SA	42,232	17.930	757,219.760	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	68.520	725,695.320	
RENAULT SA	12,442	87.790	1,092,283.180	
REPSOL SA	82,664	14.155	1,170,108.920	
REMY COINTREAU	1,860	109.900	204,414.000	
MERCK KGAA	9,551	82.340	786,429.340	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	45.375	1,620,159.750	
RWE AG	39,183	16.575	649,458.220	
SEB SA	1,405	167.500	235,337.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	50.000	580,100.000	
SOCIETE GENERALE-A	54,209	46.535	2,522,615.810	
VINCI S.A.	35,362	82.900	2,931,509.800	
SODEXO	6,286	99.680	626,588.480	
SOLVAY SA	5,036	114.600	577,125.600	

SCHNEIDER ELECTRIC SE	38,899	72.000	2,800,728.000	
VIVENDI SA	72,630	20.900	1,517,967.000	
SAP SE	69,054	84.520	5,836,444.080	
TELEFONICA S.A	322,715	8.021	2,588,497.010	
TOTAL SA	168,622	47.070	7,937,037.540	
VALEO	17,731	54.820	972,013.420	
E.ON SE	164,012	8.684	1,424,280.200	
VOEST-ALPINE AG	9,875	47.530	469,358.750	
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	101.100	760,777.500	
SIEMENS AG-REG	53,706	110.720	5,946,328.320	
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	28.100	1,037,367.700	
ING GROEP NV-CVA	272,880	14.736	4,021,159.680	
BAYER AG	58,437	97.920	5,722,151.040	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	14.260	603,240.780	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	12,178	111.500	1,357,847.000	
DAIMLER AG	68,086	70.410	4,793,935.260	
BASF SE	65,128	88.070	5,735,822.960	
BEIERSDORF AG	6,780	91.880	622,946.400	
HOCHTIEF AG	1,707	138.400	236,248.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	82.800	911,545.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	87.940	1,323,321.120	
ORANGE	141,819	14.015	1,987,593.280	
SAMPO OYJ-A SHS	28,897	46.230	1,335,908.310	
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	58.360	454,857.840	
ALLIANZ SE	31,955	191.500	6,119,382.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,374	2.800	426,647.200	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	17.620	1,610,926.120	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	32.400	570,304.800	
HERMES INTL	2,285	447.000	1,021,395.000	
ENDESA S.A.	21,037	17.600	370,251.200	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	27.130	433,076.190	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	38.660	802,349.640	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	10,760	183.550	1,974,998.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	28.190	1,331,836.550	
SOCIETE BIC SA	2,478	85.400	211,621.200	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	104.750	938,664.750	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,249	28.450	433,834.050	
HEINEKEN NV	17,373	85.100	1,478,442.300	
AKZO NOBEL	18,209	79.280	1,443,609.520	
ASML HOLDING NV	27,421	158.550	4,347,599.550	
AEGON NV	120,404	5.618	676,429.670	
BANKINTER S.A.	57,960	9.082	526,392.720	
VOLKSWAGEN AG	2,183	166.800	364,124.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	162.600	2,135,588.400	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	464,350	6.910	3,208,658.500	
KERING	5,479	391.800	2,146,672.200	
CNP ASSURANCES	13,987	19.980	279,460.260	
FORTUM OYJ	29,739	18.225	541,993.270	
AGEAS	12,993	41.820	543,367.260	
UCB SA	8,747	66.140	578,526.580	
THYSSENKRUPP AG	29,903	22.680	678,200.040	
UNILEVER NV-CVA	115,530	43.485	5,023,822.050	
CARREFOUR SA	39,144	19.150	749,607.600	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	19.015	551,625.150	
ATOS SE	7,050	110.700	780,435.000	
NOKIA OYJ	417,248	4.685	1,954,806.880	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	67,529	31.500	2,127,163.500	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	42.870	881,321.460	
SANOFI	79,878	65.050	5,196,063.900	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	18.640	854,942.240	
ELISA OYJ	9,517	35.890	341,565.130	
BANCO SANTANDER SA	1,145,690	5.653	6,476,585.570	
METSO OYJ	8,585	26.310	225,871.350	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	16.350	565,644.600	
QIAGEN N.V.	13,642	27.250	371,744.500	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	65.950	207,676.550	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	13.296	1,984,348.220	
BMW VORZUG	4,116	74.250	305,613.000	
K & S	14,982	22.370	335,147.340	
ENEL SPA	579,218	4.835	2,800,519.030	
COLRUYT NV	4,673	44.930	209,957.890	
VOPAK (KON.)	5,364	38.520	206,621.280	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	232,897	13.395	3,119,655.310	
LEONARDO SPA	26,269	8.890	233,531.410	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,930	66.520	261,423.600	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	22.260	1,820,289.240	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.633	602,870.110	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	474.400	376,673.600	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.982	182,328.140	
TELEPERFORMANCE	3,607	119.900	432,479.300	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	108.650	1,504,150.600	
EURAZEO	2,427	78.650	190,883.550	
BANCO SABADELL	367,753	1.745	641,728.980	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	93.320	542,562.480	
FRAPORT AG	3,149	85.000	267,665.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	81.150	650,336.100	
INDITEX	75,658	25.000	1,891,450.000	
JC DECAUX SA	6,058	32.000	193,856.000	
ANDRITZ AG	6,265	48.600	304,479.000	
MAPFRE SA	84,474	2.772	234,161.920	

ESSILOR INTL	14,632	109.850	1,607,325.200	
SNAM SPA	158,419	3.771	597,398.040	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	13.950	1,193,910.750	
ENAGAS	18,095	21.490	388,861.550	
WENDEL	2,220	142.100	315,462.000	
WIRECARD AG	7,990	98.740	788,932.600	
TENARIS SA	30,372	14.240	432,497.280	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.732	579,863.310	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.619	308,011.920	
ATLANTIA SPA	34,969	25.490	891,359.810	
ILIAD SA	2,102	197.650	415,460.300	
PROXIMUS	8,922	26.820	239,288.040	
SES FDR	24,585	11.405	280,391.920	
TERNA SPA	81,915	4.658	381,560.070	
GRIFOLS SA	18,800	23.550	442,740.000	
FERROVIAL SA	36,997	17.805	658,731.580	
LANXESS AG	6,856	68.120	467,030.720	
NESTE OYJ	8,839	61.760	545,896.640	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	31.800	306,583.800	
RECORDATI SPA	6,859	29.060	199,322.540	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.230	221,682.090	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,134	138.000	432,492.000	
KONE OYJ	23,717	44.880	1,064,418.960	
ENGIE	129,539	12.975	1,680,768.520	
ALSTOM	12,046	34.200	411,973.200	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	56.650	205,866.100	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.450	231,399.900	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	10.610	368,761.160	
IPSEN SA	2,487	122.000	303,414.000	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	34.550	922,968.700	
ARKEMA SA	3,796	106.400	403,894.400	
LEGRAND SA	19,920	64.400	1,282,848.000	
ADP	2,313	167.100	386,502.300	
ORION OYJ	8,051	26.890	216,491.390	
RTL GROUP SA	3,446	71.300	245,699.800	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.850	563,126.850	
SYMRISE AG	7,926	66.740	528,981.240	
SCOR SE	13,875	34.780	482,572.500	
REXEL SA	23,245	14.620	339,841.900	
PRYSMIAN SPA	14,925	26.540	396,109.500	
CAIXABANK	262,372	3.978	1,043,715.810	
BUREAU VERITAS SA	21,480	21.970	471,915.600	
GETLINK	37,646	10.540	396,788.840	
SUEZ SA	25,406	11.270	286,325.620	
AMADEUS IT GROUP SA	30,169	59.340	1,790,228.460	

	BRENNTAG AG	9,600	52.100	500,160.000	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.686	299,178.440	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.460	352,574.500	
	EDENRED	13,195	28.750	379,356.250	
	BANKIA SA	63,197	4.082	257,970.150	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.079	251,025.730	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	73.600	384,044.800	
	OSRAM LICHT AG	7,017	66.240	464,806.080	
	KION GROUP AG	4,686	71.360	334,392.960	
	VONOVIA SE	35,308	38.100	1,345,234.800	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.800	571,638.600	
	FERRARI NV	8,338	104.500	871,321.000	
	METRO AG	10,774	15.645	168,559.230	
	INNOGY SE	9,769	32.400	316,515.600	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	11.360	893,407.200	
	AIB GROUP PLC	52,322	5.230	273,644.060	
	LINDE AG-TENDER	13,375	186.000	2,487,750.000	
	NN GROUP NV	21,965	36.300	797,329.500	
	ZALANDO SE	6,674	47.820	319,150.680	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	17.620	1,351,788.780	
	AENA SME SA	5,256	167.250	879,066.000	
	ABN AMRO GROUP NV	29,129	25.530	743,663.370	
	EXOR NV	7,726	59.600	460,469.600	
	ALTICE NV-A	43,403	7.622	330,817.660	
	COVESTRO AG	10,500	93.540	982,170.000	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	53,680	86.610	4,649,224.800	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.712	268,580.680	
	AMUNDI SA	3,894	67.280	261,988.320	
	SCHAEFFLER AG	12,644	13.420	169,682.480	
	UNIPER SE	13,897	25.420	353,261.740	
ユーロ	小計	13,906,573		279,425,320.740 (36,713,692,893)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	114.900	1,907,340.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.820	3,086,480.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	34.350	2,619,531.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	77.450	9,255,275.000	
	PCCW LTD	331,000	4.520	1,496,120.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	3.980	2,118,952.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	65.850	3,226,650.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	79,040	285.800	22,589,632.000	
	MTR CORP	118,500	41.800	4,953,300.000	

HANG LUNG GROUP LTD	63,000	27.500	1,732,500.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	196.300	10,992,800.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	50.650	4,246,698.600	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	65.700	6,340,050.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	28.900	2,767,175.000	
HONG KONG & CHINA GAS	610,046	15.320	9,345,904.720	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	44.100	2,205,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	67.400	11,053,600.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	35.400	1,168,200.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	39.650	10,388,300.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	31.950	1,613,475.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.740	5,180,462.840	
SINO LAND CO	255,400	13.820	3,529,628.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	128.000	13,184,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	77.500	2,325,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	49.500	5,618,250.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	56.150	3,144,400.000	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	258,000	4.940	1,274,520.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	46.400	2,041,600.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.600	1,185,600.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	27.200	3,383,680.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	23.200	1,503,360.000	
AIA GROUP LTD	849,627	63.650	54,078,758.550	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	9.980	2,814,360.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	44.000	7,444,800.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	26.450	2,756,090.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	51.050	4,888,037.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.310	1,681,300.000	
WH GROUP LTD	530,500	9.390	4,981,395.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	99.300	19,793,667.600	
CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	67.550	12,451,626.600	
香港・ドル 小計	7,342,247		266,367,519.410 (3,641,243,990)	
合計	80,796,010		276,085,959,059 (276,085,959,059)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年2月26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	63,819.000	595,431.270	

		GOODMAN GROUP	121,619.000	998,491.990	
		GPT GROUP	144,955.000	688,536.250	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	653,852.500	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	624,102.130	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,473,361.920	
		STOCKLAND	126,459.000	510,894.360	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	670,698.640	
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,223,905.900	
	オーストラリア・ドル	小計	1,584,164.000	7,439,274.960 (623,188,063)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	520,087.540	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	392,030.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	370,753.000	
	シンガポール・ドル	小計	591,906.000	1,282,870.540 (103,861,199)	
投資信託受益証券 合計			2,176,070	727,049,262 (727,049,262)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	484,960.440	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	895,835.600	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,354,415.910	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	804,740.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,642.000	1,542,816.420	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,350,992.960	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	344,128.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	513,861.600	
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	316,846.660	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,166.000	3,110,653.040	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,545,059.600	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	623,250.900	
		EQUINIX INC	5,448.000	2,151,088.320	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,542,719.300	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,028,169.480	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	705,010.600	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,144.000	480,413.920	
		GGP INC	43,463.000	935,323.760	
		HCP INC	34,130.000	763,146.800	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	982,533.870	
		INVITATION HOMES INC	22,567.000	495,345.650	
		IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	615,709.400	
		KIMCO REALTY	32,980.000	503,274.800	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	468,639.270	

	MID AMERICA	8,123.000	715,230.150	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	403,729.760	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,387,057.160	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,182,027.680	
	REALTY INCOME CORP	18,985.000	953,047.000	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	666,458.940	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,412,665.170	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	21,825.000	3,419,104.500	
	SL GREEN	5,382.000	525,390.840	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	535,071.040	
	UDR INC	17,458.000	596,016.120	
	VENTAS INC	25,041.000	1,264,820.910	
	VEREIT INC	72,429.000	499,035.810	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	826,318.370	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,442,735.560	
	WEYERHAEUSER CO	51,939.000	1,838,640.600	
	アメリカ・ドル 小計	910,976.000	46,226,287.050 (4,942,514,611)	
	イギリス・ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	467,448.980	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	279,129.390	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,974.000	359,651.750	
	SEGRO PLC	61,113.000	358,977.760	
	イギリス・ポンド 小計	229,574.000	1,465,207.880 (218,916,709)	
	カナダ・ドル			
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	215,604.880	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	228,039.750	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	76,582.120	
	カナダ・ドル 小計	23,005.000	520,226.750 (43,922,744)	
	ユーロ			
	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	207,472.650	
	GECINA SA	3,670.000	569,217.000	
	ICADE	2,234.000	184,863.500	
	KLEPIERRE	17,042.000	584,540.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,390,403.550	
	ユーロ 小計	32,510.000	2,936,497.300 (385,826,380)	
	香港・ドル			
	LINK REIT	163,500.000	10,660,200.000	
	香港・ドル 小計	163,500.000	10,660,200.000 (145,724,934)	
	投資証券 合計	1,359,565	5,736,905,378 (5,736,905,378)	
	合計		6,463,954,640 (6,463,954,640)	

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 602銘柄	62.60%	-%	-%	66.09%
	投資証券 40銘柄	-%	-%	1.70%	
イギリス・ポンド	株式 99銘柄	6.71%	-%	-%	6.98%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.08%	
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	2.46%	-%	-%	2.75%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.21%	-%	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.56%	-%	-%	3.68%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.49%	-%	-%	0.55%
	投資信託 受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 36銘柄	3.11%	-%	-%	3.20%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.07%	-%	-%	1.10%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.73%	-%	-%	0.75%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.26%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 237銘柄	12.64%	-%	-%	13.13%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.25%	-%	-%	1.34%
	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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,516,479,320	2,427,443,670
コール・ローン		1,346,029,738	409,777,133
国債証券		241,910,908,444	211,625,176,962
派生商品評価勘定		-	189,709
未収利息		2,166,219,241	1,890,523,698
前払費用		28,959,700	30,377,614
流動資産合計		247,968,596,443	216,383,488,786
資産合計		247,968,596,443	216,383,488,786
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,975,641	124,925
未払解約金		191,711,000	343,581,000
流動負債合計		198,686,641	343,705,925
負債合計		198,686,641	343,705,925
純資産の部			
元本等			
元本	1	143,480,057,319	121,490,410,134
剰余金			
剰余金又は欠損金()		104,289,852,483	94,549,372,727
元本等合計		247,769,909,802	216,039,782,861
純資産合計		247,769,909,802	216,039,782,861
負債純資産合計		247,968,596,443	216,383,488,786

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29年2月27日現在	平成30年2月26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	149,167,353,470円	143,480,057,319円
同期中追加設定元本額	30,520,903,400円	24,072,066,564円
同期中一部解約元本額	36,208,199,551円	46,061,713,749円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	5,128,943,378円	8,178,188,221円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	13,691,042円	16,550,949円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	44,704,339円	43,087,731円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	62,814,032円	50,607,050円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	39,527,953円	84,738,289円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	42,616,554円	73,029,025円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	39,345,731円	35,964,363円
たわらノーロード 先進国債券	526,660,107円	1,550,612,754円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	21,598,989円

たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	170,191円
たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	1,177,165円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	532,097円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	- 円	28,212円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	563,219円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	751,296円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	147,764円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	57,145円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	343,053円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	193,352円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	262,467円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,778,857,729円	5,032,915,649円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	447,249,853円	474,597,820円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,429,659,466円	1,526,634,357円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,468,558,554円	1,682,020,108円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	361,249,152円	366,252,324円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	744,657,416円	780,311,672円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	555,306,358円	633,352,049円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,651,436円	23,441,361円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	563,298,507円	585,178,050円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,021,349円	6,898,943円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国10)	13,825,526円	17,867,916円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国20)	23,935,984円	39,193,230円
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興 国30)	46,434,072円	71,081,407円
クルーズコントロール DIAM 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	1,781,261,902円 44,703,644円	471,522,151円 67,264,964円
DIAM DC バラン ス・F(成長型)	64,833,181円	121,175,646円
クルーズコントロール< DC年金>	656,988円	175,031円
DIAMコア資産設計 ファンド(堅実型)	8,685,786円	1,547,650円
DIAMコア資産設計 ファンド(積極型)	28,434,647円	4,761,061円
ダイナミック・ナビゲー ション	336,463円	135,460円
DIAMパッシブ資産分 散ファンド	1,570,963,668円	1,427,367,462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)	7,162,874,811円	6,984,591,409円
DIAM外国債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	4,298,221,851円	4,074,076,473円
外国債券パッシブファン ド(適格機関投資家限 定)	3,975,487,139円	3,765,907,771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)	411,883,612円	- 円
先進国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家限 定)	577,394,424円	576,382,992円
DIAMワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	114,026,758円	107,448,126円
DIAMグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,328,163,674円	968,520,974円
DIAMグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	815,717,319円	708,041,760円

D I A M国際分散バ ランスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	83,054,540円	57,495,581円
D I A M国際分散バ ランスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	153,614,760円	107,057,634円
D I A M国内重視バ ランスファンド3 0 V A (適 格機関投資家限定)	38,607,745円	26,555,966円
D I A M国内重視バ ランスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	13,058,720円	10,750,815円
D I A M世界バラン スファンド4 0 V A (適格 機関投資家限定)	1,656,036,644円	72,188,716円
D I A M世界バラン スファンド5 0 V A (適格 機関投資家限定)	497,398,018円	85,457,559円
D I A Mバランスファン ド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	4,483,992,277円	3,796,951,947円
D I A Mバランスファン ド3 7 . 5 V A (適格機 関投資家限定)	2,756,191,387円	2,498,788,864円
D I A Mバランスファン ド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	4,587,547,137円	4,222,249,727円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A (適格機関投資家限定)	895,832,183円	766,253,872円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	1,987,647,480円	515,526,816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)	4,199,114,002円	3,592,931,221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)	15,062,291,264円	8,998,213,463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)	19,119,506円	13,975,529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)	2,036,987,121円	82,547,070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)	11,186,558,463円	2,967,288,873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)	16,133,768,314円	15,212,015,467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)	20,496,046,357円	19,892,468,598円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	26,346,082円	2,361,904円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	270,776円	34,508,457円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	6,037,223円	5,621,656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)	18,350,730,818円	17,700,778,938円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	120,985,005円	107,612,203円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	141,168,530円	83,137,353円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	237,910円	59,633,095円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限 定)	154,240円	165,250円
計	143,480,057,319円	121,490,410,134円
2 . 受益権の総数	143,480,057,319口	121,490,410,134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28年2月26日 至 平成29年2月27日	自 平成29年2月28日 至 平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,483,683,375	461,126,505
合計	1,483,683,375	461,126,505

（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29年2月22日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月22日から平成30年2月26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29年2月27日 現在				平成30年2月26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	-	-	-	-	326,384,024	-	326,319,240	64,784
アメリカ・ドル	-	-	-	-	112,189,343	-	112,143,010	46,333
イギリス・ボンド	-	-	-	-	23,904,192	-	23,904,000	192
マレーシア・リン ギット	-	-	-	-	35,800,875	-	35,925,800	124,925
ユーロ	-	-	-	-	130,597,950	-	130,470,270	127,680
南アフリカ・ラン ド	-	-	-	-	23,891,664	-	23,876,160	15,504
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・ボンド	164,494,992	-	162,922,500	1,572,492	-	-	-	-
ユーロ	741,275,481	-	738,441,900	2,833,581	-	-	-	-
合計	1,647,316,001	-	1,640,340,360	6,975,641	326,384,024	-	326,319,240	64,784

（注）時価の算定方法

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

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
 - 2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 - 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額	1.7269円	1.7782円
(1万口当たり純資産額)	(17,269円)	(17,782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30年2月26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 0.875 07/31/19	15,000,000.000	14,733,300.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,267,395.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	15,000,000.000	14,724,600.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,364,410.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,863,710.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,599,120.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,766,150.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,461,196.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	12,908,480.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,184,773.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,768,400.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,428,880.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,553,750.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	11,000,000.000	10,253,980.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,282,500.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,022,600.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	14,923,800.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,736,955.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,120,665.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,178,250.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	4,800,000.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,339,757.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,231,584.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,695,360.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	12,500,000.000	12,044,875.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,905,740.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,845,290.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,890,770.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,640,840.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	10,000,000.000	9,474,200.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	17,500,000.000	17,145,800.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,224,595.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,019,015.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,833,080.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	10,000,000.000	9,570,300.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,502,840.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,948,400.000			
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,218,000.000			
US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,527,990.000			
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,397,415.000			

US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,962,850.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,000,000.000	4,779,250.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,329,950.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,870,200.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,984,760.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,867,900.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	10,000,000.000	9,608,500.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,476,746.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,821,840.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	12,000,000.000	11,400,000.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,442,500.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,578,720.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,730,050.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,253,804.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,000,000.000	9,595,300.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	2,100,000.000	1,986,453.000	
US T N/B 2.25 12/31/23	2,500,000.000	2,437,875.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,000,000.000	5,754,360.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,694,855.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,300,581.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	5,500,000.000	4,840,385.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,385,150.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,877,600.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,855,148.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,932,480.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,617,810.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,042,840.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	12,000,000.000	12,078,240.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,413,160.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,617,104.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	6,100,000.000	5,616,758.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,032,800.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,173,390.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	4,700,000.000	4,480,040.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,641,966.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,160,376.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,200,000.000	5,040,308.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,222,284.600	
US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,858,950.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,900,000.000	6,685,410.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	4,960,107.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,786,042.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,800,972.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	3,600,000.000	3,591,828.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,152,750.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,167,760.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,580,220.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,801,404.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,200,000.000	5,409,612.000	

US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,078,560.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,387,542.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,367,920.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	17,000,000.000	17,448,120.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,691,400.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,425,000.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,103,500.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,200,000.000	4,553,682.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,212,020.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,900,000.000	5,421,360.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,364,621.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	1,929,512.500	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,374,520.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	900,000.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,412,800.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,418,580.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	1,999,768.800	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,417,500.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,341,912.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,713,250.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,800,000.000	3,486,644.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,286,000.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,030,184.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,219,840.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,824,135.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,896,150.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,220,606.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	3,926,496.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,784,888.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,878,450.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,182,570.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,169,040.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,347,640.000	
アメリカ・ドル 小計	846,210,000.000 (90,476,773,200)	837,912,364.900 (89,589,590,055)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,297,336.500	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,000,000.000	1,948,920.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,750,814.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,414,832.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,000,000.000	1,811,800.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,400,000.000	4,464,812.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,000,000.000	996,700.000	

UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,150,000.000	3,250,390.500	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	900,000.000	875,070.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,700,000.000	1,749,028.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,400,000.000	2,516,160.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,965,116.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,650,000.000	2,075,155.500	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,189,000.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,800,000.000	3,539,760.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,650,000.000	3,509,660.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,000,000.000	3,212,800.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,100,000.000	3,119,970.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,301,882.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,113,730.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	2,033,797.500	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,700,000.000	2,842,060.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,577,587.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,341,800.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,424,425.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,700,000.000	2,398,530.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,120,121.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,826,252.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,080,000.000	3,141,008.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,238,929.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,040,000.000	3,420,672.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	400,000.000	415,876.000	

	UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,350,000.000	3,238,770.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,200,000.000	3,307,700.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,850,000.000	2,000,072.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	2,289,560.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,800,000.000	2,680,020.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,535,287.300	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,941,435.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,091,357.000	
	イギリス・ポンド 小計	83,200,000.000 (12,430,912,000)	101,968,195.300 (15,235,068,060)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,800,000.000	3,999,082.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,600,000.000	2,692,248.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,114,400.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,379,384.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,150,000.000	1,140,455.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,400,000.000	2,283,840.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,135,247.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	845,379.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,520,985.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,881,092.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,669,328.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,144,175.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,221,210.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,206,950.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	889,650.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,500,000.000	1,605,225.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	3,998,088.000	

	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,757,295.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,168,008.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,447,300.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,000,000.000	4,575,520.000	
オーストラリア・ドル 小計		52,700,000.000 (4,414,679,000)	55,674,861.000 (4,663,883,106)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,478,510.000	
	CANADA 0.75 08/01/19	7,200,000.000	7,103,664.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,336,544.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	576,078.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	716,680.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	765,208.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,287,488.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,236,083.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,607,928.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,100,000.000	1,102,013.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	600,000.000	591,450.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,507,290.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,634,384.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,020,783.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,557,445.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	829,590.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,897,212.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	3,800,000.000	3,940,638.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,310,077.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,796,644.000	
CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,301,174.000		
CANADA 5.0 06/01/37	1,600,000.000	2,235,968.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,145,376.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,220,747.000		
カナダ・ドル 小計		50,650,000.000 (4,276,379,500)	54,198,974.000 (4,576,019,375)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	979,700.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	804,880.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	502,500.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	410,000.000	399,032.500	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	539,550.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	413,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	473,570.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	846,450.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,680,320.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,389,178.000	

	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	520,200.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	980,532.000	
シンガポール・ドル 小計		9,250,000.000 (748,880,000)	9,529,312.500 (771,493,140)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,218,540.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,427,306.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	10,300,000.000	11,832,537.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,423,630.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,864,850.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,800,000.000	9,262,000.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	13,146,373.800	
スウェーデン・クローナ 小計		66,280,000.000 (867,605,200)	75,175,236.800 (984,043,850)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	3,000,000.000	2,939,490.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,910,850.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	13,470,000.000	14,782,112.700	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,509,300.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	7,900,000.000	8,522,915.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	14,900,000.000	24,398,303.000	
デンマーク・クローネ 小計		57,770,000.000 (1,019,062,800)	71,062,970.700 (1,253,550,803)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,879,400.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	500,000.000	494,730.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,816,948.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,815,840.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,400,000.000	8,016,938.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	11,500,000.000	12,470,600.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	6,871,600.000	
ノルウェー・クローネ 小計		43,360,000.000 (590,563,200)	45,366,056.000 (617,885,683)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,994,480.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,174,700.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	3,976,800.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	3,977,190.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,300,000.000	2,147,579.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	2,500,000.000	2,562,200.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	4,700,000.000	4,737,271.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,295,765.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,511,340.200	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,863,774.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,763,582.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,647,360.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,137,056.000	
ポーランド・ズロチ 小計		43,900,000.000 (1,382,411,000)	45,789,097.600 (1,441,898,683)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,954,460.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,198,320.600	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,202,618.000	

	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,411,945.000	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,931,720.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,121,621.600	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	784,272.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,769,525.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,615,500.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,446,230.500	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,744,289.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,127,071.300	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,802,646.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,526,790.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,719,008.000	
マレーシア・リングgit 小計		33,430,000.000 (913,641,900)	33,356,017.600 (911,619,961)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,796,950.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	39,590,250.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	26,000,000.000	24,899,940.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,453,350.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,048,140.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,901,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,919,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,022,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	21,778,020.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,988,240.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,321,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,075,900.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,313,180.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	32,916,730.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,023,750.000	
	メキシコ・ペソ 小計		287,000,000.000 (1,653,120,000)	294,048,850.000 (1,693,721,376)
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	250,000.000	253,282.500	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,308,372.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	346,150.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,050,680.000	

AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	229,261.700	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	400,000.000	352,548.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,354,425.000	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,520,820.000	
AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,446,060.000	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	107,106.000	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,057,437.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,120,059.900	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,739,760.000	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,147,950.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,384,680.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,374,115.000	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,873,740.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	2,456,850.000	
AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,050,000.000	1,104,243.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,300,000.000	1,745,601.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,730,359.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	149,760.000	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,039,300.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,098,438.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,538,610.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,274,637.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	150,000.000	150,126.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	879,705.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	950,000.000	1,020,613.500	
BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	744,520.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,891,420.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	2,964,442.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,062,075.000	
BELGIUM 3.0 09/28/19	1,300,000.000	1,372,852.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,663,552.100	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,435,928.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,050,000.000	1,102,174.500	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,800,000.000	2,103,840.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,305,461.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,000,000.000	3,077,000.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,494,516.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,332,083.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,572,636.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,500,000.000	3,928,475.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,700,000.000	3,928,851.000	
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,528,605.000	
BUNDESOBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,141,509.000	
BUNDESOBL 04/08/22	3,000,000.000	3,021,000.000	
BUNDESOBL 04/09/21	2,200,000.000	2,225,740.000	
BUNDESSCHAT 03/15/19	2,600,000.000	2,618,538.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,500,000.000	3,411,870.000	

DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,700,000.000	2,737,773.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,200,000.000	3,220,512.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,700,000.000	1,684,411.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,688,028.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,728,544.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,352,192.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,259,390.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,692,125.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,161,040.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,649,662.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,641,765.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,400,000.000	2,600,112.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	4,400,000.000	4,778,840.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,657,575.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,491,900.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,100,000.000	3,378,070.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,385,240.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,452,355.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,489,291.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,250,200.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,858,876.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,529,890.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,850,000.000	2,646,647.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	4,400,000.000	4,648,160.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,800,000.000	4,204,900.000	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,642,769.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	2,000,709.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,400,000.000	3,767,160.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,000,000.000	3,420,480.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,050,000.000	3,220,980.500	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,364,896.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,304,690.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,786,961.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,750,000.000	2,696,680.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	509,405.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	595,446.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	434,344.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	307,893.000	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	227,366.500	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,150,000.000	1,230,327.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	429,596.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	749,536.800	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	846,073.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	752,182.200	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,059,919.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	782,348.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,002,864.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	620,000.000	661,620.600	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,433,312.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,880,630.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,702,405.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,175,558.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	508,955.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	1,500,000.000	1,473,735.000	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,002,700.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,733,694.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,000,000.000	4,073,320.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	3,821,027.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,900,000.000	2,806,040.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,200,000.000	4,373,964.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,767,268.000	

FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,186,812.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,249,356.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,901,175.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,474,480.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,000,000.000	4,411,400.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,532,970.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	8,700,000.000	9,363,114.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,716,800.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,976,386.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,000,000.000	4,037,880.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,850,156.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,009,733.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,840,000.000	5,960,944.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	6,300,000.000	7,102,053.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,074,342.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,811,920.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,940,000.000	3,158,843.800	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,200,000.000	4,658,784.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	2,000,000.000	2,112,840.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,900,000.000	7,245,613.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,900,000.000	6,162,819.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,749,169.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,408,132.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,800,000.000	6,140,002.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,097,584.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	4,835,754.000	
IRISH 0.8 03/15/22	1,150,000.000	1,187,513.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,350,000.000	1,368,036.000	
IRISH 1.7 05/15/37	750,000.000	757,417.500	
IRISH 2.0 02/18/45	890,000.000	925,190.600	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,240,063.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,095,279.600	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	829,969.000	
IRISH 4.4 06/18/19	480,000.000	511,156.800	
IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,250,333.700	
IRISH 5.0 10/18/20	1,000,000.000	1,143,420.000	

IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,671,982.200	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,050,985.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,694,339.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,044,791.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,649,680.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,497,750.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,041,780.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,895,080.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,568,100.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,542,945.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,480,525.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,471,350.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,800,000.000	2,531,956.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	600,000.000	618,360.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,750,490.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,300,000.000	1,300,052.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,334,640.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,800,000.000	2,844,520.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,397,400.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,078,319.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,260,120.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,541,430.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,400,000.000	1,250,900.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	2,082,240.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	250,000.000	265,597.500	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	3,287,716.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,647,985.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,549,320.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,565,440.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,175,766.000	

ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,500,000.000	4,141,900.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	4,060,750.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,998,820.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	6,831,936.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,899,150.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	5,100,000.000	5,349,135.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,388,052.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,493,340.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,647,114.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,270,500.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,487,730.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,971,200.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,050,000.000	2,678,530.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,400,000.000	5,165,160.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,951,280.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,677,520.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	3,992,100.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,750,000.000	3,664,925.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,500,000.000	4,549,650.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,715,490.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,032,900.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	3,341,760.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,700,000.000	5,173,710.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,588,980.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,573,280.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,717,950.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,183,561.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,674,721.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,900,000.000	1,883,850.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,456,322.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,911,932.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,175,560.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,215,620.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,709,774.000	

NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,095,064.400	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,540,000.000	2,070,961.200	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,060,000.000	2,327,594.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,829,401.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,700,000.000	2,011,100.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,800,000.000	2,744,946.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,539,120.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,200,000.000	1,277,268.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,328,640.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	400,236.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,206,248.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,738,114.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,163,231.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,600,000.000	2,595,398.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	400,000.000	412,240.000	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,400,000.000	1,393,616.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,600,000.000	2,616,640.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,607,525.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	2,500,000.000	2,636,800.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,740,068.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,795,936.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,000,000.000	1,033,000.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	1,400,000.000	1,451,184.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	3,027,483.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	1,902,762.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	950,000.000	1,079,694.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	2,700,000.000	3,188,673.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,359,720.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,380,000.000	3,106,399.800	
SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,523,106.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,780,746.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	4,100,000.000	4,388,435.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,273,348.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,958,060.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,721,972.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,280,654.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,870,000.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	2,100,000.000	2,821,350.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,253,240.000	
SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,469,732.000	

	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,219,704.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,561,624.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,700,000.000	3,292,812.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,426,175.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,314,540.000	
ユーロ 小計		580,280,000.000 (76,242,989,200)	673,553,896.500 (88,498,246,461)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	28,859,250.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	11,342,814.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	9,001,927.200	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	10,160,000.000	10,105,644.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	10,187,120.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	10,137,800.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,661,638.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,674,600.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	10,547,569.800	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,789,600.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	16,682,100.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	3,020,340.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	8,060,560.000	
南アフリカ・ランド 小計		155,240,000.000 (1,435,970,000)	150,070,963.000 (1,388,156,408)	
国債証券 合計		196,452,987,000 (196,452,987,000)	211,625,176,962 (211,625,176,962)	
合計		196,452,987,000 (196,452,987,000)	211,625,176,962 (211,625,176,962)	

(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 122銘柄	41.47%	42.33%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	7.05%	7.20%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	2.16%	2.20%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	2.12%	2.16%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.36%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.46%	0.46%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.58%	0.59%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.29%	0.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.67%	0.68%
マレーシア・リングギット	国債証券 15銘柄	0.42%	0.43%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.78%	0.80%
ユーロ	国債証券 257銘柄	40.96%	41.82%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.64%	0.66%

(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。

DIAM DC バランス30インデックスファンド

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間(平成30年2月27日から平成30年8月26日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【DIAM DC バランス30インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	151,104,450	139,356,594
親投資信託受益証券	4,315,539,264	4,360,511,724
未収入金	-	161,000
流動資産合計	4,466,643,714	4,500,029,318
資産合計	4,466,643,714	4,500,029,318
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,351,017	269,533
未払受託者報酬	733,222	712,628
未払委託者報酬	5,132,776	4,988,717
その他未払費用	109,891	94,939
流動負債合計	18,326,906	6,065,817
負債合計	18,326,906	6,065,817
純資産の部		
元本等		
元本	1,328,163,695	1,331,151,925
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,162,153,113	1,178,811,576
(分配準備積立金)	913,935,328	880,649,983
元本等合計	4,448,316,808	4,493,963,501
純資産合計	4,448,316,808	4,493,963,501
負債純資産合計	4,466,643,714	4,500,029,318

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期中間計算期間 自 平成29年2月28日 至 平成29年8月27日	第12期中間計算期間 自 平成30年2月27日 至 平成30年8月26日
営業収益		
受取利息	72	-
有価証券売買等損益	102,609,399	12,055,460
営業収益合計	102,609,471	12,055,460
営業費用		
支払利息	52,661	56,932
受託者報酬	681,128	712,628
委託者報酬	4,768,119	4,988,717
その他費用	102,084	95,062
営業費用合計	5,603,992	5,853,339
営業利益又は営業損失()	97,005,479	6,202,121
経常利益又は経常損失()	97,005,479	6,202,121
中間純利益又は中間純損失()	97,005,479	6,202,121
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,953,104	46,127
期首剰余金又は期首欠損金()	928,535,117	1,162,153,113
剰余金増加額又は欠損金減少額	48,139,556	53,773,374
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	48,139,556	53,773,374
剰余金減少額又は欠損金増加額	29,917,850	43,363,159
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	29,917,850	43,363,159
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,041,809,198	1,178,811,576

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年2月26日、当中間計算期間末日を平成30年8月26日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26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	3,262,471,331円 334,079,343円 310,386,979円	3,286,163,695円 151,614,315円 122,626,085円
2. 受益権の総数	3,286,163,695口	3,315,151,925口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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)

該当事項はありません。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額	1,3537円	1,3556円
(1万口当たり純資産額)	(13,537円)	(13,556円)

DIAM DC バランス50インデックスファンド

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間(平成30年2月27日から平成30年8月26日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間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) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	271,705,995	272,524,845
親投資信託受益証券	8,294,702,286	8,373,452,683
未収入金	3,399,000	151,000
流動資産合計	8,569,807,281	8,646,128,528
資産合計	8,569,807,281	8,646,128,528
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,415,129	3,355,303
未払受託者報酬	1,409,261	1,364,978
未払委託者報酬	11,274,429	10,920,133
その他未払費用	211,302	181,906
流動負債合計	22,310,121	15,822,320
負債合計	22,310,121	15,822,320
純資産の部		
元本等		
元本	16,158,845,818	16,209,121,346
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,388,651,342	2,421,184,862
(分配準備積立金)	2,308,810,975	2,246,830,756
元本等合計	8,547,497,160	8,630,306,208
純資産合計	8,547,497,160	8,630,306,208
負債純資産合計	8,569,807,281	8,646,128,528

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期中間計算期間 自 平成29年2月28日 至 平成29年8月27日	第12期中間計算期間 自 平成30年2月27日 至 平成30年8月26日
営業収益		
受取利息	135	-
有価証券売買等損益	273,687,636	25,086,397
営業収益合計	273,687,771	25,086,397
営業費用		
支払利息	99,113	108,257
受託者報酬	1,279,858	1,364,978
委託者報酬	10,239,243	10,920,133
その他費用	191,886	182,140
営業費用合計	11,810,100	12,575,508
営業利益又は営業損失()	261,877,671	12,510,889
経常利益又は経常損失()	261,877,671	12,510,889
中間純利益又は中間純損失()	261,877,671	12,510,889
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	6,637,953	18,616
期首剰余金又は期首欠損金()	1,702,250,394	2,388,651,342
剰余金増加額又は欠損金減少額	78,985,702	85,220,938
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	78,985,702	85,220,938
剰余金減少額又は欠損金増加額	54,854,891	65,216,923
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	54,854,891	65,216,923
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,981,620,923	2,421,184,862

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年2月26日、当中間計算期間末日を平成30年8月26日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26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	6,132,368,284円 505,249,804円 478,772,270円	6,158,845,818円 218,438,558円 168,163,030円
2. 受益権の総数	6,158,845,818口	6,209,121,346口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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)

該当事項はありません。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額	1,3878円	1,3899円
(1万口当たり純資産額)	(13,878円)	(13,899円)

DIAM DC バランス70インデックスファンド

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間(平成30年2月27日から平成30年8月26日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間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) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	183,138,674	181,612,920
親投資信託受益証券	5,486,023,427	5,548,504,491
流動資産合計	5,669,162,101	5,730,117,411
資産合計	5,669,162,101	5,730,117,411
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,973,550	2,129,307
未払受託者報酬	921,759	901,940
未払委託者報酬	8,296,232	8,117,888
その他未払費用	138,182	120,183
流動負債合計	14,329,723	11,269,318
負債合計	14,329,723	11,269,318
純資産の部		
元本等		
元本	14,057,940,642	14,096,061,117
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,596,891,736	1,622,786,976
(分配準備積立金)	1,649,139,440	1,591,842,115
元本等合計	5,654,832,378	5,718,848,093
純資産合計	5,654,832,378	5,718,848,093
負債純資産合計	5,669,162,101	5,730,117,411

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期中間計算期間 自 平成29年2月28日 至 平成29年8月27日	第12期中間計算期間 自 平成30年2月27日 至 平成30年8月26日
営業収益		
受取利息	87	-
有価証券売買等損益	224,181,326	19,660,064
営業収益合計	224,181,413	19,660,064
営業費用		
支払利息	63,474	72,137
受託者報酬	812,439	901,940
委託者報酬	7,312,369	8,117,888
その他費用	121,782	120,337
営業費用合計	8,310,064	9,212,302
営業利益又は営業損失()	215,871,349	10,447,762
経常利益又は経常損失()	215,871,349	10,447,762
中間純利益又は中間純損失()	215,871,349	10,447,762
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	6,546,686	736,198
期首剰余金又は期首欠損金()	974,310,130	1,596,891,736
剰余金増加額又は欠損金減少額	63,746,813	71,306,870
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	63,746,813	71,306,870
剰余金減少額又は欠損金増加額	45,444,290	56,595,590
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	45,444,290	56,595,590
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,201,937,316	1,622,786,976

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年2月26日、当中間計算期間末日を平成30年8月26日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26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	3,969,283,136円 477,082,367円 388,424,861円	4,057,940,642円 181,987,330円 143,866,855円
2. 受益権の総数	4,057,940,642口	4,096,061,117口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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)

該当事項はありません。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 平成30年2月26日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額	1,3935円	1,3962円
(1万口当たり純資産額)	(13,935円)	(13,962円)

(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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,427,951,479	11,081,834,197
株式	2	287,790,562,310	283,135,291,680
派生商品評価勘定		55,293,624	70,464,840
未収配当金		501,353,866	383,094,829
前払金		66,515,000	113,430,000
流動資産合計		292,841,676,279	294,784,115,546
資産合計		292,841,676,279	294,784,115,546
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		68,935,500	101,982,708
未払解約金		17,609,000	291,288,000
流動負債合計		86,544,500	393,270,708
負債合計		86,544,500	393,270,708
純資産の部			
元本等			
元本	1	109,160,728,872	112,713,729,794
剰余金			
剰余金又は欠損金()		183,594,402,907	181,677,115,044
元本等合計		292,755,131,779	294,390,844,838
純資産合計		292,755,131,779	294,390,844,838
負債純資産合計		292,841,676,279	294,784,115,546

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	125,576,804,116円	109,160,728,872円
同期中追加設定元本額	22,269,571,713円	16,399,294,119円
同期中一部解約元本額	38,685,646,957円	12,846,293,197円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	9,036,126,148円	10,765,494,305円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,870,405,653円	2,103,228,103円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,013,213円	3,107,491円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,146,230円	7,056,639円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,684,426円	11,646,115円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	20,360,996円	21,242,305円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	15,401,869円	17,681,919円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,840,415円	14,559,920円
たわらノーロード TOPIX	149,657,723円	259,034,363円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	14,607,726円	48,496,762円
たわらノーロード バランス（堅実型）	153,495円	1,164,826円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,393,312円	8,195,189円

たわらノーロード バランス (積極型)	4,683,156円	22,467,607円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	14,974円	103,038円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	237,595円	4,618,991円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	811,003円	13,908,748円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	550,423円	11,372,822円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	1,175,545円	27,452,407円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	41,547円	39,297円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	37,941円	62,022円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	338,731円	525,021円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	364,996円	516,621円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	978,271円	1,503,679円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	36,793,469,763円	37,599,643,704円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	765,964,168円	826,015,634円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,673,224,321円	2,829,930,215円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,791,900,084円	2,969,870,571円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	329,271,189円	340,043,581円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,119,268,669円	1,137,903,112円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,054,683,588円	1,077,371,976円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	46,713,000円	42,726,996円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,161,767,467円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	24,024,004円	25,558,900円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	39,477,748円	270,331,358円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	97,811,246円	167,203,982円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	189,483,338円	298,842,348円
投資のソムリエ	1,008,877,316円	3,733,168,917円
クルーズコントロール	201,841,066円	553,189,076円
投資のソムリエ< D C年金>	69,455,867円	320,084,595円

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	147,946,865円	181,234,136円
DIAM DC バランス・F (成長型)	205,022,193円	238,317,143円
クルーズコントロール<DC年金>	74,862円	284,731円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,239,139円	4,631,357円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	3,802,586円	13,361,782円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	22,937,313円	75,739,501円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	726,871円	1,352,404円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	355,728,259円	1,429,060,856円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	668,403円	926,042円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	513,926円	612,380円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	108,503円	405,176円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	1,237,938円	1,339,795円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	12,005,064円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	224,601,077円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	-円	18,666円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	70,701,371円	66,349,091円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	-円	55,599,022円
DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	132,883,832円	121,450,190円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	292,283,119円	283,810,695円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	16,233,373円	15,658,176円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	70,408,344円	64,258,293円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	17,521,498円	16,556,137円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	21,833,378円	16,604,468円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	31,638,558円	30,147,733円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	56,259,704円	53,104,673円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,071,953,946円	1,021,470,527円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,013,017,452円	964,117,312円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,782,258,327円	2,687,967,000円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	201,418,412円	195,753,274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)	96,974,567円	57,961,714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)	591,732,801円	556,308,883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)	1,652,857,363円	639,831,487円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド (適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	36,951,217円	7,990,925円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,108,127,625円	131,575,177円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	15,040,555,136円	12,470,167,745円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	541,254,717円	489,095,827円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	1,724,496,050円	1,712,184,865円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	9,829,818,156円	9,814,477,692円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	519,843円	3,168,817円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	9,093,798円	3,009,532円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	3,718,064円	3,771,978円

	D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	8,747,496,476円	8,747,585,084円
	D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	70,015,367円	67,982,651円
	D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	27,507,643円	27,670,484円
	D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	18,240,489円	25,126,872円
	D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	15,682,249円	99,008円
	D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	109,957円	112,661円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	426,902,115円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,323,021,834円	1,311,785,878円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,764,382,103円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	76,281,237円	72,414,656円
	計	109,160,728,872円	112,713,729,794円
2 .	受益権の総数	109,160,728,872口	112,713,729,794口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,661,500,000円	株式 3,415,000,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成30年2月26日 現在				平成30年8月26日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,334,250,000	-	5,320,705,000	13,545,000	11,269,290,000	-	11,237,985,000	31,305,000
合計	5,334,250,000	-	5,320,705,000	13,545,000	11,269,290,000	-	11,237,985,000	31,305,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額	2.6819円	2.6118円
(1万口当たり純資産額)	(26,819円)	(26,118円)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,759,043,801	1,769,582,559
国債証券		295,128,432,800	283,531,791,400
地方債証券		22,904,593,464	22,213,166,415
特殊債券		15,762,062,689	17,025,077,508
社債券		16,876,083,640	15,052,623,720
未収入金		3,043,919,000	1,350,143,700
未収利息		1,052,224,327	938,191,486
前払費用		11,392,773	45,587,534
流動資産合計		356,537,752,494	341,926,164,322
資産合計		356,537,752,494	341,926,164,322
負債の部			
流動負債			
未払解約金		3,707,675,000	680,456,000
流動負債合計		3,707,675,000	680,456,000
負債合計		3,707,675,000	680,456,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	274,056,741,701	265,801,745,002
剰余金			
剰余金又は欠損金()		78,773,335,793	75,443,963,320
元本等合計		352,830,077,494	341,245,708,322
純資産合計		352,830,077,494	341,245,708,322
負債純資産合計		356,537,752,494	341,926,164,322

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26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	295,190,206,036円 61,855,153,624円 82,988,617,959円	274,056,741,701円 47,635,239,089円 55,890,235,788円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	14,134,325,523円	16,509,709,845円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	133,630,997円	115,144,060円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	110,362,927円	94,261,015円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	35,282,821円	27,467,152円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	683,723,247円	787,011,069円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	186,801,804円	236,327,754円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,093,209円	34,379,730円
たわらノーロード 国内債券	3,053,849,271円	4,398,088,575円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	28,763,462円	94,038,522円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,797,390円	20,800,822円
たわらノーロード バランス（標準型）	6,736,262円	38,914,907円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,846,591円	8,710,746円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	427,592円	2,816,059円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	2,978,010円	56,314,841円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	4,270,909円	66,795,910円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	1,180,680円	18,697,198円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	401,500円	9,501,392円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	1,023,651円	1,176,551円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	371,890円	548,776円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,490,812円	2,384,892円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	457,571円	618,961円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	61,604円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,519,073,028円	12,774,208,291円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,538,860,716円	5,766,313,017円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	8,094,578,747円	8,363,942,965円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,297,220,345円	3,367,362,272円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,822,404,385円	1,821,729,032円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	2,021,440,802円	2,018,598,534円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	317,189,866円	312,782,929円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	88,286,247円	91,445,749円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,216,731,348円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,224,336円	2,359,537円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国1 0)	474,201,213円	3,123,603,503円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国2 0)	434,763,343円	714,797,157円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国3 0)	99,374,518円	154,352,179円
投資のソムリエ	3,477,837,094円	7,845,796,116円
クルーズコントロール	444,343,713円	1,099,977,204円
投資のソムリエ< D C年金>	239,353,124円	677,064,863円
D I A M 8 資産 バランスファ ンドN< D C年金>	1,836,523,487円	2,154,893,017円
D I A M D C バランス・F (成長型)	232,011,746円	266,330,235円
クルーズコントロール< D C年 金>	165,091円	567,014円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,123,528円	3,651,342円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	3,353,398円	10,629,737円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	479,665,477円	478,364,215円
ダイナミック・ナビゲーション	187,857円	506,835円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,432,216,368円	8,912,388,595円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	627,520円	1,609,206円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	487,386円	1,072,314円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,441,185円	2,543,831円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,160,053円	1,815,598円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	63,046,896円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	189,645,802円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	290,676円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	-円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	22,730,596,257円	22,717,118,849円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	496,308,197円	455,162,625円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	341,395,897円	302,746,387円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	250,881,142円	235,640,644円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	79,938,561円	75,915,475円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	223,396,523円	200,702,999円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	92,500,119円	86,056,017円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,711,189円	45,988,258円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	100,150,915円	93,942,151円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	178,394,585円	165,598,275円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,083,808,272円	5,683,391,571円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	3,221,440,007円	3,004,319,509円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	5,882,071,810円	5,583,026,340円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	647,151,905円	610,886,850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)	512,238,067円	302,213,535円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	3,765,931,500円	3,474,467,407円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	3,503,037,017円	1,329,306,025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)	194,752,933円	194,752,933円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	229,020,962円	49,834,475円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	1,835,245,523円	211,867,260円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	85,219,076,699円	69,092,938,468円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	1,149,665,356円	1,015,816,629円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	7,349,516,600円	7,115,433,846円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	28,046,381,699円	27,182,725,864円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	8,994,522円	53,264,492円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	49,160,062円	15,718,576円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	8,006,452円	7,833,813円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	31,135,137,178円	30,290,314,374円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	497,599,388円	466,616,785円
D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	137,417,719円	134,082,420円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	395,041,757円	522,909,535円

	D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	118,842,206円	722,683円
	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	393,617円	390,551円
	計	274,056,741,701円	265,801,745,002円
2.	受益権の総数	274,056,741,701口	265,801,745,002口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26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）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額	1,2874円	1,2838円
(1万口当たり純資産額)	(12,874円)	(12,838円)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,233,816,584	2,028,184,196
コール・ローン		174,163,954	238,332,778
株式		276,085,959,059	304,402,618,910
投資信託受益証券		727,049,262	737,875,167
投資証券		5,736,905,378	6,750,285,444
派生商品評価勘定		94,011,486	54,481,524
未収入金		3,784,281	1,344,200
未収配当金		478,226,822	587,248,437
差入委託証拠金		1,981,931,156	2,768,118,599
流動資産合計		290,515,847,982	317,568,489,255
資産合計		290,515,847,982	317,568,489,255
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		96,094,864	12,652,275
未払解約金		13,251,000	488,710,000
流動負債合計		109,345,864	501,362,275
負債合計		109,345,864	501,362,275
純資産の部			
元本等			
元本	1	85,879,794,434	87,836,885,848
剰余金			
剰余金又は欠損金()		204,526,707,684	229,230,241,132
元本等合計		290,406,502,118	317,067,126,980
純資産合計		290,406,502,118	317,067,126,980
負債純資産合計		290,515,847,982	317,568,489,255

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26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	91,611,980,480円	85,879,794,434円
同期中追加設定元本額	20,138,120,617円	13,731,388,745円
同期中一部解約元本額	25,870,306,663円	11,774,297,331円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,845,103,642円	2,219,830,085円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,104,022円	2,336,609円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	7,162,575円	7,296,374円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	19,381,505円	13,522,491円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	15,872,931円	15,969,881円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	12,125,945円	18,282,142円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,759,108円	16,861,831円
たわらノーロード 先進国株式	5,915,663,164円	7,357,214,701円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,744円	424,170円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	540,654,638円	845,295,303円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	11,463,145円	35,142,886円
たわらノーロード バランス (堅実型)	346,989円	2,467,990円
たわらノーロード バランス (標準型)	4,082,551円	22,266,022円
たわらノーロード バランス (積極型)	10,904,902円	49,114,034円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	14,227円	113,320円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	588,618円	10,640,376円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	1,820,571円	29,590,055円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	1,168,664円	21,501,710円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	2,375,189円	52,848,569円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	6,182円	14,657円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	35,270円	54,160円

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	325,553円	539,785円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	349,076円	534,911円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,079,503円	1,720,718円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	37,329,263,860円	39,093,061,099円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	155,272,827円	157,934,366円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	854,160,900円	844,713,859円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,042,632,432円	1,063,353,454円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	128,651,065円	125,933,936円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	385,326,790円	368,798,945円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	332,068,806円	325,611,636円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	32,623,606円	31,471,673円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	811,105,505円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	186,981,108円	207,736,689円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	31,116,597円	197,173,243円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	76,880,278円	123,203,307円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	149,320,860円	219,697,514円
投資のソムリエ	525,467,955円	601,661,539円
クルーズコントロール	81,781,664円	199,752,269円
投資のソムリエ<DC年金>	36,100,432円	51,742,082円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	116,625,994円	135,881,702円
DIAM DC バランス・F(成長型)	76,361,478円	83,183,962円
クルーズコントロール<DC年金>	30,467円	103,020円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	402,135円	1,318,564円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	1,245,127円	3,879,936円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	18,021,302円	39,216,469円
ダイナミック・ナビゲーション	395,905円	1,462,343円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	279,057,463円	740,579,897円
ワールドアセットバランス(基本コース)	621,453,988円	673,654,585円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,329,368,925円	2,544,034,446円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	765,901円	1,070,129円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	590,045円	712,337円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	86,101円	209,708円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,328,385円	1,458,362円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	4,349,695円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	120,108,970円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	13,989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)	94,665,820円	91,706,011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)	2,918,652,247円	2,873,943,255円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	161,164,985円	158,382,887円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	208,761,652円	206,261,351円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	23,652,082円	21,290,066円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	103,714,081円	91,029,251円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	228,512,241円	212,722,371円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,671,338円	11,736,080円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	82,511,736円	72,274,879円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,831,650円	6,199,154円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,417,217円	8,295,438円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	24,714,283円	22,596,166円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	65,916,546円	59,719,480円

D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	557,553,761円	510,427,759円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	691,799,410円	632,269,267円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,171,548,593円	2,014,686,740円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	786,997,339円	733,673,656円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	225,669,532円	130,996,877円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	924,836,705円	835,413,387円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	430,329,218円	159,943,333円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	128,701,947円	26,800,521円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	349,183,417円	38,157,282円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	7,824,134,623円	6,231,333,074円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	422,676,347円	366,651,102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)	1,345,791,625円	1,283,322,385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)	5,115,080,431円	4,903,329,936円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	2,032,372円	11,898,559円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	28,378,177円	9,050,979円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	10,651,080円	10,400,016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)	6,827,085,597円	6,556,587,283円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	42,301,326円	56,855,133円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	36,544,094円	223,830円

	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	257,372円	254,361円
計		85,879,794,434円	87,836,885,848円
2.	受益権の総数	85,879,794,434口	87,836,885,848口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年2月26日 現在				平成30年8月26日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	42,579,342	-	42,579,000	342	700,759,373	-	702,302,670	1,543,297
アメリカ・ドル	-	-	-	-	512,111,774	-	513,476,880	1,365,106
イギリス・ポ ンド	42,579,342	-	42,579,000	342	25,986,669	-	25,985,960	709
オーストラリ ア・ドル	-	-	-	-	25,247,688	-	25,225,200	22,488
カナダ・ドル	-	-	-	-	25,106,910	-	25,113,350	6,440
ユーロ	-	-	-	-	112,306,332	-	112,501,280	194,948
買 建	328,600,107	-	328,448,150	151,957	-	-	-	-
アメリカ・ドル	240,630,998	-	240,535,060	95,938	-	-	-	-
イギリス・ポ ンド	7,468,550	-	7,470,000	1,450	-	-	-	-
カナダ・ドル	9,609,349	-	9,623,880	14,531	-	-	-	-
ユーロ	70,891,210	-	70,819,210	72,000	-	-	-	-
合計	371,179,449	-	371,027,150	151,615	700,759,373	-	702,302,670	1,543,297

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成30年2月26日 現在				平成30年8月26日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,903,918,528	-	7,901,986,765	1,931,763	4,577,456,533	-	4,620,829,079	43,372,546
合計	7,903,918,528	-	7,901,986,765	1,931,763	4,577,456,533	-	4,620,829,079	43,372,546

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額	3.3815円	3.6097円
(1万口当たり純資産額)	(33,815円)	(36,097円)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,427,443,670	2,636,105,342
コール・ローン		409,777,133	486,788,158
国債証券		211,625,176,962	200,965,542,401
派生商品評価勘定		189,709	18,792
未収入金		-	1,441,325,394
未収利息		1,890,523,698	1,568,745,359
前払費用		30,377,614	24,403,639
流動資産合計		216,383,488,786	207,122,929,085
資産合計		216,383,488,786	207,122,929,085
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		124,925	-
未払解約金		343,581,000	335,921,000
流動負債合計		343,705,925	335,921,000
負債合計		343,705,925	335,921,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	121,490,410,134	114,462,156,951
剰余金			
剰余金又は欠損金()		94,549,372,727	92,324,851,134
元本等合計		216,039,782,861	206,787,008,085
純資産合計		216,039,782,861	206,787,008,085
負債純資産合計		216,383,488,786	207,122,929,085

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30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	143,480,057,319円	121,490,410,134円
同期中追加設定元本額	24,072,066,564円	16,014,746,708円
同期中一部解約元本額	46,061,713,749円	23,042,999,891円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,178,188,221円	7,514,771,551円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	16,550,949円	12,270,314円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	43,087,731円	34,513,072円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	50,607,050円	40,194,854円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	84,738,289円	83,471,687円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	73,029,025円	86,584,078円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	35,964,363円	50,269,036円
たわらノーロード 先進国債券	1,550,612,754円	2,321,707,510円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	21,598,989円	70,203,069円
たわらノーロード バランス（堅実型）	170,191円	1,265,983円

たわらノーロード バランス (標準型)	1,177,165円	6,785,461円
たわらノーロード バランス (積極型)	532,097円	2,503,965円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	28,212円	153,154円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	563,219円	12,295,496円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	751,296円	17,977,713円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	147,764円	5,618,618円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	2,703,070円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	57,145円	107,329円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	343,053円	776,467円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	193,352円	410,614円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	262,467円	654,174円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	5,032,915,649円	5,103,020,045円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	474,597,820円	506,635,287円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,526,634,357円	1,658,947,568円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,682,020,108円	1,750,297,361円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	366,252,324円	375,880,904円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	780,311,672円	818,524,847円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	633,352,049円	640,824,377円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	23,441,361円	23,582,221円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	585,178,050円	599,670,192円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,898,943円	9,563,624円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	17,867,916円	116,556,212円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	39,193,230円	65,609,092円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	71,081,407円	108,940,806円
クルーズコントロール	471,522,151円	1,176,430,807円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	67,264,964円	79,382,168円

D I A M D C バランス・F (成長型)	121,175,646円	140,180,554円
クルーズコントロール<DC年金>	175,031円	605,716円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,547,650円	5,233,641円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	4,761,061円	15,199,986円
ダイナミック・ナビゲーション	135,460円	362,192円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	13,033,689円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	11,075円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,427,367,462円	1,343,048,507円
D I A M為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド(適 格機関投資家向け)	6,984,591,409円	6,905,362,322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)	4,074,076,473円	4,034,028,935円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	3,765,907,771円	3,317,960,151円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	576,382,992円	6,089,139,432円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	107,448,126円	98,447,200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)	968,520,974円	865,553,058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)	708,041,760円	673,936,192円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	57,495,581円	54,234,282円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	107,057,634円	95,349,652円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	26,555,966円	24,565,759円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	10,750,815円	8,207,078円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	72,188,716円	67,112,843円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	85,457,559円	78,798,617円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,796,951,947円	3,542,245,525円

D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	2,498,788,864円	2,325,205,914円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,222,249,727円	3,988,538,303円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	766,253,872円	728,225,171円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	515,526,816円	302,506,981円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	3,592,931,221円	3,306,642,102円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	8,998,213,463円	3,455,343,587円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	82,547,070円	17,793,458円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	2,967,288,873円	342,809,371円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	15,212,015,467円	12,335,191,066円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	19,892,468,598円	19,419,236,137円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	2,361,904円	14,183,366円
D I A Mバランス50VA(適 格機関投資家限定)	34,508,457円	11,197,861円
D I A Mバランス70VA(適 格機関投資家限定)	5,621,656円	5,596,870円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資 家限定)	17,700,778,938円	17,309,780,028円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	107,612,203円	100,875,970円
D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	83,137,353円	112,194,198円
D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	59,633,095円	368,536円
D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	165,250円	166,959円
計	121,490,410,134円	114,462,156,951円
2. 受益権の総数	121,490,410,134口	114,462,156,951口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年2月26日 現在				平成30年8月26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	326,384,024	-	326,319,240	64,784	407,380,000	-	407,361,208	18,792
アメリカ・ドル	112,189,343	-	112,143,010	46,333	-	-	-	-
イギリス・ポ ンド	23,904,192	-	23,904,000	192	363,210,000	-	363,200,078	9,922
シンガポール・ ドル	-	-	-	-	21,280,000	-	21,279,999	1
マレーシア・リ ンギット	35,800,875	-	35,925,800	124,925	-	-	-	-
ユーロ	130,597,950	-	130,470,270	127,680	-	-	-	-
南アフリカ・ラ ンド	23,891,664	-	23,876,160	15,504	22,890,000	-	22,881,131	8,869
合計	326,384,024	-	326,319,240	64,784	407,380,000	-	407,361,208	18,792

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額	1.7782円	1.8066円
(1万口当たり純資産額)	(17,782円)	(18,066円)

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30年8月31日現在

資産総額	4,518,301,524円
負債総額	3,335,971円
純資産総額（ - ）	4,514,965,553円
発行済数量	3,318,181,286口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3607円

DIAM DC バランス50インデックスファンド

平成30年8月31日現在

資産総額	8,703,074,931円
負債総額	3,368,508円
純資産総額（ - ）	8,699,706,423円
発行済数量	6,217,228,340口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3993円

DIAM DC バランス70インデックスファンド

平成30年8月31日現在

資産総額	5,793,930,753円
負債総額	4,093,031円
純資産総額（ - ）	5,789,837,722円
発行済数量	4,107,030,971口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4097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30年8月31日現在

資産総額	300,485,016,869円
負債総額	628,486,156円
純資産総額（ - ）	299,856,530,713円
発行済数量	113,057,134,012口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6523円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

資産総額	341,681,622,693円
負債総額	586,784,000円
純資産総額（ - ）	341,094,838,693円
発行済数量	265,837,230,349口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2831円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

資産総額	321,309,266,363円
負債総額	918,700,422円
純資産総額(-)	320,390,565,941円
発行済数量	87,735,064,879口
1口当たり純資産額(/)	3.6518円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

資産総額	207,009,561,575円
負債総額	417,922,000円
純資産総額(-)	206,591,639,575円
発行済数量	114,473,190,657口
1口当たり純資産額(/)	1.8047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（2018年8月31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（2018年8月31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。

2018年8月31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	1,207,316,840,603
追加型株式投資信託	853	13,043,312,848,128
単位型公社債投資信託	48	194,109,113,884
単位型株式投資信託	146	978,340,252,718
合計	1,085	15,423,079,055,333

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038
未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911
役員賞与引当金	27,495	49,986
本社移転費用引当金	-	156,587
流動負債計	17,211,706	22,211,034
固定負債		
退職給付引当金	1,305,273	1,637,133
時効後支払損引当金	216,466	199,026
本社移転費用引当金	942,315	-
固定負債計	2,464,055	1,836,160
負債合計	19,675,761	24,047,195
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	31,899,643	44,349,855
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	31,776,350	44,226,562
別途積立金	24,580,000	24,580,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	6,696,350	19,146,562
株主資本計	53,452,601	65,902,812
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,864	795,002
評価・換算差額等計	517,864	795,002
純資産合計	53,970,465	66,697,815
負債・純資産合計	73,646,227	90,745,010

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>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。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,000	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式					

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21日
	A種種類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っているデリバティブ取引は後述するリスクを低減する目的で行っております。当該デリバティブ取引は、実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

第33期(平成30年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

第33期(平成30年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

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

（千円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500 億円	資産管理 等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473 億円	信託銀行 業	-	-	投資一任契約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注3) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29銭

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

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

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

2018年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
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2018年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2)信託財産の計算
- (3)信託財産に関する報告書の作成
- (4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)信託契約の一部解約事務
- (3)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (4)受益者に対する収益分配金の再投資
- (5)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付
- (6)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

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、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年4月11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 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC バランス30インデックスファンドの平成29年2月28日から平成30年2月26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30年2月26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

(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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年4月11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 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC バランス50インデックスファンドの平成29年2月28日から平成30年2月26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30年2月26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

(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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年4月11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 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM DC バランス70インデックスファンドの平成29年2月28日から平成30年2月26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30年2月26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

(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。

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30年10月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMDCバランス30インデックスファンドの平成30年2月27日から平成30年8月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、DIAMDCバランス30インデックスファンドの平成30年8月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年2月27日から平成30年8月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成30年2月26日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年10月11日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成30年4月11日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年10月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMDCバランス50インデックスファンドの平成30年2月27日から平成30年8月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、DIAMDCバランス50インデックスファンドの平成30年8月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年2月27日から平成30年8月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成30年2月26日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年10月11日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成30年4月11日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年10月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMDC バランス70インデックスファンドの平成30年2月27日から平成30年8月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、DIAMDC バランス70インデックスファンドの平成30年8月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年2月27日から平成30年8月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成30年2月26日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年10月11日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成30年4月11日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

