



DIAMバランス・ファンド<DC年金>

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型

追加型投信／内外／資産複合（インデックス型）

■この目論見書により行う「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型」の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により、有価証券届出書を2017年5月26日に関東財務局長に提出しており、2017年5月27日にその効力が生じております。

■「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
ファンドは、課税上「株式投資信託」として取り扱われます。

■委託会社への照会先

【コールセンター】 0120-104-694 （受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

【ホームページアドレス】 <http://www.am-one.co.jp/>

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 西 恵正
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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
第2【管理及び運営】	71
第3【ファンドの経理状況】	78
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	300
第三部【委託会社等の情報】	302
第1【委託会社等の概況】	302
約款	418

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

D I A M バランス・ファンド<D C 年金> 1 安定型

D I A M バランス・ファンド<D C 年金> 2 安定・成長型

D I A M バランス・ファンド<D C 年金> 3 成長型

(以上を総称して、または個別に「バランス・ファンド<D C 年金>」、「ファンド」、「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また各々、「D I A M バランス・ファンド<D C 年金> 1 安定型」を「バランス・ファンド<D C 年金> 1」、「D I A M バランス・ファンド<D C 年金> 2 安定・成長型」を「バランス・ファンド<D C 年金> 2」、「D I A M バランス・ファンド<D C 年金> 3 成長型」を「バランス・ファンド<D C 年金> 3」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」に記載の振替機関及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、収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（但し、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）

※収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成29年5月27日から平成30年5月25日まで

※お申込みの取扱いは、販売会社の毎営業日に行われます。

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 委託会社への照会

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・ 株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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、お申込みの受付を行いません。

※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係る口数の増加の記載または記録が行われます。

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

○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】

- ①当ファンドは、3本のファンドから構成され、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- ②各ファンドの信託金の限度額は1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

●ライフサイクルにあわせた分散投資

- 主としてマザーファンド*を通じて実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券の4つのアセット(資産)に投資します。

※国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

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

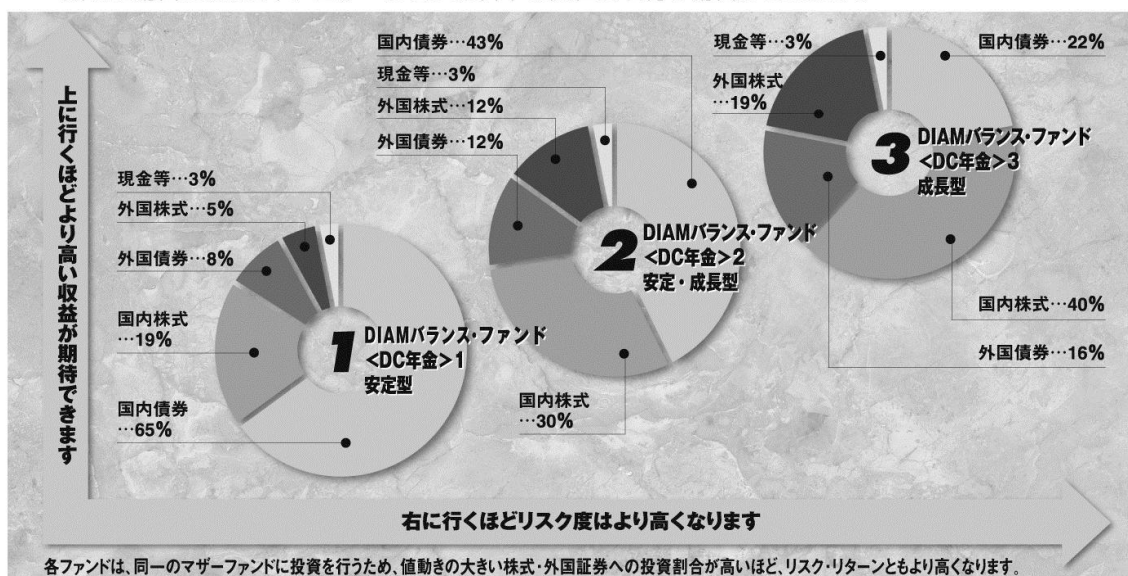
2

●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

3ファンドの基本アロケーション

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



- DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型
比較的リスクの低い資産(国内債券)を中心に組入れ、安定運用を行います。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型
各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスク・ミドルリターンをめざします。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

分配方針

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

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

○商品分類表

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型」

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信	特殊型
	内外	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 バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型」

「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型」

「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型」

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

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

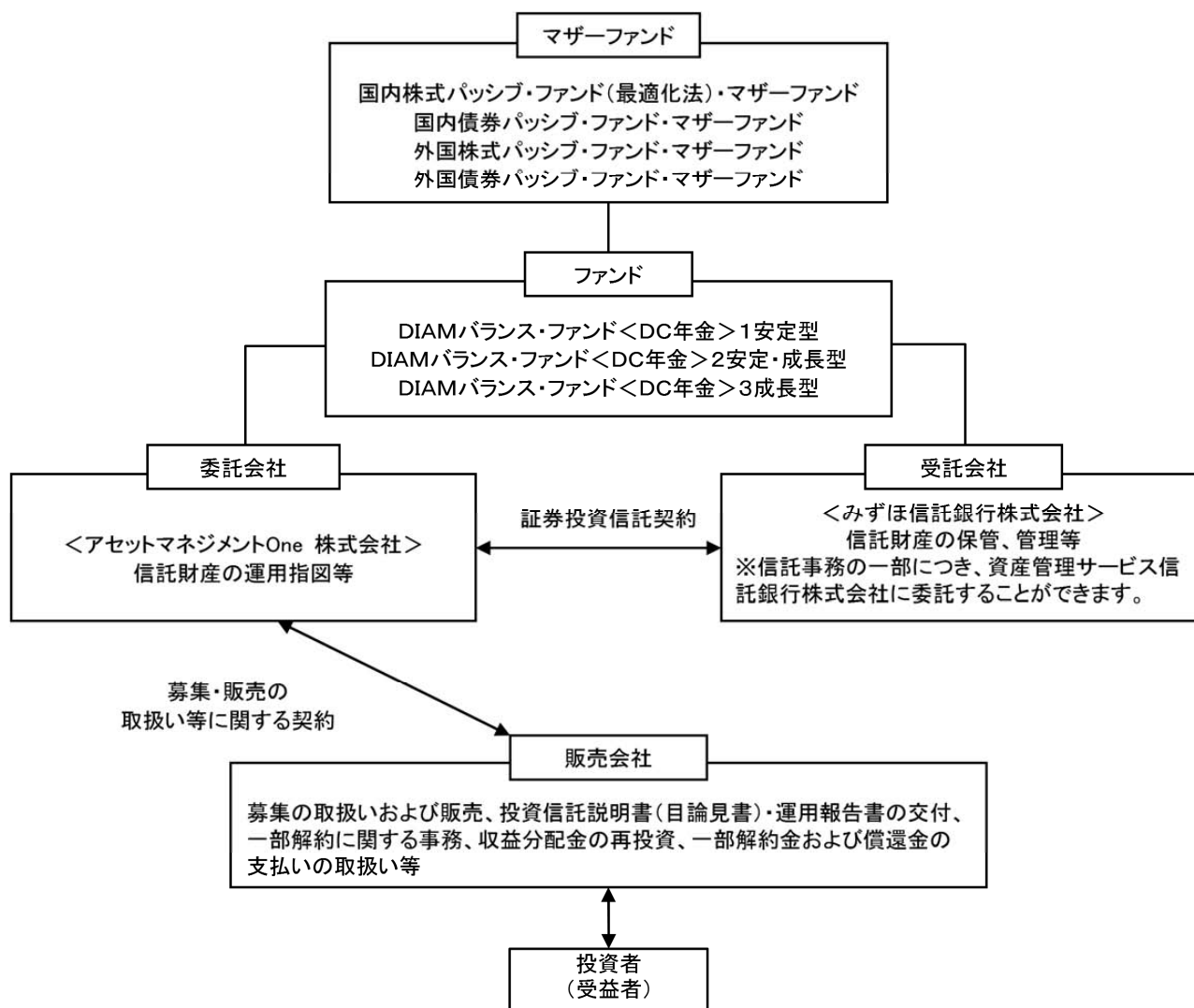
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成14年12月13日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
平成17年10月 1日 信託報酬率の変更

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

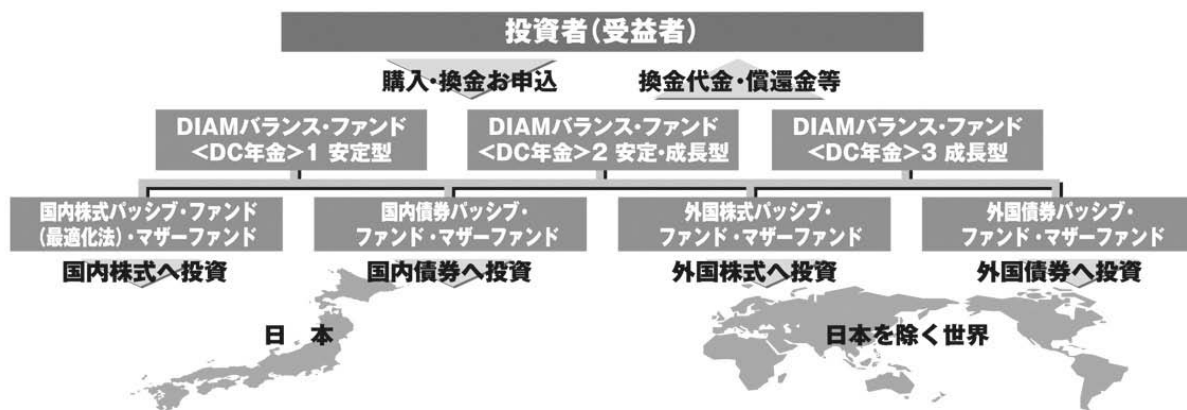
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

①資本金の額

20億円（平成29年8月31日現在）

②委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日	会社設立
平成10年 3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月 1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月 1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年 1月 1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月 1日	D I A M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

③大株主の状況

（平成29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>

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

<投資対象>

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

<投資態度>

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

2) ①「D I AMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が40%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が30%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス※に概ね連動する投資成果をめざして運用します。

②「D I AMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が60%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が50%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス※に概ね連動する投資成果をめざして運用します。

③「D I AMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が80%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が55%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス※に概ね連動する投資成果をめざして運用します。

※委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(T O P I X)(配当込み)^(注1)、国内債券についてはN O M U R A - B P I 総合^(注2)、外国株式についてはM S C I コクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)^(注3)、外国債券についてはシティ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) T O P I Xの指数値及びT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「**㈱東京証券取引所**」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利及びT O P I Xの商標に関するすべての権利は**㈱東京証券取引所**が有しています。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- 3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

■対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成インデックスに連動させるため、以下の対応を行います。

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

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

(2) 【投資対象】

1. 投資の対象とする資産 (約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りします。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

- b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲 (約款第16条第1項)

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

- (1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- (2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (5) 株券または新株引受権証書
- (6) 国債証券
- (7) 地方債証券

- (8) 特別の法律により法人の発行する債券
 - (9) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - (10) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - (11) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - (12) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - (13) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 - (14) コマーシャル・ペーパー
 - (15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - (16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
 - (17) 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
 - (18) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - (19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - (20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りします。）
 - (21) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - (23) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします。）
 - (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上記(25)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

- (1) 預金
- (2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形
- (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3. の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

(参考) ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	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	1) 流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 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。 ・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

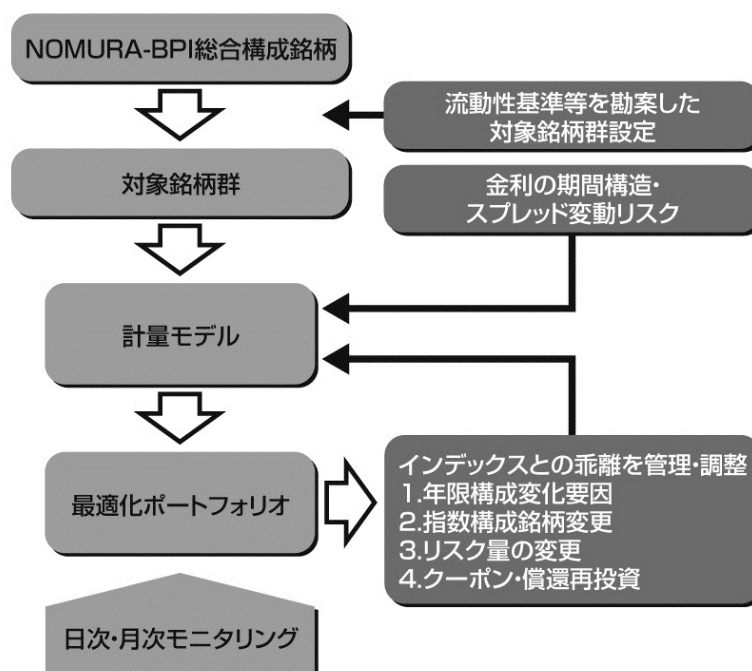
	<pre> graph TD A[TOPIX 構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[アクティブウェイトコントロール] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.配当金再投資 3.新規上場・合併等] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを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。 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。

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-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 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。
運用プロセス	1) 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA-BPI 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。 2) 最適化法によるポートフォリオの構築 ①債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 ②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 ①、②が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3) 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。

- ・ 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

- ① 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。
- ② 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③ 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 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。

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	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	1) 流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCI コクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。 2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

	<pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整
1.市場変動要因
2.指数構成銘柄変更
3.配当金再投資] --> D </pre>
主な投資制限	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。

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	1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 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

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

2) 最適化法によるポートフォリオの構築

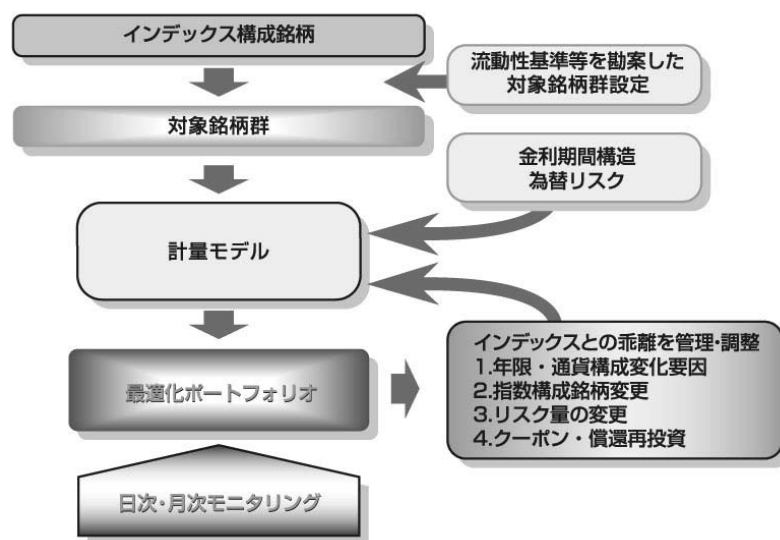
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

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



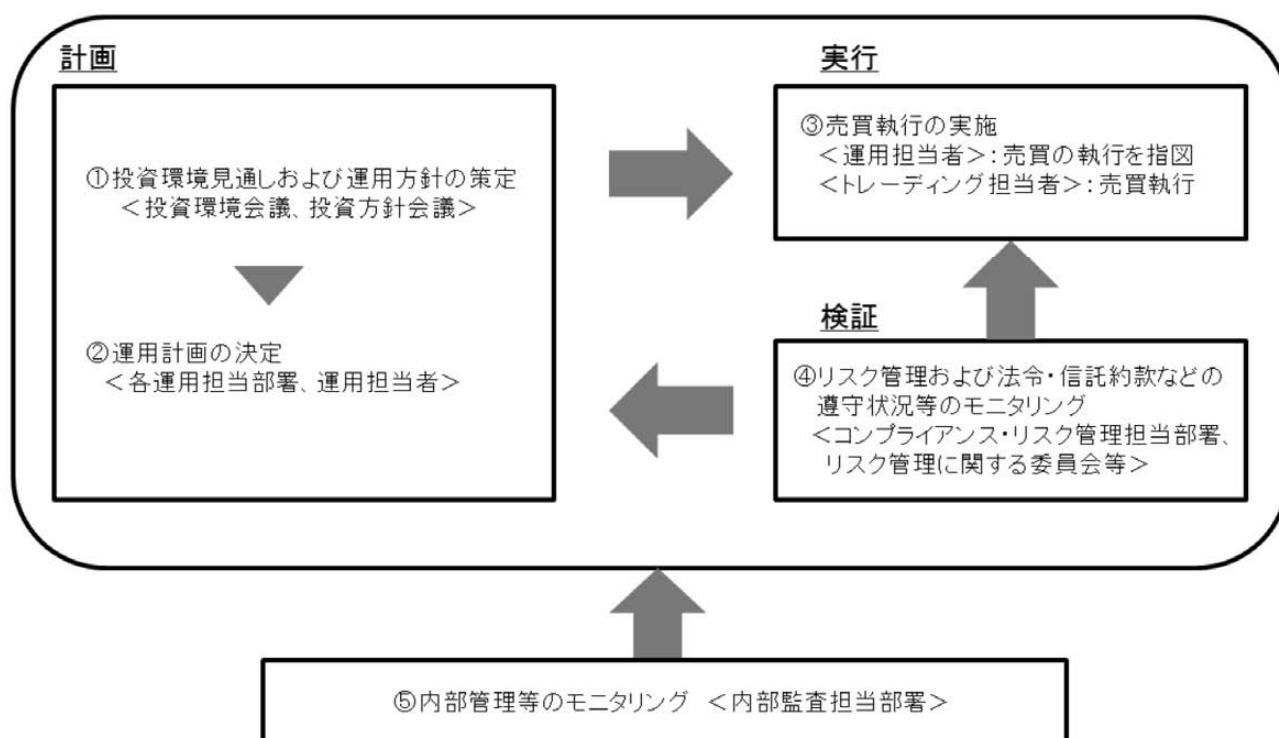
主な投資制限

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

資金動向、市況動向によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



① 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。

② 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。

③ 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。

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は平成29年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】

①収益分配方針

毎決算時（原則2月25日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

②収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の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利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③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します。）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

①「D I A M バランス・ファンド＜D C 年金＞ 1 安定型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

②「D I A M バランス・ファンド＜D C 年金＞ 2 安定・成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

③「D I A M バランス・ファンド＜D C 年金＞ 3 成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。

①②③共通

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

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

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

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

(5) 投資する株式等の範囲（約款第18条）

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

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

(6) 同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資制限（約款第19条）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(7) 同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第20条）

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

(8) 信用取引の指図範囲（約款第21条）

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

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

- 1) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2) 株式分割により取得する株券
- 3) 有償増資により取得する株券
- 4) 売出しにより取得する株券
- 5) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券
- 6) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(9) 先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第22条）

(a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

1) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。))を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

3) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(c) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。

- 1) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。
- 2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3. 金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額（以下2)において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- 3) コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(10) スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。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係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供を要求され委託会社がその必要性を認めたときあるいは担保の受入れが必要と委託会社が認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (11) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。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、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）を超えないものとします。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係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下(e)において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- (f) 上記(e)においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (g) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (h) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (12) デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (13) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
- 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価総額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b) 上記(a) 1)～2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- (14) 公社債の空売りの指図範囲（約款第26条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (b) 上記(a)の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- (15) 公社債の借入れ（約款第27条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(d) 上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(16) 特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第29条）

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

(17) 外国為替予約の指図（約款第30条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

(c) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(d) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(18) 資金の借入れ（約款第37条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

(d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての

議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

(1)株式投資リスク

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

1)価格変動リスク

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

2)信用リスク

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

(2)債券投資リスク

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

1)金利リスク

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

2)信用リスク

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

(3)為替リスク

当ファンドは実質的に外貨建資産を保有します。外貨建資産に投資する場合には、一般的に為替リスクがあります。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。従いまして、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が

減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替変動リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としており、円と投資対象国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に影響します。

(4) 資産配分リスク

当ファンドの各資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産）の資産配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

(5) カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落する場合があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合に、

資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

- 当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。
- 資金動向、市況動向等によっては、上記の投資態度に従った運用ができない場合があります。
- 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。
- 各ファンドにつき、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

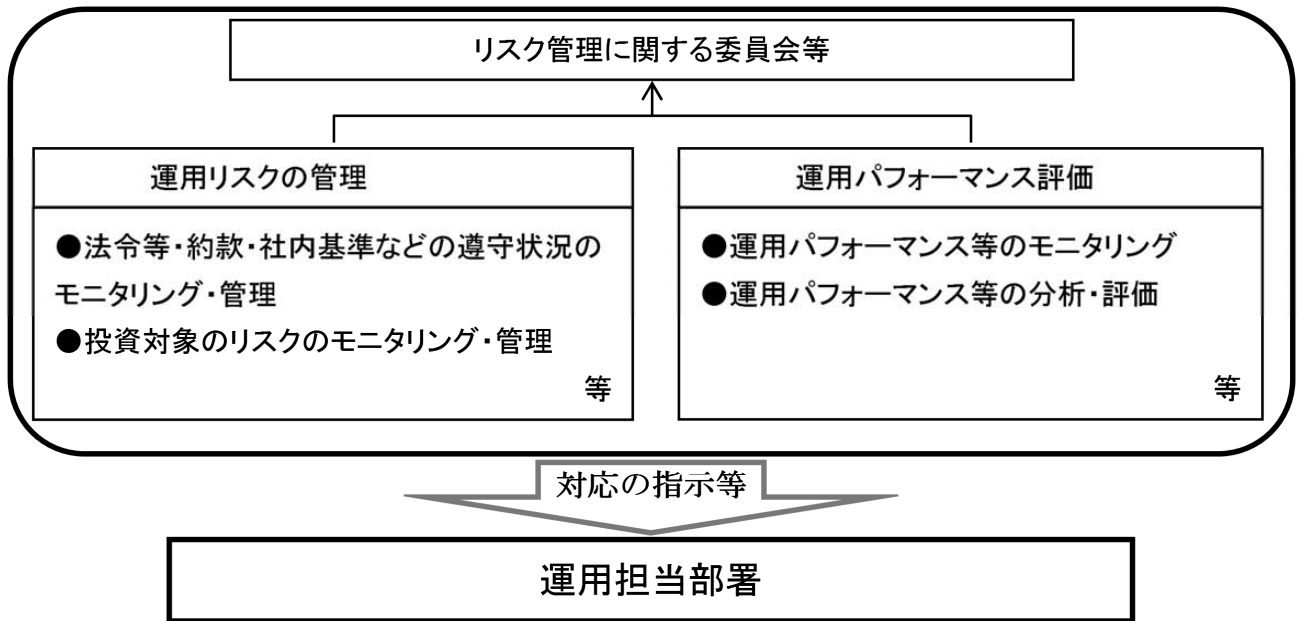
○注意事項

- イ. 当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

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

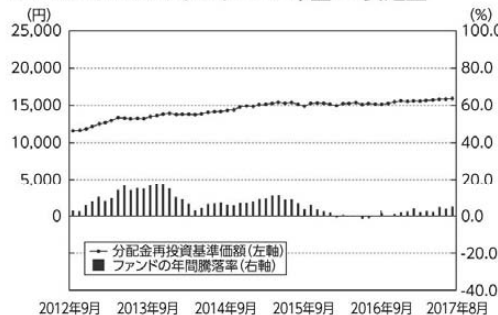


※上記体制は平成29年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

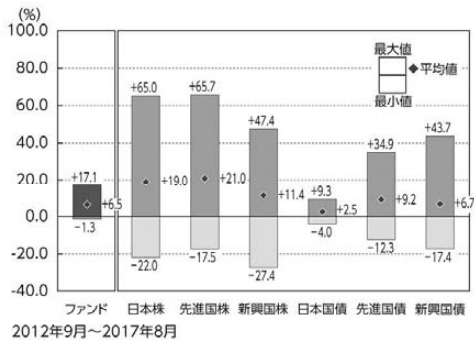
<参考情報>

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

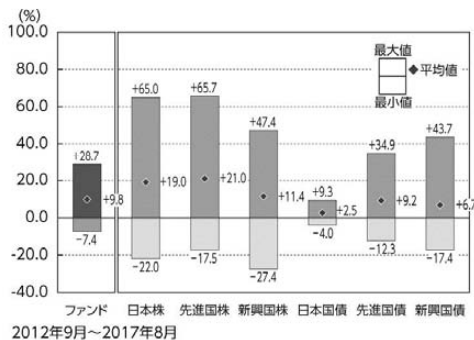
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型



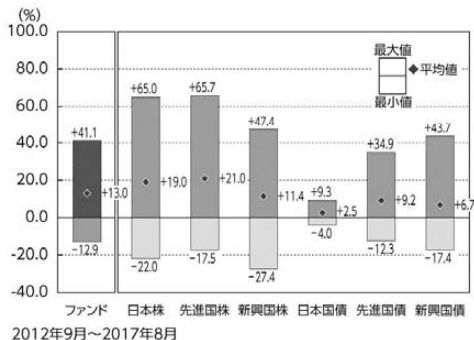
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型



DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



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

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

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

* 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 日本国債…NOMURA-BPI国債
 先進国債…シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 新興国債…J.P.モルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (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。
- 「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「J.P.モルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

ファンド名 信託報酬 税込（税抜）	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
D I AMバランス・ファンド <DC年金> 1 安定型 年率0.2808%（税抜0.26%）	0.100%	0.130%	0.030%
D I AMバランス・ファンド <DC年金> 2 安定・成長型 年率0.3132%（税抜0.29%）	0.115%	0.145%	0.030%
D I AMバランス・ファンド <DC年金> 3 成長型 年率0.3456%（税抜0.32%）	0.130%	0.160%	0.030%
主な役務	信託財産の運用、目 論見書等各種書類の 作成、基準価額の算 出等の対価	購入後の情報提供、 交付運用報告書等各 種書類の送付、口座 内でのファンドの管 理等の対価	運用財産の保管・管 理、委託会社からの 運用指図の実行等の 対価

※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。

①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。

②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。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①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。

②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。

③損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、平成29年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>

①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。

②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。

③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、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1 安定型

平成29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	10,114,762,455	97.02
内 日本	10,114,762,455	97.02
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	311,204,380	2.98
純資産総額	10,425,966,835	100.00

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

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

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型

平成29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	21,961,656,650	97.02
内 日本	21,961,656,650	97.02
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	673,737,761	2.98
純資産総額	22,635,394,411	100.00

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

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

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3 成長型

平成29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	17,071,889,967	97.03
内 日本	17,071,889,967	97.03
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	522,217,747	2.97
純資産総額	17,594,107,714	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

平成29年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	287,530,808,580	98.39
内 日本	287,530,808,580	98.39
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	4,711,278,574	1.61
純資産総額	292,242,087,154	100.00

その他資産の投資状況

平成29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）	4,571,220,000	1.56
内 日本	4,571,220,000	1.56

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	303,327,573,200	83.24
内 日本	303,327,573,200	83.24
地方債証券	23,756,166,383	6.52
内 日本	23,756,166,383	6.52
特殊債券	17,034,557,988	4.67
内 日本	17,034,557,988	4.67
社債券	17,798,023,980	4.88
内 日本	17,596,697,980	4.83
内 オランダ	201,326,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,464,233,784	0.68
純資産総額	364,380,555,335	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	265,447,943,127	94.10
内 アメリカ	162,252,287,331	57.52
内 イギリス	18,640,250,481	6.61
内 カナダ	10,727,275,053	3.80
内 フランス	10,716,480,907	3.80
内 ドイツ	10,601,216,938	3.76
内 スイス	10,063,159,360	3.57
内 オーストラリア	7,138,456,341	2.53
内 オランダ	5,333,870,169	1.89
内 アイルランド	4,066,911,251	1.44
内 スペイン	3,940,705,220	1.40
内 スウェーデン	3,199,059,798	1.13
内 香港	2,707,971,092	0.96
内 イタリア	2,285,711,529	0.81
内 シンガポール	2,124,050,300	0.75
内 デンマーク	2,077,900,019	0.74
内 ジョージア	1,559,912,527	0.55

	内 バミューダ	1,352,914,172	0.48
	内 ベルギー	1,309,238,824	0.46
	内 フィンランド	1,128,218,441	0.40
	内 ノルウェー	733,766,401	0.26
	内 ケイマン諸島	731,260,011	0.26
	内 オランダ領キュラソー	698,818,457	0.25
	内 イスラエル	515,625,947	0.18
	内 ルクセンブルグ	359,466,597	0.13
	内 オーストリア	297,293,894	0.11
	内 ポルトガル	192,047,544	0.07
	内 パナマ	188,568,942	0.07
	内 ニュージーランド	166,491,564	0.06
	内 リベリア	165,099,717	0.06
	内 パプアニューギニア	56,138,330	0.02
	内 イギリス領バージン諸島	55,386,739	0.02
	内 マン島	40,145,790	0.01
	内 モーリシャス	22,243,441	0.01
投資信託受益証券		818,575,073	0.29
	内 オーストラリア	673,800,581	0.24
	内 シンガポール	144,774,492	0.05
投資証券		6,356,674,586	2.25
	内 アメリカ	5,521,428,639	1.96
	内 フランス	386,515,021	0.14
	内 イギリス	254,283,291	0.09
	内 香港	147,416,341	0.05
	内 カナダ	47,031,294	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,470,793,664	3.36
純資産総額		282,093,986,450	100.00

その他資産の投資状況

平成29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（買建）	828,442,400	0.29
—	828,442,400	0.29
株価指数先物取引（買建）	9,490,294,384	3.36
内 アメリカ	6,236,770,045	2.21
内 ドイツ	1,850,916,830	0.66
内 イギリス	746,095,122	0.26
内 カナダ	372,409,200	0.13
内 オーストラリア	284,103,187	0.10

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（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。

平成29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		237,928,169,682	98.09
	内 アメリカ	103,065,836,010	42.49
	内 フランス	24,839,536,753	10.24
	内 イタリア	23,816,297,582	9.82
	内 ドイツ	17,504,534,479	7.22
	内 イギリス	16,156,714,986	6.66
	内 スペイン	13,784,407,486	5.68
	内 ベルギー	6,084,142,480	2.51
	内 オーストラリア	5,237,448,744	2.16
	内 オランダ	5,216,320,541	2.15
	内 カナダ	5,129,642,080	2.11
	内 オーストリア	3,665,835,905	1.51
	内 メキシコ	2,121,356,394	0.87
	内 アイルランド	1,933,507,578	0.80
	内 ポーランド	1,524,271,524	0.63
	内 デンマーク	1,489,421,848	0.61
	内 フィンランド	1,445,643,663	0.60
	内 南アフリカ	1,299,123,889	0.54
	内 スウェーデン	1,146,203,176	0.47
	内 マレーシア	917,237,325	0.38
	内 シンガポール	892,016,521	0.37
	内 ノルウェー	658,670,718	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,628,294,502	1.91
純資産総額		242,556,464,184	100.00

その他資産の投資状況

平成29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）		1,054,787,470	△0.43
	—	1,054,787,470	△0.43

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

平成29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	5, 251, 273, 480	1. 2801 6, 722, 156, 983	1. 2856 6, 751, 037, 185	— —	64. 75%
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	825, 078, 296	2. 2778 1, 879, 371, 060	2. 4207 1, 997, 267, 031	— —	19. 16%
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	459, 727, 584	1. 7296 795, 165, 332	1. 8265 839, 692, 432	— —	8. 05%
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	166, 676, 942	2. 9981 499, 715, 212	3. 1604 526, 765, 807	— —	5. 05%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97. 02%
合計	97. 02%

(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。

平成29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	7,532,713,875	1.2800 9,642,364,872	1.2856 9,684,056,957	— —	42.78%
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	2,818,597,100	2.2728 6,406,247,210	2.4207 6,822,977,999	— —	30.14%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	864,625,872	2.9913 2,586,403,764	3.1604 2,732,563,605	— —	12.07%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,490,313,764	1.7289 2,576,676,931	1.8265 2,722,058,089	— —	12.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.02%
合計	97.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

平成29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	2,909,752,372	2.2732 6,614,466,569	2.4207 7,043,637,566	— —	40.03%
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	2,998,131,365	1.2801 3,837,926,826	1.2856 3,854,397,682	— —	21.91%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,058,696,780	2.9940 3,169,836,250	3.1604 3,345,905,303	— —	19.02%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,548,288,758	1.7279 2,675,359,978	1.8265 2,827,949,416	— —	16.07%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.03%
合計	97.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成29年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	1,486,600	6,346.00 9,433,963,600	6,183.00 9,191,647,800	— —	3.15%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,055,200	751.20 6,802,266,240	674.10 6,104,110,320	— —	2.09%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	968,800	4,874.00 4,721,931,200	5,468.00 5,297,398,400	— —	1.81%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	543,400	8,664.00 4,708,017,600	8,922.00 4,848,214,800	— —	1.66%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	966,300	4,479.00 4,328,057,700	4,114.00 3,975,358,200	— —	1.36%
6	ソニー 日本	株式 電気機器	863,800	3,599.00 3,108,816,200	4,337.00 3,746,300,600	— —	1.28%
7	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,178,900	2,947.00 3,474,218,300	2,967.00 3,497,796,300	— —	1.20%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,100,300	3,541.00 3,896,162,300	3,081.00 3,390,024,300	— —	1.16%
9	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,400	43,880.00 2,430,952,000	57,260.00 3,172,204,000	— —	1.09%
10	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	16,386,800	208.50 3,416,647,800	189.10 3,098,743,880	— —	1.06%
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	480,200	5,021.00 2,411,084,200	6,077.00 2,918,175,400	— —	1.00%
12	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	759,400	3,632.00 2,758,140,800	3,764.00 2,858,381,600	— —	0.98%
13	任天堂 日本	株式 その他製品	75,300	23,230.00 1,749,219,000	36,640.00 2,758,992,000	— —	0.94%
14	ファナック 日本	株式 電気機器	124,000	21,565.00 2,674,060,000	21,340.00 2,646,160,000	— —	0.91%
15	キヤノン 日本	株式 電気機器	658,100	3,252.00 2,140,141,200	3,854.00 2,536,317,400	— —	0.87%
16	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	234,300	9,995.00 2,341,828,500	10,085.00 2,362,915,500	— —	0.81%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	905,700	2,541.00 2,301,383,700	2,543.50 2,303,647,950	— —	0.79%
18	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	888,300	2,690.00 2,389,527,000	2,553.50 2,268,274,050	— —	0.78%
19	信越化学工業 日本	株式 化学	229,700	9,505.00 2,183,298,500	9,724.00 2,233,602,800	— —	0.76%
	日立製作所	株式		672.30	757.00	—	

20	日本	電気機器	2,936,000	1,973,872,800	2,222,552,000	—	0.76%
21	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	505,100	4,428.00 2,236,582,800	4,365.00 2,204,761,500	— —	0.75%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	128,300	15,385.00 1,973,895,500	16,840.00 2,160,572,000	— —	0.74%
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	486,000	4,705.00 2,286,630,000	4,390.00 2,133,540,000	— —	0.73%
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,304,300	1,608.50 2,097,966,550	1,627.00 2,122,096,100	— —	0.73%
25	花王 日本	株式 化学	300,800	5,863.00 1,763,590,400	6,862.00 2,064,089,600	— —	0.71%
26	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,404,200	1,175.50 1,650,644,426	1,465.50 2,057,855,100	— —	0.70%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	432,200	4,054.00 1,752,138,800	4,719.00 2,039,551,800	— —	0.70%
28	日本電産 日本	株式 電気機器	158,500	10,405.00 1,649,192,500	12,460.00 1,974,910,000	— —	0.68%
29	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	101,700	17,995.00 1,830,091,500	18,630.00 1,894,671,000	— —	0.65%
30	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	837,600	1,703.33 1,426,712,000	2,191.00 1,835,181,600	— —	0.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年8月31日現在

種類	投資比率
株式	98.39%
合計	98.39%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.13%
輸送用機器		8.50%
情報・通信業		7.97%
銀行業		7.32%
化学		7.11%
機械		5.16%
小売業		4.62%
卸売業		4.51%
食料品		4.51%
医薬品		4.48%
陸運業		4.04%
サービス業		3.87%
建設業		3.20%
保険業		2.29%
不動産業		2.27%
その他製品		2.06%
電気・ガス業		1.77%
精密機器		1.58%
鉄鋼		1.25%
その他金融業		1.24%
証券、商品先物取引業		1.02%
非鉄金属		1.01%
ガラス・土石製品		0.95%
ゴム製品		0.94%
繊維製品		0.72%
金属製品		0.68%
空運業		0.60%
石油・石炭製品		0.53%
鉱業		0.30%
パルプ・紙		0.25%
海運業		0.22%
倉庫・運輸関連業		0.19%
水産・農林業		0.11%
合計		98.39%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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	1 2 2 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.73 4,532,864,000	100.60 4,527,405,000	0.100000 2019/12/20	1.24%
2	3 4 5 回 利付国庫債券 (10 年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.34 4,013,635,000	101.02 4,040,920,000	0.100000 2026/12/20	1.11%
3	1 1 7 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.84 4,033,960,000	100.56 4,022,520,000	0.200000 2019/3/20	1.10%
4	1 1 8 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.91 3,733,892,000	100.66 3,724,568,000	0.200000 2019/6/20	1.02%
5	3 4 1 回 利付国庫債券 (10 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	102.02 3,570,700,000	102.91 3,601,990,000	0.300000 2025/12/20	0.99%
6	1 3 1 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.15 3,540,285,000	101.18 3,541,580,000	0.100000 2022/3/20	0.97%
7	3 4 3 回 利付国庫債券 (10 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.18 3,506,425,000	101.14 3,540,075,000	0.100000 2026/6/20	0.97%
8	3 4 4 回 利付国庫債券 (10 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.14 3,504,970,000	101.08 3,538,045,000	0.100000 2026/9/20	0.97%
9	1 2 9 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.92 3,532,270,000	101.01 3,535,595,000	0.100000 2021/9/20	0.97%
10	3 4 7 回 利付国庫債券 (10 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.60 3,521,160,000	100.97 3,534,265,000	0.100000 2027/6/20	0.97%
11	1 2 4 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.78 3,527,580,000	100.72 3,525,515,000	0.100000 2020/6/20	0.97%
12	1 1 6 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.82 3,528,770,000	100.46 3,516,310,000	0.200000 2018/12/20	0.97%
13	3 1 3 回 利付国庫債券 (10 年) 日本	国債証券	3,000,000,000	105.76 3,173,010,000	105.16 3,154,800,000	1.300000 2021/3/20	0.87%
14	3 4 0 回 利付国庫債券 (10 年) 日本	国債証券	3,000,000,000	102.90 3,087,180,000	103.71 3,111,540,000	0.400000 2025/9/20	0.85%
15	3 4 2 回 利付国庫債券 (10 年)	国債証券	3,000,000,000	100.22	101.19	0.100000	0.83%

	日本			3,006,675,000	3,035,970,000	2026/3/20	
16	130回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	101.06 3,031,845,000	101.10 3,033,060,000	0.100000 2021/12/20	0.83%
17	128回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.91 3,027,450,000	100.95 3,028,590,000	0.100000 2021/6/20	0.83%
18	127回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.88 3,026,490,000	100.90 3,027,210,000	0.100000 2021/3/20	0.83%
19	126回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.84 3,025,440,000	100.84 3,025,320,000	0.100000 2020/12/20	0.83%
20	125回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.81 3,024,330,000	100.77 3,023,370,000	0.100000 2020/9/20	0.83%
21	123回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,490,000	100.67 3,020,250,000	0.100000 2020/3/20	0.83%
22	301回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	103.95 3,014,811,000	103.00 2,987,029,000	1.500000 2019/6/20	0.82%
23	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.49 2,637,250,000	105.23 2,630,800,000	1.000000 2022/3/20	0.72%
24	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	104.15 2,603,800,000	103.37 2,584,300,000	1.300000 2019/12/20	0.71%
25	346回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.70 2,517,745,000	101.00 2,525,050,000	0.100000 2027/3/20	0.69%
26	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,300,000,000	104.04 2,392,920,000	103.51 2,380,868,000	1.000000 2020/9/20	0.65%
27	297回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,300,000,000	103.01 2,369,299,000	102.02 2,346,483,000	1.400000 2018/12/20	0.64%
28	141回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	1,900,000,000	119.10 2,262,900,000	121.26 2,304,111,000	1.700000 2032/12/20	0.63%
29	312回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,200,000,000	105.07 2,311,606,000	104.46 2,298,274,000	1.200000 2020/12/20	0.63%
30	143回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	1,900,000,000	117.60 2,234,476,000	119.83 2,276,865,000	1.600000 2033/3/20	0.62%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.24%
地方債証券	6.52%
特殊債券	4.67%
社債券	4.88%
合計	99.32%

(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。

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	380,314	14,953.96 5,687,200,472	18,037.10 6,859,764,311	— —	2.43%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	532,889	7,147.34 3,808,744,163	8,172.18 4,354,867,066	— —	1.54%
3	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	171,222	14,870.53 2,546,161,909	18,762.56 3,212,564,144	— —	1.14%
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	29,455	92,723.56 2,731,172,510	106,841.28 3,147,010,132	— —	1.12%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	197,213	12,889.15 2,541,908,750	14,472.74 2,854,214,327	— —	1.01%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	259,998	9,896.46 2,573,060,391	10,082.45 2,621,416,887	— —	0.93%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	300,888	9,139.38 2,749,930,720	8,402.96 2,528,350,430	— —	0.90%
8	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	22,654	90,805.35 2,057,104,418	102,643.11 2,325,277,226	— —	0.82%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	21,598	93,041.96 2,009,520,400	104,195.62 2,250,417,100	— —	0.80%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	225,890	8,390.74 1,895,385,658	9,280.10 2,096,283,596	— —	0.74%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	346,331	6,390.32 2,213,168,076	5,671.17 1,964,102,392	— —	0.70%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	729,149	2,657.53 1,937,740,237	2,635.72 1,921,836,539	— —	0.68%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	185,247	9,708.00 1,798,378,619	10,144.28 1,879,198,437	— —	0.67%
14	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	444,988	4,493.82 1,999,696,855	4,159.52 1,850,937,108	— —	0.66%
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	89,976	18,460.95 1,661,042,801	19,914.24 1,791,804,288	— —	0.64%
	GENERAL ELECTRIC CO	株式		3,331.01	2,680.99	—	

16	アメリカ	コングロマリ ット	634, 217	2, 112, 586, 789	1, 700, 334, 254	—	0. 60%
17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	137, 665	12, 415. 82 1, 709, 224, 394	11, 895. 54 1, 637, 600, 422	— —	0. 58%
18	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	433, 941	3, 618. 27 1, 570, 119, 562	3, 693. 54 1, 602, 782, 346	— —	0. 57%
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	295, 811	5, 330. 94 1, 576, 951, 294	5, 313. 41 1, 571, 765, 243	— —	0. 56%
20	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	344, 423	4, 205. 79 1, 448, 571, 939	4, 507. 34 1, 552, 433, 080	— —	0. 55%
21	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	135, 281	9, 626. 99 1, 302, 350, 175	11, 453. 86 1, 549, 490, 527	— —	0. 55%
22	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1, 444, 682	997. 01 1, 440, 375, 825	1, 068. 81 1, 544, 099, 062	— —	0. 55%
23	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	70, 178	18, 104. 04 1, 270, 505, 710	21, 629. 06 1, 517, 884, 846	— —	0. 54%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	201, 895	6, 631. 62 1, 338, 892, 569	7, 509. 66 1, 516, 163, 653	— —	0. 54%
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	295, 882	4, 486. 95 1, 327, 608, 336	5, 011. 96 1, 482, 949, 873	— —	0. 53%
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	162, 978	8, 632. 31 1, 406, 877, 182	9, 085. 21 1, 480, 690, 985	— —	0. 52%
27	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	89, 050	15, 641. 71 1, 392, 894, 662	16, 563. 00 1, 474, 935, 150	— —	0. 52%
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	112, 812	11, 356. 70 1, 281, 172, 725	12, 856. 20 1, 450, 333, 702	— —	0. 51%
29	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	51, 353	27, 247. 43 1, 399, 237, 343	27, 651. 16 1, 419, 970, 430	— —	0. 50%
30	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	201, 190	7, 243. 60 1, 457, 341, 369	6, 969. 71 1, 402, 236, 035	— —	0. 50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年8月31日現在

種類	投資比率
株式	94. 10%
投資信託受益証券	0. 29%
投資証券	2. 25%
合計	96. 64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.36%
石油・ガス・消耗燃料		5.66%
医薬品		5.53%
保険		4.11%
ソフトウェア		3.75%
インターネットソフトウェア・サービス		3.06%
情報技術サービス		2.83%
資本市場		2.83%
コンピュータ・周辺機器		2.78%
半導体・半導体製造装置		2.53%
化学		2.49%
メディア		2.45%
バイオテクノロジー		2.27%
各種電気通信サービス		2.27%
飲料		2.06%
航空宇宙・防衛		2.04%
ヘルスケア機器・用品		1.99%
食品		1.95%
電力		1.94%
コングロマリット		1.93%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.92%
ホテル・レストラン・レジャー		1.77%
インターネット販売・通信販売		1.68%
食品・生活必需品小売り		1.67%
金属・鉱業		1.56%
機械		1.56%
専門小売り		1.53%
タバコ		1.40%
家庭用品		1.38%
繊維・アパレル・贅沢品		1.17%
総合公益事業		1.11%
自動車		0.98%
各種金融サービス		0.95%
陸運・鉄道		0.86%
通信機器		0.82%
電気設備		0.76%
パーソナル用品		0.75%
専門サービス		0.59%
航空貨物・物流サービス		0.58%
不動産管理・開発		0.56%
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.55%
エネルギー設備・サービス		0.51%
家庭用耐久財		0.48%
消費者金融		0.47%

自動車部品	0.45%
建設関連製品	0.40%
電子装置・機器・部品	0.40%
商業サービス・用品	0.37%
無線通信サービス	0.36%
建設資材	0.34%
複合小売り	0.34%
建設・土木	0.33%
容器・包装	0.30%
運送インフラ	0.28%
商社・流通業	0.28%
ガス	0.14%
旅客航空輸送業	0.14%
紙製品・林産品	0.10%
海運業	0.09%
水道	0.08%
販売	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
レジャー用品	0.06%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.04%
各種消費者サービス	0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	94.10%

(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。

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	3,754,280,000	100.42 3,770,385,861	100.12 3,758,972,850	1.375000 2018/9/30	1.55%
2	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	2,318,820,000	101.09 2,344,164,702	101.97 2,364,639,883	2.125000 2021/8/15	0.97%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,877,140,000	106.25 1,994,461,250	105.45 1,979,575,529	3.625000 2020/2/15	0.82%
4	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,932,350,000	100.44 1,940,965,520	101.43 1,960,040,575	2.000000 2022/2/15	0.81%
5	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,821,930,000	103.32 1,882,563,830	103.42 1,884,258,225	2.625000 2020/8/15	0.78%
6	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,877,140,000	100.57 1,887,989,869	100.28 1,882,414,763	1.500000 2018/12/31	0.78%
7	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,733,594,000	100.98 1,750,652,564	101.91 1,766,774,989	2.125000 2021/12/31	0.73%
8	US T N/B 1.625 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,656,300,000	100.75 1,668,722,250	100.52 1,664,962,449	1.625000 2019/3/31	0.69%
9	US T N/B 1.25 12/15/18 アメリカ	国債証券	1,656,300,000	100.13 1,658,552,568	99.99 1,656,233,748	1.250000 2018/12/15	0.68%
10	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,545,880,000	106.09 1,640,132,303	105.56 1,631,861,845	3.500000 2020/5/15	0.67%
11	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,490,670,000	99.08 1,477,089,996	99.35 1,481,055,178	1.000000 2019/8/31	0.61%
12	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,435,460,000	104.00 1,492,878,400	103.07 1,479,528,622	3.125000 2019/5/15	0.61%
13	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,391,292,000	103.82 1,444,484,405	105.06 1,461,719,201	2.750000 2024/2/15	0.60%
14	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,435,460,000	100.29 1,439,651,543	100.09 1,436,852,396	1.375000 2019/2/28	0.59%
15	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,402,334,000	100.64 1,411,421,124	100.24 1,405,727,648	1.500000 2018/8/31	0.58%
16	US T N/B 6.25 08/15/23 アメリカ	国債証券	1,104,200,000	124.69 1,376,895,440	124.87 1,378,869,750	6.250000 2023/8/15	0.57%
17	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,325,040,000	103.01 1,364,936,954	102.07 1,352,521,329	2.750000 2019/2/15	0.56%
18	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,325,040,000	100.78 1,335,388,562	101.54 1,345,525,118	2.000000 2021/5/31	0.55%
19	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	1,325,040,000	100.06 1,325,934,402	101.04 1,338,899,918	2.250000 2027/2/15	0.55%
20	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,325,040,000	99.45 1,317,792,031	99.93 1,324,205,224	1.375000 2020/4/30	0.55%
21	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,195,194,000	110.01 1,314,952,438	109.50 1,308,737,430	2.500000 2020/10/25	0.54%
	US T N/B 2.25 03/31/21			101.85	102.42	2.250000	

22	アメリカ	国債証券	1,269,830,000	1,293,436,139	1,300,572,584	2021/3/31	0.54%
23	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,291,914,000	99.15 1,280,978,444	100.23 1,294,937,078	1.750000 2022/3/31	0.53%
24	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,280,872,000	98.98 1,267,884,841	100.21 1,283,664,300	1.750000 2022/5/15	0.53%
25	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	1,325,040,000	92.08 1,220,163,084	95.00 1,258,880,752	1.500000 2026/8/15	0.52%
26	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,214,620,000	100.93 1,226,000,989	101.27 1,230,082,112	1.875000 2020/6/30	0.51%
27	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	1,214,620,000	99.60 1,209,822,251	99.69 1,210,963,993	1.125000 2019/5/31	0.50%
28	FRANCE OAT 3.5 04/25/20 フランス	国債証券	1,090,122,000	112.01 1,221,154,664	110.72 1,207,059,386	3.500000 2020/4/25	0.50%
29	US T N/B 2.0 11/15/26 アメリカ	国債証券	1,214,620,000	97.22 1,180,933,949	98.92 1,201,611,419	2.000000 2026/11/15	0.50%
30	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,192,536,000	99.35 1,184,796,441	99.70 1,189,077,645	1.250000 2020/1/31	0.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	98.09%
合計	98.09%

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成29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	T O P I X 先物 2 9 0 9 月	買建	282	4, 545, 751, 368	4, 571, 220, 000	1. 56%

(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。

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	ー	アメリカ・ドル買／円 売 2017年09月	買建	4,370,000	480,450,574	482,481,500	0.17%
		ユーロ買／円売 2017年09月	買建	1,590,000	209,164,969	208,830,600	0.07%
		イギリス・ポンド買／ 円売 2017年09月	買建	520,000	73,934,549	74,187,100	0.03%
		オーストラリア・ドル 買／円売 2017年 09月	買建	370,000	32,369,256	32,350,800	0.01%
		カナダ・ドル買／円売 2017年09月	買建	350,000	30,686,394	30,592,400	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T S e p 1 7	買建	460	6,266,573,783	6,236,770,045	2.21%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 S e p 1 7	買建	414	1,876,459,833	1,850,916,830	0.66%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 7	買建	71	745,435,940	746,095,122	0.26%
	モントリオ ール取引所	S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 7	買建	24	375,472,396	372,409,200	0.13%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S S e p 1 7	買建	23	285,620,445	284,103,187	0.10%

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

(注2) 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。

平成29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	—	ユーロ売／円買 2017年09月	売建	3,432,000	451,248,229	450,758,880	△0.19%
		アメリカ・ドル売／円 買2017年09月	売建	4,006,000	441,205,350	442,263,260	△0.18%
		イギリス・ポンド売／ 円買2017年09月	売建	396,000	56,238,573	56,497,320	△0.02%
		スイス・フラン売／円 買2017年09月	売建	489,000	56,236,564	56,058,960	△0.02%
		スウェーデン・クロー ナ売／円買2017年 09月	売建	3,553,000	49,210,115	49,209,050	△0.02%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（平成29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。

D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	3,305	3,305	1.2076	1.2076
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	3,259	3,259	1.0599	1.0599
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	3,884	3,884	1.1365	1.1365
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	4,419	4,419	1.1651	1.1651
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	4,993	4,993	1.1720	1.1720
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	5,846	5,846	1.2689	1.2689
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	6,797	6,797	1.3874	1.3874
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	8,185	8,185	1.5056	1.5056
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	8,608	8,608	1.4954	1.4954
第14計算期間末 (平成29年2月27日)	9,711	9,711	1.5586	1.5586
平成28年8月末日	9,218	—	1.5154	—
9月末日	9,281	—	1.5124	—
10月末日	9,388	—	1.5264	—
11月末日	9,525	—	1.5477	—
12月末日	9,676	—	1.5615	—
平成29年1月末日	9,713	—	1.5530	—
2月末日	9,717	—	1.5595	—
3月末日	9,816	—	1.5569	—
4月末日	9,911	—	1.5667	—
5月末日	10,009	—	1.5748	—
6月末日	10,314	—	1.5837	—
7月末日	10,366	—	1.5853	—
8月末日	10,425	—	1.5919	—

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	8,199	8,199	1.3419	1.3419
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	7,395	7,395	1.0433	1.0433
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	9,529	9,529	1.1659	1.1659
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	10,826	10,826	1.2065	1.2065
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	11,905	11,905	1.1984	1.1984
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	14,251	14,251	1.3506	1.3506
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	16,454	16,454	1.5495	1.5495
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	19,545	19,545	1.7503	1.7503
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	18,932	18,932	1.6738	1.6738
第14計算期間末 (平成29年2月27日)	21,334	21,334	1.8059	1.8059
平成28年8月末日	19,957	—	1.6980	—
9月末日	19,985	—	1.6908	—
10月末日	20,377	—	1.7202	—
11月末日	21,018	—	1.7712	—
12月末日	21,387	—	1.8065	—
平成29年1月末日	21,269	—	1.7973	—
2月末日	21,358	—	1.8079	—
3月末日	21,529	—	1.8054	—
4月末日	21,781	—	1.8186	—
5月末日	21,911	—	1.8369	—
6月末日	22,218	—	1.8578	—
7月末日	22,406	—	1.8615	—
8月末日	22,635	—	1.8674	—

D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	7,103	7,103	1.4810	1.4810
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	5,656	5,656	1.0219	1.0219
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	7,667	7,667	1.1890	1.1890
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	8,673	8,673	1.2395	1.2395
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	9,234	9,234	1.2166	1.2166
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	11,326	11,326	1.4236	1.4236
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	13,230	13,230	1.7075	1.7075
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	15,889	15,889	2.0030	2.0030
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	14,524	14,524	1.8463	1.8463
第14計算期間末 (平成29年2月27日)	16,465	16,465	2.0530	2.0530
平成28年8月末日	15,262	—	1.8733	—
9月末日	15,183	—	1.8612	—
10月末日	15,545	—	1.9071	—
11月末日	16,191	—	1.9919	—
12月末日	16,544	—	2.0515	—
平成29年1月末日	16,408	—	2.0413	—
2月末日	16,493	—	2.0561	—
3月末日	16,654	—	2.0540	—
4月末日	16,813	—	2.0710	—
5月末日	16,976	—	2.1010	—
6月末日	17,334	—	2.1359	—
7月末日	17,447	—	2.1419	—
8月末日	17,594	—	2.1468	—

②【分配の推移】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

	1口当たりの分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	1口当たりの分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

	1口当たりの分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	—

③【収益率の推移】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

	収益率(%)
第5計算期間	△4.0
第6計算期間	△12.2
第7計算期間	7.2
第8計算期間	2.5
第9計算期間	0.6
第10計算期間	8.3
第11計算期間	9.3
第12計算期間	8.5
第13計算期間	△0.7
第14計算期間	4.2
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	1.7

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	収益率(%)
第5計算期間	△8.3
第6計算期間	△22.3
第7計算期間	11.8
第8計算期間	3.5
第9計算期間	△0.7
第10計算期間	12.7
第11計算期間	14.7
第12計算期間	13.0
第13計算期間	△4.4
第14計算期間	7.9
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	2.7

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

	収益率(%)
第5計算期間	△12.1
第6計算期間	△31.0
第7計算期間	16.4
第8計算期間	4.2
第9計算期間	△1.8
第10計算期間	17.0
第11計算期間	19.9
第12計算期間	17.3
第13計算期間	△7.8
第14計算期間	11.2
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	3.6

(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】

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型

	設定口数	解約口数
第5計算期間	1, 023, 536, 793	407, 728, 822
第6計算期間	808, 835, 748	470, 954, 147
第7計算期間	717, 089, 255	374, 538, 190
第8計算期間	717, 088, 658	341, 609, 549
第9計算期間	891, 096, 153	423, 802, 872
第10計算期間	792, 020, 789	445, 175, 024
第11計算期間	1, 211, 792, 457	920, 086, 264
第12計算期間	1, 286, 101, 728	748, 268, 806
第13計算期間	1, 428, 568, 208	1, 108, 983, 410
第14計算期間	1, 177, 511, 256	702, 902, 178
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	707, 472, 375	425, 655, 892

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型

	設定口数	解約口数
第5計算期間	1, 986, 010, 161	647, 207, 655
第6計算期間	1, 694, 085, 942	716, 280, 777
第7計算期間	1, 585, 255, 449	499, 713, 782
第8計算期間	1, 458, 689, 281	659, 115, 611
第9計算期間	1, 799, 986, 538	838, 294, 174
第10計算期間	1, 442, 236, 754	824, 908, 601
第11計算期間	1, 713, 460, 271	1, 646, 999, 165
第12計算期間	1, 739, 079, 770	1, 190, 841, 426
第13計算期間	1, 697, 863, 637	1, 553, 640, 036
第14計算期間	1, 423, 621, 400	920, 758, 675
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	786, 025, 179	549, 199, 537

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

D I AMバランス・ファンド＜DC年金＞3成長型

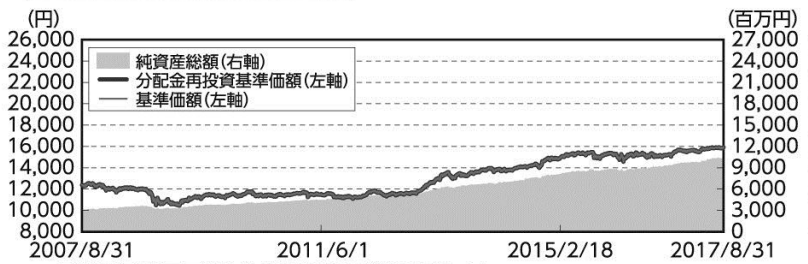
	設定口数	解約口数
第5計算期間	1,854,832,281	639,682,536
第6計算期間	1,377,219,073	638,023,646
第7計算期間	1,360,590,692	447,612,668
第8計算期間	1,167,657,064	618,314,729
第9計算期間	1,241,120,741	648,446,247
第10計算期間	1,210,113,248	844,741,332
第11計算期間	1,548,578,623	1,756,263,299
第12計算期間	1,448,206,115	1,263,916,173
第13計算期間	1,425,335,822	1,490,982,099
第14計算期間	1,086,201,353	932,940,956
平成29年2月28日～ 平成29年8月27日	594,634,456	465,212,189

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

データの基準日:2017年8月31日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

基準価額・純資産の推移 (2007年8月31日～2017年8月31日)



分配の推移(税引前)

第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
第14期	(2017.02.27)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

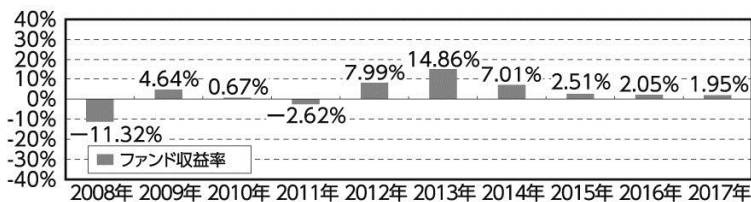
主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	64.75%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.16%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.05%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.05%

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

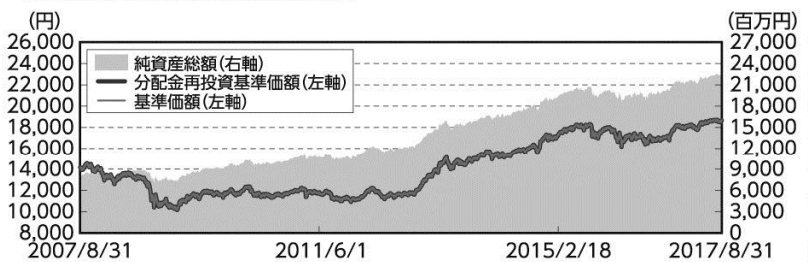
年間収益率の推移(暦年ベース)



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

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

基準価額・純資産の推移 (2007年8月31日～2017年8月31日)



分配の推移(税引前)

第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
第14期	(2017.02.27)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

○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。

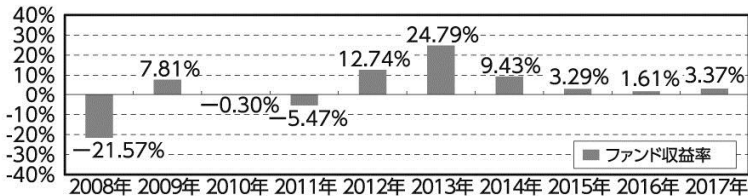
主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	42.78%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30.14%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.07%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.03%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

基準価額・純資産の推移

(2007年8月31日～2017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:2002年12月13日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
第14期	(2017.02.27)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

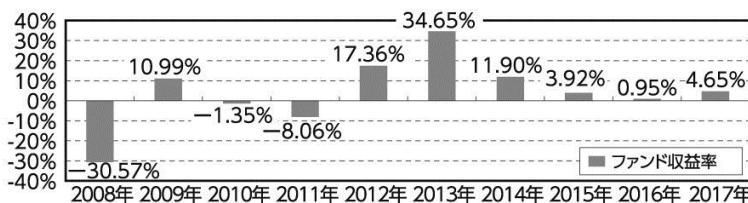
主要な資産の状況

組入銘柄 ※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	40.03%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.91%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.02%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.07%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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	3.15%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.09%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.81%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.66%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.36%

■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	2.43%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.54%
3	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	1.14%
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.12%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.01%

■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	1.24%
2	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/12/20	1.11%
3	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.10%
4	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.02%
5	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.99%

■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 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	1.55%
2	US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/8/15	0.97%
3	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.82%
4	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.81%
5	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.78%

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

- ・お申込価額（発行価格）はお申込日の翌営業日の基準価額※とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

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

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・ お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

※収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

- ・ お申込手数料はありません。

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

2【換金（解約）手続等】

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

- ・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・解約価額の照会方法等

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・換金（解約）単位は1口単位とします。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

信託期間は平成14年12月13日から無期限です。

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

（４）【計算期間】

- 計算期間は原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとします。
- 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

イ. 償還規定

- 委託会社は各ファンドについて受益権の口数が10億口を下回る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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 委託会社は上記a. b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 上記a. b. につき、上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えると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つて、上記c. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a. ～e. の規定に従います。

g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の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。

ニ. 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】

①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。

②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。

③一部解約請求権

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。

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞1 安定型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（平成28年2月26日から平成29年2月27日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成29年 4月12日

アセットマネジメント One 株式会社

取締役会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴司

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成28年2月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

1【財務諸表】

【D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞ 1 安定型】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	281,775,214	—
コール・ローン	—	313,077,974
親投資信託受益証券	8,351,998,256	9,420,316,494
未収入金	11,082,000	790,000
流動資産合計	8,644,855,470	9,734,184,468
資産合計	8,644,855,470	9,734,184,468
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,791,516	8,934,274
未払受託者報酬	1,418,199	1,557,966
未払委託者報酬	10,873,110	11,944,683
その他未払費用	224,467	233,606
流動負債合計	36,307,292	22,670,529
負債合計	36,307,292	22,670,529
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 5,756,501,296	※ 1 6,231,110,374
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,852,046,882	3,480,403,565
（分配準備積立金）	1,137,498,160	1,295,752,917
元本等合計	8,608,548,178	9,711,513,939
純資産合計	8,608,548,178	9,711,513,939
負債純資産合計	8,644,855,470	9,734,184,468

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
営業収益		
受取利息	148,692	309
有価証券売買等損益	△43,154,511	403,726,238
営業収益合計	△43,005,819	403,726,547
営業費用		
支払利息	—	191,101
受託者報酬	2,780,475	2,995,008
委託者報酬	21,317,448	22,962,290
その他費用	440,066	451,631
営業費用合計	24,537,989	26,600,030
営業利益又は営業損失 (△)	△67,543,808	377,126,517
経常利益又は経常損失 (△)	△67,543,808	377,126,517
当期純利益又は当期純損失 (△)	△67,543,808	377,126,517
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 (△)	11,777,196	23,371,348
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	2,748,864,299	2,852,046,882
剰余金増加額又は欠損金減少額	745,668,467	624,783,271
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	745,668,467	624,783,271
剰余金減少額又は欠損金増加額	563,164,880	350,181,757
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	563,164,880	350,181,757
分配金	※1 —	※1 —
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	2,852,046,882	3,480,403,565

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1. ※1 期首元本額	5,436,916,498円	5,756,501,296円
期中追加設定元本額	1,428,568,208円	1,177,511,256円
期中一部解約元本額	1,108,983,410円	702,902,178円
2. 受益権の総数	5,756,501,296口	6,231,110,374口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. ※1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,714,548,722円)及び分配準備積立金(1,137,498,160円)より分配対象収益は2,852,046,882円(1万口当たり4,954.48円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(283,337,113円)、信託約款に規定される収益調整金(2,184,831,240円)及び分配準備積立金(1,012,415,804円)より分配対象収益は3,480,584,157円(1万口当たり5,585.82円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△71,988,237	366,920,264
合計	△71,988,237	366,920,264

(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13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.4954円	1.5586円
(1万口当たり純資産額)	(14,954円)	(15,586円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年2月27日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	816,514,087	1,853,976,885	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,912,270,839	6,287,706,673	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	169,317,804	506,277,165	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	447,249,853	772,355,771	
親投資信託受益証券 合計		6,345,352,583	9,420,316,494	
合計		6,345,352,583	9,420,316,494	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(平成28年2月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成29年 4 月12日

アセットマネジメント One 株式会社

取締役会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴司

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光彦

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成28年2月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

【D I A Mバランス・ファンド＜D C 年金＞ 2 安定・成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	607,708,568	—
コール・ローン	—	682,530,012
親投資信託受益証券	18,367,994,608	20,693,026,226
未収入金	1,757,000	2,890,000
流動資産合計	18,977,460,176	21,378,446,238
資産合計	18,977,460,176	21,378,446,238
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,962,513	10,044,480
未払受託者報酬	3,206,512	3,410,980
未払委託者報酬	27,790,146	29,562,168
その他未払費用	507,606	511,562
流動負債合計	44,466,777	43,529,190
負債合計	44,466,777	43,529,190
純資産の部		
元本等		
元本	※1 11,311,377,052	※1 11,814,239,777
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,621,616,347	9,520,677,271
（分配準備積立金）	4,205,323,682	4,543,965,384
元本等合計	18,932,993,399	21,334,917,048
純資産合計	18,932,993,399	21,334,917,048
負債純資産合計	18,977,460,176	21,378,446,238

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
営業収益		
受取利息	339,806	680
有価証券売買等損益	△808,148,393	1,612,209,618
営業収益合計	△807,808,587	1,612,210,298
営業費用		
支払利息	—	411,418
受託者報酬	6,451,258	6,556,231
委託者報酬	55,911,633	56,821,368
その他費用	1,021,276	988,895
営業費用合計	63,384,167	64,777,912
営業利益又は営業損失（△）	△871,192,754	1,547,432,386
経常利益又は経常損失（△）	△871,192,754	1,547,432,386
当期純利益又は当期純損失（△）	△871,192,754	1,547,432,386
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（△）	28,909,690	58,419,410
期首剰余金又は期首欠損金（△）	8,378,221,947	7,621,616,347
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,312,909,567	1,032,666,618
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,312,909,567	1,032,666,618
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,169,412,723	622,618,670
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,169,412,723	622,618,670
分配金	※1 —	※1 —
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,621,616,347	9,520,677,271

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1. ※1 期首元本額	11,167,153,451円	11,311,377,052円
期中追加設定元本額	1,697,863,637円	1,423,621,400円
期中一部解約元本額	1,553,640,036円	920,758,675円
2. 受益権の総数	11,311,377,052口	11,814,239,777口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. ※1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,177,758,096円)及び分配準備積立金(4,205,323,682円)より分配対象収益は8,383,081,778円(1万口当たり7,411.19円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(657,568,400円)、信託約款に規定される収益調整金(4,977,107,064円)及び分配準備積立金(3,886,396,984円)より分配対象収益は9,521,072,448円(1万口当たり8,058.98円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△884,405,348	1,531,599,648
合計	△884,405,348	1,531,599,648

(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13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.6738円	1.8059円
(1万口当たり純資産額)	(16,738円)	(18,059円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年2月27日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	2,899,738,685	6,584,146,658	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,923,494,244	8,862,072,632	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	929,041,840	2,777,928,005	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,429,659,466	2,468,878,931	
親投資信託受益証券 合計		12,181,934,235	20,693,026,226	
合計		12,181,934,235	20,693,026,226	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(平成28年2月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成29年 4 月12日

アセットマネジメント One 株式会社

取締役会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成28年2月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

【D I A M バランス・ファンド＜D C 年金＞3 成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	469,831,116	—
コール・ローン	—	544,167,446
親投資信託受益証券	14,090,232,030	15,968,245,361
流動資産合計	14,560,063,146	16,512,412,807
資産合計	14,560,063,146	16,512,412,807
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,908,084	18,801,216
未払受託者報酬	2,529,402	2,621,230
未払委託者報酬	24,451,297	25,339,003
その他未払費用	400,401	393,103
流動負債合計	35,289,184	47,154,552
負債合計	35,289,184	47,154,552
純資産の部		
元本等		
元本	※1 7,866,965,749	※1 8,020,226,146
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,657,808,213	8,445,032,109
（分配準備積立金）	3,708,200,293	3,746,046,132
元本等合計	14,524,773,962	16,465,258,255
純資産合計	14,524,773,962	16,465,258,255
負債純資産合計	14,560,063,146	16,512,412,807

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
営業収益		
受取利息	277,563	525
有価証券売買等損益	△1,166,735,350	1,717,761,331
営業収益合計	△1,166,457,787	1,717,761,856
営業費用		
支払利息	—	321,113
受託者報酬	5,169,266	5,035,088
委託者報酬	49,970,401	48,673,376
その他費用	818,293	759,454
営業費用合計	55,957,960	54,789,031
営業利益又は営業損失(△)	△1,222,415,747	1,662,972,825
経常利益又は経常損失(△)	△1,222,415,747	1,662,972,825
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,222,415,747	1,662,972,825
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(△)	46,115,348	90,102,598
期首剰余金又は期首欠損金(△)	7,956,536,137	6,657,808,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,471,216,245	1,007,572,466
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,471,216,245	1,007,572,466
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,501,413,074	793,218,797
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,501,413,074	793,218,797
分配金	※1 —	※1 —
期末剰余金又は期末欠損金(△)	6,657,808,213	8,445,032,109

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1. ※1 期首元本額	7,932,612,026円	7,866,965,749円
期中追加設定元本額	1,425,335,822円	1,086,201,353円
期中一部解約元本額	1,490,982,099円	932,940,956円
2. 受益権の総数	7,866,965,749口	8,020,226,146口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. ※1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,264,635,308円)及び分配準備積立金(3,708,200,293円)より分配対象収益は7,972,835,601円(1万口当たり10,134.58円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(443,363,241円)、信託約款に規定される収益調整金(4,825,460,172円)及び分配準備積立金(3,302,682,891円)より分配対象収益は8,571,506,304円(1万口当たり10,687.36円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第13期 自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	第14期 自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△1,241,919,402	1,639,737,447
合計	△1,241,919,402	1,639,737,447

(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13期 平成28年2月25日現在	第14期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.8463円	2.0530円
(1万口当たり純資産額)	(18,463円)	(20,530円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年2月27日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	2,949,143,393	6,696,324,988	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,718,978,952	3,480,293,058	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,088,784,171	3,255,573,549	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,468,558,554	2,536,053,766	
親投資信託受益証券 合計		8,225,465,070	15,968,245,361	
合計		8,225,465,070	15,968,245,361	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型」、「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型」、「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	155,777,350,252円	142,969,149,329円
同期中追加設定元本額	39,180,158,135円	31,828,067,138円
同期中一部解約元本額	51,988,359,058円	49,220,412,351円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	5,696,126,195円	6,296,121,588円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,699,376,937円	1,669,207,881円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,524,503円	5,012,187円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	13,299,631円	12,048,308円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	31,387,977円	23,525,414円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,547,145円	14,468,349円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,269,512円	11,463,058円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,755,011円	14,708,962円
D I A M国内株式インデックスファンド＜D C年金＞	38,084,258,210円	36,554,930,032円

D I A M バランス・ファン ド<DC年金>1安定 型	856,679,246円	816,514,087円
D I A M バランス・ファン ド<DC年金>2安 定・成長型	2,984,860,292円	2,899,738,685円
D I A M バランス・ファン ド<DC年金>3成長 型	3,003,978,386円	2,949,143,393円
D I A M DC バラン ス30インデックスファン ド	368,862,991円	382,332,675円
D I A M DC バラン ス50インデックスファン ド	1,225,176,057円	1,242,482,131円
D I A M DC バラン ス70インデックスファン ド	1,095,709,664円	1,100,776,018円
マネックス資産設計ファン ド<隔月分配型>	60,788,627円	59,530,357円
マネックス資産設計ファン ド<育成型>	1,229,112,654円	1,318,320,660円
マネックス資産設計ファン ド エボリューション	27,113,958円	28,435,219円
D I A M DC 8資産 バランスファンド(新興 国10)	25,953,986円	35,217,725円
D I A M DC 8資産 バランスファンド(新興 国20)	51,128,058円	68,814,338円
D I A M DC 8資産 バランスファンド(新興 国30)	108,496,820円	140,148,670円
投資のソムリエ	1,057,072,049円	1,146,020,551円
クルーズコントロール	292,854,639円	1,099,018,981円
投資のソムリエ<DC年 金>	20,915,913円	36,165,399円
D I A M 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	76,867,727円	114,712,450円
D I A M DC バラン ス・F(成長型)	60,755,446円	122,053,447円
クルーズコントロール< DC年金>	73,605円	405,651円
D I A M コア資産設計フ ァンド(堅実型)	3,971,426円	10,061,702円
D I A M コア資産設計フ ァンド(積極型)	7,035,679円	32,908,087円
投資のソムリエ<DC年 金>リスク抑制型	762,065円	13,983,088円

ダイナミック・ナビゲーション	－円	1,427,701円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	－円	75,809,247円
D I AMアクティブアロケーション私募ファンド (適格機関投資家限定)	199,876,126円	313,751,716円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	113,636,589円	86,560,257円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	492,301,556円	209,554,515円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	474,003,080円	389,570,983円
D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	39,526,570円	26,792,261円
D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	166,681,120円	117,532,264円
D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	39,752,947円	29,346,280円
D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	58,181,496円	30,052,812円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	5,219,612,585円	831,235,040円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,982,163,464円	374,549,335円
D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,997,353,962円	1,451,571,979円
D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,598,529,122円	1,289,496,820円
D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,159,227,906円	3,504,438,578円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	319,046,954円	275,194,302円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	847,270,983円	426,211,367円
D I AM アクサ グローバル バランスファン	999,463,797円	793,276,429円

ド30VA（適格機関投資家限定）		
D I AM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	4,058,272,373円	3,115,298,558円
D I AMグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	46,003,219円	13,741,300円
D I AM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,326,335,640円	1,034,605,688円
D I AM世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	5,832,541,011円	4,854,751,930円
D I AM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	20,951,975,557円	18,487,572,950円
D I AM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	793,931,787円	674,423,695円
D I AM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,393,749,966円	2,103,188,596円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	13,362,055,990円	11,713,549,624円
D I AMバランス30VA（適格機関投資家限定）	4,455,809円	6,605,415円
D I AMバランス50VA（適格機関投資家限定）	7,115,578円	81,551円
D I AMバランス70VA（適格機関投資家限定）	5,949,384円	4,672,150円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	12,007,265,860円	10,473,010,652円
D I AM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	112,585,022円	94,419,937円
D I AM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	42,353,931円	33,859,295円
D I AMバランス20VA（適格機関投資家限定）	39,006,138円	35,633,726円
D I AMバランス40VA（適格機関投資家限定）	12,076,611円	73,509円

	D I A M バランス 6 0 V A (適格機関投資家限 定)	120,493円	119,539円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 2 1 2) (適格機関 投資家限定)	670,998,289円	612,913,713円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 3 0 3) (適格機関 投資家限定)	1,887,540,594円	1,622,373,744円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 3 0 6) (適格機関 投資家限定)	2,485,634,300円	2,159,696,264円
	D I A M 世界アセットバ ランスファンド 7 V A (1 3 0 9) (適格機関 投資家限定)	94,839,111円	91,571,301円
	計	142,969,149,329円	125,576,804,116円
2.	受益権の総数	142,969,149,329口	125,576,804,116口
3.	※2 差入代用有価証券	株式 2,965,500,000円	株式 3,203,000,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	△14,881,124,320	3,265,212,730
合計	△14,881,124,320	3,265,212,730

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月9日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月8日から平成29年2月27日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成29年2月27日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,945,500,000	—	3,762,720,000	△182,780,000	4,740,289,900	—	4,701,690,000	△38,599,900
合計	3,945,500,000	—	3,762,720,000	△182,780,000	4,740,289,900	—	4,701,690,000	△38,599,900

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年2月27日現在

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

西松建設	162,000	585.00	94,770,000	
三井住友建設	538,300	125.00	67,287,500	
大豊建設	51,000	517.00	26,367,000	
前田建設工業	87,000	1,000.00	87,000,000	
佐田建設	9,800	426.00	4,174,800	
ナカノフドー建設	10,800	592.00	6,393,600	
奥村組	115,000	705.00	81,075,000	
東鉄工業	16,900	3,070.00	51,883,000	
イチケン	13,000	500.00	6,500,000	
浅沼組	45,000	361.00	16,245,000	
戸田建設	163,000	684.00	111,492,000	
熊谷組	221,000	307.00	67,847,000	
青木あすなろ建設	9,200	831.00	7,645,200	
北野建設	29,000	319.00	9,251,000	
植木組	18,000	260.00	4,680,000	
三井ホーム	18,000	584.00	10,512,000	
矢作建設工業	19,200	1,032.00	19,814,400	
ピーエス三菱	14,900	418.00	6,228,200	
日本ハウスホールディングス	28,700	509.00	14,608,300	
大東建託	51,700	15,735.00	813,499,500	
新日本建設	16,800	940.00	15,792,000	
N I P P O	33,000	2,161.00	71,313,000	
東亜道路工業	27,000	342.00	9,234,000	
前田道路	44,000	2,025.00	89,100,000	
日本道路	42,000	483.00	20,286,000	
東亜建設工業	11,400	1,971.00	22,469,400	
若築建設	82,000	152.00	12,464,000	
東洋建設	40,500	418.00	16,929,000	
五洋建設	156,200	531.00	82,942,200	
大林道路	14,600	679.00	9,913,400	
世紀東急工業	20,400	511.00	10,424,400	
福田組	23,000	1,041.00	23,943,000	
日本ドライケミカル	1,700	2,301.00	3,911,700	
住友林業	96,700	1,632.00	157,814,400	
日本基礎技術	15,800	361.00	5,703,800	
日成ビルド工業	42,000	557.00	23,394,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	74,000	79.00	5,846,000	
巴コーポレーション	17,600	364.00	6,406,400	
パナホーム	53,000	1,040.00	55,120,000	
大和ハウス工業	415,400	3,104.00	1,289,401,600	
ライト工業	27,100	1,139.00	30,866,900	
積水ハウス	442,400	1,800.50	796,541,200	
日特建設	12,200	452.00	5,514,400	
北陸電気工事	6,900	875.00	6,037,500	
ユアテック	22,000	784.00	17,248,000	
西部電気工業	2,400	2,284.00	5,481,600	
四電工	6,000	433.00	2,598,000	

中電工	17,700	2,363.00	41,825,100	
関電工	56,000	923.00	51,688,000	
きんでん	93,600	1,499.00	140,306,400	
東京エネシス	15,000	943.00	14,145,000	
トーエネック	20,000	535.00	10,700,000	
住友電設	9,700	1,284.00	12,454,800	
日本電設工業	22,900	1,938.00	44,380,200	
協和エクシオ	55,100	1,584.00	87,278,400	
新日本空調	10,900	1,350.00	14,715,000	
日本工営	8,800	2,714.00	23,883,200	
N D S	2,200	2,911.00	6,404,200	
九電工	27,300	2,829.00	77,231,700	
三機工業	31,200	969.00	30,232,800	
日揮	131,200	2,015.00	264,368,000	
中外炉工業	43,000	242.00	10,406,000	
ヤマト	12,900	541.00	6,978,900	
太平電業	19,000	1,078.00	20,482,000	
高砂熱学工業	38,700	1,633.00	63,197,100	
三晃金属工業	1,300	3,285.00	4,270,500	
N E C ネットエスアイ	13,600	2,162.00	29,403,200	
朝日工業社	3,200	3,140.00	10,048,000	
明星工業	25,600	635.00	16,256,000	
大気社	18,600	2,864.00	53,270,400	
ダイダン	19,000	984.00	18,696,000	
日比谷総合設備	15,700	1,695.00	26,611,500	
東芝プラントシステム	22,800	1,570.00	35,796,000	
日本製粉	41,900	1,688.00	70,727,200	
日清製粉グループ本社	154,300	1,696.00	261,692,800	
日東富士製粉	800	4,030.00	3,224,000	
昭和産業	58,000	608.00	35,264,000	
鳥越製粉	11,600	799.00	9,268,400	
中部飼料	15,500	1,162.00	18,011,000	
フィード・ワン	85,700	198.00	16,968,600	
東洋精糖	23,000	118.00	2,714,000	
日本甜菜製糖	7,300	2,494.00	18,206,200	
三井製糖	10,000	2,724.00	27,240,000	
塩水港精糖	16,300	260.00	4,238,000	
日新製糖	6,000	1,905.00	11,430,000	
ネクスト	32,500	743.00	24,147,500	
ジェイエイシーリクルートメント	8,100	1,602.00	12,976,200	
日本M&Aセンター	37,900	3,445.00	130,565,500	
中広	1,400	698.00	977,200	
タケエイ	11,600	1,066.00	12,365,600	
トラスト・テック	5,400	1,740.00	9,396,000	
コシダカホールディングス	4,500	2,394.00	10,773,000	
パソナグループ	11,400	804.00	9,165,600	
C D S	3,200	1,016.00	3,251,200	

リンクアンドモチベーション	29,800	505.00	15,049,000	
G C A	11,700	955.00	11,173,500	
エス・エム・エス	18,500	2,492.00	46,102,000	
テンプホールディングス	101,400	1,898.00	192,457,200	
リニカル	7,800	1,489.00	11,614,200	
クックパッド	29,300	960.00	28,128,000	
エスクリ	4,700	896.00	4,211,200	
アイ・ケイ・ケイ	6,000	736.00	4,416,000	
森永製菓	27,500	5,120.00	140,800,000	
中村屋	3,400	5,150.00	17,510,000	
江崎グリコ	35,200	5,450.00	191,840,000	
名糖産業	6,300	1,397.00	8,801,100	
不二家	81,000	226.00	18,306,000	
山崎製パン	103,100	2,237.00	230,634,700	
第一屋製パン	23,000	126.00	2,898,000	
モロゾフ	22,000	507.00	11,154,000	
亀田製菓	7,900	5,000.00	39,500,000	
寿スピリッツ	10,100	2,669.00	26,956,900	
カルビー	57,400	3,810.00	218,694,000	
森永乳業	126,000	878.00	110,628,000	
六甲バター	6,300	2,420.00	15,246,000	
ヤクルト本社	75,500	6,150.00	464,325,000	
明治ホールディングス	83,300	9,070.00	755,531,000	
雪印メグミルク	30,400	3,080.00	93,632,000	
プリマハム	89,000	456.00	40,584,000	
日本ハム	95,000	2,995.00	284,525,000	
林兼産業	4,700	867.00	4,074,900	
丸大食品	68,000	488.00	33,184,000	
S F o o d s	7,600	3,175.00	24,130,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	81,300	1,119.00	90,974,700	
学情	5,500	1,224.00	6,732,000	
スタジオアリス	5,400	2,260.00	12,204,000	
シミックホールディングス	6,700	1,479.00	9,909,300	
システナ	9,900	1,625.00	16,087,500	
N J S	3,000	1,419.00	4,257,000	
デジタルアーツ	5,500	3,305.00	18,177,500	
新日鉄住金ソリューションズ	20,700	2,250.00	46,575,000	
総合警備保障	47,700	4,245.00	202,486,500	
キューブシステム	5,600	683.00	3,824,800	
いちご	117,800	359.00	42,290,200	
日本駐車場開発	149,600	150.00	22,440,000	
コア	5,300	1,336.00	7,080,800	
カカコム	93,600	1,627.00	152,287,200	
アイロムグループ	3,900	1,312.00	5,116,800	
ルネサンス	6,800	1,798.00	12,226,400	
ディップ	17,000	2,258.00	38,386,000	
S B S ホールディングス	12,400	817.00	10,130,800	

オブトホールディング	9,300	947.00	8,807,100	
新日本科学	13,900	571.00	7,936,900	
ツクイ	31,200	699.00	21,808,800	
キャリアデザインセンター	2,800	1,149.00	3,217,200	
エムスリー	113,600	2,864.00	325,350,400	
ツカダ・グローバルホールディング	9,600	622.00	5,971,200	
アウトソーシング	7,500	3,740.00	28,050,000	
ウェルネット	9,900	1,313.00	12,998,700	
ワールドホールディングス	3,000	1,988.00	5,964,000	
ディー・エヌ・エー	58,800	2,534.00	148,999,200	
博報堂DYホールディングス	181,800	1,359.00	247,066,200	
ぐるなび	19,000	2,236.00	42,484,000	
エスアールジータカミヤ	14,300	582.00	8,322,600	
ジャパンベストレスキューシステム	17,300	256.00	4,428,800	
ファンコミュニケーションズ	33,400	775.00	25,885,000	
ライク	2,800	2,584.00	7,235,200	
WDBホールディングス	4,800	1,330.00	6,384,000	
ティア	6,500	739.00	4,803,500	
バリューコマース	12,900	404.00	5,211,600	
インフォマート	55,700	590.00	32,863,000	
サッポロホールディングス	46,100	2,822.00	130,094,200	
アサヒグループホールディングス	263,900	4,026.00	1,062,461,400	
麒麟ホールディングス	605,700	1,947.50	1,179,600,750	
宝ホールディングス	102,000	1,142.00	116,484,000	
オエノンホールディングス	37,000	252.00	9,324,000	
養命酒製造	4,500	1,883.00	8,473,500	
コカ・コーラウエスト	47,700	3,385.00	161,464,500	
コカ・コーライーストジャパン	54,800	2,523.00	138,260,400	
サントリー食品インターナショナル	96,400	4,740.00	456,936,000	
ダイドーグループホールディングス	6,500	5,720.00	37,180,000	
伊藤園	41,800	3,835.00	160,303,000	
キーコーヒー	12,500	2,172.00	27,150,000	
ユニカフェ	4,200	978.00	4,107,600	
ジャパンフーズ	2,100	1,387.00	2,912,700	
日清オイリオグループ	81,000	581.00	47,061,000	
不二製油グループ本社	37,600	2,469.00	92,834,400	
J-オイルミルズ	6,600	4,140.00	27,324,000	
ローソン	43,000	7,740.00	332,820,000	
サンエー	9,300	5,160.00	47,988,000	
カワチ薬品	9,600	2,993.00	28,732,800	
エービーシー・マート	22,500	6,730.00	151,425,000	
ハードオフコーポレーション	5,500	1,164.00	6,402,000	
高千穂交易	4,900	1,075.00	5,267,500	
アスクル	12,900	3,220.00	41,538,000	
ゲオホールディングス	20,700	1,374.00	28,441,800	
アダストリア	19,000	2,864.00	54,416,000	
ジーフット	7,500	776.00	5,820,000	

シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1,900	731.00	1,388,900	
伊藤忠食品	3,100	4,520.00	14,012,000	
くらコーポレーション	8,100	4,605.00	37,300,500	
キャンドウ	6,600	1,806.00	11,919,600	
エレマテック	4,900	1,935.00	9,481,500	
パルグループホールディングス	6,300	2,721.00	17,142,300	
JALUX	4,000	2,258.00	9,032,000	
エディオン	48,000	1,019.00	48,912,000	
あらた	5,600	2,899.00	16,234,400	
サーラコーポレーション	15,500	647.00	10,028,500	
ワッツ	5,500	1,255.00	6,902,500	
トーメンデバイス	1,900	2,215.00	4,208,500	
ハローズ	4,100	2,271.00	9,311,100	
J Pホールディングス	37,800	253.00	9,563,400	
あみやき亭	2,400	4,030.00	9,672,000	
東京エレクトロン デバイス	4,600	1,630.00	7,498,000	
ひらまつ	17,200	672.00	11,558,400	
フィールズ	9,400	1,251.00	11,759,400	
双日	731,200	291.00	212,779,200	
ゲンキー	2,500	6,440.00	16,100,000	
アルフレッサ ホールディングス	146,600	2,012.00	294,959,200	
大黒天物産	3,000	5,060.00	15,180,000	
ハニーズ	10,900	1,114.00	12,142,600	
ファーマライズホールディングス	3,100	518.00	1,605,800	
キッコーマン	98,000	3,405.00	333,690,000	
味の素	289,800	2,256.00	653,788,800	
キュービー	71,600	2,994.00	214,370,400	
ハウス食品グループ本社	52,100	2,411.00	125,613,100	
カゴメ	50,600	2,883.00	145,879,800	
焼津水産化学工業	7,000	1,240.00	8,680,000	
アリアケジャパン	11,500	6,230.00	71,645,000	
ピエトロ	1,700	1,650.00	2,805,000	
エバラ食品工業	3,600	2,119.00	7,628,400	
ニチレイ	69,300	2,616.00	181,288,800	
横浜冷凍	30,900	1,077.00	33,279,300	
東洋水産	69,200	4,105.00	284,066,000	
イートアンド	1,700	2,311.00	3,928,700	
日清食品ホールディングス	55,000	6,300.00	346,500,000	
永谷園ホールディングス	7,000	1,422.00	9,954,000	
一正蒲鉾	5,000	1,212.00	6,060,000	
フジッコ	13,700	2,423.00	33,195,100	
ロック・フィールド	14,700	1,747.00	25,680,900	
日本たばこ産業	779,500	3,778.00	2,944,951,000	
ケンコーマヨネーズ	5,000	2,727.00	13,635,000	
わらべや日洋ホールディングス	8,300	2,503.00	20,774,900	
なとり	7,200	1,943.00	13,989,600	
北の達人コーポレーション	3,100	620.00	1,922,000	

ユーグレナ	45,300	1,218.00	55,175,400	
片倉工業	16,500	1,449.00	23,908,500	
グンゼ	98,000	413.00	40,474,000	
ヒューリック	258,400	1,068.00	275,971,200	
神栄	18,000	175.00	3,150,000	
山下医科器械	1,100	1,809.00	1,989,900	
ラサ商事	5,800	705.00	4,089,000	
アルペン	9,500	1,971.00	18,724,500	
ラクーン	5,600	507.00	2,839,200	
クオール	14,000	1,568.00	21,952,000	
アルコニックス	7,100	1,746.00	12,396,600	
神戸物産	6,700	3,870.00	25,929,000	
ジェイアイエヌ	8,400	5,950.00	49,980,000	
ビックカメラ	71,100	1,085.00	77,143,500	
D C Mホールディングス	75,200	986.00	74,147,200	
M o n o t a R O	43,900	3,235.00	142,016,500	
東京一番フーズ	2,400	583.00	1,399,200	
ダイヤモンドダイニング	2,800	1,642.00	4,597,600	
あい ホールディングス	17,600	2,347.00	41,307,200	
ディーブイエックス	4,500	1,305.00	5,872,500	
きちり	3,600	657.00	2,365,200	
アークランドサービスホールディングス	3,900	3,070.00	11,973,000	
J. フロント リテイリング	156,700	1,717.00	269,053,900	
ドトール・日レスホールディングス	21,700	2,144.00	46,524,800	
マツモトキヨシホールディングス	23,400	5,260.00	123,084,000	
ブロンコビリー	6,500	2,811.00	18,271,500	
スタートトゥデイ	113,100	2,346.00	265,332,600	
トレジャー・ファクトリー	3,700	802.00	2,967,400	
物語コーポレーション	3,300	4,600.00	15,180,000	
ココカラファイン	12,900	4,720.00	60,888,000	
三越伊勢丹ホールディングス	246,400	1,422.00	350,380,800	
東洋紡	521,000	195.00	101,595,000	
ユニチカ	361,000	93.00	33,573,000	
富士紡ホールディングス	6,400	3,235.00	20,704,000	
日清紡ホールディングス	69,600	1,158.00	80,596,800	
倉敷紡績	132,000	243.00	32,076,000	
ダイワボウホールディングス	105,000	298.00	31,290,000	
シキボウ	72,000	150.00	10,800,000	
日東紡績	106,000	489.00	51,834,000	
トヨタ紡織	43,900	2,467.00	108,301,300	
マクニカ・富士エレホールディングス	22,900	1,570.00	35,953,000	
H a m e e	1,900	1,003.00	1,905,700	
ウエルシアホールディングス	24,600	3,140.00	77,244,000	
クリエイトSDホールディングス	18,200	2,586.00	47,065,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,300	1,036.00	24,138,800	

八洲電機	9,800	645.00	6,321,000	
U K C ホールディングス	8,000	2,173.00	17,384,000	
丸善 C H I ホールディングス	14,800	366.00	5,416,800	
O C H I ホールディングス	3,300	1,393.00	4,596,900	
T O K A I ホールディングス	54,600	827.00	45,154,200	
ミサワ	1,800	461.00	829,800	
エー・ピーカンパニー	2,300	863.00	1,984,900	
三洋貿易	6,800	1,802.00	12,253,600	
チムニー	3,400	2,858.00	9,717,200	
シュッピン	4,700	1,587.00	7,458,900	
ビューティガレージ	1,100	1,259.00	1,384,900	
ウイン・パートナーズ	9,000	974.00	8,766,000	
ネクステージ	2,200	2,795.00	6,149,000	
ジョイフル本田	20,100	3,485.00	70,048,500	
鳥貴族	3,100	2,409.00	7,467,900	
キリン堂ホールディングス	4,100	832.00	3,411,200	
ホットランド	4,900	1,066.00	5,223,400	
すかいらく	53,200	1,624.00	86,396,800	
綿半ホールディングス	5,000	1,655.00	8,275,000	
日本毛織	37,000	895.00	33,115,000	
ダイトウボウ	20,000	76.00	1,520,000	
トーア紡コーポレーション	5,500	542.00	2,981,000	
ダイドーリミテッド	15,000	457.00	6,855,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	40,900	1,009.00	41,268,100	
三栄建築設計	5,000	1,517.00	7,585,000	
野村不動産ホールディングス	82,200	1,904.00	156,508,800	
三重交通グループホールディングス	22,100	391.00	8,641,100	
サムティ	10,000	1,145.00	11,450,000	
ディア・ライフ	8,800	395.00	3,476,000	
エー・ディー・ワークス	116,100	42.00	4,876,200	
日本商業開発	6,900	1,922.00	13,261,800	
プレサンスコーポレーション	19,300	1,375.00	26,537,500	
ユニゾホールディングス	10,200	2,945.00	30,039,000	
T H E グローバル社	4,900	457.00	2,239,300	
日本管理センター	8,900	1,356.00	12,068,400	
サンセイランディック	2,700	801.00	2,162,700	
エストラスト	2,400	709.00	1,701,600	
フージャースホールディングス	16,100	636.00	10,239,600	
オープンハウス	17,900	2,666.00	47,721,400	
東急不動産ホールディングス	299,500	637.00	190,781,500	
飯田グループホールディングス	103,300	1,896.00	195,856,800	
ムゲンエステート	4,000	737.00	2,948,000	
帝国繊維	13,800	1,730.00	23,874,000	
ブックオフコーポレーション	7,300	843.00	6,153,900	
日本コークス工業	107,000	102.00	10,914,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	785.00	3,061,500	

ミタチ産業	3,300	643.00	2,121,900	
B E E N O S	1,500	1,453.00	2,179,500	
あさひ	9,200	1,283.00	11,803,600	
日本調剤	4,400	3,890.00	17,116,000	
コスモス薬品	6,200	21,360.00	132,432,000	
シップヘルスケアホールディングス	23,800	3,150.00	74,970,000	
トーエル	6,200	952.00	5,902,400	
一六堂	3,300	395.00	1,303,500	
ソフトクリエイトホールディングス	6,100	1,342.00	8,186,200	
セブン&アイ・ホールディングス	518,500	4,407.00	2,285,029,500	
薬王堂	6,200	2,444.00	15,152,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	33,300	976.00	32,500,800	
明治電機工業	4,300	1,232.00	5,297,600	
ツルハホールディングス	24,800	10,400.00	257,920,000	
デリカフーズ	2,900	1,076.00	3,120,400	
スターティア	2,600	541.00	1,406,600	
サンマルクホールディングス	8,000	3,390.00	27,120,000	
フェリシモ	3,600	1,033.00	3,718,800	
トリドールホールディングス	15,200	2,318.00	35,233,600	
帝人	107,400	2,151.00	231,017,400	
東レ	954,000	995.00	949,230,000	
クラレ	221,200	1,691.00	374,049,200	
旭化成	820,000	1,084.50	889,290,000	
サカイオーベックス	3,300	1,899.00	6,266,700	
稲葉製作所	7,100	1,337.00	9,492,700	
宮地エンジニアリンググループ	38,000	234.00	8,892,000	
トーカロ	8,600	2,641.00	22,712,600	
アルファ	4,500	1,353.00	6,088,500	
S U M C O	137,200	1,652.00	226,654,400	
川田テクノロジーズ	2,500	7,640.00	19,100,000	
ファーストブラザーズ	1,300	1,710.00	2,223,000	
シーアールイー	1,800	1,765.00	3,177,000	
住江織物	33,000	284.00	9,372,000	
日本フエルト	7,900	520.00	4,108,000	
イチカワ	9,000	301.00	2,709,000	
エコナックホールディングス	44,000	53.00	2,332,000	
日東製網	1,500	1,908.00	2,862,000	
芦森工業	29,000	166.00	4,814,000	
アツギ	108,000	132.00	14,256,000	
コメダホールディングス	16,700	1,841.00	30,744,700	
サツドラホールディングス	1,700	2,030.00	3,451,000	
ダイユー・リックホールディングス	4,200	751.00	3,154,200	
パロックジャパンリミテッド	7,300	1,453.00	10,606,900	
クスリのアオキホールディングス	9,800	4,835.00	47,383,000	
ダイニック	26,000	190.00	4,940,000	
共和レザー	7,700	924.00	7,114,800	

セーレン	32,800	1,463.00	47,986,400	
ソトー	5,000	1,158.00	5,790,000	
東海染工	19,000	149.00	2,831,000	
小松精練	18,600	723.00	13,447,800	
ワコールホールディングス	78,000	1,411.00	110,058,000	
ホギメディカル	8,300	6,680.00	55,444,000	
レナウン	35,700	116.00	4,141,200	
クラウディア	3,400	551.00	1,873,400	
T S I ホールディングス	54,100	775.00	41,927,500	
T I S	41,100	2,717.00	111,668,700	
ネオス	3,900	449.00	1,751,100	
電算システム	4,300	1,695.00	7,288,500	
グリー	75,500	702.00	53,001,000	
コーエーテクモホールディングス	29,400	2,244.00	65,973,600	
三菱総合研究所	4,800	3,145.00	15,096,000	
ボルテージ	2,500	1,010.00	2,525,000	
電算	1,500	2,488.00	3,732,000	
A G S	2,600	2,022.00	5,257,200	
ファインデックス	9,200	1,076.00	9,899,200	
ヒト・コミュニケーションズ	2,800	1,740.00	4,872,000	
ブレインパッド	1,900	1,119.00	2,126,100	
K L a b	23,700	893.00	21,164,100	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,900	1,097.00	9,763,300	
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	930.00	1,953,000	
ネクソン	135,600	1,897.00	257,233,200	
アイスタイル	26,100	962.00	25,108,200	
エムアップ	3,700	936.00	3,463,200	
エイチーム	6,900	2,188.00	15,097,200	
テクノスジャパン	9,600	1,183.00	11,356,800	
e n i s h	3,800	570.00	2,166,000	
コロプラ	34,500	1,056.00	36,432,000	
モバイルクリエイト	8,600	413.00	3,551,800	
オルトプラス	5,300	788.00	4,176,400	
ブロードリーフ	30,600	672.00	20,563,200	
ハーツユナイテッドグループ	6,600	1,461.00	9,642,600	
メディアドゥ	2,700	1,665.00	4,495,500	
ブイキューブ	6,900	630.00	4,347,000	
サイバーリンクス	2,000	1,032.00	2,064,000	
ディー・エル・イー	3,800	622.00	2,363,600	
フィックスターズ	1,800	3,500.00	6,300,000	
VOYAGE GROUP	4,300	1,808.00	7,774,400	
オブティム	1,100	5,540.00	6,094,000	
セレス	2,200	1,660.00	3,652,000	
特種東海製紙	7,700	4,265.00	32,840,500	
ベリサーブ	1,500	2,960.00	4,440,000	
ティーガイア	12,400	1,928.00	23,907,200	

日本アジアグループ	14,100	418.00	5,893,800	
豆蔵ホールディングス	9,200	876.00	8,059,200	
テクマトリックス	7,800	1,183.00	9,227,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	259,900	259.00	67,314,100	
GMOペイメントゲートウェイ	10,200	6,440.00	65,688,000	
ザッパラス	7,500	457.00	3,427,500	
インターネットイニシアティブ	18,300	2,023.00	37,020,900	
さくらインターネット	8,800	998.00	8,782,400	
GMOクラウド	2,800	1,860.00	5,208,000	
SRAホールディングス	6,600	2,890.00	19,074,000	
MINORIソリューションズ	2,700	1,371.00	3,701,700	
システムインテグレータ	2,000	680.00	1,360,000	
朝日ネット	11,700	520.00	6,084,000	
アドソル日進	2,500	1,283.00	3,207,500	
フリービット	6,900	949.00	6,548,100	
コムチュア	2,100	3,630.00	7,623,000	
サイバーコム	1,600	1,084.00	1,734,400	
王子ホールディングス	514,000	538.00	276,532,000	
日本製紙	58,900	2,041.00	120,214,900	
三菱製紙	18,900	785.00	14,836,500	
北越紀州製紙	73,500	769.00	56,521,500	
中越パルプ工業	52,000	238.00	12,376,000	
巴川製紙所	21,000	250.00	5,250,000	
大王製紙	52,500	1,389.00	72,922,500	
メディカル・データ・ビジョン	2,100	2,819.00	5,919,900	
gumi	12,800	1,247.00	15,961,600	
PCIホールディングス	1,500	2,844.00	4,266,000	
パイプドHD	1,800	1,109.00	1,996,200	
オーブンドア	1,200	3,215.00	3,858,000	
LINE	20,700	3,805.00	78,763,500	
レンゴー	127,000	644.00	81,788,000	
トーモク	42,000	329.00	13,818,000	
ザ・パック	9,300	3,070.00	28,551,000	
AOI TYO HOLDINGS	10,200	836.00	8,527,200	
昭和電工	87,500	1,963.00	171,762,500	
住友化学	968,000	626.00	605,968,000	
住友精化	5,500	4,725.00	25,987,500	
日産化学工業	72,000	3,695.00	266,040,000	
ラサ工業	51,000	149.00	7,599,000	
クレハ	9,900	4,705.00	46,579,500	
多木化学	8,000	904.00	7,232,000	
テイカ	20,000	683.00	13,660,000	
石原産業	23,600	1,106.00	26,101,600	
片倉コープアグリ	17,000	253.00	4,301,000	
日東エフシー	7,700	968.00	7,453,600	
日本曹達	79,000	653.00	51,587,000	

東ソー	380,000	965.00	366,700,000	
トクヤマ	205,000	534.00	109,470,000	
セントラル硝子	134,000	510.00	68,340,000	
東亜合成	82,200	1,262.00	103,736,400	
大阪ソーダ	57,000	499.00	28,443,000	
関東電化工業	27,000	1,081.00	29,187,000	
デンカ	272,000	586.00	159,392,000	
イビデン	87,800	1,812.00	159,093,600	
信越化学工業	235,800	9,560.00	2,254,248,000	
日本カーバイド工業	45,000	159.00	7,155,000	
堺化学工業	49,000	413.00	20,237,000	
エア・ウォーター	108,400	2,092.00	226,772,800	
大陽日酸	101,300	1,385.00	140,300,500	
日本化学工業	49,000	244.00	11,956,000	
日本パーカライジング	67,100	1,350.00	90,585,000	
高压ガス工業	19,500	738.00	14,391,000	
チタン工業	16,000	190.00	3,040,000	
四国化成工業	19,000	1,158.00	22,002,000	
戸田工業	26,000	281.00	7,306,000	
ステラ ケミファ	6,200	3,245.00	20,119,000	
保土谷化学工業	4,600	3,615.00	16,629,000	
日本触媒	20,700	7,320.00	151,524,000	
大日精化工業	54,000	697.00	37,638,000	
カネカ	177,000	872.00	154,344,000	
協和発酵キリン	157,300	1,677.00	263,792,100	
三菱瓦斯化学	122,500	2,309.00	282,852,500	
三井化学	597,000	568.00	339,096,000	
J S R	132,100	1,919.00	253,499,900	
東京応化工業	24,600	3,650.00	89,790,000	
大阪有機化学工業	8,700	966.00	8,404,200	
三菱ケミカルホールディングス	885,600	864.00	765,158,400	
KHネオケム	16,100	1,388.00	22,346,800	
ダイセル	177,300	1,360.00	241,128,000	
住友ベークライト	116,000	665.00	77,140,000	
積水化学工業	298,400	1,847.00	551,144,800	
日本ゼオン	111,000	1,246.00	138,306,000	
アイカ工業	42,100	2,868.00	120,742,800	
宇部興産	662,000	281.00	186,022,000	
積水樹脂	20,300	1,863.00	37,818,900	
タキロン	28,000	543.00	15,204,000	
旭有機材	42,000	240.00	10,080,000	
日立化成	73,100	3,150.00	230,265,000	
ニチバン	13,000	996.00	12,948,000	
リケンテクノス	28,400	528.00	14,995,200	
大倉工業	32,000	558.00	17,856,000	
積水化成品工業	18,200	815.00	14,833,000	
群栄化学工業	3,100	3,730.00	11,563,000	

タイガースポリマー	6,500	783.00	5,089,500	
ミライアル	5,000	886.00	4,430,000	
ダイキアクシス	2,200	1,375.00	3,025,000	
ダイキョーニシカワ	23,100	1,499.00	34,626,900	
日本化薬	85,000	1,543.00	131,155,000	
カーリットホールディングス	12,300	611.00	7,515,300	
E P S ホールディングス	16,300	1,544.00	25,167,200	
レグス	3,000	785.00	2,355,000	
プレステージ・インターナショナル	18,700	909.00	16,998,300	
フェイス	3,400	1,367.00	4,647,800	
アミューズ	7,300	2,049.00	14,957,700	
野村総合研究所	92,600	3,900.00	361,140,000	
ドリームインキュベータ	4,000	2,084.00	8,336,000	
サイバネットシステム	10,200	774.00	7,894,800	
クイック	6,800	1,224.00	8,323,200	
T A C	7,700	229.00	1,763,300	
C E ホールディングス	1,800	1,134.00	2,041,200	
ケネディクス	166,200	442.00	73,460,400	
電通	146,100	6,180.00	902,898,000	
インテージホールディングス	7,100	2,238.00	15,889,800	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,300	939.00	5,915,700	
東邦システムサイエンス	4,300	657.00	2,825,100	
ぴあ	4,000	2,930.00	11,720,000	
イオンファンタジー	3,900	3,010.00	11,739,000	
ソースネクスト	6,800	622.00	4,229,600	
シーティーエス	7,200	812.00	5,846,400	
ネクシィーズグループ	4,700	1,600.00	7,520,000	
メディカルシステムネットワーク	14,100	440.00	6,204,000	
日本精化	11,000	923.00	10,153,000	
扶桑化学工業	9,400	3,185.00	29,939,000	
A D E K A	56,500	1,565.00	88,422,500	
日油	106,000	1,224.00	129,744,000	
ミヨシ油脂	50,000	142.00	7,100,000	
新日本理化	21,600	153.00	3,304,800	
ハリマ化成グループ	11,300	796.00	8,994,800	
花王	333,900	5,780.00	1,929,942,000	
第一工業製薬	29,000	443.00	12,847,000	
日華化学	4,100	1,222.00	5,010,200	
三洋化成工業	8,200	4,635.00	38,007,000	
武田薬品工業	492,900	5,325.00	2,624,692,500	
アステラス製薬	1,343,100	1,523.00	2,045,541,300	
大日本住友製薬	93,100	1,992.00	185,455,200	
塩野義製薬	177,900	5,507.00	979,695,300	
田辺三菱製薬	153,200	2,330.00	356,956,000	
わかもと製薬	7,000	249.00	1,743,000	
あすか製薬	14,300	1,741.00	24,896,300	
日本新薬	30,100	6,130.00	184,513,000	

バイオフェルミン製薬	2, 200	3, 145. 00	6, 919, 000	
中外製薬	130, 900	3, 720. 00	486, 948, 000	
科研製薬	24, 500	6, 020. 00	147, 490, 000	
エーザイ	161, 800	6, 285. 00	1, 016, 913, 000	
理研ビタミン	4, 200	4, 315. 00	18, 123, 000	
ロート製薬	64, 400	2, 161. 00	139, 168, 400	
小野薬品工業	298, 600	2, 502. 50	747, 246, 500	
久光製薬	37, 100	6, 070. 00	225, 197, 000	
有機合成薬品工業	9, 400	272. 00	2, 556, 800	
持田製薬	9, 000	8, 490. 00	76, 410, 000	
参天製薬	237, 300	1, 634. 00	387, 748, 200	
扶桑薬品工業	4, 500	2, 876. 00	12, 942, 000	
日本ケミファ	1, 800	5, 540. 00	9, 972, 000	
ツムラ	44, 100	3, 315. 00	146, 191, 500	
日医工	30, 700	1, 702. 00	52, 251, 400	
テルモ	192, 400	3, 905. 00	751, 322, 000	
みらかホールディングス	33, 500	5, 190. 00	173, 865, 000	
キッセイ薬品工業	23, 300	2, 854. 00	66, 498, 200	
生化学工業	24, 400	1, 765. 00	43, 066, 000	
栄研化学	11, 000	3, 040. 00	33, 440, 000	
日水製薬	5, 300	1, 407. 00	7, 457, 100	
鳥居薬品	9, 000	2, 900. 00	26, 100, 000	
J C Rファーマ	10, 100	2, 751. 00	27, 785, 100	
東和薬品	6, 000	5, 470. 00	32, 820, 000	
富士製薬工業	4, 300	3, 120. 00	13, 416, 000	
沢井製薬	22, 300	6, 100. 00	136, 030, 000	
ゼリア新薬工業	26, 900	1, 743. 00	46, 886, 700	
第一三共	386, 900	2, 575. 50	996, 460, 950	
キョーリン製薬ホールディングス	32, 100	2, 371. 00	76, 109, 100	
大幸薬品	6, 600	1, 884. 00	12, 434, 400	
ダイト	7, 400	2, 321. 00	17, 175, 400	
大塚ホールディングス	282, 700	5, 141. 00	1, 453, 360, 700	
大正製薬ホールディングス	28, 100	9, 150. 00	257, 115, 000	
ペプチドリーム	24, 600	5, 350. 00	131, 610, 000	
大日本塗料	75, 000	230. 00	17, 250, 000	
日本ペイントホールディングス	101, 500	3, 625. 00	367, 937, 500	
関西ペイント	138, 100	2, 172. 00	299, 953, 200	
神東塗料	10, 000	219. 00	2, 190, 000	
中国塗料	37, 700	845. 00	31, 856, 500	
日本特殊塗料	9, 200	1, 752. 00	16, 118, 400	
藤倉化成	17, 900	665. 00	11, 903, 500	
太陽ホールディングス	10, 700	4, 810. 00	51, 467, 000	
D I C	51, 900	3, 960. 00	205, 524, 000	
サカタインクス	26, 800	1, 574. 00	42, 183, 200	
東洋インキ S C ホールディングス	130, 000	556. 00	72, 280, 000	
T & K T O K A	9, 500	1, 103. 00	10, 478, 500	
アルプス技研	5, 300	3, 120. 00	16, 536, 000	

サニックス	22,000	189.00	4,158,000	
ダイオーズ	2,600	1,070.00	2,782,000	
日本空調サービス	12,800	662.00	8,473,600	
オリエンタルランド	141,700	6,324.00	896,110,800	
フォーカスシステムズ	5,100	617.00	3,146,700	
ダスキン	33,600	2,447.00	82,219,200	
パーク24	62,800	3,145.00	197,506,000	
明光ネットワークジャパン	16,300	1,219.00	19,869,700	
ファルコホールディングス	6,300	1,502.00	9,462,600	
クレスコ	2,900	2,446.00	7,093,400	
フジ・メディア・ホールディングス	128,900	1,545.00	199,150,500	
秀英予備校	2,900	484.00	1,403,600	
田谷	2,600	671.00	1,744,600	
ラウンドワン	41,000	842.00	34,522,000	
リポートトラスト	50,800	2,074.00	105,359,200	
オービック	42,700	5,270.00	225,029,000	
ジャストシステム	20,100	1,183.00	23,778,300	
TDC ソフトウェアエンジニアリング	5,500	1,259.00	6,924,500	
ヤフー	888,500	521.00	462,908,500	
ビー・エム・エル	17,200	2,450.00	42,140,000	
ワタベウェディング	2,100	600.00	1,260,000	
トレンドマイクロ	65,600	4,915.00	322,424,000	
りらいあコミュニケーションズ	21,700	1,095.00	23,761,500	
インフォメーション・ディベロプメント	3,700	1,195.00	4,421,500	
リソー教育	22,400	617.00	13,820,800	
日本オラクル	19,900	6,570.00	130,743,000	
早稲田アカデミー	1,900	1,285.00	2,441,500	
アルファシステムズ	4,100	1,931.00	7,917,100	
フューチャー	16,800	866.00	14,548,800	
CAC Holdings	9,300	1,131.00	10,518,300	
ソフトバンク・テクノロジー	3,000	3,915.00	11,745,000	
トーセ	3,600	807.00	2,905,200	
ユー・エス・エス	158,700	1,930.00	306,291,000	
オービックビジネスコンサルタント	6,300	5,490.00	34,587,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	28,100	3,085.00	86,688,500	
アイティフォー	16,400	630.00	10,332,000	
東京個別指導学院	4,400	1,031.00	4,536,400	
東計電算	2,300	2,212.00	5,087,600	
サイバーエージェント	69,000	3,165.00	218,385,000	
楽天	670,000	1,131.00	757,770,000	
エックスネット	1,300	2,040.00	2,652,000	
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,025.00	4,817,500	
テー・オー・ダブリュー	10,600	684.00	7,250,400	
大塚商会	33,300	5,780.00	192,474,000	
総合メディカル	6,000	3,925.00	23,550,000	
サイボウズ	16,800	432.00	7,257,600	

ソフトブレーン	17,100	537.00	9,182,700	
セントラルスポーツ	4,500	3,455.00	15,547,500	
パラカ	3,600	1,968.00	7,084,800	
電通国際情報サービス	7,700	2,258.00	17,386,600	
デジタルガレージ	18,000	2,118.00	38,124,000	
イーエムシステムズ	4,300	1,720.00	7,396,000	
ウェザーニューズ	4,200	3,610.00	15,162,000	
C I J	11,600	530.00	6,148,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,553.00	2,174,200	
日本エンタープライズ	13,400	279.00	3,738,600	
WOWOW	5,900	3,895.00	22,980,500	
スカラ	7,800	827.00	6,450,600	
フルキャストホールディングス	13,500	1,092.00	14,742,000	
富士フイルムホールディングス	260,700	4,324.00	1,127,266,800	
コニカミノルタ	293,800	1,072.00	314,953,600	
資生堂	249,500	2,979.50	743,385,250	
ライオン	163,000	1,942.00	316,546,000	
高砂香料工業	8,600	3,625.00	31,175,000	
マンダム	13,200	5,280.00	69,696,000	
ミルボン	7,100	5,580.00	39,618,000	
ファンケル	28,000	1,673.00	46,844,000	
コーセー	21,300	9,510.00	202,563,000	
コタ	5,000	1,355.00	6,775,000	
シーズ・ホールディングス	17,100	3,270.00	55,917,000	
シーボン	1,600	2,565.00	4,104,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	13,400	10,920.00	146,328,000	
ノエビアホールディングス	8,300	4,440.00	36,852,000	
アジュバンコスメジャパン	2,800	977.00	2,735,600	
エステー	9,100	1,750.00	15,925,000	
アグロ カネショウ	5,200	1,297.00	6,744,400	
コニシ	20,600	1,312.00	27,027,200	
長谷川香料	16,600	1,934.00	32,104,400	
星光PMC	7,200	1,103.00	7,941,600	
小林製薬	36,500	5,250.00	191,625,000	
荒川化学工業	11,300	2,031.00	22,950,300	
メック	10,200	1,187.00	12,107,400	
日本高純度化学	3,800	2,491.00	9,465,800	
タカラバイオ	28,200	1,567.00	44,189,400	
J C U	4,100	6,920.00	28,372,000	
新田ゼラチン	8,200	840.00	6,888,000	
O A Tアグリオ	1,600	1,456.00	2,329,600	
デクセリアルズ	34,400	1,261.00	43,378,400	
アース製薬	9,500	5,340.00	50,730,000	
イハラケミカル工業	18,200	1,069.00	19,455,800	
北興化学工業	13,000	488.00	6,344,000	
大成ラミック	3,800	2,917.00	11,084,600	
クミアイ化学工業	27,200	687.00	18,686,400	

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

MARUWA	4,800	3,630.00	17,424,000	
品川リフラクトリーズ	33,000	301.00	9,933,000	
黒崎播磨	28,000	437.00	12,236,000	
ヨータイ	7,000	384.00	2,688,000	
イソライト工業	6,800	405.00	2,754,000	
東京窯業	16,000	206.00	3,296,000	
ニッカトー	4,800	424.00	2,035,200	
フジミインコーポレーテッド	11,200	2,486.00	27,843,200	
エーアンドエーマテリアル	28,000	132.00	3,696,000	
ニチアス	69,000	1,079.00	74,451,000	
新日鐵住金	592,600	2,763.50	1,637,650,100	
神戸製鋼所	227,100	1,071.00	243,224,100	
中山製鋼所	14,700	793.00	11,657,100	
合同製鐵	7,300	1,850.00	13,505,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	359,200	2,121.00	761,863,200	
日新製鋼	59,900	1,598.00	95,720,200	
東京製鐵	66,500	977.00	64,970,500	
共英製鋼	14,000	2,113.00	29,582,000	
大和工業	26,400	3,165.00	83,556,000	
東京鐵鋼	27,000	461.00	12,447,000	
大阪製鐵	8,200	2,129.00	17,457,800	
淀川製鋼所	18,100	3,320.00	60,092,000	
東洋鋼鈑	31,400	458.00	14,381,200	
丸一鋼管	43,900	3,545.00	155,625,500	
モリ工業	4,200	2,421.00	10,168,200	
大同特殊鋼	220,000	547.00	120,340,000	
日本高周波鋼業	46,000	86.00	3,956,000	
日本冶金工業	108,800	225.00	24,480,000	
山陽特殊製鋼	78,000	595.00	46,410,000	
愛知製鋼	7,700	4,800.00	36,960,000	
日立金属	133,700	1,580.00	211,246,000	
日本金属	3,200	1,447.00	4,630,400	
大太平洋金属	84,000	409.00	34,356,000	
新日本電工	74,400	318.00	23,659,200	
栗本鐵工所	6,300	2,318.00	14,603,400	
虹 技	19,000	239.00	4,541,000	
日本鑄鉄管	14,000	195.00	2,730,000	
日本製鋼所	43,400	1,985.00	86,149,000	
三菱製鋼	91,000	248.00	22,568,000	
日亜鋼業	18,400	286.00	5,262,400	
日本精線	9,000	611.00	5,499,000	
大紀アルミニウム工業所	22,000	524.00	11,528,000	
日本軽金属ホールディングス	320,300	278.00	89,043,400	
三井金属鉱業	357,000	367.00	131,019,000	
東邦亜鉛	74,000	577.00	42,698,000	
三菱マテリアル	82,000	3,700.00	303,400,000	

住友金属鉱山	340,000	1,571.50	534,310,000	
DOWAホールディングス	145,000	901.00	130,645,000	
古河機械金属	205,000	231.00	47,355,000	
エス・サイエンス	65,100	39.00	2,538,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	1,817.00	26,164,800	
東邦チタニウム	22,200	947.00	21,023,400	
UACJ	167,000	309.00	51,603,000	
古河電気工業	44,100	4,075.00	179,707,500	
住友電気工業	495,000	1,841.50	911,542,500	
フジクラ	172,900	832.00	143,852,800	
昭和電線ホールディングス	157,000	90.00	14,130,000	
東京特殊電線	1,900	1,729.00	3,285,100	
タツタ電線	24,700	454.00	11,213,800	
沖電線	14,000	247.00	3,458,000	
カナレ電気	1,900	2,200.00	4,180,000	
平河ヒューテック	6,200	1,176.00	7,291,200	
リョービ	80,000	490.00	39,200,000	
アーレスティ	15,200	1,158.00	17,601,600	
アサヒホールディングス	19,800	1,946.00	38,530,800	
東洋製罐グループホールディングス	93,300	2,029.00	189,305,700	
ホッカンホールディングス	34,000	515.00	17,510,000	
コロナ	6,900	1,168.00	8,059,200	
横河ブリッジホールディングス	23,100	1,387.00	32,039,700	
OSJBホールディングス	43,300	254.00	10,998,200	
駒井ハルテック	2,500	2,113.00	5,282,500	
高田機工	12,000	259.00	3,108,000	
三和ホールディングス	130,400	1,050.00	136,920,000	
文化シャッター	36,600	829.00	30,341,400	
三協立山	17,200	1,699.00	29,222,800	
アルインコ	9,100	1,049.00	9,545,900	
東洋シャッター	3,400	651.00	2,213,400	
LIXILグループ	183,000	2,747.00	502,701,000	
日本ファイルコン	9,800	563.00	5,517,400	
ノーリツ	25,700	2,145.00	55,126,500	
長府製作所	14,000	2,709.00	37,926,000	
リンナイ	22,400	8,960.00	200,704,000	
ユニプレス	24,200	2,288.00	55,369,600	
ダイニチ工業	7,000	738.00	5,166,000	
日東精工	19,000	422.00	8,018,000	
三洋工業	17,000	200.00	3,400,000	
岡部	27,300	1,011.00	27,600,300	
ジーテクト	13,700	2,091.00	28,646,700	
中国工業	2,300	693.00	1,593,900	
東ブレ	25,300	2,945.00	74,508,500	
高周波熱錬	24,400	898.00	21,911,200	
東京製綱	8,900	1,772.00	15,770,800	
サンコール	7,100	542.00	3,848,200	

モリテックスチール	7,200	311.00	2,239,200	
パイオラックス	6,600	7,660.00	50,556,000	
日本発条	123,500	1,276.00	157,586,000	
中央発條	15,000	348.00	5,220,000	
アドバネクス	2,300	1,857.00	4,271,100	
三浦工業	53,700	1,733.00	93,062,100	
タクマ	42,100	1,048.00	44,120,800	
テクノプロ・ホールディングス	21,300	4,040.00	86,052,000	
インターワークス	2,600	1,149.00	2,987,400	
K e e P e r 技研	1,500	2,083.00	3,124,500	
ファーストロジック	700	2,402.00	1,681,400	
イー・ガーディアン	4,300	1,763.00	7,580,900	
リブセンス	9,300	452.00	4,203,600	
ジャパンマテリアル	9,600	1,611.00	15,465,600	
ベクトル	10,700	1,315.00	14,070,500	
ウチヤマホールディングス	6,300	443.00	2,790,900	
サクセスホールディングス	1,100	1,362.00	1,498,200	
キャリアリンク	3,100	700.00	2,170,000	
I B J	10,300	616.00	6,344,800	
アサンテ	4,900	1,700.00	8,330,000	
N・フィールド	6,200	1,445.00	8,959,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,700	4,010.00	6,817,000	
ライドオン・エクスプレス	3,100	953.00	2,954,300	
E R I ホールディングス	3,700	822.00	3,041,400	
アビスト	2,100	3,820.00	8,022,000	
ウィルグループ	5,400	737.00	3,979,800	
日本ビューホテル	1,900	1,363.00	2,589,700	
リクルートホールディングス	286,500	5,450.00	1,561,425,000	
エラン	1,700	1,495.00	2,541,500	
ツガミ	35,000	690.00	24,150,000	
オークマ	85,000	1,204.00	102,340,000	
東芝機械	78,000	477.00	37,206,000	
アマダホールディングス	176,700	1,272.00	224,762,400	
アイダエンジニアリング	37,300	999.00	37,262,700	
滝澤鉄工所	39,000	184.00	7,176,000	
富士機械製造	40,000	1,487.00	59,480,000	
牧野フライス製作所	65,000	1,036.00	67,340,000	
オーエスジー	59,800	2,362.00	141,247,600	
ダイジェット工業	17,000	182.00	3,094,000	
旭ダイヤモンド工業	37,600	915.00	34,404,000	
DMG森精機	77,700	1,743.00	135,431,100	
ソディック	33,300	1,099.00	36,596,700	
ディスコ	15,400	16,880.00	259,952,000	
日東工器	7,600	2,577.00	19,585,200	
パンチ工業	4,800	1,181.00	5,668,800	
日本郵政	341,900	1,445.00	494,045,500	
ベルシステム24ホールディングス	20,000	939.00	18,780,000	

ソラスト	6,000	1,471.00	8,826,000	
豊田自動織機	114,300	5,460.00	624,078,000	
豊和工業	7,600	659.00	5,008,400	
OKK	48,000	125.00	6,000,000	
石川製作所	3,500	765.00	2,677,500	
東洋機械金属	8,900	567.00	5,046,300	
津田駒工業	30,000	178.00	5,340,000	
エンシュウ	34,000	93.00	3,162,000	
島精機製作所	17,100	3,720.00	63,612,000	
NCホールディングス	4,400	935.00	4,114,000	
フリー	7,800	1,523.00	11,879,400	
ヤマシンフィルタ	2,600	1,918.00	4,986,800	
日阪製作所	17,800	898.00	15,984,400	
やまびこ	24,100	1,391.00	33,523,100	
ペガサスミシン製造	12,700	924.00	11,734,800	
ナブテスコ	68,300	3,115.00	212,754,500	
三井海洋開発	13,200	2,424.00	31,996,800	
レオン自動機	11,100	1,027.00	11,399,700	
SMC	39,400	31,970.00	1,259,618,000	
新川	11,000	772.00	8,492,000	
ホソカワミクロン	22,000	825.00	18,150,000	
ユニオンツール	5,700	3,655.00	20,833,500	
オイレス工業	16,900	2,095.00	35,405,500	
日精エー・エス・ビー機械	4,200	2,382.00	10,004,400	
サトーホールディングス	16,300	2,418.00	39,413,400	
日本エアーテック	4,400	668.00	2,939,200	
日精樹脂工業	10,400	1,101.00	11,450,400	
オカダアイヨン	2,800	1,148.00	3,214,400	
ワイエイシイ	5,000	1,329.00	6,645,000	
小松製作所	606,100	2,662.00	1,613,438,200	
住友重機械工業	383,000	787.00	301,421,000	
日立建機	58,700	2,544.00	149,332,800	
日工	4,000	2,093.00	8,372,000	
巴工業	5,400	1,871.00	10,103,400	
井関農機	134,000	254.00	34,036,000	
TOWA	10,800	1,944.00	20,995,200	
丸山製作所	28,000	190.00	5,320,000	
北川鉄工所	6,000	2,360.00	14,160,000	
シンニッタン	10,800	699.00	7,549,200	
ローツェ	4,700	2,491.00	11,707,700	
タカキタ	3,600	566.00	2,037,600	
クボタ	628,700	1,770.00	1,112,799,000	
荏原実業	3,700	1,377.00	5,094,900	
東洋エンジニアリング	83,000	271.00	22,493,000	
三菱化工機	43,000	222.00	9,546,000	
月島機械	24,900	1,259.00	31,349,100	
帝国電機製作所	9,600	1,016.00	9,753,600	

東京機械製作所	50,000	75.00	3,750,000	
新東工業	29,700	1,029.00	30,561,300	
澁谷工業	11,000	2,878.00	31,658,000	
アイチコーポレーション	18,600	873.00	16,237,800	
小森コーポレーション	31,500	1,484.00	46,746,000	
鶴見製作所	9,800	1,524.00	14,935,200	
住友精密工業	21,000	365.00	7,665,000	
酒井重工業	25,000	324.00	8,100,000	
荏原製作所	59,500	3,320.00	197,540,000	
石井鐵工所	2,000	1,760.00	3,520,000	
西島製作所	12,900	1,142.00	14,731,800	
北越工業	14,100	988.00	13,930,800	
千代田化工建設	101,000	717.00	72,417,000	
ダイキン工業	171,400	10,590.00	1,815,126,000	
オルガノ	25,000	490.00	12,250,000	
トーヨーカネツ	60,000	310.00	18,600,000	
栗田工業	74,300	2,689.00	199,792,700	
椿本チエイン	75,000	955.00	71,625,000	
大同工業	26,000	289.00	7,514,000	
日機装	43,400	1,212.00	52,600,800	
木村化工機	11,500	343.00	3,944,500	
新興プランテック	28,800	926.00	26,668,800	
アネスト岩田	22,800	1,083.00	24,692,400	
ダイフク	62,700	2,612.00	163,772,400	
サムコ	3,300	1,016.00	3,352,800	
加藤製作所	6,900	2,861.00	19,740,900	
油研工業	24,000	242.00	5,808,000	
タダノ	65,600	1,426.00	93,545,600	
フジテック	36,500	1,291.00	47,121,500	
CKD	37,600	1,430.00	53,768,000	
キトー	15,800	1,215.00	19,197,000	
平和	38,900	3,010.00	117,089,000	
理想科学工業	12,500	2,026.00	25,325,000	
SANKYO	34,800	3,965.00	137,982,000	
日本金銭機械	11,600	1,499.00	17,388,400	
マースエンジニアリング	7,100	2,365.00	16,791,500	
福島工業	7,800	3,785.00	29,523,000	
オーイズミ	5,500	685.00	3,767,500	
ダイコク電機	5,200	1,765.00	9,178,000	
竹内製作所	22,900	2,216.00	50,746,400	
アマノ	38,900	2,261.00	87,952,900	
JUKI	19,800	1,280.00	25,344,000	
サンデンホールディングス	77,000	382.00	29,414,000	
蛇の目ミシン工業	12,200	755.00	9,211,000	
ブラザー工業	162,300	2,096.00	340,180,800	
マックス	19,000	1,505.00	28,595,000	
モリタホールディングス	22,000	1,560.00	34,320,000	

グローリー	40,100	3,790.00	151,979,000	
新晃工業	8,800	1,470.00	12,936,000	
大和冷機工業	20,100	1,062.00	21,346,200	
セガサミーホールディングス	124,500	1,668.00	207,666,000	
日本ピストンリング	4,900	2,323.00	11,382,700	
リケン	5,800	4,410.00	25,578,000	
T P R	14,100	3,785.00	53,368,500	
ツバキ・ナカシマ	14,100	1,863.00	26,268,300	
ホシザキ	27,500	9,010.00	247,775,000	
大豊工業	10,200	1,516.00	15,463,200	
日本精工	257,800	1,581.00	407,581,800	
N T N	290,000	556.00	161,240,000	
ジェイテクト	133,700	1,885.00	252,024,500	
不二越	126,000	605.00	76,230,000	
ミネベアミツミ	228,300	1,345.00	307,063,500	
日本トムソン	40,100	534.00	21,413,400	
T H K	88,700	2,926.00	259,536,200	
ユーシン精機	5,600	2,872.00	16,083,200	
前澤給装工業	4,800	1,546.00	7,420,800	
イーグル工業	13,600	1,585.00	21,556,000	
前澤工業	9,300	334.00	3,106,200	
日本ピラー工業	12,700	1,513.00	19,215,100	
キッツ	60,100	764.00	45,916,400	
日立製作所	3,014,000	616.90	1,859,336,600	
東芝	2,808,000	215.80	605,966,400	
三菱電機	1,338,900	1,651.50	2,211,193,350	
富士電機	378,000	620.00	234,360,000	
東洋電機製造	5,000	1,712.00	8,560,000	
安川電機	145,500	2,096.00	304,968,000	
シンフォニア テクノロジー	81,000	303.00	24,543,000	
明電舎	115,000	375.00	43,125,000	
オリジン電気	18,000	316.00	5,688,000	
山洋電気	33,000	872.00	28,776,000	
デンヨー	11,600	1,697.00	19,685,200	
日立工機	33,600	867.00	29,131,200	
三櫻工業	16,100	863.00	13,894,300	
マキタ	81,800	7,770.00	635,586,000	
東芝テック	79,000	589.00	46,531,000	
芝浦メカトロニクス	21,000	275.00	5,775,000	
マブチモーター	35,400	6,100.00	215,940,000	
日本電産	162,700	10,480.00	1,705,096,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,500	2,913.00	4,369,500	
東光高岳	6,400	2,141.00	13,702,400	
ダブル・スコープ	12,100	1,911.00	23,123,100	
宮越ホールディングス	4,500	494.00	2,223,000	
ダイヘン	69,000	729.00	50,301,000	
田淵電機	19,100	354.00	6,761,400	

ヤーマン	1,600	5,930.00	9,488,000	
JVCケンウッド	92,200	285.00	26,277,000	
ミマキエンジニアリング	11,300	743.00	8,395,900	
第一精工	5,900	1,772.00	10,454,800	
日新電機	25,200	1,319.00	33,238,800	
大崎電気工業	25,000	1,071.00	26,775,000	
オムロン	133,400	4,815.00	642,321,000	
日東工業	18,400	1,564.00	28,777,600	
I D E C	16,400	1,202.00	19,712,800	
不二電機工業	1,400	1,342.00	1,878,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	242,000	507.00	122,694,000	
サクサホールディングス	32,000	231.00	7,392,000	
メルコホールディングス	7,000	3,310.00	23,170,000	
テクノメディカ	2,900	2,236.00	6,484,400	
日本電気	1,725,000	279.00	481,275,000	
富士通	1,210,000	652.00	788,920,000	
沖電気工業	54,300	1,585.00	86,065,500	
岩崎通信機	56,000	89.00	4,984,000	
電気興業	36,000	559.00	20,124,000	
サンケン電気	73,000	490.00	35,770,000	
ナカヨ	13,000	407.00	5,291,000	
アイホン	7,200	1,878.00	13,521,600	
ルネサスエレクトロニクス	65,100	923.00	60,087,300	
セイコーエプソン	186,900	2,523.00	471,548,700	
ワコム	97,500	422.00	41,145,000	
アルバック	21,200	4,965.00	105,258,000	
アクセル	5,300	836.00	4,430,800	
E I Z O	12,400	3,225.00	39,990,000	
ジャパンディスプレイ	234,500	272.00	63,784,000	
日本信号	34,600	1,071.00	37,056,600	
京三製作所	29,000	422.00	12,238,000	
能美防災	14,200	1,525.00	21,655,000	
ホーチキ	9,100	1,439.00	13,094,900	
エレコム	10,900	2,008.00	21,887,200	
日本無線	7,700	1,402.00	10,795,400	
パナソニック	1,434,000	1,229.50	1,763,103,000	
アンリツ	91,400	844.00	77,141,600	
富士通ゼネラル	43,000	2,220.00	95,460,000	
日立国際電気	32,900	2,555.00	84,059,500	
ソニー	886,200	3,454.00	3,060,934,800	
TDK	70,700	7,750.00	547,925,000	
帝国通信工業	27,000	190.00	5,130,000	
タムラ製作所	48,000	450.00	21,600,000	
アルプス電気	115,900	3,325.00	385,367,500	
池上通信機	40,000	154.00	6,160,000	
パイオニア	188,700	225.00	42,457,500	
日本電波工業	12,200	835.00	10,187,000	

鈴木	4,900	645.00	3,160,500	
日本トリム	3,100	4,015.00	12,446,500	
ローランド ディー. ジー.	6,400	3,410.00	21,824,000	
日本コロムビア	3,900	650.00	2,535,000	
フォスター電機	14,700	1,908.00	28,047,600	
クラリオン	66,000	432.00	28,512,000	
SMK	32,000	439.00	14,048,000	
ヨコオ	9,000	1,346.00	12,114,000	
ティアック	92,000	45.00	4,140,000	
ホシデン	38,100	983.00	37,452,300	
ヒロセ電機	20,300	14,950.00	303,485,000	
日本航空電子工業	36,000	1,551.00	55,836,000	
TOA	14,800	996.00	14,740,800	
日立マクセル	18,700	2,188.00	40,915,600	
古野電気	16,200	744.00	12,052,800	
ユニデンホールディングス	37,000	166.00	6,142,000	
アルパイン	29,900	1,645.00	49,185,500	
スミダコーポレーション	10,300	1,318.00	13,575,400	
アイコム	6,900	2,436.00	16,808,400	
リオン	4,900	1,620.00	7,938,000	
本多通信工業	3,600	1,314.00	4,730,400	
船井電機	13,800	982.00	13,551,600	
横河電機	136,100	1,736.00	236,269,600	
新電元工業	48,000	463.00	22,224,000	
アズビル	38,000	3,600.00	136,800,000	
東亜ディーケーケー	6,400	558.00	3,571,200	
日本光電工業	52,500	2,448.00	128,520,000	
チノー	4,600	1,282.00	5,897,200	
共和電業	14,400	441.00	6,350,400	
日本電子材料	5,100	631.00	3,218,100	
堀場製作所	24,900	6,250.00	155,625,000	
アドバンテスト	85,600	1,967.00	168,375,200	
小野測器	6,300	870.00	5,481,000	
エスベック	11,100	1,386.00	15,384,600	
パナソニック デバイス SUNX	11,100	834.00	9,257,400	
キーエンス	56,900	43,630.00	2,482,547,000	
日置電機	6,600	2,279.00	15,041,400	
シスメックス	97,500	6,500.00	633,750,000	
日本マイクロニクス	23,400	917.00	21,457,800	
メガチップス	11,700	2,571.00	30,080,700	
OBARA GROUP	7,300	4,965.00	36,244,500	
イマジカ・ロボット ホールディングス	10,500	795.00	8,347,500	
澤藤電機	8,000	248.00	1,984,000	
デンソー	309,500	5,008.00	1,549,976,000	
コーセル	17,400	1,426.00	24,812,400	
イリソ電子工業	4,000	6,950.00	27,800,000	

新日本無線	9,900	428.00	4,237,200	
オブテックスグループ	9,500	2,997.00	28,471,500	
千代田インテグレ	6,600	2,471.00	16,308,600	
アイ・オー・データ機器	4,000	1,189.00	4,756,000	
レーザーテック	13,800	2,771.00	38,239,800	
スタンレー電気	89,500	3,095.00	277,002,500	
岩崎電気	46,000	175.00	8,050,000	
ウシオ電機	76,200	1,436.00	109,423,200	
岡谷電機産業	7,000	413.00	2,891,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	656.00	7,740,800	
日本セラミック	10,300	2,389.00	24,606,700	
遠藤照明	6,400	921.00	5,894,400	
古河電池	9,000	764.00	6,876,000	
双信電機	6,500	303.00	1,969,500	
山一電機	11,800	1,479.00	17,452,200	
図研	8,200	1,301.00	10,668,200	
日本電子	46,000	517.00	23,782,000	
カシオ計算機	101,000	1,515.00	153,015,000	
ファナック	127,300	21,965.00	2,796,144,500	
日本シイエムケイ	27,100	635.00	17,208,500	
エンプラス	5,700	3,365.00	19,180,500	
大真空	4,600	1,522.00	7,001,200	
ローム	60,700	7,280.00	441,896,000	
浜松ホトニクス	97,900	3,315.00	324,538,500	
三井ハイテック	16,600	864.00	14,342,400	
新光電気工業	47,400	782.00	37,066,800	
京セラ	206,000	6,232.00	1,283,792,000	
協栄産業	16,000	180.00	2,880,000	
太陽誘電	61,000	1,483.00	90,463,000	
村田製作所	131,700	16,130.00	2,124,321,000	
ユーシン	16,800	781.00	13,120,800	
双葉電子工業	20,500	2,023.00	41,471,500	
日東電工	94,800	9,455.00	896,334,000	
北陸電気工業	51,000	139.00	7,089,000	
東海理化電機製作所	33,000	2,234.00	73,722,000	
ニチコン	39,500	1,069.00	42,225,500	
日本ケミコン	108,000	338.00	36,504,000	
KOA	17,400	1,407.00	24,481,800	
三井造船	453,000	183.00	82,899,000	
日立造船	99,300	645.00	64,048,500	
三菱重工業	2,103,000	438.30	921,744,900	
川崎重工業	977,000	348.00	339,996,000	
IHI	965,000	338.00	326,170,000	
名村造船所	37,600	751.00	28,237,600	
サノヤスホールディングス	15,300	300.00	4,590,000	
日本車輛製造	46,000	303.00	13,938,000	
ニチユ三菱フォークリフト	14,500	699.00	10,135,500	

近畿車輛	1,900	2,630.00	4,997,000	
F P G	44,200	1,102.00	48,708,400	
島根銀行	2,800	1,402.00	3,925,600	
じもとホールディングス	89,200	192.00	17,126,400	
全国保証	34,900	3,595.00	125,465,500	
めぶきフィナンシャルグループ	597,300	489.00	292,079,700	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	17,900	3,840.00	68,736,000	
九州フィナンシャルグループ	203,100	761.00	154,559,100	
かんぽ生命保険	46,800	2,731.00	127,810,800	
ゆうちょ銀行	350,800	1,401.00	491,470,800	
富山第一銀行	31,600	525.00	16,590,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	811,100	591.30	479,603,430	
西日本フィナンシャルホールディングス	84,000	1,219.00	102,396,000	
日産自動車	1,480,300	1,105.00	1,635,731,500	
いすゞ自動車	363,700	1,490.00	541,913,000	
トヨタ自動車	1,526,000	6,406.00	9,775,556,000	*
日野自動車	179,100	1,297.00	232,292,700	
三菱自動車工業	460,100	738.00	339,553,800	
エフテック	6,700	1,388.00	9,299,600	
レシップホールディングス	4,300	855.00	3,676,500	
GMB	2,100	1,366.00	2,868,600	
ファルテック	2,300	1,428.00	3,284,400	
武蔵精密工業	14,600	2,945.00	42,997,000	
日産車体	55,100	1,063.00	58,571,300	
新明和工業	51,000	1,139.00	58,089,000	
極東開発工業	25,000	1,757.00	43,925,000	
日信工業	28,000	1,999.00	55,972,000	
トビー工業	10,300	3,115.00	32,084,500	
ティラド	49,000	308.00	15,092,000	
曙ブレーキ工業	58,500	301.00	17,608,500	
タチエス	21,300	2,079.00	44,282,700	
NOK	60,700	2,596.00	157,577,200	
フタバ産業	38,300	772.00	29,567,600	
K Y B	140,000	598.00	83,720,000	
市光工業	26,000	523.00	13,598,000	
大同メタル工業	15,800	1,020.00	16,116,000	
プレス工業	66,600	560.00	37,296,000	
ミクニ	16,000	437.00	6,992,000	
カルソニックカンセイ	85,000	1,283.00	109,055,000	
太平洋工業	25,800	1,389.00	35,836,200	
ケーシン	28,800	1,854.00	53,395,200	
河西工業	16,700	1,464.00	24,448,800	
アイシン精機	114,800	5,570.00	639,436,000	
富士機工	12,500	571.00	7,137,500	
マツダ	397,400	1,573.50	625,308,900	

今仙電機製作所	11,500	1,001.00	11,511,500	
本田技研工業	1,129,500	3,498.00	3,950,991,000	
スズキ	248,800	4,407.00	1,096,461,600	
富士重工業	389,700	4,229.00	1,648,041,300	
安永	4,300	1,681.00	7,228,300	
ヤマハ発動機	177,300	2,558.00	453,533,400	
ショーワ	32,700	929.00	30,378,300	
小糸製作所	75,200	5,780.00	434,656,000	
T B K	16,300	519.00	8,459,700	
エクセディ	17,000	3,175.00	53,975,000	
ミツバ	23,100	2,121.00	48,995,100	
豊田合成	40,500	2,856.00	115,668,000	
愛三工業	22,000	953.00	20,966,000	
盟和産業	1,800	1,222.00	2,199,600	
ヨロズ	11,700	1,787.00	20,907,900	
エフ・シー・シー	20,500	2,244.00	46,002,000	
新家工業	29,000	174.00	5,046,000	
シマノ	50,600	16,660.00	842,996,000	
タカタ	22,700	553.00	12,553,100	
テイ・エス テック	29,100	2,937.00	85,466,700	
ジャムコ	7,400	2,419.00	17,900,600	
小野建	10,800	1,414.00	15,271,200	
はるやまホールディングス	5,700	980.00	5,586,000	
ノジマ	14,400	1,466.00	21,110,400	
佐鳥電機	9,800	812.00	7,957,600	
カッパ・クリエイト	17,500	1,290.00	22,575,000	
エコートレーディング	3,200	688.00	2,201,600	
伯東	8,400	1,113.00	9,349,200	
コンドーテック	9,900	909.00	8,999,100	
中山福	7,500	843.00	6,322,500	
ライトオン	9,300	984.00	9,151,200	
ナガイレーベン	17,900	2,382.00	42,637,800	
ジーンズメイト	4,600	258.00	1,186,800	
三菱食品	13,600	3,480.00	47,328,000	
良品計画	16,400	23,750.00	389,500,000	
三城ホールディングス	15,500	486.00	7,533,000	
松田産業	9,000	1,526.00	13,734,000	
第一興商	20,100	4,730.00	95,073,000	
メディパルホールディングス	123,900	1,831.00	226,860,900	
アドヴァン	12,600	1,169.00	14,729,400	
S P K	2,800	2,552.00	7,145,600	
萩原電気	4,200	2,126.00	8,929,200	
アルビス	3,300	3,430.00	11,319,000	
アズワン	9,700	4,950.00	48,015,000	
スズデン	4,400	1,089.00	4,791,600	
尾家産業	4,400	1,178.00	5,183,200	
シモジマ	7,700	1,195.00	9,201,500	

ドウシシャ	14,600	2,130.00	31,098,000	
小津産業	2,800	2,171.00	6,078,800	
コナカ	15,700	593.00	9,310,100	
高速	7,500	1,118.00	8,385,000	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,573.00	2,674,100	
G-7ホールディングス	3,700	2,298.00	8,502,600	
たけびし	4,300	1,469.00	6,316,700	
イオン北海道	12,400	594.00	7,365,600	
コジマ	18,400	271.00	4,986,400	
ヒマラヤ	3,900	840.00	3,276,000	
コーナン商事	17,600	2,079.00	36,590,400	
黒田電気	16,900	2,290.00	38,701,000	
ネットワンシステムズ	53,500	863.00	46,170,500	
エコス	4,800	1,203.00	5,774,400	
ワタミ	14,700	1,228.00	18,051,600	
マルシェ	3,100	842.00	2,610,200	
リックス	2,900	1,685.00	4,886,500	
システムソフト	22,800	156.00	3,556,800	
ドンキホーテホールディングス	80,100	3,955.00	316,795,500	
丸文	11,000	736.00	8,096,000	
西松屋チェーン	21,700	1,259.00	27,320,300	
ゼンショーホールディングス	64,200	1,892.00	121,466,400	
ハビネット	10,400	1,571.00	16,338,400	
幸楽苑ホールディングス	8,000	1,709.00	13,672,000	
ハークスレイ	3,000	1,135.00	3,405,000	
橋本総業ホールディングス	2,600	1,502.00	3,905,200	
日本ライフライン	10,600	2,036.00	21,581,600	
サイゼリヤ	20,400	2,618.00	53,407,200	
エクセル	5,300	1,461.00	7,743,300	
V Tホールディングス	42,000	522.00	21,924,000	
マルカキカイ	4,000	1,836.00	7,344,000	
アルゴグラフィックス	5,700	2,515.00	14,335,500	
魚力	3,900	1,292.00	5,038,800	
I D O M	33,400	740.00	24,716,000	
日本エム・ディ・エム	9,400	770.00	7,238,000	
ポブラ	3,500	533.00	1,865,500	
フジ・コーポレーション	1,900	2,310.00	4,389,000	
ユナイテッドアローズ	16,500	3,505.00	57,832,500	
進和	7,300	1,775.00	12,957,500	
エスケイジャパン	2,700	303.00	818,100	
ダイトロン	5,700	1,094.00	6,235,800	
ハイデイ日高	13,560	2,345.00	31,798,200	
シークス	8,800	4,250.00	37,400,000	
京都きもの友禅	8,100	1,001.00	8,108,100	
コロワイド	41,100	1,853.00	76,158,300	
ピーシーデポコーポレーション	16,500	549.00	9,058,500	
田中商事	3,900	720.00	2,808,000	

オーハシテクニカ	7,000	1,435.00	10,045,000	
壺番屋	8,700	3,705.00	32,233,500	
白銅	3,100	1,777.00	5,508,700	
トップカルチャー	5,000	481.00	2,405,000	
P L A N T	2,800	1,210.00	3,388,000	
スギホールディングス	27,100	5,170.00	140,107,000	
島津製作所	161,500	1,833.00	296,029,500	
J M S	23,000	350.00	8,050,000	
クボテック	2,800	566.00	1,584,800	
長野計器	8,500	717.00	6,094,500	
ブイ・テクノロジー	2,500	16,060.00	40,150,000	
スター精密	22,000	1,620.00	35,640,000	
東京計器	43,000	230.00	9,890,000	
愛知時計電機	1,700	3,680.00	6,256,000	
オーバル	12,500	270.00	3,375,000	
東京精密	24,200	3,655.00	88,451,000	
マニー	16,700	2,596.00	43,353,200	
ニコン	218,700	1,705.00	372,883,500	
トプコン	63,200	1,957.00	123,682,400	
オリンパス	200,300	3,950.00	791,185,000	
理研計器	11,000	1,592.00	17,512,000	
S C R E E Nホールディングス	25,700	7,560.00	194,292,000	
キヤノン電子	11,400	1,793.00	20,440,200	
タムロン	11,100	2,092.00	23,221,200	
HOYA	258,200	5,062.00	1,307,008,400	
ノーリツ鋼機	12,300	964.00	11,857,200	
エー・アンド・デイ	11,600	458.00	5,312,800	
キヤノン	675,700	3,292.00	2,224,404,400	
リコー	377,300	991.00	373,904,300	
シチズン時計	137,200	720.00	98,784,000	
リズム時計工業	51,000	188.00	9,588,000	
大研医器	10,800	813.00	8,780,400	
メニコン	8,600	3,520.00	30,272,000	
スノーピーク	1,600	2,893.00	4,628,800	
パラマウントベッドホールディングス	12,000	4,260.00	51,120,000	
トランザクション	5,600	1,046.00	5,857,600	
S H O - B I	5,000	431.00	2,155,000	
ニホンフラッシュ	5,300	1,312.00	6,953,600	
前田工織	12,600	1,311.00	16,518,600	
永大産業	16,000	526.00	8,416,000	
アートネイチャー	13,400	750.00	10,050,000	
ダンロップスポーツ	8,000	1,039.00	8,312,000	
バンダイナムコホールディングス	138,400	3,225.00	446,340,000	
アイフィスジャパン	2,400	420.00	1,008,000	
共立印刷	21,600	341.00	7,365,600	
S H O E I	5,700	2,574.00	14,671,800	
フランスベッドホールディングス	15,800	946.00	14,946,800	

マーベラス	20,900	946.00	19,771,400	
パイロットコーポレーション	21,900	4,480.00	98,112,000	
萩原工業	3,500	2,646.00	9,261,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	22,800	1,610.00	36,708,000	
トッパン・フォームズ	22,400	1,055.00	23,632,000	
フジシールインターナショナル	28,200	2,240.00	63,168,000	
タカラトミー	48,900	1,187.00	58,044,300	
廣済堂	12,700	386.00	4,902,200	
アーケ	53,500	111.00	5,938,500	
レック	4,100	4,280.00	17,548,000	
タカノ	5,700	1,040.00	5,928,000	
プロネクス	11,800	1,183.00	13,959,400	
ホクシン	9,700	214.00	2,075,800	
ウッドワン	22,000	300.00	6,600,000	
大建工業	8,900	2,140.00	19,046,000	
きもと	23,400	243.00	5,686,200	
凸版印刷	354,000	1,119.00	396,126,000	
大日本印刷	362,000	1,210.00	438,020,000	
図書印刷	17,000	480.00	8,160,000	
共同印刷	39,000	384.00	14,976,000	
日本写真印刷	21,100	3,130.00	66,043,000	
光村印刷	3,000	268.00	804,000	
藤森工業	9,800	2,951.00	28,919,800	
ヴィア・ホールディングス	9,400	1,184.00	11,129,600	
宝印刷	6,200	1,583.00	9,814,600	
前澤化成工業	8,700	1,189.00	10,344,300	
アシックス	124,700	1,970.00	245,659,000	
ツツミ	4,700	2,079.00	9,771,300	
J S P	6,100	2,615.00	15,951,500	
ニチハ	17,500	3,190.00	55,825,000	
エフピコ	11,700	5,110.00	59,787,000	
小松ウオール工業	4,300	1,881.00	8,088,300	
ヤマハ	84,600	2,919.00	246,947,400	
河合楽器製作所	5,000	2,343.00	11,715,000	
クリナップ	14,800	842.00	12,461,600	
ピジョン	75,900	3,225.00	244,777,500	
天馬	8,700	2,073.00	18,035,100	
兼松サステック	14,000	243.00	3,402,000	
キングジム	10,600	867.00	9,190,200	
リンテック	29,800	2,387.00	71,132,600	
T A S A K I	2,700	1,500.00	4,050,000	
信越ポリマー	25,800	813.00	20,975,400	
東リ	31,500	411.00	12,946,500	
イトーキ	26,500	722.00	19,133,000	
任天堂	77,300	23,680.00	1,830,464,000	
三菱鉛筆	10,300	5,610.00	57,783,000	

松風	6,600	1,351.00	8,916,600	
タカスタンダード	25,900	1,862.00	48,225,800	
コクヨ	65,200	1,445.00	94,214,000	
ナカバヤシ	23,000	273.00	6,279,000	
ニフコ	23,000	5,690.00	130,870,000	
立川ブラインド工業	5,500	943.00	5,186,500	
グローブライド	6,200	1,739.00	10,781,800	
岡村製作所	43,900	1,010.00	44,339,000	
日本バルカー工業	10,100	1,847.00	18,654,700	
MUTOHホールディングス	16,000	261.00	4,176,000	
伊藤忠商事	907,300	1,625.50	1,474,816,150	
丸紅	1,219,100	725.50	884,457,050	
スクロール	18,800	354.00	6,655,200	
高島	21,000	209.00	4,389,000	
ヨンドシーホールディングス	9,400	2,544.00	23,913,600	
三陽商会	69,000	177.00	12,213,000	
長瀬産業	74,200	1,620.00	120,204,000	
ナイガイ	49,000	65.00	3,185,000	
蝶理	7,900	1,995.00	15,760,500	
豊田通商	137,900	3,330.00	459,207,000	
オンワードホールディングス	85,000	827.00	70,295,000	
三共生興	18,800	412.00	7,745,600	
兼松	263,000	193.00	50,759,000	
美津濃	68,000	588.00	39,984,000	
ツカモトコーポレーション	23,000	126.00	2,898,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	54,300	6,840.00	371,412,000	
ルック	24,000	207.00	4,968,000	
三井物産	1,120,100	1,709.50	1,914,810,950	
日本紙パルプ商事	65,000	375.00	24,375,000	
東京エレクトロン	83,700	11,175.00	935,347,500	
日立ハイテクノロジーズ	43,000	4,690.00	201,670,000	
カメイ	16,100	1,300.00	20,930,000	
東都水産	2,000	1,967.00	3,934,000	
OUGホールディングス	20,000	262.00	5,240,000	
スターゼン	5,200	4,780.00	24,856,000	
セイコーホールディングス	89,000	468.00	41,652,000	
山善	47,500	1,030.00	48,925,000	
椿本興業	14,000	423.00	5,922,000	
住友商事	779,800	1,511.50	1,178,667,700	
日本ユニシス	34,200	1,518.00	51,915,600	
内田洋行	6,100	2,517.00	15,353,700	
三菱商事	929,600	2,543.00	2,363,972,800	
第一実業	28,000	760.00	21,280,000	
キャノンマーケティングジャパン	35,300	2,270.00	80,131,000	
西華産業	39,000	365.00	14,235,000	
佐藤商事	11,100	886.00	9,834,600	

菱洋エレクトロ	11,800	1,575.00	18,585,000	
東京産業	12,500	477.00	5,962,500	
ユアサ商事	11,700	3,170.00	37,089,000	
神鋼商事	3,100	2,456.00	7,613,600	
小林産業	9,400	275.00	2,585,000	
阪和興業	124,000	797.00	98,828,000	
カナデン	11,900	1,064.00	12,661,600	
菱電商事	20,000	740.00	14,800,000	
ニプロ	86,800	1,430.00	124,124,000	
フルサト工業	6,800	1,787.00	12,151,600	
岩谷産業	137,000	657.00	90,009,000	
すてきナイスグループ	53,000	154.00	8,162,000	
昭光通商	46,000	97.00	4,462,000	
ニチモウ	18,000	190.00	3,420,000	
極東貿易	19,000	237.00	4,503,000	
イワキ	19,000	306.00	5,814,000	
兼松エレクトロニクス	7,800	2,617.00	20,412,600	
三愛石油	33,200	917.00	30,444,400	
稲畑産業	29,600	1,467.00	43,423,200	
G S I クレオス	31,000	146.00	4,526,000	
明和産業	11,600	418.00	4,848,800	
キムラタン	566,000	8.00	4,528,000	
ゴールドウイン	5,600	6,040.00	33,824,000	
ユニ・チャーム	266,200	2,500.00	665,500,000	
デサント	30,000	1,322.00	39,660,000	
キング	6,600	415.00	2,739,000	
ワキタ	26,300	1,023.00	26,904,900	
ヤマトインターナショナル	8,300	410.00	3,403,000	
東邦ホールディングス	39,600	2,461.00	97,455,600	
サンゲツ	42,400	1,937.00	82,128,800	
ミツウロコグループホールディングス	20,000	761.00	15,220,000	
シナネンホールディングス	5,300	2,317.00	12,280,100	
伊藤忠エネクス	27,300	947.00	25,853,100	
サンリオ	38,200	2,214.00	84,574,800	
サンワ テクノス	7,300	1,108.00	8,088,400	
リョーサン	18,400	3,580.00	65,872,000	
新光商事	13,500	1,310.00	17,685,000	
トーヨー	5,700	2,562.00	14,603,400	
三信電気	13,700	1,348.00	18,467,600	
東陽テクニカ	16,400	997.00	16,350,800	
モスフードサービス	16,200	3,365.00	54,513,000	
加賀電子	11,200	1,996.00	22,355,200	
三益半導体工業	9,700	1,682.00	16,315,400	
ソーダニッカ	13,100	516.00	6,759,600	
立花エレクトック	8,400	1,325.00	11,130,000	
木曽路	15,200	2,454.00	37,300,800	
サトレストランシシステムズ	14,800	877.00	12,979,600	

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

三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,387,800	738.90	6,936,645,420	
りそなホールディングス	1,449,400	624.80	905,585,120	
三井住友トラスト・ホールディングス	258,600	4,051.00	1,047,588,600	
三井住友フィナンシャルグループ	992,000	4,380.00	4,344,960,000	
第四銀行	152,000	508.00	77,216,000	
北越銀行	13,400	2,662.00	35,670,800	
千葉銀行	478,000	777.00	371,406,000	
群馬銀行	275,200	645.00	177,504,000	
武蔵野銀行	19,700	3,575.00	70,427,500	
千葉興業銀行	34,100	611.00	20,835,100	
筑波銀行	51,600	344.00	17,750,400	
七十七銀行	194,000	522.00	101,268,000	
青森銀行	96,000	385.00	36,960,000	
秋田銀行	81,000	354.00	28,674,000	
山形銀行	70,000	476.00	33,320,000	
岩手銀行	8,100	4,680.00	37,908,000	
東邦銀行	111,000	426.00	47,286,000	
東北銀行	65,000	156.00	10,140,000	
みちのく銀行	63,000	190.00	11,970,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	503,000	516.00	259,548,000	
静岡銀行	337,000	984.00	331,608,000	
十六銀行	166,000	395.00	65,570,000	
スルガ銀行	126,700	2,455.00	311,048,500	
八十二銀行	238,900	698.00	166,752,200	
山梨中央銀行	77,000	527.00	40,579,000	
大垣共立銀行	165,000	369.00	60,885,000	
福井銀行	106,000	267.00	28,302,000	
北國銀行	131,000	458.00	59,998,000	
清水銀行	4,200	3,645.00	15,309,000	
富山銀行	2,400	4,145.00	9,948,000	
滋賀銀行	116,000	616.00	71,456,000	
南都銀行	12,000	4,540.00	54,480,000	
百五銀行	111,000	501.00	55,611,000	
京都銀行	222,000	914.00	202,908,000	
紀陽銀行	46,500	1,860.00	86,490,000	
三重銀行	5,600	2,406.00	13,473,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	82,400	1,943.00	160,103,200	
広島銀行	365,000	528.00	192,720,000	
山陰合同銀行	74,400	995.00	74,028,000	
中国銀行	87,800	1,764.00	154,879,200	
鳥取銀行	4,000	1,845.00	7,380,000	
伊予銀行	132,400	817.00	108,170,800	
百十四銀行	136,000	393.00	53,448,000	
四国銀行	96,000	300.00	28,800,000	
阿波銀行	106,000	778.00	82,468,000	
大分銀行	71,000	444.00	31,524,000	
宮崎銀行	83,000	361.00	29,963,000	

佐賀銀行	75,000	304.00	22,800,000	
十八銀行	76,000	361.00	27,436,000	
沖縄銀行	12,000	4,175.00	50,100,000	
琉球銀行	25,500	1,582.00	40,341,000	
セブン銀行	464,400	349.00	162,075,600	
みずほフィナンシャルグループ	16,819,100	208.40	3,505,100,440	
高知銀行	47,000	134.00	6,298,000	
山口フィナンシャルグループ	116,000	1,279.00	148,364,000	
アクリーティブ	10,600	382.00	4,049,200	
芙蓉総合リース	14,200	5,390.00	76,538,000	
興銀リース	23,300	2,541.00	59,205,300	
東京センチュリー	24,900	3,800.00	94,620,000	
S B I ホールディングス	140,000	1,570.00	219,800,000	
日本証券金融	54,300	634.00	34,426,200	
アイフル	207,700	349.00	72,487,300	
日本アジア投資	12,200	479.00	5,843,800	
ポケットカード	9,400	607.00	5,705,800	
長野銀行	4,100	1,991.00	8,163,100	
名古屋銀行	10,400	4,175.00	43,420,000	
北洋銀行	202,000	461.00	93,122,000	
愛知銀行	4,200	6,860.00	28,812,000	
第三銀行	7,100	1,733.00	12,304,300	
中京銀行	5,100	2,280.00	11,628,000	
大光銀行	44,000	243.00	10,692,000	
愛媛銀行	14,700	1,380.00	20,286,000	
トマト銀行	4,900	1,611.00	7,893,900	
みなと銀行	11,200	2,217.00	24,830,400	
京葉銀行	101,000	518.00	52,318,000	
関西アーバン銀行	17,300	1,484.00	25,673,200	
栃木銀行	68,300	562.00	38,384,600	
北日本銀行	3,900	3,175.00	12,382,500	
東和銀行	233,000	118.00	27,494,000	
福島銀行	136,000	95.00	12,920,000	
大東銀行	65,000	172.00	11,180,000	
リコーリース	9,700	3,685.00	35,744,500	
イオンフィナンシャルサービス	79,100	2,151.00	170,144,100	
アコム	249,000	483.00	120,267,000	
ジャックス	68,000	501.00	34,068,000	
オリエントコーポレーション	267,600	210.00	56,196,000	
日立キャピタル	29,200	2,904.00	84,796,800	
アプラスフィナンシャル	60,100	114.00	6,851,400	
オリックス	877,300	1,742.50	1,528,695,250	
三菱UFJリース	314,200	623.00	195,746,600	
ジャフコ	20,700	3,770.00	78,039,000	
トモニホールディングス	102,200	627.00	64,079,400	
大和証券グループ本社	1,159,000	702.00	813,618,000	
野村ホールディングス	2,532,800	720.60	1,825,135,680	

岡三証券グループ	105,000	733.00	76,965,000	
丸三証券	39,400	958.00	37,745,200	
東洋証券	44,000	275.00	12,100,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	142,000	650.00	92,300,000	
光世証券	30,000	187.00	5,610,000	
水戸証券	38,500	313.00	12,050,500	
いちよし証券	27,700	867.00	24,015,900	
松井証券	70,600	924.00	65,234,400	
SOMPOホールディングス	259,000	4,176.00	1,081,584,000	
だいがう証券ビジネス	6,200	635.00	3,937,000	
日本取引所グループ	385,200	1,563.00	602,067,600	
マネックスグループ	132,900	290.00	38,541,000	
カブドットコム証券	92,300	384.00	35,443,200	
極東証券	16,600	1,661.00	27,572,600	
岩井コスモホールディングス	11,700	1,086.00	12,706,200	
藍澤証券	23,200	654.00	15,172,800	
フィデアホールディングス	120,400	213.00	25,645,200	
池田泉州ホールディングス	131,400	502.00	65,962,800	
アニコムホールディングス	8,400	2,209.00	18,555,600	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	370,200	3,769.00	1,395,283,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	118,700	1,975.00	234,432,500	
マネーパートナーズグループ	15,900	521.00	8,283,900	
小林洋行	4,300	295.00	1,268,500	
第一生命ホールディングス	747,100	2,110.50	1,576,754,550	
東京海上ホールディングス	501,900	4,886.00	2,452,283,400	
イー・ギャランティ	3,700	2,615.00	9,675,500	
アサックス	2,300	1,684.00	3,873,200	
NECキャピタルソリューション	5,000	1,782.00	8,910,000	
T&Dホールディングス	451,500	1,733.00	782,449,500	
アドバンスクリエイト	3,000	2,065.00	6,195,000	
三井不動産	657,000	2,542.50	1,670,422,500	
三菱地所	921,000	2,219.00	2,043,699,000	
平和不動産	23,400	1,582.00	37,018,800	
東京建物	143,700	1,582.00	227,333,400	
ダイビル	31,900	1,014.00	32,346,600	
京阪神ビルディング	20,600	653.00	13,451,800	
住友不動産	297,000	3,120.00	926,640,000	
太平洋興発	53,000	106.00	5,618,000	
大京	230,000	234.00	53,820,000	
テーオーシー	48,100	908.00	43,674,800	
東京楽天地	21,000	523.00	10,983,000	
レオパレス21	156,300	589.00	92,060,700	
スターツコーポレーション	12,600	2,439.00	30,731,400	
フジ住宅	15,800	747.00	11,802,600	

空港施設	15,100	592.00	8,939,200	
明和地所	7,000	763.00	5,341,000	
住友不動産販売	11,100	2,850.00	31,635,000	
ゴールドクレスト	11,200	2,062.00	23,094,400	
リログループ	4,900	16,010.00	78,449,000	
日本エスリード	4,900	1,501.00	7,354,900	
日神不動産	14,700	582.00	8,555,400	
日本エスコン	16,700	391.00	6,529,700	
タカラレーベン	54,100	593.00	32,081,300	
サンヨーハウジング名古屋	6,400	992.00	6,348,800	
イオンモール	79,700	1,705.00	135,888,500	
ファースト住建	4,700	1,449.00	6,810,300	
ランド	64,400	18.00	1,159,200	
東祥	2,800	4,865.00	13,622,000	
トーセイ	17,000	765.00	13,005,000	
穴吹興産	1,400	2,691.00	3,767,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	76,900	1,029.00	79,130,100	
サンフロンティア不動産	13,300	1,015.00	13,499,500	
エフ・ジェー・ネクスト	10,900	783.00	8,534,700	
ランドビジネス	8,000	293.00	2,344,000	
グランディハウス	11,100	417.00	4,628,700	
東武鉄道	670,000	573.00	383,910,000	
相鉄ホールディングス	201,000	560.00	112,560,000	
東京急行電鉄	682,000	831.00	566,742,000	
京浜急行電鉄	344,000	1,238.00	425,872,000	
小田急電鉄	201,100	2,202.00	442,822,200	
京王電鉄	351,000	877.00	307,827,000	
京成電鉄	94,100	2,658.00	250,117,800	
富士急行	34,000	1,019.00	34,646,000	
新京成電鉄	16,000	421.00	6,736,000	
東日本旅客鉄道	242,800	10,175.00	2,470,490,000	
西日本旅客鉄道	120,800	7,422.00	896,577,600	
東海旅客鉄道	104,400	18,360.00	1,916,784,000	
西武ホールディングス	173,300	1,928.00	334,122,400	
鴻池運輸	17,700	1,424.00	25,204,800	
西日本鉄道	151,000	492.00	74,292,000	
ハマキョウレックス	8,200	2,316.00	18,991,200	
サカイ引越センター	4,300	3,105.00	13,351,500	
近鉄グループホールディングス	1,263,000	416.00	525,408,000	
阪急阪神ホールディングス	158,500	3,730.00	591,205,000	
南海電気鉄道	265,000	551.00	146,015,000	
京阪ホールディングス	281,000	710.00	199,510,000	
神戸電鉄	31,000	381.00	11,811,000	
名古屋鉄道	457,000	514.00	234,898,000	
山陽電気鉄道	46,000	605.00	27,830,000	
トランコム	3,600	5,840.00	21,024,000	
日本通運	485,000	583.00	282,755,000	

ヤマトホールディングス	224,400	2,462.00	552,472,800	
山九	165,000	713.00	117,645,000	
日新	51,000	369.00	18,819,000	
丸運	7,100	255.00	1,810,500	
丸全昭和運輸	42,000	443.00	18,606,000	
センコー	56,400	740.00	41,736,000	
トナミホールディングス	26,000	364.00	9,464,000	
ニッコンホールディングス	42,500	2,469.00	104,932,500	
日本石油輸送	1,400	2,501.00	3,501,400	
福山通運	76,000	672.00	51,072,000	
セイノーホールディングス	88,900	1,291.00	114,769,900	
神奈川中央交通	15,000	725.00	10,875,000	
日立物流	26,100	2,310.00	60,291,000	
丸和運輸機関	3,200	2,527.00	8,086,400	
C & F ロジホールディングス	13,100	1,573.00	20,606,300	
日本郵船	1,060,000	243.00	257,580,000	
商船三井	658,000	367.00	241,486,000	
川崎汽船	476,000	295.00	140,420,000	
N S ユナイテッド海運	56,000	240.00	13,440,000	
明治海運	11,400	432.00	4,924,800	
飯野海運	64,900	520.00	33,748,000	
共栄タンカー	11,000	230.00	2,530,000	
九州旅客鉄道	93,500	3,455.00	323,042,500	
日本航空	226,100	3,670.00	829,787,000	
A N A ホールディングス	2,330,000	334.70	779,851,000	
パスコ	12,000	420.00	5,040,000	
三菱倉庫	82,000	1,614.00	132,348,000	
三井倉庫ホールディングス	73,000	341.00	24,893,000	
住友倉庫	91,000	645.00	58,695,000	
澁澤倉庫	33,000	356.00	11,748,000	
ヤマタネ	6,300	1,610.00	10,143,000	
東陽倉庫	22,200	304.00	6,748,800	
乾汽船	9,200	984.00	9,052,800	
日本トランスシティ	29,000	465.00	13,485,000	
ケイヒン	23,000	159.00	3,657,000	
中央倉庫	7,400	1,097.00	8,117,800	
安田倉庫	9,700	805.00	7,808,500	
東洋埠頭	37,000	187.00	6,919,000	
宇徳	10,400	419.00	4,357,600	
上組	150,000	1,055.00	158,250,000	
サンリツ	1,700	520.00	884,000	
キムラユニティー	3,300	1,183.00	3,903,900	
キューソー流通システム	3,900	2,829.00	11,033,100	
郵船ロジスティクス	11,500	1,198.00	13,777,000	
近鉄エクスプレス	22,500	1,718.00	38,655,000	
東海運	7,200	456.00	3,283,200	
エーアイティー	7,700	1,014.00	7,807,800	

内外トランスライン	3,800	1,088.00	4,134,400	
東京放送ホールディングス	81,600	2,051.00	167,361,600	
日本テレビホールディングス	113,000	2,011.00	227,243,000	
朝日放送	12,100	782.00	9,462,200	
テレビ朝日ホールディングス	33,800	2,318.00	78,348,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	80,400	504.00	40,521,600	
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,645.00	26,714,500	
日本BS放送	2,800	1,020.00	2,856,000	
ビジョン	1,400	3,615.00	5,061,000	
U-NEXT	3,400	1,037.00	3,525,800	
ワイヤレスゲート	4,100	1,549.00	6,350,900	
コネクシオ	10,900	1,621.00	17,668,900	
日本通信	104,200	183.00	19,068,600	
クロップス	1,400	610.00	854,000	
日本電信電話	994,500	4,788.00	4,761,666,000	
KDDI	1,225,600	2,969.00	3,638,806,400	
光通信	14,900	11,040.00	164,496,000	
NTTドコモ	925,700	2,687.50	2,487,818,750	
エムティーアイ	19,000	685.00	13,015,000	
GMOインターネット	45,300	1,459.00	66,092,700	
カドカワ	35,900	1,700.00	61,030,000	
学研ホールディングス	41,000	310.00	12,710,000	
ゼンリン	16,400	2,201.00	36,096,400	
昭文社	6,900	719.00	4,961,100	
インプレスホールディングス	11,100	146.00	1,620,600	
東京電力ホールディングス	1,064,800	429.00	456,799,200	
中部電力	413,500	1,484.00	613,634,000	
関西電力	512,300	1,251.00	640,887,300	
中国電力	173,400	1,239.00	214,842,600	
北陸電力	122,800	1,115.00	136,922,000	
東北電力	313,500	1,437.00	450,499,500	
四国電力	113,000	1,132.00	127,916,000	
九州電力	277,300	1,245.00	345,238,500	
北海道電力	117,500	809.00	95,057,500	
沖縄電力	18,500	2,598.00	48,063,000	
電源開発	99,800	2,619.00	261,376,200	
エフオン	5,300	981.00	5,199,300	
イーレックス	5,300	3,425.00	18,152,500	
東京瓦斯	1,346,000	511.30	688,209,800	
大阪瓦斯	1,218,000	434.00	528,612,000	
東邦瓦斯	316,000	790.00	249,640,000	
北海道瓦斯	31,000	279.00	8,649,000	
広島ガス	26,000	371.00	9,646,000	
西部瓦斯	142,000	267.00	37,914,000	
静岡ガス	38,600	713.00	27,521,800	
メタウォーター	7,100	2,844.00	20,192,400	
アイネット	7,100	1,225.00	8,697,500	

松竹	82,000	1,299.00	106,518,000	
東宝	81,000	3,180.00	257,580,000	
エイチ・アイ・エス	21,400	2,986.00	63,900,400	
東映	46,000	1,008.00	46,368,000	
ラックランド	2,200	2,022.00	4,448,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	76,500	5,300.00	405,450,000	
共立メンテナンス	10,600	7,060.00	74,836,000	
イチネンホールディングス	13,900	1,177.00	16,360,300	
建設技術研究所	8,400	1,064.00	8,937,600	
スペース	7,000	1,318.00	9,226,000	
アインホールディングス	16,200	8,090.00	131,058,000	
燦ホールディングス	2,600	1,590.00	4,134,000	
ピー・シー・エー	1,800	1,595.00	2,871,000	
スバル興業	10,000	507.00	5,070,000	
東京テアトル	52,000	153.00	7,956,000	
タナベ経営	2,700	1,393.00	3,761,100	
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,047.00	1,779,900	
ナガワ	2,400	4,425.00	10,620,000	
よみうりランド	26,000	462.00	12,012,000	
東京都競馬	90,000	261.00	23,490,000	
常磐興産	5,000	1,612.00	8,060,000	
カナモト	18,300	2,858.00	52,301,400	
東京ドーム	52,300	1,123.00	58,732,900	
D T S	12,800	2,590.00	33,152,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	47,700	3,440.00	164,088,000	
シーイーシー	7,400	1,814.00	13,423,600	
カプコン	29,000	2,289.00	66,381,000	
西尾レントオール	10,600	3,210.00	34,026,000	
アイ・エス・ビー	2,300	918.00	2,111,400	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	72,000	37.00	2,664,000	
日本空港ビルデング	39,500	3,950.00	156,025,000	
トランス・コスモス	15,200	2,589.00	39,352,800	
乃村工藝社	28,100	1,859.00	52,237,900	
ジャステック	7,900	1,045.00	8,255,500	
S C S K	33,700	4,160.00	140,192,000	
藤田観光	43,000	357.00	15,351,000	
K N T - C Tホールディングス	72,000	135.00	9,720,000	
日本管財	11,300	1,825.00	20,622,500	
トーカイ	5,800	4,025.00	23,345,000	
白洋舎	500	2,715.00	1,357,500	
セコム	136,400	8,178.00	1,115,479,200	
日本システムウエア	4,100	1,529.00	6,268,900	
セントラル警備保障	5,800	1,823.00	10,573,400	
アイネス	15,600	1,114.00	17,378,400	
丹青社	22,700	846.00	19,204,200	

メイテック	15,900	4,395.00	69,880,500	
T K C	11,500	3,235.00	37,202,500	
アサツー ディ・ケイ	21,400	2,930.00	62,702,000	
富士ソフト	18,400	2,868.00	52,771,200	
応用地質	12,400	1,444.00	17,905,600	
船井総研ホールディングス	16,900	1,986.00	33,563,400	
N S D	26,300	1,710.00	44,973,000	
進学会	5,500	572.00	3,146,000	
丸紅建材リース	12,000	237.00	2,844,000	
オオバ	9,700	484.00	4,694,800	
コナミホールディングス	55,900	4,735.00	264,686,500	
学究社	3,500	1,644.00	5,754,000	
ベネッセホールディングス	43,900	3,395.00	149,040,500	
イオンディライト	14,800	3,440.00	50,912,000	
ナック	8,100	1,007.00	8,156,700	
福井コンピュータホールディングス	3,600	2,847.00	10,249,200	
ニチイ学館	22,800	864.00	19,699,200	
ダイセキ	22,900	2,349.00	53,792,100	
ステップ	4,500	1,409.00	6,340,500	
日鉄住金物産	10,800	4,795.00	51,786,000	
元気寿司	3,200	2,258.00	7,225,600	
トラスコ中山	28,300	2,542.00	71,938,600	
ヤマダ電機	414,300	569.00	235,736,700	
オートバックスセブン	45,800	1,784.00	81,707,200	
モリト	9,900	964.00	9,543,600	
アークランドサカモト	21,000	1,467.00	30,807,000	
ニトリホールディングス	53,500	12,970.00	693,895,000	
グルメ杵屋	9,000	1,070.00	9,630,000	
愛眼	9,700	198.00	1,920,600	
ケーユーホールディングス	6,500	926.00	6,019,000	
吉野家ホールディングス	43,100	1,640.00	70,684,000	
加藤産業	19,400	2,953.00	57,288,200	
イノテック	10,800	713.00	7,700,400	
イエローハット	11,700	2,865.00	33,520,500	
松屋フーズ	6,000	4,225.00	25,350,000	
J B C Cホールディングス	10,500	801.00	8,410,500	
J Kホールディングス	12,400	658.00	8,159,200	
サガミチェーン	15,600	1,388.00	21,652,800	
日伝	5,100	3,505.00	17,875,500	
関西スーパーマーケット	10,200	1,547.00	15,779,400	
ミロク情報サービス	9,200	1,697.00	15,612,400	
北沢産業	11,000	217.00	2,387,000	
杉本商事	7,200	1,569.00	11,296,800	
因幡電機産業	17,300	3,965.00	68,594,500	
王将フードサービス	9,100	4,170.00	37,947,000	
プレナス	13,900	2,414.00	33,554,600	
ミニストップ	9,100	2,142.00	19,492,200	

アークス	23,200	2,528.00	58,649,600	
パローホールディングス	26,700	2,778.00	74,172,600	
バイテックホールディングス	5,100	1,360.00	6,936,000	
ミスミグループ本社	139,200	1,976.00	275,059,200	
アルテック	11,200	215.00	2,408,000	
ベルク	5,500	4,510.00	24,805,000	
大 庄	6,700	1,525.00	10,217,500	
タキヒヨー	19,000	462.00	8,778,000	
ファーストリテイリング	20,700	35,250.00	729,675,000	
ソフトバンクグループ	557,700	8,393.00	4,680,776,100	
蔵王産業	2,000	1,511.00	3,022,000	
スズケン	56,400	3,800.00	214,320,000	
サンドラッグ	23,600	7,410.00	174,876,000	
サックスパー ホールディングス	11,700	1,236.00	14,461,200	
ジェコス	8,600	1,118.00	9,614,800	
ヤマザワ	2,600	1,827.00	4,750,200	
やまや	2,600	1,726.00	4,487,600	
ルネサスイーストン	11,200	610.00	6,832,000	
ベルーナ	31,000	854.00	26,474,000	
合計	189,890,120		280,719,581,820	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘 柄	株 式 数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

D I A M バランス・ファン ド＜D C 年金＞3 成長 型	2, 637, 655, 262円	2, 718, 978, 952円
D I A M D C バラン ス3 0 インデックスファ ンド	1, 668, 885, 289円	1, 657, 494, 852円
D I A M D C バラン ス5 0 インデックスファ ンド	1, 829, 884, 341円	1, 744, 690, 480円
D I A M D C バラン ス7 0 インデックスファ ンド	275, 586, 880円	247, 785, 929円
マネックス資産設計ファ ンド＜隔月分配型＞	118, 176, 862円	98, 517, 017円
マネックス資産設計ファ ンド＜育成型＞	2, 437, 259, 337円	2, 182, 976, 967円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	7, 449, 695円	1, 831, 280円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド（新興 国1 0）	223, 190, 480円	356, 002, 601円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド（新興 国2 0）	166, 232, 315円	254, 997, 478円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド（新興 国3 0）	41, 960, 388円	63, 187, 247円
投資のソムリエ	5, 533, 410, 782円	7, 588, 674, 489円
クルーズコントロール	604, 204, 415円	2, 463, 848, 090円
投資のソムリエ＜D C 年 金＞	99, 483, 266円	240, 441, 643円
D I A M 8 資産バラン スファンドN＜D C 年金 ＞	706, 595, 262円	1, 159, 116, 457円
D I A M D C バラン ス・F（成長型）	50, 283, 533円	121, 311, 364円
クルーズコントロール＜ D C 年金＞	151, 948円	909, 502円
D I A M コア資産設計フ ァンド（堅実型）	2, 220, 634円	6, 058, 111円
D I A M コア資産設計フ ァンド（積極型）	3, 942, 514円	19, 630, 847円
投資のソムリエ＜D C 年 金＞リスク抑制型	10, 975, 697円	145, 993, 757円
ダイナミック・ナビゲー ション	－円	460, 972円
リスク抑制世界8 資産バ ランスファンド	－円	797, 399, 737円
みずほエマージングボン ドオープン	10, 801, 911円	10, 801, 911円

D I AM高金利通貨ファン ド	9,608,918円	9,608,918円
D I AMエマージング債 券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I AM国内債券パッシ ブファンド（適格機関投 資家向け）	31,110,776,277円	31,037,609,957円
D I AMアクティブアロ ケーション私募ファンド （適格機関投資家限定）	925,357,458円	548,565,885円
D I AMワールドバラン ス25VA（適格機関投 資家限定）	598,181,155円	511,856,892円
D I AMグローバル・バ ランスファンド25VA （適格機関投資家限定）	890,668,185円	452,644,236円
D I AMグローバル・バ ランスファンド50VA （適格機関投資家限定）	295,141,650円	278,222,935円
D I AM国際分散バラン スファンド30VA（適 格機関投資家限定）	145,393,586円	113,027,666円
D I AM国際分散バラン スファンド50VA（適 格機関投資家限定）	396,454,681円	315,455,060円
D I AM国内重視バラン スファンド30VA（適 格機関投資家限定）	158,862,523円	131,854,367円
D I AM国内重視バラン スファンド50VA（適 格機関投資家限定）	122,661,862円	72,187,907円
D I AM世界バランスフ ァンド40VA（適格機 関投資家限定）	12,416,124,695円	2,253,845,204円
D I AM世界バランスフ ァンド50VA（適格機 関投資家限定）	4,716,711,039円	1,015,599,225円
D I AMバランスファン ド25VA（適格機関投 資家限定）	8,456,183,355円	6,998,400,243円
D I AMバランスファン ド37.5VA（適格機 関投資家限定）	3,795,959,754円	3,474,267,418円
D I AMバランスファン ド50VA（適格機関投 資家限定）	6,570,343,905円	6,265,110,925円
D I AMグローバル・ア セット・バランスVA （適格機関投資家限定）	787,739,006円	734,607,542円

D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	3,456,549,937円	1,931,112,724円
D I A M アクサ グロ ーバル バランスファン ド30V A (適格機関投 資家限定)	4,821,704,426円	4,285,930,749円
D I A M世界アセットバ ランスファンドV A (適 格機関投資家向け)	6,663,294,119円	5,583,515,787円
D I A Mグローバルβ私 募ファンド (適格機関投 資家向け)	839,267,900円	273,887,149円
D I A M世界バランスフ ァンド55V A (適格機 関投資家限定)	6,555,700,476円	5,572,131,426円
D I A M世界バランスフ ァンド35V A (適格機 関投資家限定)	6,940,477,535円	6,745,903,203円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2V A (適格機関投資家限定)	89,526,721,508円	88,332,879,239円
D I A M世界アセットバ ランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	1,276,115,973円	1,204,275,501円
D I A M世界アセットバ ランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	7,766,460,038円	7,547,500,500円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3V A (適格機関投資家限定)	28,803,192,292円	27,992,746,964円
D I A Mバランス30V A (適格機関投資家限 定)	58,681,744円	95,642,492円
D I A Mバランス50V A (適格機関投資家限 定)	29,226,882円	369,888円
D I A Mバランス70V A (適格機関投資家限 定)	9,770,347円	8,244,501円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4V A (適格機関投資家限定)	32,292,361,602円	31,327,804,436円
D I A M世界バランス 25V A (適格機関投資 家限定)	593,551,673円	547,765,920円
D I A M国内バランス 30V A (適格機関投資 家限定)	158,113,403円	139,363,216円

D I A M バランス 2 0 V A (適格機関投資家限 定)	641, 936, 416円	640, 261, 286円
D I A M バランス 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	69, 505, 002円	454, 852円
D I A M バランス 6 0 V A (適格機関投資家限 定)	330, 308円	351, 483円
計	311, 246, 557, 550円	295, 190, 206, 036円
2. 受益権の総数	311, 246, 557, 550口	295, 190, 206, 036口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	6,348,296,900	1,861,783,300
地方債証券	118,622,402	52,629,642
特殊債券	55,700,444	14,982,365
社債券	59,665,370	25,950,390
合計	6,582,285,116	1,955,345,697

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月16日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月15日から平成29年2月27日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.2829円	1.2800円
(1万口当たり純資産額)	(12,829円)	(12,800円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年2月27日現在

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

299回 利付国庫債券（10年）	900,000,000	928,674,000	
301回 利付国庫債券（10年）	2,900,000,000	3,015,855,000	
303回 利付国庫債券（10年）	1,300,000,000	1,353,781,000	
305回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,605,425,000	
306回 利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,572,960,000	
308回 利付国庫債券（10年）	800,000,000	839,208,000	
309回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,042,370,000	
310回 利付国庫債券（10年）	2,800,000,000	2,916,676,000	
312回 利付国庫債券（10年）	2,200,000,000	2,314,554,000	
313回 利付国庫債券（10年）	3,000,000,000	3,177,990,000	
315回 利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,587,375,000	
317回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,056,850,000	
318回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,052,270,000	
319回 利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,589,205,000	
320回 利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,581,960,000	
321回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,642,975,000	
324回 利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,097,660,000	
325回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,837,349,000	
326回 利付国庫債券（10年）	1,700,000,000	1,779,934,000	
328回 利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,563,930,000	
329回 利付国庫債券（10年）	1,200,000,000	1,268,112,000	
330回 利付国庫債券（10年）	1,700,000,000	1,799,178,000	
332回 利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,092,340,000	
333回 利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,094,220,000	
334回 利付国庫債券（10年）	2,600,000,000	2,722,876,000	
335回 利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,081,060,000	
336回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,041,050,000	
337回 利付国庫債券（10年）	1,300,000,000	1,333,033,000	
338回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,583,625,000	
339回 利付国庫債券（10年）	2,300,000,000	2,377,372,000	
340回 利付国庫債券（10年）	3,000,000,000	3,101,340,000	
341回 利付国庫債券（10年）	3,500,000,000	3,587,710,000	
342回 利付国庫債券（10年）	4,000,000,000	4,027,080,000	
343回 利付国庫債券（10年）	4,000,000,000	4,025,960,000	
344回 利付国庫債券（10年）	4,000,000,000	4,022,840,000	
345回 利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,010,720,000	
1回 利付国庫債券（30年）	100,000,000	132,251,000	
2回 利付国庫債券（30年）	100,000,000	127,904,000	
3回 利付国庫債券（30年）	200,000,000	253,926,000	
4回 利付国庫債券（30年）	200,000,000	271,220,000	
5回 利付国庫債券（30年）	200,000,000	253,376,000	
6回 利付国庫債券（30年）	200,000,000	259,954,000	
7回 利付国庫債券（30年）	300,000,000	386,484,000	
8回 利付国庫債券（30年）	300,000,000	365,121,000	
11回 利付国庫債券（30年）	400,000,000	481,060,000	
12回 利付国庫債券（30年）	300,000,000	379,779,000	
13回 利付国庫債券（30年）	300,000,000	375,585,000	

1 4 回	利付国庫債券（3 0 年）	500,000,000	659,630,000	
1 5 回	利付国庫債券（3 0 年）	200,000,000	267,538,000	
1 6 回	利付国庫債券（3 0 年）	400,000,000	535,160,000	
1 7 回	利付国庫債券（3 0 年）	200,000,000	264,726,000	
1 8 回	利付国庫債券（3 0 年）	820,000,000	1,071,485,800	
1 9 回	利付国庫債券（3 0 年）	200,000,000	261,464,000	
2 0 回	利付国庫債券（3 0 年）	300,000,000	402,909,000	
2 1 回	利付国庫債券（3 0 年）	500,000,000	654,700,000	
2 2 回	利付国庫債券（3 0 年）	470,000,000	632,408,500	
2 3 回	利付国庫債券（3 0 年）	600,000,000	808,410,000	
2 4 回	利付国庫債券（3 0 年）	300,000,000	404,364,000	
2 5 回	利付国庫債券（3 0 年）	400,000,000	525,488,000	
2 6 回	利付国庫債券（3 0 年）	700,000,000	933,877,000	
2 7 回	利付国庫債券（3 0 年）	900,000,000	1,221,858,000	
2 8 回	利付国庫債券（3 0 年）	800,000,000	1,090,216,000	
2 9 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,100,000,000	1,483,592,000	
3 0 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,000,000,000	1,333,670,000	
3 1 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,100,000,000	1,449,657,000	
3 2 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,200,000,000	1,611,480,000	
3 3 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,300,000,000	1,665,313,000	
3 4 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,200,000,000	1,595,172,000	
3 5 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,500,000,000	1,932,900,000	
3 6 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,400,000,000	1,809,122,000	
3 7 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,400,000,000	1,781,570,000	
3 8 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,000,000,000	1,252,020,000	
3 9 回	利付国庫債券（3 0 年）	800,000,000	1,022,336,000	
4 0 回	利付国庫債券（3 0 年）	700,000,000	878,325,000	
4 1 回	利付国庫債券（3 0 年）	800,000,000	986,120,000	
4 2 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,000,000,000	1,233,050,000	
4 3 回	利付国庫債券（3 0 年）	800,000,000	986,776,000	
4 4 回	利付国庫債券（3 0 年）	800,000,000	987,080,000	
4 5 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,000,000,000	1,184,820,000	
4 6 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,200,000,000	1,421,760,000	
4 7 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,000,000,000	1,211,180,000	
4 8 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,100,000,000	1,277,166,000	
4 9 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,000,000,000	1,160,840,000	
5 0 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,200,000,000	1,205,676,000	
5 1 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,100,000,000	960,311,000	
5 2 回	利付国庫債券（3 0 年）	1,100,000,000	1,017,467,000	
5 3 回	利付国庫債券（3 0 年）	200,000,000	190,144,000	
4 0 回	利付国庫債券（2 0 年）	720,000,000	748,915,200	
4 2 回	利付国庫債券（2 0 年）	800,000,000	846,760,000	
4 3 回	利付国庫債券（2 0 年）	860,000,000	928,610,800	
4 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	900,000,000	971,253,000	
4 6 回	利付国庫債券（2 0 年）	500,000,000	539,440,000	
4 7 回	利付国庫債券（2 0 年）	950,000,000	1,030,246,500	
4 8 回	利付国庫債券（2 0 年）	500,000,000	550,850,000	

5 0 回	利付国庫債券（2 0 年）	780,000,000	845,098,800
5 1 回	利付国庫債券（2 0 年）	600,000,000	655,488,000
5 2 回	利付国庫債券（2 0 年）	550,000,000	606,243,000
5 4 回	利付国庫債券（2 0 年）	700,000,000	778,680,000
5 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	810,000,000	897,552,900
5 7 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,130,000,000	1,251,508,900
5 8 回	利付国庫債券（2 0 年）	600,000,000	667,416,000
6 0 回	利付国庫債券（2 0 年）	990,000,000	1,076,714,100
6 1 回	利付国庫債券（2 0 年）	800,000,000	853,576,000
6 2 回	利付国庫債券（2 0 年）	800,000,000	845,136,000
6 4 回	利付国庫債券（2 0 年）	600,000,000	678,072,000
6 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,100,000,000	1,248,170,000
6 7 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,900,000,000	2,164,499,000
7 0 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,250,000,000	1,473,962,500
7 2 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,250,000,000	1,451,637,500
7 3 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,190,000,000	1,377,912,900
7 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,400,000,000	1,638,700,000
7 8 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,450,000,000	1,680,173,000
8 1 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,400,000,000	1,638,868,000
8 3 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,400,000,000	1,657,418,000
8 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,400,000,000	1,663,116,000
8 8 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,200,000,000	1,453,404,000
9 0 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,200,000,000	1,448,124,000
9 2 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,300,000,000	1,561,560,000
9 3 回	利付国庫債券（2 0 年）	700,000,000	836,101,000
9 4 回	利付国庫債券（2 0 年）	800,000,000	963,544,000
9 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,200,000,000	1,475,268,000
9 7 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,400,000,000	1,712,466,000
9 9 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,400,000,000	1,702,036,000
1 0 0 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,300,000,000	1,599,286,000
1 0 2 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,400,000,000	1,757,952,000
1 0 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,300,000,000	1,592,474,000
1 0 7 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,700,000,000	2,086,954,000
1 0 9 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,600,000,000	1,931,456,000
1 1 1 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,600,000,000	1,993,840,000
1 1 3 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,500,000,000	1,854,750,000
1 1 4 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,500,000,000	1,859,310,000
1 1 6 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,800,000,000	2,257,920,000
1 1 8 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,000,000,000	1,230,870,000
1 1 9 回	利付国庫債券（2 0 年）	900,000,000	1,083,798,000
1 2 1 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,700,000,000	2,073,218,000
1 2 3 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,700,000,000	2,122,518,000
1 2 5 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,800,000,000	2,276,478,000
1 2 8 回	利付国庫債券（2 0 年）	700,000,000	857,136,000
1 2 9 回	利付国庫債券（2 0 年）	900,000,000	1,089,639,000
1 3 0 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,500,000,000	1,817,610,000
1 3 2 回	利付国庫債券（2 0 年）	1,800,000,000	2,157,228,000

	1 3 4 回 利付国庫債券（20年）	900,000,000	1,092,060,000	
	1 3 5 回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	959,224,000	
	1 3 7 回 利付国庫債券（20年）	1,700,000,000	2,040,782,000	
	1 4 0 回 利付国庫債券（20年）	1,600,000,000	1,921,488,000	
	1 4 1 回 利付国庫債券（20年）	2,100,000,000	2,524,578,000	
	1 4 3 回 利付国庫債券（20年）	2,100,000,000	2,491,377,000	
	1 4 5 回 利付国庫債券（20年）	1,400,000,000	1,683,710,000	
	1 4 6 回 利付国庫債券（20年）	1,600,000,000	1,924,464,000	
	1 4 7 回 利付国庫債券（20年）	1,700,000,000	2,018,053,000	
	1 4 8 回 利付国庫債券（20年）	1,500,000,000	1,756,380,000	
	1 4 9 回 利付国庫債券（20年）	2,200,000,000	2,574,968,000	
	1 5 0 回 利付国庫債券（20年）	1,700,000,000	1,959,573,000	
	1 5 1 回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	2,012,580,000	
	1 5 2 回 利付国庫債券（20年）	1,300,000,000	1,451,866,000	
	1 5 3 回 利付国庫債券（20年）	1,900,000,000	2,153,080,000	
	1 5 4 回 利付国庫債券（20年）	1,500,000,000	1,671,195,000	
	1 5 5 回 利付国庫債券（20年）	1,600,000,000	1,722,704,000	
	1 5 6 回 利付国庫債券（20年）	1,500,000,000	1,449,945,000	
	1 5 7 回 利付国庫債券（20年）	1,500,000,000	1,391,370,000	
	1 5 8 回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,762,326,000	
	1 5 9 回 利付国庫債券（20年）	1,000,000,000	996,470,000	
国債証券 合計		288,020,000,000	317,647,724,400	
地方債証券	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	207,810,130	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	309,627,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	208,428,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	518,630,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	206,718,000	
	6 9 7 回 東京都公募公債	500,000,000	524,105,000	
	7 0 1 回 東京都公募公債	700,000,000	732,060,000	
	7 0 8 回 東京都公募公債	500,000,000	523,755,000	
	7 2 0 回 東京都公募公債	300,000,000	316,080,000	
	7 2 6 回 東京都公募公債	400,000,000	418,736,000	
	5 回 東京都公募公債 20年	100,000,000	116,095,000	
	9 回 東京都公募公債 20年	200,000,000	242,346,000	
	1 0 回 東京都公募公債 20年	300,000,000	361,761,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	207,944,000	
	2 2 年度 1 2 回 北海道公募公債	200,000,000	210,064,000	
	1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,371,000	
	1 9 4 回 神奈川県公募公債	300,000,000	313,521,000	
	2 0 8 回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,374,000	
	3 1 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	205,614,000	
	3 3 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	208,948,000	
	3 4 5 回 大阪府公募公債	300,000,000	314,400,000	
	3 5 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	210,198,000	
	3 6 4 回 大阪府公募公債	300,000,000	312,873,000	
	3 7 4 回 大阪府公募公債	300,000,000	317,139,000	
	2 6 年度 1 1 回 京都府公募公債	350,000,000	360,202,500	

2 6 年度 1 7 回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,384,000	
1 回 兵庫県公募公債 (1 2 年)	300,000,000	322,155,000	
2 1 年度 5 回 静岡県公募公債	197,000,000	203,963,950	
2 2 年度 8 回 静岡県公募公債	200,000,000	207,360,000	
2 3 年度 9 回 静岡県公募公債	200,000,000	209,866,000	
1 回 静岡県公募公債 2 0 年	100,000,000	117,393,000	
2 0 年度 4 回 愛知県公募公債	100,000,000	102,505,000	
2 2 年度 6 回 愛知県公募公債	200,000,000	208,022,000	
2 3 年度 2 0 回 愛知県公募公債	500,000,000	527,665,000	
2 5 年度 4 回 愛知県公募公債	300,000,000	315,570,000	
2 2 年度 1 回 広島県公募公債	200,000,000	208,848,000	
2 1 年度 4 回 埼玉県公募公債	200,000,000	207,006,000	
2 3 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	210,042,000	
2 6 年度 5 回 埼玉県公募公債	400,000,000	415,648,000	
2 1 年度 3 回 福岡県公募公債	200,000,000	207,686,000	
2 5 年度 1 1 回 福岡県公募公債	200,000,000	208,896,000	
2 1 年度 6 回 千葉県公募公債	200,000,000	207,208,000	
2 4 年度 7 回 千葉県公募公債	300,000,000	312,645,000	
2 5 年度 5 回 千葉県公募公債	200,000,000	210,430,000	
6 5 回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,394,000	
8 0 回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,388,000	
9 4 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	524,145,000	
9 9 回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	735,245,000	
1 0 6 回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,250,000	
1 0 9 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	527,205,000	
1 1 1 回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	732,949,000	
1 1 9 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,295,000	
1 2 1 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,755,000	
1 2 6 回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	833,991,950	
1 2 7 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,075,000	
1 2 8 回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,393,000	
1 3 7 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,875,000	
1 3 9 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,065,000	
1 4 2 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,415,000	
1 4 4 回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,512,000	
1 4 6 回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	414,280,000	
1 4 8 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,925,000	
4 8 8 回 名古屋市公募公債 1 0 年	450,000,000	467,158,500	
4 回 京都市公募公債 2 0 年	100,000,000	122,168,000	
2 2 年度 3 回 横浜市公募公債	200,000,000	208,270,000	
2 2 年度 5 回 横浜市公募公債	200,000,000	209,540,000	
2 3 年度 4 回 横浜市公募公債	450,000,000	472,036,500	
2 5 年度 2 回 横浜市公募公債	400,000,000	421,852,000	
2 5 年度 4 回 札幌市公募公債	200,000,000	209,706,000	
2 回 川崎市公募公債 1 5 年	100,000,000	105,389,000	
2 1 年度 2 回 北九州市公募公債	200,000,000	207,616,000	
2 3 年度 1 回 千葉市公募公債	200,000,000	211,316,000	

地方債証券 合計		22,844,400,000	23,951,302,530	
特殊債券	4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	724,570,000	
	9 6 回 高速道路機構債	700,000,000	728,952,000	
	1 1 6 回 高速道路機構債	100,000,000	104,362,000	
	9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,871,000	
	1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	330,174,000	
	6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	724,215,450	
	6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	165,912,300	
	6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	411,907,200	
	7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	615,606,000	
	7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	721,644,000	
	8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,556,000	
	8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,296,000	
	1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	419,628,000	
	1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,044,980,000	
	1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	517,795,000	
	1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	528,965,000	
	1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	349,988,100	
	2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	515,475,000	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	673,192,590	
	3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,798,610	
	5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	518,535,000	
	8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,517,000	
	1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,140,000	
	1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,134,000	
	2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,388,000	
	2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,186,000	
	3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,691,000	
	4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	420,580,000	
	5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,065,000	
	6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,595,000	
	3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	310,719,000	
	6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	55,488,000	59,217,348	

	8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,092,000	41,721,327	
	9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	57,975,000	61,929,474	
	2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	61,869,000	66,579,086	
	13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,095,000	27,258,576	
	14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	132,875,000	137,884,387	
	4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,233,000	38,104,996	
	43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,419,000	22,939,106	
	44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,908,000	86,605,541	
	51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,624,000	64,614,877	
	1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,705,000	115,384,922	
	29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	201,470,000	216,332,441	
	36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	373,528,000	397,680,320	
	755号 利付商工債	260,000,000	260,873,600	
	い第769号 利付商工債	200,000,000	201,090,000	
	い第779号 利付商工債	200,000,000	201,214,000	
	760号 利附農林債	300,000,000	301,848,000	
	764号 利附農林債	500,000,000	503,245,000	
	282回 利附信金中金債	300,000,000	301,074,000	
	293回 利附信金中金債	400,000,000	402,024,000	
	302回 利附信金中金債	300,000,000	301,572,000	
	186号 利附商工債（3年）	200,000,000	200,422,000	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	306,351,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	205,798,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	524,380,000	
特殊債券 合計		17,669,281,000	18,324,582,251	
社債券	1回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,871,000	
	337回 東京交通債	200,000,000	217,378,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,114,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	310,887,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	104,228,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,992,000	
	3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,571,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	104,057,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	102,918,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,852,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	104,285,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,582,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	101,330,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	210,072,000	
	16回 トヨタ自動車社債	100,000,000	103,352,000	
	49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	102,984,000	

9 4 回	丸紅社債	100,000,000	103,800,000	
4 5 回	住友商事社債	100,000,000	103,500,000	
4 7 回	住友商事社債	100,000,000	102,408,000	
6 9 回	三菱商事社債	300,000,000	307,338,000	
4 8 回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,397,000	
7 回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	105,349,000	
7 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	210,942,000	
2 5 回	三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	208,282,000	
2 8 回	三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	210,636,000	
3 2 回	三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	300,000,000	318,006,000	
4 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,023,000	
6 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	105,621,000	
7 回	三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	200,000,000	209,108,000	
9 回	三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	106,092,000	
1 2 回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,310,000	
1 0 回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	206,318,000	
1 0 回	セブン銀行社債	100,000,000	104,136,000	
2 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	209,994,000	
2 2 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	208,932,000	
2 3 回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	421,596,000	
1 4 回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	210,268,000	
1 5 回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	211,568,000	
4 7 回	日立キャピタル社債	200,000,000	206,580,000	
1 6 4 回	オリックス社債	100,000,000	102,475,000	
1 4 回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	103,452,000	
2 6 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,054,000	
4 6 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,370,000	
3 8 回	三井不動産社債	200,000,000	208,624,000	
7 2 回	三菱地所社債	100,000,000	114,610,000	
9 0 回	三菱地所社債	100,000,000	101,903,000	
9 6 回	三菱地所社債	200,000,000	207,358,000	
8 7 回	住友不動産社債	100,000,000	101,988,000	
1 5 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,177,000	
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,306,000	
3 9 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	345,756,000	
5 2 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	305,562,000	
5 6 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,486,000	
9 回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	222,162,000	
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	337,494,000	
5 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,476,000	
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,390,000	
1 1 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,037,000	
1 4 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,429,000	
1 5 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	209,096,000	
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,484,000	
6 0 回	日本電信電話社債	300,000,000	313,581,000	
1 5 回	ＮＴＴドコモ社債	200,000,000	205,220,000	

4 5 5 回 東京電力社債	200,000,000	206,224,000	
5 4 2 回 東京電力社債	500,000,000	508,225,000	
4 7 6 回 中部電力社債	100,000,000	102,801,000	
4 9 6 回 中部電力社債	500,000,000	518,410,000	
4 1 0 回 関西電力社債	300,000,000	310,056,000	
4 9 2 回 関西電力社債	200,000,000	202,068,000	
4 9 3 回 関西電力社債	200,000,000	202,088,000	
3 7 7 回 中国電力社債	200,000,000	211,332,000	
2 6 0 回 北陸電力社債	100,000,000	107,107,000	
2 8 1 回 北陸電力社債	200,000,000	204,546,000	
4 7 1 回 東北電力社債	200,000,000	211,894,000	
4 7 3 回 東北電力社債	300,000,000	305,088,000	
2 3 7 回 四国電力社債	100,000,000	103,510,000	
2 5 3 回 四国電力社債	200,000,000	209,860,000	
4 2 3 回 九州電力社債	200,000,000	204,254,000	
4 2 4 回 九州電力社債	200,000,000	212,114,000	
4 2 6 回 九州電力社債	400,000,000	419,888,000	
3 2 0 回 北海道電力社債	200,000,000	203,488,000	
3 2 1 回 北海道電力社債	161,000,000	167,320,860	
1 3 回 電源開発社債	200,000,000	227,716,000	
3 8 回 電源開発社債	300,000,000	314,430,000	
1 7 回 東京ガス社債	100,000,000	103,439,000	
1 8 回 大阪ガス社債	100,000,000	107,760,000	
2 7 回 N T T データ社債	100,000,000	103,785,000	
社債券 合計	15,861,000,000	16,594,570,860	
合計	344,394,681,000	376,518,180,041	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

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

(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。 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。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1.	※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	109,314,267,788円	101,062,929,782円
	同期中追加設定元本額	20,720,942,880円	17,462,001,997円
	同期中一部解約元本額	28,972,280,886円	26,912,951,299円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,265,346,668円	1,957,218,700円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	5,067,406円	4,597,665円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	10,330,738円	12,813,496円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	24,590,871円	27,139,952円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	12,074,361円	13,284,546円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	8,743,829円	12,182,802円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	9,184,637円	16,970,640円
	たわらノーロード 先進国株式	826,190,880円	2,401,466,878円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	－円	425,695円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	－円	95,071,790円
	D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	34,283,257,934円	35,537,387,647円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	169,874,284円	169,317,804円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	905,415,134円	929,041,840円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,068,407,169円	1,088,784,171円
	D I A M DC バランス30インデックスファンド	140,986,314円	151,198,377円

D I A M D C バラン ス 5 0 インデックスファ ンド	406, 671, 520円	421, 382, 473円
D I A M D C バラン ス 7 0 インデックスファ ンド	338, 651, 848円	340, 601, 324円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	43, 215, 717円	42, 243, 439円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	874, 460, 875円	932, 693, 027円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	242, 048, 956円	215, 631, 374円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド (新興 国 1 0)	19, 784, 452円	27, 054, 593円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド (新興 国 2 0)	39, 211, 766円	52, 812, 992円
D I A M D C 8 資産 バランスファンド (新興 国 3 0)	83, 633, 667円	106, 602, 334円
投資のソムリエ	477, 923, 774円	1, 447, 959, 597円
クルーズコントロール	116, 268, 511円	423, 103, 664円
投資のソムリエ< D C 年 金 >	9, 139, 329円	44, 003, 627円
D I A M 8 資産バラン スファンド N < D C 年金 >	60, 602, 702円	88, 624, 580円
D I A M D C バラン ス・ F (成長型)	21, 789, 339円	44, 097, 862円
クルーズコントロール< D C 年金 >	29, 118円	156, 043円
D I A M コア資産設計フ ァンド (堅実型)	1, 060, 414円	2, 581, 654円
D I A M コア資産設計フ ァンド (積極型)	1, 885, 928円	8, 454, 381円
投資のソムリエ< D C 年 金 > リスク抑制型	389, 909円	19, 173, 147円
ダイナミック・ナビゲー ション	—円	1, 575, 046円
リスク抑制世界 8 資産バ ランスファンド	—円	104, 007, 220円
ワールドアセットバラン ス (基本コース)	—円	111, 316, 911円
ワールドアセットバラン ス (リスク抑制コース)	—円	145, 454, 314円
D I A M 外国株式インデ ックスファンド V A (適 格機関投資家専用)	246, 302, 019円	163, 368, 838円

D I AM外国株式パッシブ 私募ファンド（適格機 関投資家向け）	3,399,312,717円	3,207,285,574円
D I AMアクティブアロ ケーション私募ファンド （適格機関投資家限定）	117,716,486円	180,603,347円
D I AM先進国株式パッ シブファンド（適格機関 投資家限定）	－円	392,000円
D I AMワールドバラン ス25VA（適格機関投 資家限定）	38,663,574円	28,887,946円
D I AMグローバル・バ ランスファンド25VA （適格機関投資家限定）	380,345,852円	161,611,237円
D I AMグローバル・バ ランスファンド50VA （適格機関投資家限定）	374,359,591円	298,410,591円
D I AM国際分散バラン スファンド30VA（適 格機関投資家限定）	31,054,047円	20,377,575円
D I AM国際分散バラン スファンド50VA（適 格機関投資家限定）	198,593,205円	135,252,737円
D I AM国内重視バラン スファンド30VA（適 格機関投資家限定）	15,800,472円	11,414,013円
D I AM国内重視バラン スファンド50VA（適 格機関投資家限定）	30,800,758円	15,373,489円
D I AM世界バランスフ ァンド40VA（適格機 関投資家限定）	4,146,137,174円	632,259,643円
D I AM世界バランスフ ァンド50VA（適格機 関投資家限定）	2,361,996,766円	427,409,243円
D I AMバランスファン ド25VA（適格機関投 資家限定）	1,057,860,672円	743,979,293円
D I AMバランスファン ド37.5VA（適格機 関投資家限定）	1,111,132,004円	870,032,675円
D I AMバランスファン ド50VA（適格機関投 資家限定）	3,303,720,878円	2,693,426,272円
D I AMグローバル・ア セット・バランスVA （適格機関投資家限定）	1,243,117,731円	1,053,591,911円

D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	1, 975, 013, 508円	980, 540, 194円
D I A M アクサ グロ ーバル バランスファン ド3 0 V A (適格機関投 資家限定)	1, 590, 347, 521円	1, 217, 509, 769円
D I A M世界アセットバ ランスファンドV A (適 格機関投資家向け)	1, 062, 501, 229円	799, 238, 075円
D I A Mグローバルβ私 募ファンド(適格機関投 資家向け)	12, 333, 699円	3, 672, 039円
D I A M世界バランスフ ァンド5 5 V A (適格機 関投資家限定)	4, 679, 814, 254円	3, 561, 322, 538円
D I A M世界バランスフ ァンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	1, 794, 957, 557円	1, 507, 107, 240円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	11, 097, 820, 859円	9, 475, 846, 807円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	630, 608, 542円	519, 886, 797円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1, 901, 357, 227円	1, 623, 806, 982円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	7, 078, 616, 550円	6, 051, 606, 509円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	17, 738, 254円	25, 152, 055円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	22, 620, 054円	239, 046円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	17, 318, 549円	13, 078, 140円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	9, 537, 135, 837円	8, 108, 064, 369円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	92, 569, 470円	84, 358, 582円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	28, 741, 863円	169, 337円

	D I A M バランス 6 0 V A (適格機関投資家限 定)	282, 813円	274, 012円
計		101, 062, 929, 782円	91, 611, 980, 480円
2.	受益権の総数	101, 062, 929, 782口	91, 611, 980, 480口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	7,430,439,349	1,851,257,751
投資信託受益証券	22,625,311	△1,845,255
投資証券	230,562,250	145,524,021
合計	7,683,626,910	1,994,936,517

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月16日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月16日から平成29年2月27日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成29年2月27日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	534,711,398	—	535,463,600	△752,202	—	—	—	—
アメリカ・ドル	362,801,552	—	363,395,200	△593,648	—	—	—	—
イギリス・ポンド	43,862,032	—	43,721,600	140,432	—	—	—	—
オーストラリア・ドル	19,353,404	—	19,324,400	29,004	—	—	—	—
カナダ・ドル	18,676,884	—	18,816,300	△139,416	—	—	—	—
ユーロ	90,017,526	—	90,206,100	△188,574	—	—	—	—
買 建	—	—	—	—	2,719,286,282	—	2,719,140,100	△146,182
アメリカ・ドル	—	—	—	—	1,783,590,450	—	1,783,503,000	△87,450
イギリス・ポンド	—	—	—	—	213,067,188	—	213,052,500	△14,688
オーストラリア・ドル	—	—	—	—	115,296,548	—	115,280,200	△16,348
カナダ・ドル	—	—	—	—	109,487,616	—	109,478,400	△9,216
ユーロ	—	—	—	—	497,844,480	—	497,826,000	△18,480
合計	534,711,398	—	535,463,600	△752,202	2,719,286,282	—	2,719,140,100	△146,182

(注) 時価の算定方法

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

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

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年2月27日現在

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

PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	81.440	637,756.640	
AMEREN CORP	17,312	54.580	944,888.960	
ARROW ELECTRONICS INC	7,403	73.490	544,046.470	
AUTOLIV INC	6,197	104.610	648,268.170	
AUTODESK INC	14,259	87.550	1,248,375.450	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,227	103.000	3,525,381.000	
AUTOZONE INC	2,229	732.750	1,633,299.750	
AVERY DENNISON CORP	7,368	80.250	591,282.000	
AVNET INC	10,288	46.410	477,466.080	
BAKER HUGHES INC	30,916	59.800	1,848,776.800	
BALL CORP	12,162	73.070	888,677.340	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	91,251	170.220	15,532,745.220	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,107	47.090	3,725,148.630	
CR BARD INC	5,309	245.180	1,301,660.620	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,687	50.490	1,902,816.630	
BED BATH & BEYOND INC	10,744	41.040	440,933.760	
BECTON DICKINSON & CO	15,808	183.420	2,899,503.360	
AMETEK INC	16,775	54.630	916,418.250	
BE AEROSPACE INC	8,229	63.130	519,496.770	
VERIZON COMM INC	305,099	50.600	15,438,009.400	
WR BERKLEY CORP	8,134	71.520	581,743.680	
BEST BUY CO INC	21,033	45.560	958,263.480	
YUM! BRANDS INC	28,494	65.950	1,879,179.300	
FIRSTENERGY CORP	30,796	32.320	995,326.720	
H&R BLOCK INC	16,114	20.050	323,085.700	
BOEING CO	44,146	177.440	7,833,266.240	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	47.960	520,174.160	
BORGWARNER INC	14,648	41.530	608,331.440	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,578	24.780	2,492,322.840	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	80.130	792,806.220	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	475.460	873,895.480	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	124,492	56.440	7,026,328.480	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	168.030	636,497.640	
INGREDION INC	5,305	122.760	651,241.800	
ONEOK INC	16,401	53.160	871,877.160	
UNITED RENTALS INC	6,332	124.150	786,117.800	
SEMPRA ENERGY	18,176	109.090	1,982,819.840	
FEDEX CORP	18,672	193.110	3,605,749.920	
VERISIGN INC	6,321	83.310	526,602.510	
AMPHENOL CORP	23,304	70.180	1,635,474.720	

BROWN-FORMAN CORP	16,642	48.880	813,460.960	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,337	57.610	1,286,834.570	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.120	650,711.040	
CSX CORP	69,449	48.480	3,366,887.520	
CABOT OIL & GAS CORP	38,049	22.450	854,200.050	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	59.110	830,495.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	47.750	1,109,662.250	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,081	158.850	2,077,916.850	
CARDINAL HEALTH INC	24,212	82.140	1,988,773.680	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	27,339	56.030	1,531,804.170	
CATERPILLAR INC	44,065	95.480	4,207,326.200	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	99.450	977,792.400	
CELGENE CORP	57,620	118.230	6,812,412.600	
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	114.190	412,454.280	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	80.180	873,641.280	
CENTURYLINK INC	39,384	24.580	968,058.720	
CERNER CORP	23,765	55.610	1,321,571.650	
JPMORGAN CHASE & CO	269,975	90.330	24,386,841.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	49.530	932,253.660	
CIGNA CORP	19,066	147.040	2,803,464.640	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	73.490	807,067.180	
CINTAS CORP	6,282	119.070	747,997.740	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	96,233	3.370	324,305.210	
CISCO SYSTEMS INC	375,461	34.320	12,885,821.520	
CLOROX COMPANY	9,331	136.370	1,272,468.470	
COCA-COLA CO/THE	306,559	41.780	12,808,035.020	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,128	73.350	4,630,438.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	25,301	87.080	2,203,211.080	
COMERICA INC	12,068	71.200	859,241.600	
COMCAST CORP-CL A	359,104	37.890	13,606,450.560	
CA INC	22,732	32.630	741,745.160	
COMPUTER SCIENCES CORP	10,556	69.100	729,419.600	
CONAGRA BRANDS INC	31,942	41.160	1,314,732.720	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,660	76.610	1,812,592.600	
CMS ENERGY CORP	22,372	44.680	999,580.960	
COOPER COS INC	3,794	199.720	757,737.680	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	101.020	1,399,632.100	
CORNING INC	79,197	27.730	2,196,132.810	
WR GRACE & CO	5,923	71.050	420,829.150	
SEALED AIR CORP	16,041	47.260	758,097.660	
CUMMINS INC	12,194	149.940	1,828,368.360	

DR HORTON INC	24,498	31.390	768,992.220	
DANAHER CORP	46,324	86.080	3,987,569.920	
MOODY'S CORP	12,924	113.290	1,464,159.960	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,469	59.500	2,705,405.500	
TARGET CORP	40,245	66.510	2,676,694.950	
DEERE & CO	20,474	108.620	2,223,885.880	
MORGAN STANLEY	106,341	45.530	4,841,705.730	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	61.350	1,065,956.250	
COSTAR GROUP INC	2,278	201.340	458,652.520	
THE WALT DISNEY CO	113,984	110.320	12,574,714.880	
DOLLAR TREE INC	17,493	79.410	1,389,119.130	
DOVER CORP	10,736	80.060	859,524.160	
DOW CHEMICAL	83,895	63.550	5,331,527.250	
OMNICOM GROUP	16,993	86.160	1,464,116.880	
DTE ENERGY CO	13,122	101.090	1,326,502.980	
DUKE ENERGY CORP	51,765	81.960	4,242,659.400	
FLOWERVE CORP	8,406	47.720	401,134.320	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	75.460	712,040.560	
EBAY INC	82,914	34.060	2,824,050.840	
BANK OF AMERICA CORP	761,401	24.230	18,448,746.230	
CITIGROUP INC	216,601	59.560	12,900,755.560	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	80.160	817,070.880	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	36.790	689,444.600	
EATON CORP PLC	34,800	72.390	2,519,172.000	
EATON VANCE CORP	9,184	46.960	431,280.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	31.290	653,241.330	
DISH NETWORK CORP	16,150	62.540	1,010,021.000	
ECOLAB INC	20,098	125.500	2,522,299.000	
ELECTRONIC ARTS INC	23,105	86.540	1,999,506.700	
SALESFORCE.COM INC	49,119	81.780	4,016,951.820	
EMERSON ELECTRIC CO	48,079	60.480	2,907,817.920	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	78.180	642,717.780	
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	5.570	392,350.800	
ENTERGY CORP	13,984	75.800	1,059,987.200	
EOG RESOURCES INC	42,707	96.300	4,112,684.100	
EQUIFAX INC	8,495	129.380	1,099,083.100	
EQT CORP	13,874	59.940	831,607.560	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	83.750	1,351,222.500	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	56.700	809,619.300	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	47,994	71.550	3,433,970.700	
EXXON MOBIL CORP	309,835	81.080	25,121,421.800	
FMC CORP	10,694	58.130	621,642.220	
NEXTERA ENERGY INC	34,612	130.960	4,532,787.520	
ASSURANT INC	4,960	98.760	489,849.600	
FASTENAL CO	21,654	50.100	1,084,865.400	

FIFTH THIRD BANCORP	57,732	27.320	1,577,238.240	
M&T BANK CORP	10,664	168.670	1,798,696.880	
FISERV INC	15,880	116.300	1,846,844.000	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	36.720	426,796.560	
MACY'S INC	24,512	33.170	813,063.040	
FORD MOTOR CO	279,141	12.470	3,480,888.270	
FRANKLIN RESOURCES INC	27,510	42.740	1,175,777.400	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	13.250	1,282,759.000	
FLEX LTD	44,363	16.730	742,192.990	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	56.860	692,327.360	
TEGNA INC	16,963	24.800	420,682.400	
GAP INC/THE	18,295	24.700	451,886.500	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	62.790	1,097,380.830	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,255	189.630	3,651,325.650	
GENERAL MILLS INC	43,879	61.370	2,692,854.230	
GENUINE PARTS CO	11,094	96.250	1,067,797.500	
GILEAD SCIENCES INC	98,271	69.940	6,873,073.740	
GARTNER INC	6,829	103.710	708,235.590	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	35.360	639,909.920	
MCKESSON CORP	16,986	150.850	2,562,338.100	
NVIDIA CORP	39,760	101.460	4,034,049.600	
GENERAL ELECTRIC CO	669,933	30.190	20,225,277.270	
WW GRAINGER INC	4,486	250.240	1,122,576.640	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	17.050	379,123.800	
HALLIBURTON CO	64,633	52.870	3,417,146.710	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	43.550	1,285,683.100	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,115	247.350	6,706,895.250	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	56.560	729,680.560	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,679	111.440	632,867.760	
HARRIS CORP	8,954	111.100	994,789.400	
HASBRO INC	8,909	97.780	871,122.020	
HENRY SCHEIN INC	5,713	173.530	991,376.890	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	67.530	487,093.890	
HERSHEY FOODS CORP	11,306	108.900	1,231,223.400	
HP INC	131,066	17.650	2,313,314.900	
F5 NETWORKS INC	4,874	144.410	703,854.340	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,481	53.330	612,281.730	
REYNOLDS AMERICAN INC	63,698	61.500	3,917,427.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	146.710	505,709.370	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.420	788,370.800	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	28.940	401,918.720	
HOLOGIC INC	17,500	40.820	714,350.000	
UNUM GROUP	16,000	48.480	775,680.000	
HOME DEPOT INC	92,204	145.950	13,457,173.800	

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12, 887	87. 510	1, 127, 741. 370	
HORMEL FOODS CORP	23, 322	34. 660	808, 340. 520	
CENTERPOINT ENERGY INC	31, 952	27. 020	863, 343. 040	
HUMANA INC	11, 580	207. 280	2, 400, 302. 400	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5, 927	99. 820	591, 633. 140	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75, 161	14. 180	1, 065, 782. 980	
RED HAT INC	13, 472	84. 860	1, 143, 233. 920	
BIOGEN INC	16, 273	285. 130	4, 639, 920. 490	
ILLINOIS TOOL WORKS	23, 599	131. 680	3, 107, 516. 320	
INTUIT INC	17, 739	128. 010	2, 270, 769. 390	
IDEXX LABORATORIES INC	7, 050	143. 060	1, 008, 573. 000	
INGERSOLL-RAND PLC	19, 490	81. 320	1, 584, 926. 800	
INTEL CORP	353, 216	36. 530	12, 902, 980. 480	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5, 578	125. 000	697, 250. 000	
INTERNATIONAL PAPER CO	28, 375	52. 620	1, 493, 092. 500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29, 157	24. 560	716, 095. 920	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7, 931	56. 030	444, 373. 930	
INCYTE CORP	12, 360	131. 210	1, 621, 755. 600	
JOHNSON & JOHNSON	204, 804	122. 730	25, 135, 594. 920	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29, 304	48. 620	1, 424, 760. 480	
KLA-TENCOR CORP	11, 724	90. 290	1, 058, 559. 960	
DEVON ENERGY CORP	34, 184	42. 810	1, 463, 417. 040	
WESTAR ENERGY INC	9, 911	53. 800	533, 211. 800	
KELLOGG CO	18, 922	75. 230	1, 423, 502. 060	
KEYCORP	81, 264	18. 740	1, 522, 887. 360	
KIMBERLY-CLARK CORP	26, 663	133. 660	3, 563, 776. 580	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9, 030	389. 160	3, 514, 114. 800	
KOHL'S CORP	14, 862	42. 990	638, 917. 380	
KROGER CO	69, 381	33. 290	2, 309, 693. 490	
LAM RESEARCH CORP	11, 522	118. 790	1, 368, 698. 380	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7, 455	93. 450	696, 669. 750	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12, 622	62. 870	793, 545. 140	
LEGGETT & PLATT INC	9, 588	49. 430	473, 934. 840	
LENNAR CORP	14, 850	47. 430	704, 335. 500	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21, 462	25. 690	551, 358. 780	
ELI LILLY & CO	74, 120	82. 870	6, 142, 324. 400	
L BRANDS INC	18, 583	50. 990	947, 547. 170	
LINCOLN NATIONAL CORP	17, 276	70. 820	1, 223, 486. 320	
LINEAR TECH CORP	17, 456	64. 540	1, 126, 610. 240	

UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,738	106.180	5,493,540.840	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	51.740	1,255,522.840	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,723	266.000	5,246,318.000	
LOEWS CORP	21,346	47.230	1,008,171.580	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	27.640	378,585.080	
LOWE'S COS INC	65,195	76.100	4,961,339.500	
DOMINION RESOURCES INC/VA	47,031	77.000	3,621,387.000	
SCANA CORP	10,902	68.920	751,365.840	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	26.390	849,705.220	
MCCORMICK & CO INC	9,163	99.330	910,160.790	
MCDONALD'S CORPORATION	63,662	128.650	8,190,116.300	
S&P GLOBAL INC	20,295	130.820	2,654,991.900	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	235.030	769,018.160	
MANPOWERGROUP INC	5,703	97.360	555,244.080	
MARKEL CORPORATION	989	976.980	966,233.220	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	94.760	1,494,933.760	
MARSH & MCLENNAN COS	38,323	73.510	2,817,123.730	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,056	74.690	302,942.640	
MASCO CORP	23,043	34.020	783,922.860	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	210.050	921,489.350	
MATTEL INC	24,003	25.760	618,317.280	
METLIFE INC	70,719	52.490	3,712,040.310	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	45.060	916,610.520	
MEDTRONIC PLC	104,227	81.030	8,445,513.810	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,373	45.550	1,975,640.150	
CVS HEALTH CORP	79,353	81.480	6,465,682.440	
MERCK & CO. INC.	206,907	66.160	13,688,967.120	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	142.890	1,025,378.640	
MICROSOFT CORP	553,414	64.620	35,761,612.680	
MICRON TECH INC	76,146	23.240	1,769,633.040	
MIDDLEBY CORP	4,100	139.050	570,105.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,176	72.830	1,105,268.080	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,922	16.010	559,101.220	
3M CO	45,218	187.410	8,474,305.380	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,759	225.960	1,075,343.640	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,150	80.270	895,010.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,789	88.330	776,332.370	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	28.150	350,270.450	
ENDO INTERNATIONAL PLC	16,587	13.150	218,119.050	

MYLAN NV	34,754	42.160	1,465,228.640	
ILLUMINA INC	11,255	160.000	1,800,800.000	
XCEL ENERGY INC	37,554	43.340	1,627,590.360	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	39.790	1,071,863.020	
NETAPP INC	20,641	40.950	845,248.950	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	36.740	504,807.600	
NEWELL BRANDS INC	32,324	48.670	1,573,209.080	
DUN & BRADSTREET CORP	3,012	105.600	318,067.200	
NEWMONT MINING CORP	38,093	36.080	1,374,395.440	
NIKE INC-CL B	99,876	57.860	5,778,825.360	
NOBLE ENERGY INC	31,005	36.780	1,140,363.900	
NORDSTROM INC	9,487	46.460	440,766.020	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,604	120.080	2,714,288.320	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	59.030	1,362,707.550	
NISOURCE INC	22,198	24.010	532,973.980	
COACH INC	19,175	38.020	729,033.500	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	87.050	1,400,634.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,620	245.050	3,092,531.000	
WELLS FARGO & CO	358,022	57.810	20,697,251.820	
NUCOR CORP	23,780	60.860	1,447,250.800	
MONSANTO CO	33,243	112.960	3,755,129.280	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	47.460	755,895.420	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,294	92.610	3,453,797.340	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,546	64.890	3,669,269.940	
OGE ENERGY CORP	16,028	36.110	578,771.080	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,017	268.730	1,885,678.410	
ORACLE CORP	231,390	43.170	9,989,106.300	
PACCAR INC	26,578	67.420	1,791,888.760	
EXELON CORP	69,607	37.180	2,587,988.260	
PARKER HANNIFIN CORP	9,981	155.040	1,547,454.240	
PATTERSON COS INC	7,169	45.220	324,182.180	
PAYCHEX INC	23,141	61.810	1,430,345.210	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	68.940	449,902.440	
MEDNAX INC	7,824	71.170	556,834.080	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	102.890	540,686.950	
PPL CORPORATION	49,957	36.830	1,839,916.310	
PEPSICO INC	107,608	109.830	11,818,586.640	
PENTAIR PLC	11,775	58.150	684,716.250	
PFIZER INC	453,602	34.260	15,540,404.520	
CONOCOPHILLIPS	91,766	47.040	4,316,672.640	
PVH CORP	6,682	91.570	611,870.740	
PG&E CORP	37,651	66.330	2,497,390.830	

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,977	185.360	2,405,416.720	
ALTRIA GROUP INC	146,055	74.430	10,870,873.650	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,446	126.880	4,624,268.480	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	86.290	432,312.900	
GARMIN LTD	7,795	53.030	413,368.850	
AETNA INC	26,111	128.970	3,367,535.670	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	55.090	541,038.890	
PPG INDUSTRIES INC	19,289	103.310	1,992,746.590	
PRAXAIR INC	21,868	118.110	2,582,829.480	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,574	177.560	5,783,839.440	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,304	71.950	1,316,972.800	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	97.310	1,009,883.180	
PROCTER & GAMBLE CO	191,488	91.050	17,434,982.400	
PROGRESSIVE CORP	44,358	39.050	1,732,179.900	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	45.610	1,692,815.150	
PULTE GROUP INC	25,477	21.730	553,615.210	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	39,870	15.400	613,998.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	78.970	850,427.930	
QUALCOMM INC	109,993	57.220	6,293,799.460	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	78.490	799,577.630	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	146.280	517,099.800	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	361.010	2,042,955.590	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	129.400	600,674.800	
AUTONATION INC	5,772	46.830	270,302.760	
RESMED INC	11,376	71.960	818,616.960	
US BANCORP	127,815	55.100	7,042,606.500	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	62.730	458,995.410	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	94.540	820,039.960	
RITE AID CORP	85,598	5.970	511,020.060	
ROSS STORES INC	30,542	69.010	2,107,703.420	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,820	209.910	1,641,496.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,667	151.140	1,461,070.380	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,567	96.150	1,304,467.050	
RAYTHEON COMPANY	21,940	153.480	3,367,351.200	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,399	244.810	1,076,919.190	
ACCENTURE PLC-CL A	46,433	123.430	5,731,225.190	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	115,309	45.380	5,232,722.420	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,919	128.090	1,270,524.710	
ROCKWELL COLLINS INC	9,535	94.560	901,629.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,229	122.270	2,595,669.830	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	23,052	83.840	1,932,679.680	
PRICELINE GROUP INC	3,670	1,631.620	5,988,045.400	
SCHLUMBERGER LTD	103,570	80.150	8,301,135.500	
SCHWAB (CHARLES) CORP	88,020	41.110	3,618,502.200	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,255	116.920	1,783,614.600	
BUNGE LTD	11,367	81.050	921,295.350	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	50.940	565,790.580	
ANTHEM INC	19,543	163.830	3,201,729.690	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,348	92.160	1,322,311.680	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	62.750	1,345,485.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	312.650	1,862,768.700	
CENTENE CORP	13,899	70.610	981,408.390	
SMITH (A. O.) CORP	9,565	50.560	483,606.400	
ACUITY BRANDS INC	3,087	218.130	673,367.310	
SNAP-ON INC	3,932	171.360	673,787.520	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,142	109.960	3,534,334.320	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	157.330	829,601.090	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,997	7.350	286,627.950	
EDISON INTERNATIONAL	24,139	78.870	1,903,842.930	
SOUTHERN CO	73,354	50.500	3,704,377.000	
BB&T CORP	59,828	48.110	2,878,325.080	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	58.540	664,546.080	
AT&T INC	460,498	42.360	19,506,695.280	
CHEVRON CORP	140,802	110.120	15,505,116.240	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,590	127.770	1,480,854.300	
STAPLES INC	52,662	9.280	488,703.360	
STATE STREET CORP	29,122	78.950	2,299,181.900	
STARBUCKS CORP	108,982	57.480	6,264,285.360	
STRYKER CORP	25,117	129.270	3,246,874.590	
NETFLIX INC	31,878	143.250	4,566,523.500	
STERICYCLE INC	6,853	82.930	568,319.290	
SUNTRUST BANKS INC	37,716	59.290	2,236,181.640	
SYMANTEC CORP	46,581	28.840	1,343,396.040	
SYNOPSYS INC	10,656	72.060	767,871.360	
SYSCO CORP	40,782	53.200	2,169,602.400	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,837	736.860	2,090,471.820	
TELEFLEX INC	3,203	189.790	607,897.370	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	67,717	35.380	2,395,827.460	

TESORO CORP	9,395	87.950	826,290.250	
TEXAS INSTRUMENTS INC	74,880	77.240	5,783,731.200	
TEXTRON INC	19,076	47.170	899,814.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,340	158.980	4,664,473.200	
TIFFANY & CO	8,733	91.730	801,078.090	
TOLL BROTHERS INC	13,356	33.740	450,631.440	
TORCHMARK CORP	7,699	77.550	597,057.450	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	55.180	622,375.220	
DAVITA INC	12,245	69.040	845,394.800	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	71.170	660,172.920	
TRIMBLE INC	20,073	31.400	630,292.200	
TYSON FOODS INC	21,621	62.680	1,355,204.280	
UGI CORP	12,068	48.170	581,315.560	
MARATHON OIL CORP	66,702	15.730	1,049,222.460	
UNION PACIFIC CORP	62,006	107.740	6,680,526.440	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	59,230	112.460	6,661,005.800	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,272	163.060	11,621,612.320	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	125.980	800,098.980	
VALSPAR CORP	6,122	111.450	682,296.900	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	84.720	580,162.560	
VF CORP	24,309	53.060	1,289,835.540	
CBS CORP	31,152	66.970	2,086,249.440	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,957	86.070	1,631,628.990	
VULCAN MATERIALS CO	9,977	117.820	1,175,490.140	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,696	87.610	6,018,456.560	
WAL-MART STORES INC	116,011	72.390	8,398,036.290	
WASTE MANAGEMENT INC	34,095	73.150	2,494,049.250	
WATERS CORP	5,963	156.400	932,613.200	
ALLERGAN PLC	29,478	245.370	7,233,016.860	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	141.180	1,236,030.900	
WESTERN DIGITAL CORP	22,106	74.650	1,650,212.900	
WABTEC CORP	7,363	79.450	584,990.350	
WHIRLPOOL CORP	5,553	180.160	1,000,428.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	94.700	1,281,196.300	
WYNN RESORTS LTD	6,279	94.010	590,288.790	
WHOLE FOODS MARKET INC	22,675	31.560	715,623.000	
NASDAQ INC	9,132	71.450	652,481.400	
CME GROUP INC	25,149	122.620	3,083,770.380	
WILLIAMS COS INC	54,722	27.970	1,530,574.340	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	49.240	368,758.360	

LKQ CORP	22,948	31.880	731,582.240	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	39.520	647,456.160	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	59.490	1,375,230.330	
FOOT LOCKER INC	9,476	75.010	710,794.760	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	43.410	808,771.710	
CARMAX INC	13,513	65.830	889,560.790	
XEROX CORP	69,821	7.540	526,450.340	
XILINX INC	18,777	58.990	1,107,655.230	
YAHOO! INC	66,277	45.550	3,018,917.350	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	126.030	882,588.090	
TJX COMPANIES INC	48,566	78.250	3,800,289.500	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	6.820	645,854.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,000	62.950	1,259,000.000	
SIGNATURE BANK	4,171	156.920	654,513.320	
CBRE GROUP INC	20,976	35.270	739,823.520	
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	36.990	594,540.270	
REGIONS FINANCIAL CORP	94,000	15.200	1,428,800.000	
DOMINO'S PIZZA INC	3,935	186.280	733,011.800	
T-MOBILE US INC	21,188	62.210	1,318,105.480	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,734	52.170	1,759,902.780	
MOSAIC CO/THE	26,525	31.420	833,415.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	30,914	30.230	934,530.220	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	79,925	30.610	2,446,504.250	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	75.670	414,141.910	
CELANESE CORP	10,766	88.790	955,913.140	
DEXCOM INC	6,161	78.500	483,638.500	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- A	10,423	29.270	305,081.210	
EXPEDIA INC	9,786	119.160	1,166,099.760	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	31.150	575,496.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,627	129.830	1,509,533.410	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	50,537	36.200	1,829,439.400	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,298	58.300	2,699,173.400	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	21.810	320,519.760	
VIACOM INC-CLASS B	27,527	43.890	1,208,160.030	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,089	420.900	879,260.100	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	75.080	464,820.280	

TRANSDIGM GROUP INC	3,812	250.990	956,773.880	
MASTERCARD INC	72,464	111.000	8,043,504.000	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	20.010	590,915.310	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	83.870	623,657.320	
HANESBRANDS INC	27,619	21.380	590,494.220	
WESTERN UNION CO	35,222	20.170	710,427.740	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	45.350	525,425.100	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,099	16.060	290,669.940	
SPECTRA ENERGY CORP	51,646	40.680	2,100,959.280	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	70.360	586,098.800	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,440	19.250	354,970.000	
DELTA AIR LINES INC	14,611	50.460	737,271.060	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	44.640	283,642.560	
DISCOVER FINANCIAL	30,804	71.220	2,193,860.880	
TE CONNECTIVITY LTD	27,026	74.300	2,008,031.800	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	133.280	1,406,370.560	
WABCO HOLDING INC	4,379	112.870	494,257.730	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,052	65.320	591,276.640	
VMWARE INC	5,491	91.010	499,735.910	
MERCADOLIBRE INC	2,861	207.790	594,487.190	
ULTA BEAUTY INC	4,332	276.330	1,197,061.560	
INVESCO LTD	29,824	32.660	974,051.840	
MSCI INC	6,462	95.540	617,379.480	
CALPINE CORP NPR	27,876	11.760	327,821.760	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,885	107.720	12,483,132.200	
VISA INC	141,188	88.430	12,485,254.840	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,377	94.790	1,362,795.830	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,301	76.300	1,091,166.300	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	80.760	531,804.600	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	73.800	449,811.000	
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	16,085	28.550	459,226.750	
MARATHON PETROLEUM CORP	39,747	50.030	1,988,542.410	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	57.400	667,217.600	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	137.270	250,655.020	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	140,475	21.240	2,983,689.000	
XYLEM INC	11,630	47.900	557,077.000	
ALKERMES PLC	12,053	52.980	638,567.940	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,049	92.430	2,500,139.070	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	216.980	754,873.420	
SPLUNK INC	10,674	62.800	670,327.200	
HCA HOLDINGS INC	23,320	87.070	2,030,472.400	
VERISK ANALYTICS INC	12,227	83.950	1,026,456.650	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,846	136.110	659,589.060	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	168.700	1,103,972.800	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,697	87.890	1,203,829.330	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,555	95.290	1,005,785.950	
CIT GROUP INC	16,266	42.780	695,859.480	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	102.830	2,329,305.160	
TARGA RESOURCES CORP	12,532	56.380	706,554.160	
LEAR CORP	5,132	141.360	725,459.520	
DOLLAR GENERAL CORP	21,500	77.350	1,663,025.000	
FORTINET INC	11,399	37.150	423,472.850	
AON PLC	20,606	116.560	2,401,835.360	
TESLA INC	9,875	257.000	2,537,875.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	41.280	470,261.760	
GENERAL MOTORS CO	105,443	36.900	3,890,846.700	
VANTIV INC	12,141	65.790	798,756.390	
TRIPADVISOR INC	9,263	42.620	394,789.060	
ALLY FINANCIAL INC	35,251	22.770	802,665.270	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	37.300	444,727.900	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	41.680	563,722.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,532	76.690	1,574,599.080	
PHILLIPS 66	34,686	78.030	2,706,548.580	
FACEBOOK INC	173,536	135.440	23,503,715.840	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	11,968	77.640	929,195.520	
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,616	100.410	563,902.560	
SERVICENOW INC	12,640	91.820	1,160,604.800	
WHITEWAVE FOODS CO	14,444	55.200	797,308.800	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	153.010	1,078,414.480	
WORKDAY INC	8,710	89.660	780,938.600	
ABBVIE INC	121,323	62.090	7,532,945.070	
ZOETIS INC	34,481	53.880	1,857,836.280	

NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	50.020	611,444.480	
COTY INC	38,871	18.660	725,332.860	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.100	396,445.300	
MALLINCKRODT PLC	9,419	53.380	502,786.220	
CDW CORP	9,877	59.380	586,496.260	
SPRINT CORP	63,882	8.940	571,105.080	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	46.280	472,009.720	
ARCONIC INC	34,259	29.320	1,004,473.880	
ENVISION HEALTHCARE CORP	4,730	71.390	337,674.700	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	39.050	195,484.300	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	18,330	38.710	709,554.300	
XL GROUP LTD	20,259	41.120	833,050.080	
BROADCOM LTD	29,475	210.370	6,200,655.750	
DELL TECHNOLOGIES INC	17,283	64.240	1,110,259.920	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	19.830	305,580.300	
TECHNIPFMC LTD	14,816	32.300	478,556.800	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	24.000	315,912.000	
TWITTER INC	43,692	15.980	698,198.160	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	31.830	249,451.710	
PERRIGO CO PLC	10,322	84.430	871,486.460	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	57.780	854,912.880	
ARAMARK	17,307	35.810	619,763.670	
SABRE CORP	17,624	21.790	384,026.960	
NAVIENT CORP	22,636	15.380	348,141.680	
PARSLEY ENERGY INC	10,949	29.490	322,886.010	
IHS MARKIT LTD	26,741	40.080	1,071,779.280	
FNF GROUP	20,571	38.490	791,777.790	
SYNCHRONY FINANCIAL	62,691	36.480	2,286,967.680	
MOBILEYE NV	14,001	47.080	659,167.080	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	39,020	36.650	1,430,083.000	
CDK GLOBAL INC	8,309	66.630	553,628.670	
QORVO INC	10,599	66.190	701,547.810	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	31.080	353,970.120	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	86.380	675,318.840	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	29.380	432,179.800	
LIBERTY LILAC GROUP-C	6,305	25.270	159,327.350	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	45.160	1,212,094.400	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,128	121.870	624,949.360	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	34.950	562,345.500	
WESTROCK CO	17,744	53.430	948,061.920	

	KRAFT HEINZ CO	45,382	93.080	4,224,156.560	
	FORTIVE CORP	23,758	57.790	1,372,974.820	
	WASTE CONNECTIONS INC	10,157	87.330	887,010.810	
	ALPHABET INC-CL A	21,999	847.810	18,650,972.190	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	22.960	2,791,706.400	
	PAYPAL HOLDINGS INC	80,567	43.070	3,470,020.690	
	FIRST DATA CORP	22,035	16.270	358,509.450	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	35.170	286,072.780	
	ALPHABET INC-CL C	23,139	828.640	19,173,900.960	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	167.140	984,788.880	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	16,119	326.750	5,266,883.250	
アメリカ・ドル 小計		23,435,804		1,559,878,886.130 (174,987,213,445)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.661	189,838.400	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	8.075	209,182.870	
	ASHTED GROUP	35,233	16.350	576,059.550	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	23.450	349,334.650	
	BHP BILLITON PLC	153,323	13.080	2,005,464.840	
	BARCLAYS PLC	1,247,081	2.259	2,817,155.970	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,682	5.135	424,572.070	
	BT GROUP PLC	621,220	3.329	2,068,041.380	
	SKY PLC	72,210	9.980	720,655.800	
	BUNZL PLC	26,929	21.710	584,628.590	
	EASYJET PLC	13,628	9.315	126,944.820	
	CAPITA PLC	54,894	5.570	305,759.580	
	AVIVA PLC	306,804	5.035	1,544,758.140	
	CRODA INTERNATIONAL	10,965	33.100	362,941.500	
	DIAGEO PLC	186,418	22.715	4,234,484.870	
	SCHRODERS PLC	7,188	30.080	216,215.040	
	DCC PLC	7,281	68.050	495,472.050	
	NATIONAL GRID PLC	280,203	9.777	2,739,544.730	
	GKN PLC	134,180	3.451	463,055.180	
	KINGFISHER PLC	165,680	3.238	536,471.840	
	BAE SYSTEMS PLC	241,905	6.150	1,487,715.750	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	29.200	350,020.400	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	138,548	50.700	7,024,383.600	
	COBHAM PLC	142,739	1.182	168,717.490	
	NEXT PLC	9,731	37.910	368,902.210	
	IMPERIAL BRANDS PLC	70,388	38.365	2,700,435.620	
	IMI PLC	21,218	12.110	256,949.980	
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	30.130	377,438.510	
	ANGLO AMERICAN PLC	105,010	12.525	1,315,250.250	
	COMPASS GROUP PLC	119,716	14.670	1,756,233.720	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,486,352	6.503	9,665,747.050	

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.472	1,047,260.320	
CENTRICA PLC	392,766	2.257	886,472.860	
UNILEVER PLC	97,369	37.730	3,673,732.370	
MEGGITT PLC	62,181	4.108	255,439.540	
MORRISON <WM. > SUPERMARKETS	155,682	2.445	380,642.490	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	9.790	544,314.210	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.950	481,140.800	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	26.110	660,791.880	
PEARSON PLC	65,009	6.570	427,109.130	
PERSIMMON PLC	23,150	20.250	468,787.500	
PRUDENTIAL PLC	194,275	16.090	3,125,884.750	
RIO TINTO PLC	90,216	33.155	2,991,111.480	
VODAFONE GROUP PLC	1,974,479	2.028	4,004,243.410	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	46,978	73.110	3,434,561.580	
RELX PLC	80,689	14.940	1,205,493.660	
OLD MUTUAL PLC	389,986	2.187	852,899.380	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	146,260	7.635	1,116,695.100	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.382	665,630.840	
ST JAMES' S PLACE PLC	40,884	10.850	443,591.400	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	15.080	306,983.560	
SSE PLC	73,043	15.470	1,129,975.210	
BP PLC	1,397,956	4.471	6,250,261.270	
SHIRE PLC	68,023	48.440	3,295,034.120	
SAGE GROUP PLC (THE)	85,271	6.425	547,866.170	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.820	470,090.400	
STANDARD CHARTERED PLC	251,434	7.305	1,836,725.370	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,885,554	0.692	3,380,803.360	
TATE & LYLE PLC	39,915	7.365	293,973.970	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.771	448,101.960	
TESCO PLC	624,703	1.900	1,186,935.700	
3I GROUP PLC	78,491	6.875	539,625.620	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.060	797,829.300	
GLAXOSMITHKLINE PLC	363,678	16.395	5,962,500.810	
WEIR GROUP	18,336	18.100	331,881.600	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,907	31.250	778,343.750	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	8.840	188,309.680	
WPP PLC	97,555	18.720	1,826,229.600	
WOLSELEY PLC	18,238	48.730	888,737.740	
ASTRAZENECA PLC	94,192	46.090	4,341,309.280	
WHITBREAD PLC	12,159	38.000	462,042.000	

	CARNIVAL PLC	13, 153	43. 460	571, 629. 380	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	120, 290	3. 283	394, 912. 070	
	INTERTEK GROUP PLC	10, 500	34. 450	361, 725. 000	
	WILLIAM HILL PLC	72, 474	2. 685	194, 592. 690	
	BURBERRY GROUP PLC	35, 774	16. 610	594, 206. 140	
	INVESTEC PLC	50, 655	5. 755	291, 519. 520	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	15, 187	37. 600	571, 031. 200	
	ITV PLC	247, 210	2. 021	499, 611. 410	
	SAINSBURY (J) PLC	109, 410	2. 656	290, 592. 960	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6, 998	76. 500	535, 347. 000	
	G4S PLC	122, 250	2. 571	314, 304. 750	
	ADMIRAL GROUP PLC	15, 893	18. 700	297, 199. 100	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10, 726	29. 060	311, 697. 560	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	324, 139	20. 730	6, 719, 401. 470	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	277, 839	21. 660	6, 017, 992. 740	
	INMARSAT PLC	34, 127	7. 020	239, 571. 540	
	PETROFAC LTD	21, 809	8. 565	186, 794. 080	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11, 457	21. 090	241, 628. 130	
	TUI AG-DI	19, 394	11. 250	218, 182. 500	
	STANDARD LIFE PLC	155, 609	3. 694	574, 819. 640	
	EXPERIAN PLC	71, 516	15. 930	1, 139, 249. 880	
	MONDI PLC	30, 200	18. 650	563, 230. 000	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21, 290	13. 210	281, 240. 900	
	FRESNILLO PLC NPR	15, 639	15. 250	238, 494. 750	
	GLENCORE PLC	899, 043	3. 275	2, 944, 365. 820	
	DIXONS CARPHONE PLC	84, 639	3. 006	254, 424. 830	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112, 694	3. 646	410, 882. 320	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30, 616	7. 375	225, 793. 000	
	COCA-COLA HBC AG	13, 406	19. 360	259, 540. 160	
	ROYAL MAIL PLC	55, 060	4. 083	224, 809. 980	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50, 037	4. 983	249, 334. 370	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76, 348	3. 998	305, 239. 300	
	WORLDPAY GROUP PLC	112, 202	2. 714	304, 516. 220	
イギリス・ポンド	小計	22, 276, 564		135, 199, 620. 030 (18, 827, 899, 086)	
イスラエル・シェケル	BANK HAPOLIM BM	78, 428	22. 360	1, 753, 650. 080	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124, 270	15. 710	1, 952, 281. 700	

	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	6.538	1,230,647.740	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	437.100	769,296.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	202.400	526,240.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.840	782,670.240	
	NICE LTD	5,638	255.000	1,437,690.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	60.100	627,684.400	
イスラエル・シュケル 小計		460,781		9,080,160.160 (275,946,067)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	69.350	770,825.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	221,660	30.960	6,862,593.600	
	AMCOR LTD	80,741	14.190	1,145,714.790	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	248,237	34.090	8,462,399.330	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	11.510	351,849.190	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	6.570	749,801.250	
	TELSTRA CORP LTD	314,574	4.810	1,513,100.940	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	12.290	479,482.060	
	AMP LTD	200,498	4.880	978,430.240	
	ASX LTD	16,354	51.520	842,558.080	
	BHP BILLITON LTD	241,614	25.060	6,054,846.840	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	29.060	608,690.760	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	13.390	509,355.600	
	CSL LIMITED	33,499	117.740	3,944,172.260	
	REA GROUP LTD	4,119	55.850	230,046.150	
	TRANSURBAN GROUP	149,591	11.120	1,663,451.920	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.640	517,114.640	
	COCHLEAR LTD	3,992	130.200	519,758.400	
	ORIGIN ENERGY LTD	143,330	6.600	945,978.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	127,579	83.020	10,591,608.580	
	BORAL LIMITED	60,188	5.920	356,312.960	
	RIO TINTO LIMITED	31,897	62.880	2,005,683.360	
	APA GROUP	73,253	8.400	615,325.200	
	ARISTOCRAT LEISU	44,406	15.870	704,723.220	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.130	1,051,117.230	
	TPG TELECOM LTD	28,719	6.400	183,801.600	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,706	29.860	140,521.160	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	19.250	688,957.500	
	ORICA LTD	25,308	18.400	465,667.200	

	CIMIC GROUP LTD	8,709	37.810	329,287.290	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.050	515,036.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	21,869	86.310	1,887,513.390	
	SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.260	1,235,580.060	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	200,714	31.900	6,402,776.600	
	NEWCREST MINING LTD	61,110	23.530	1,437,918.300	
	OIL SEARCH LTD	93,715	7.220	676,622.300	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.680	502,047.680	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	12.300	1,173,297.000	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	11.810	539,799.670	
	SANTOS LTD	133,862	3.910	523,400.420	
	SONIC HEALTHCARE	26,192	21.570	564,961.440	
	TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.290	303,629.040	
	WESFARMERS LTD	86,331	43.000	3,712,233.000	
	ALUMINA LIMITED	184,613	1.865	344,303.240	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	32.010	1,854,115.230	
	WOOLWORTHS LTD	92,344	26.500	2,447,116.000	
	DUET GROUP	207,776	2.730	567,228.480	
	SEEK LTD	25,899	15.840	410,240.160	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	56.080	256,902.480	
	TATTS GROUP LTD	109,937	4.060	446,344.220	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.645	271,533.570	
	AGL ENERGY LTD	46,315	23.730	1,099,054.950	
	BRAMBLES LTD	115,255	9.520	1,097,227.600	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.240	402,218.640	
	VOCUS GROUP LTD	43,023	4.580	197,045.340	
	AURIZON HOLDINGS LTD	171,522	5.350	917,642.700	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	12.250	783,044.500	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.330	347,279.510	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.820	662,274.180	
	SOUTH32 LTD (AUD)	432,027	2.460	1,062,786.420	
オーストラリア・ドル 小計		5,860,008		86,924,347.220 (7,479,840,078)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	59.390	958,613.990	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	60.160	1,848,596.480	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	25.590	2,140,552.320	
	ATCO LTD	7,193	45.470	327,065.710	
	BANK OF MONTREAL	47,743	99.980	4,773,345.140	
	BANK OF NOVA SCOTIA	89,436	80.350	7,186,182.600	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	57.830	1,373,809.480	
	BCE INC	11,568	58.160	672,794.880	

BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,043	47.620	3,097,347.660	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	21.200	547,362.800	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.400	363,876.000	
SAPUTO INC	20,680	46.250	956,450.000	
BLACKBERRY LTD	39,652	9.240	366,384.480	
CGI GROUP INC	15,228	61.700	939,567.600	
CCL INDUSTRIES INC	2,268	290.160	658,082.880	
CAE INC	23,000	19.940	458,620.000	
CAMECO CORP	32,627	14.380	469,176.260	
ROGERS COMM-CL B	25,967	56.360	1,463,500.120	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,159	118.520	3,574,444.680	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	84,339	37.730	3,182,110.470	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	155.040	753,804.480	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	36.020	328,466.380	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,306	92.360	5,292,782.160	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.780	237,245.260	
AGRIUM INC	9,382	130.240	1,221,911.680	
YAMANA GOLD INC	67,520	3.660	247,123.200	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	33.510	466,794.300	
OPEN TEXT CORP	19,756	43.870	866,695.720	
ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.220	197,453.800	
EMPIRE CO LTD	15,093	17.290	260,957.970	
KINROSS GOLD CORP	99,741	4.990	497,707.590	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	25.360	250,861.120	
FORTIS INC	29,002	42.730	1,239,255.460	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	14.000	774,144.000	
TELUS CORP	18,945	43.450	823,160.250	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	36.960	917,975.520	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	41.250	888,607.500	
ENBRIDGE INC	68,827	54.200	3,730,423.400	
IGM FINANCIAL INC	8,426	41.330	348,246.580	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	4.460	392,457.700	
MANULIFE FINANCIAL CORP	144,196	23.850	3,439,074.600	
LINAMAR CORP	3,827	59.750	228,663.250	
LOBLAW CO LTD	17,936	70.330	1,261,438.880	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	56.530	368,801.720	
MAGNA INTERNATIONAL INC	29,208	56.430	1,648,207.440	
SUN LIFE FINANCIAL INC	46,405	48.210	2,237,185.050	

FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,805	600.310	1,083,559.550	
METRO INC	19,350	39.710	768,388.500	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.500	445,609.500	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	14.990	599,480.080	
METHANEX CORP	7,381	68.020	502,055.620	
ONEX CORP	6,646	94.650	629,043.900	
GOLDCORP INC	67,652	21.700	1,468,048.400	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	23.410	1,429,789.160	
POWER CORP OF CANADA	25,052	31.460	788,135.920	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	35.100	613,688.400	
ROYAL BANK OF CANADA	110,868	96.610	10,710,957.480	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,459	54.590	680,136.810	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	194.070	2,058,500.490	
SHAW COMM INC-B	34,029	27.800	946,006.200	
SUNCOR ENERGY INC	126,273	41.240	5,207,498.520	
ENCANA CORP	69,257	14.680	1,016,692.760	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	27.160	1,113,994.560	
THOMSON REUTERS CORP	25,128	55.980	1,406,665.440	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	138,562	69.260	9,596,804.120	
TRANSCANADA CORP	62,895	60.660	3,815,210.700	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	53.880	306,900.480	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	111.620	346,580.100	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	95.380	1,022,282.840	
SILVER WHEATON CORP	33,943	27.710	940,560.530	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	625.120	933,929.280	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	13,919	86.270	1,200,792.130	
WASTE CONNECTIONS INC	2,429	114.410	277,901.890	
CI FINANCIAL CORP	20,695	27.090	560,627.550	
VERESEN INC	24,982	13.680	341,753.760	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	29.550	466,269.450	
KEYERA CORP	13,728	39.400	540,883.200	
ALTAGAS LTD	12,538	30.940	387,925.720	
PEMBINA PIPELINE CORP	30,719	42.520	1,306,171.880	
DOLLARAMA INC	9,286	103.790	963,793.940	
CENOVUS ENERGY INC W/I	59,124	16.950	1,002,151.800	
VERMILION ENERGY INC	8,291	51.580	427,649.780	
ARC RESOURCES LTD	22,997	20.040	460,859.880	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	27.160	393,629.880	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	14.040	430,059.240	

	INTER PIPELINE LTD	24,083	28.380	683,475.540	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	29.900	447,333.900	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	24.360	419,747.160	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,390	72.740	1,264,948.600	
	HYDRO ONE LTD	16,612	23.680	393,372.160	
カナダ・ドル 小計		3,085,509		124,677,195.360 (10,664,887,291)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.690	461,250.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	3.270	266,178.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.460	428,002.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.400	276,856.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	133,100	18.870	2,511,597.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	9.530	276,370.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	40.620	416,111.280	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.000	211,500.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.560	520,884.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.630	698,466.450	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.005	418,482.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	6.950	829,135.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.430	432,297.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	249,053	9.600	2,390,908.800	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.960	2,344,011.120	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.860	468,350.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	21.700	2,050,650.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	151,000	3.700	558,700.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	145,700	0.915	133,315.500	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	2.750	473,275.000	
シンガポール・ドル 小計		3,663,574		16,166,339.150 (1,290,073,864)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	145,106	15.030	2,180,943.180	
	SYNGENTA AG	6,872	428.100	2,941,903.200	
	NESTLE SA-REGISTERED	232,379	74.500	17,312,235.500	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,674	75.000	2,975,550.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,476	245.200	12,867,115.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	193.500	548,572.500	

	SIKA INHABER	151	5,605.000	846,355.000	
	SGS SA-REG	405	2,131.000	863,055.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	166,725	77.600	12,937,860.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	130.100	536,922.700	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,304.000	187,776.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	449.600	807,032.000	
	ABB LTD	137,622	22.620	3,113,009.640	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,926	70.500	770,283.000	
	GEBERIT AG	2,801	426.600	1,194,906.600	
	LONZA GROUP AG-REG	4,373	179.900	786,702.700	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,635.000	422,625.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	6	64,190.000	385,140.000	
	GIVAUDAN-REG	692	1,821.000	1,260,132.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,053	275.500	3,045,101.500	
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,941	55.650	1,165,366.650	
	ACTELION	7,435	269.800	2,005,963.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	130.100	587,921.900	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	141.500	630,099.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	342.200	669,001.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	66.600	305,827.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	189.600	315,304.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,618	314.600	823,622.800	
	GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,149.000	350,445.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	578.500	319,910.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.750	519,632.500	
	DUFREY GROUP	3,566	143.400	511,364.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,474	526.000	775,324.000	
	ARYZTA AG	7,191	32.150	231,190.650	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	48.630	740,489.010	
	SWISS RE LTD	23,838	90.700	2,162,106.600	
	UBS GROUP AG	277,078	15.450	4,280,855.100	
スイス・フラン 小計		1,203,635		82,377,645.330 (9,170,279,478)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	293.100	14,179,298.700	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	264.100	7,700,363.700	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	58.400	12,950,083.200	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	149.100	1,961,112.300	
	LUNDBERGS B	2,606	585.000	1,524,510.000	
	SKF AB-B SHS	32,306	169.700	5,482,328.200	
	SANDVIK AB	75,199	122.000	9,174,278.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	121,939	103.600	12,632,880.400	
	SKANSKA AB-B SHS	27,150	214.500	5,823,675.000	
	SWEDBANK AB	66,507	224.100	14,904,218.700	

	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,024	277.300	12,762,455.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	127.400	15,149,006.600	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	117.700	13,379,194.400	
	SWEDISH MATCH AB	15,807	284.300	4,493,930.100	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	81.200	2,190,451.200	
	NORDEA AB	229,457	106.500	24,437,170.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	242.100	4,646,141.100	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	133.900	3,226,722.200	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	358.900	11,991,566.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	72,617	238.500	17,319,154.500	
	ASSA ABLOY AB-B	75,670	176.400	13,348,188.000	
	TELIA CO AB	184,927	36.130	6,681,412.510	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	185.700	3,117,903.000	
	BOLIDEN AB	21,855	273.200	5,970,786.000	
	ALFA LAVAL AB	24,553	162.900	3,999,683.700	
	KINNEVIK AB-B	18,310	244.400	4,474,964.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	490.000	2,612,680.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	292.000	1,728,640.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	77.000	2,594,284.000	
	HEXAGON AB	16,702	361.100	6,031,092.200	
スウェーデン・クローナ 小計		1,742,056		246,488,174.210 (3,058,918,242)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,601	616.000	5,298,216.000	
	A P MOLLER A/S	481	11,300.000	5,435,300.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	10,800.000	2,948,400.000	
	DANSKE BANK A/S	52,545	235.200	12,358,584.000	
	GENMAB A/S	4,633	1,371.000	6,351,843.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	268.000	4,262,272.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,139	249.300	35,435,252.700	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	520.500	8,228,064.000	
	TDC A/S	68,939	37.870	2,610,719.930	
	COLOPLAST-B	8,286	496.000	4,109,856.000	
	DSV A/S	15,601	342.300	5,340,222.300	
	WILLIAM DEMANT	6,537	141.500	924,985.500	
	TRYG A/S	11,107	129.200	1,435,024.400	
	PANDORA A/S	8,251	836.500	6,901,961.500	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	415.200	3,200,361.600	
	ISS A/S	11,125	265.600	2,954,800.000	
	DONG ENERGY A/S	6,575	252.600	1,660,845.000	
デンマーク・クローネ 小計		384,513		109,456,707.930 (1,744,739,925)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.950	681,044.400	

	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	9.700	730,225.700	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.565	749,223.960	
ニュージーランド・ドル 小計		383,434		2,160,494.060 (174,308,661)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	31,839	145.200	4,623,022.800	
	DNB ASA	70,426	138.400	9,746,958.400	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	46.500	4,272,373.500	
	TELENOR ASA	53,178	136.400	7,253,479.200	
	SCHIBSTED ASA	9,131	221.500	2,022,516.500	
	ORKLA ASA	61,421	75.250	4,621,930.250	
	STATOIL ASA	81,414	147.100	11,975,999.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,576	312.400	4,553,542.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	131.300	2,190,477.900	
ノルウェー・クローネ 小計		430,547		51,260,300.350 (686,888,024)	
ユーロ	CRH PLC	62,222	31.435	1,955,948.570	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	102.050	637,404.300	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	72.640	840,880.640	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.225	494,693.320	
	UMICORE	7,660	50.030	383,229.800	
	AIR LIQUIDE	28,615	102.150	2,923,022.250	
	AIRBUS SE	42,705	68.350	2,918,886.750	
	AXA	146,095	22.195	3,242,578.520	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	15.125	523,657.750	
	ADIDAS AG	14,302	151.900	2,172,473.800	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	14.100	1,212,529.500	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	41,829	13.885	580,795.660	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,060.000	166,420.000	
	DANONE	43,220	62.650	2,707,733.000	
	SAFRAN SA	23,731	65.500	1,554,380.500	
	INTESA SANPAOLO	934,915	2.076	1,940,883.540	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	1.995	224,367.670	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,055	84.250	2,026,633.750	
	ACCOR SA	10,385	37.285	387,204.720	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	33.575	253,927.720	
	BOUYGUES	13,996	35.700	499,657.200	
	BNP PARIBAS	78,591	54.680	4,297,355.880	
	RELX NV	70,826	16.730	1,184,918.980	
	THALES SA	8,128	89.110	724,286.080	
	CAP GEMINI SA	11,481	80.950	929,386.950	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	50.240	214,223.360	
	CHRISTIAN DIOR SE	3,940	201.450	793,713.000	
	INGENICO GROUP	4,334	84.950	368,173.300	

UNICREDIT SPA	37,824	12.160	459,939.840	
NATIXIS	70,166	5.150	361,354.900	
KONINKLIJKE DSM NV	12,285	61.400	754,299.000	
COMMERZBANK AG	72,573	7.098	515,123.150	
EIFFAGE	4,777	66.440	317,383.880	
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	75.670	2,281,904.520	
UNITED INTERNET	9,882	39.130	386,682.660	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	43.530	241,417.380	
PUBLICIS GROUPE	15,068	62.930	948,229.240	
MAN SE	3,396	96.820	328,800.720	
IBERDROLA SA	424,273	6.280	2,664,434.440	
ENI SPA	188,983	14.300	2,702,456.900	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.105	294,804.280	
KBC GROUPE	18,378	57.020	1,047,913.560	
HANNOVER RUECK SE	5,050	107.300	541,865.000	
WARTSILA OYJ	11,645	48.740	567,577.300	
L'OREAL	18,815	175.550	3,302,973.250	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,036	190.700	4,011,565.200	
LAGARDERE S. C. A.	9,600	23.520	225,792.000	
GEA GROUP AG	14,635	36.905	540,104.670	
BOLLORE	71,347	3.640	259,703.080	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.445	315,697.780	
MICHELIN(CGDE)-B	13,125	106.550	1,398,468.750	
CONTINENTAL AG	8,310	192.050	1,595,935.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	74,274	32.185	2,390,508.690	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	37.390	351,428.610	
AXEL SPRINGER SE	3,067	48.700	149,362.900	
OMV AG	9,766	36.095	352,503.770	
PERNOD-RICARD	16,110	107.950	1,739,074.500	
PEUGEOT SA	32,906	17.930	590,004.580	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,066	52.670	635,516.220	
RENAULT SA	14,360	83.910	1,204,947.600	
REPSOL SA	80,153	13.820	1,107,714.460	
REMY COINTREAU	1,860	84.390	156,965.400	
MERCK KGAA	8,752	103.200	903,206.400	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	44.370	1,584,275.220	
SAIPEM	465,751	0.420	195,615.420	
RWE AG	39,183	13.220	517,999.260	
SEB SA	1,405	123.700	173,798.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	49.360	572,674.720	
SOCIETE GENERALE-A	56,243	41.430	2,330,147.490	
VINCI S. A.	37,818	67.490	2,552,336.820	
SODEXO	7,368	102.750	757,062.000	
SOLVAY SA	5,991	111.950	670,692.450	

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

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

HEINEKEN HOLDING NV-A	8, 014	71. 730	574, 844. 220	
INDITEX	83, 755	30. 205	2, 529, 819. 770	
JC DECAUX SA	6, 058	29. 680	179, 801. 440	
ANDRITZ AG	6, 265	49. 285	308, 770. 520	
MAPFRE SA	84, 474	2. 870	242, 440. 380	
ESSILOR INTL	16, 004	108. 750	1, 740, 435. 000	
SNAM SPA	186, 129	3. 728	693, 888. 910	
CREDIT AGRICOLE SA	85, 585	11. 215	959, 835. 770	
ENAGAS	18, 095	23. 225	420, 256. 370	
WENDEL	2, 220	104. 550	232, 101. 000	
TENARIS SA	38, 237	15. 530	593, 820. 610	
TELECOM ITALIA SPA	672, 896	0. 758	510, 055. 160	
TELECOM ITALIA-RNC	497, 596	0. 618	307, 514. 320	
ATLANTIA SPA	27, 920	21. 690	605, 584. 800	
ILIAD SA	2, 102	196. 400	412, 832. 800	
PROXIMUS	13, 498	28. 375	383, 005. 750	
SES FDR	30, 439	19. 625	597, 365. 370	
TERNA SPA	117, 108	4. 370	511, 761. 960	
GRIFOLS SA	25, 309	20. 820	526, 933. 380	
FERROVIAL SA	35, 610	16. 950	603, 589. 500	
LANXESS AG	6, 856	63. 930	438, 304. 080	
NESTE OYJ	10, 692	34. 040	363, 955. 680	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9, 641	21. 120	203, 617. 920	
KONE OYJ	23, 717	41. 510	984, 492. 670	
ENGIE	110, 924	11. 225	1, 245, 121. 900	
ALSTOM	12, 046	25. 350	305, 366. 100	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12, 542	18. 055	226, 445. 810	
ELECTRICITE DE FRANCE	20, 751	8. 952	185, 762. 950	
DEUTSCHE WOHNEN AG	26, 714	32. 435	866, 468. 590	
ARKEMA SA	4, 241	91. 120	386, 439. 920	
LEGRAND SA	19, 920	53. 360	1, 062, 931. 200	
ADP	2, 313	105. 500	244, 021. 500	
ORION OYJ	8, 051	47. 000	378, 397. 000	
RTL GROUP SA	3, 446	72. 730	250, 627. 580	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37, 921	13. 845	525, 016. 240	
SYMRISE AG	7, 926	58. 910	466, 920. 660	
SCOR SE	13, 875	34. 075	472, 790. 620	
REXEL SA	23, 245	14. 960	347, 745. 200	
PRYSMIAN SPA	14, 925	24. 000	358, 200. 000	
CAIXABANK	229, 231	3. 211	736, 060. 740	
BUREAU VERITAS SA	21, 480	18. 000	386, 640. 000	
GROUPE EUROTUNNEL SE	37, 646	8. 805	331, 473. 030	
SUEZ SA	25, 406	14. 010	355, 938. 060	
ENGIE	3, 318	0. 001	3. 310	
AMADEUS IT GROUP SA	33, 099	43. 330	1, 434, 179. 670	

	BRENNTAG AG	12,331	53.890	664,517.590	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	68,448	6.226	426,157.240	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	5.005	241,766.520	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.365	351,474.870	
	EDENRED	18,682	21.300	397,926.600	
	BANKIA SA	370,638	0.916	339,504.400	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.110	252,933.510	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	67.840	353,989.120	
	OSRAM LICHT AG	7,017	56.300	395,057.100	
	GEMALTO	6,103	56.230	343,171.690	
	VONOVIA SE	35,271	33.250	1,172,760.750	
	UNICREDIT SPA-RTS	37,820	12.350	467,077.000	
	FERRARI NV	8,338	61.200	510,285.600	
	DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	83.940	1,162,065.360	
	INNOGY SE	9,769	33.815	330,338.730	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	8.650	680,279.250	
	SFR GROUP SA	8,774	27.660	242,688.840	
	NN GROUP NV	21,965	28.760	631,713.400	
	ZALANDO SE	6,674	37.795	252,243.830	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	10.150	711,616.500	
	AENA SA	5,256	134.950	709,297.200	
	ABN AMRO GROUP NV	19,363	21.450	415,336.350	
	EXOR NV	9,441	43.920	414,648.720	
	ALTICE NV-A	38,525	19.940	768,188.500	
	COVESTRO AG	5,966	70.340	419,648.440	
	TECHNIPFMC PLC	17,740	30.380	538,941.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,644	102.850	5,825,835.400	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	5.940	237,689.100	
	SCHAEFFLER AG	12,644	14.960	189,154.240	
	LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	52.310	737,832.550	
	UNIPER SE	16,058	13.280	213,250.240	
ユーロ 小計		17,338,831		265,910,474.940 (31,518,368,595)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	99.500	1,651,700.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.860	3,257,040.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	32.900	2,508,954.000	
	CLP HOLDINGS LTD	130,500	77.850	10,159,425.000	
	PCCW LTD	331,000	4.690	1,552,390.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	92,000	11.420	1,050,640.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	3.530	1,879,372.000	

CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	64.100	3,140,900.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	89,540	198.000	17,728,920.000	
MTR CORP	118,500	41.350	4,899,975.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	31.750	2,000,250.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	160.000	8,960,000.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	94,222	45.200	4,258,834.400	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	112,500	69.750	7,846,875.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	61.850	5,922,137.500	
HONG KONG & CHINA GAS	616,588	14.980	9,236,488.240	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	37.000	6,993,000.000	
KERRY PROPERTIES LTD	43,000	24.150	1,038,450.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	287,000	31.050	8,911,350.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	28.150	1,421,575.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	10.180	4,492,087.880	
SINO LAND CO	255,400	13.380	3,417,252.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	113,000	114.400	12,927,200.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	81.000	3,442,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	28.400	3,223,400.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	51.000	2,856,000.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	13.660	1,699,304.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	13.920	902,016.000	
AIA GROUP LTD	892,627	48.750	43,515,566.250	
HKT TRUST / HKT LTD	214,000	10.380	2,221,320.000	
SANDS CHINA LTD	198,000	32.150	6,365,700.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.500	2,448,700.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	6.780	1,559,400.000	
WH GROUP LTD	530,500	6.060	3,214,830.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	94.500	18,836,874.000	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	198,832	53.450	10,627,570.400	
香港・ドル 小計	6,985,717		226,167,996.670 (3,268,127,551)	
合計	87,250,973		263,147,490,307 (263,147,490,307)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年2月27日現在

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

	GGP INC	43,463.000	1,088,748.150	
	HCP INC	34,130.000	1,114,003.200	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	1,047,209.460	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	710,878.500	
	KIMCO REALTY	32,980.000	804,052.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	461,999.340	
	MID AMERICA	8,123.000	828,952.150	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	484,075.040	
	PROLOGIS INC	38,966.000	1,990,383.280	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,546,999.910	
	REALTY INCOME CORP	20,047.000	1,266,769.930	
	REGENCY CENTERS CORP	7,365.000	524,314.350	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,156.000	1,017,780.960	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,516.000	4,333,763.640	
	SL GREEN	7,722.000	862,856.280	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	605,830.940	
	UDR INC	21,797.000	789,051.400	
	VENTAS INC	27,031.000	1,756,474.380	
	VEREIT INC	59,654.000	535,692.920	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	1,344,797.430	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,857,710.960	
	WEYERHAEUSER CO	57,008.000	1,908,057.760	
アメリカ・ドル 小計		893,594.000	49,256,825.330 (5,525,630,665)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	442,006.650	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	346,127.480	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	218,980.870	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	674,674.770	
	SEGRO PLC	50,928.000	252,450.090	
イギリス・ポンド 小計		319,358.000	1,934,239.860 (269,362,243)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	249,568.560	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	259,290.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,582.000	86,367.900	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	595,226.460 (50,915,671)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	181,348.200	
	GECINA SA	3,212.000	386,564.200	
	ICADE	2,234.000	150,504.580	
	KLEPIERRE	17,042.000	604,224.110	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,565,873.850	
ユーロ 小計		32,052.000	2,888,514.940	

			(342, 375, 675)	
	香港・ドル	LINK REIT	163, 500. 000	8, 829, 000. 000
	香港・ドル	小計	163, 500. 000	8, 829, 000. 000
				(127, 579, 051)
投資証券	合計		1, 431, 509	6, 315, 863, 305
				(6, 315, 863, 305)
合計				7, 141, 786, 454
				(7, 141, 786, 454)

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比 率
アメリカ・ドル	株式 600銘柄 投資証券 39銘柄	63. 88% -%	-% -%	-% 2. 02%	66. 79%
イギリス・ポンド	株式 104銘柄 投資証券 5銘柄	6. 87% -%	-% -%	-% 0. 10%	7. 07%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0. 10%	-%	-%	0. 10%
オーストラリア・ドル	株式 60銘柄 投資信託 受益証券 9銘柄	2. 73% -%	-% 0. 26%	-% -%	3. 03%
カナダ・ドル	株式 90銘柄 投資証券 3銘柄	3. 89% -%	-% -%	-% 0. 02%	3. 96%
シンガポール・ドル	株式 20銘柄 投資信託 受益証券 4銘柄	0. 47% -%	-% 0. 04%	-% -%	0. 52%
スイス・フラン	株式 37銘柄	3. 35%	-%	-%	3. 39%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1. 12%	-%	-%	1. 13%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0. 64%	-%	-%	0. 65%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0. 06%	-%	-%	0. 06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0. 25%	-%	-%	0. 25%
ユーロ	株式 234銘柄 投資証券 5銘柄	11. 51% -%	-% -%	-% 0. 12%	11. 79%
香港・ドル	株式 36銘柄 投資証券 1銘柄	1. 19% -%	-% -%	-% 0. 05%	1. 26%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	183,852,928,058円	149,167,353,470円
同期中追加設定元本額	22,714,623,570円	30,520,903,400円
同期中一部解約元本額	57,400,198,158円	36,208,199,551円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	4,608,868,777円	5,128,943,378円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	17,135,667円	13,691,042円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	49,601,868円	44,704,339円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	84,885,603円	62,814,032円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	40,812,730円	39,527,953円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	41,966,921円	42,616,554円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	31,685,325円	39,345,731円
たわらノーロード 先進国債券	154,189,800円	526,660,107円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	－円	606,412円

D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	4, 589, 345, 800円	4, 778, 857, 729円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	381, 621, 256円	447, 249, 853円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	1, 283, 530, 211円	1, 429, 659, 466円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1, 366, 997, 870円	1, 468, 558, 554円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	325, 115, 189円	361, 249, 152円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	702, 091, 373円	744, 657, 416円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	505, 339, 054円	555, 306, 358円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27, 849, 563円	25, 651, 436円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	568, 221, 729円	563, 298, 507円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18, 844, 770円	6, 021, 349円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	8, 241, 243円	13, 825, 526円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	14, 982, 115円	23, 935, 984円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国30）	29, 626, 646円	46, 434, 072円
クルーズコントロール	416, 028, 978円	1, 781, 261, 902円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	25, 339, 893円	44, 703, 644円
D I A M DC バランス・F（成長型）	25, 127, 893円	64, 833, 181円
クルーズコントロール<DC年金>	104, 666円	656, 988円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	3, 004, 878円	8, 685, 786円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	5, 367, 737円	28, 434, 647円
ダイナミック・ナビゲーション	－円	336, 463円

D I AMパッシブ資産分散ファンド	1, 803, 256, 689円	1, 570, 963, 668円
D I AM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6, 936, 738, 041円	7, 162, 874, 811円
D I AM外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	4, 671, 354, 435円	4, 298, 221, 851円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2, 389, 669, 712円	3, 975, 487, 139円
D I AMアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	195, 054, 050円	411, 883, 612円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	－円	577, 394, 424円
D I AMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	125, 179, 732円	114, 026, 758円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2, 536, 469, 224円	1, 328, 163, 674円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	833, 903, 203円	815, 717, 319円
D I AM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	100, 546, 922円	83, 054, 540円
D I AM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	183, 536, 447円	153, 614, 760円
D I AM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	43, 892, 957円	38, 607, 745円
D I AM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	21, 332, 413円	13, 058, 720円
D I AM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	8, 626, 781, 465円	1, 656, 036, 644円
D I AM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2, 181, 728, 841円	497, 398, 018円
D I AMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	5, 129, 506, 277円	4, 483, 992, 277円

D I A M バランスファン ド 3 7 . 5 V A (適格機 関投資家限定)	2, 858, 417, 978円	2, 756, 191, 387円
D I A M バランスファン ド 5 0 V A (適格機関投 資家限定)	4, 576, 434, 371円	4, 587, 547, 137円
D I A M グローバル・ア セット・バランス V A (適格機関投資家限定)	881, 138, 244円	895, 832, 183円
D I A M グローバル・ア セット・バランス V A 2 (適格機関投資家限定)	3, 273, 256, 957円	1, 987, 647, 480円
D I A M アクサ グロ ーバル バランスファン ド 3 0 V A (適格機関投 資家限定)	4, 397, 691, 775円	4, 199, 114, 002円
D I A M 世界アセットバ ランスファンド V A (適 格機関投資家向け)	16, 100, 828, 427円	15, 062, 291, 264円
D I A M グローバル β 私 募ファンド (適格機関投 資家向け)	56, 954, 254円	19, 119, 506円
D I A M 世界バランスフ ァンド 5 5 V A (適格機 関投資家限定)	2, 193, 691, 472円	2, 036, 987, 121円
D I A M 世界バランスフ ァンド 3 5 V A (適格機 関投資家限定)	10, 833, 445, 814円	11, 186, 558, 463円
D I A M 世界アセットバ ランスファンド 2 V A (適格機関投資家限定)	15, 360, 947, 657円	16, 133, 768, 314円
D I A M 世界アセットバ ランスファンド 3 V A (適格機関投資家限定)	19, 589, 996, 575円	20, 496, 046, 357円
D I A M バランス 3 0 V A (適格機関投資家限 定)	14, 748, 909円	26, 346, 082円
D I A M バランス 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	19, 587, 305円	270, 776円
D I A M バランス 7 0 V A (適格機関投資家限 定)	6, 546, 806円	6, 037, 223円
D I A M 世界アセットバ ランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	17, 612, 128, 830円	18, 350, 730, 818円
D I A M 世界バランス 2 5 V A (適格機関投資 家限定)	124, 173, 768円	120, 985, 005円

	D I A M バランス 2 0 V A (適格機関投資家限 定)	129, 091, 817円	141, 168, 530円
	D I A M バランス 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	33, 261, 642円	237, 910円
	D I A M バランス 6 0 V A (適格機関投資家限 定)	132, 906円	154, 240円
計		149, 167, 353, 470円	143, 480, 057, 319円
2.	受益権の総数	149, 167, 353, 470口	143, 480, 057, 319口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年2月26日 至 平成28年2月25日	自 平成28年2月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	485,021,012	1,483,683,375
合計	485,021,012	1,483,683,375

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月23日から平成28年2月25日まで及び平成29年2月22日から平成29年2月27日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成29年2月27日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	973,770,226	—	974,984,120	△1,213,894	—	—	—	—
アメリカ・ドル	486,997,104	—	487,778,840	△781,736	—	—	—	—
イギリス・ポンド	86,047,075	—	85,726,350	320,725	—	—	—	—
ユーロ	400,726,047	—	401,478,930	△752,883	—	—	—	—
買 建	—	—	—	—	1,647,316,001	—	1,640,340,360	△6,975,641
アメリカ・ドル	—	—	—	—	741,545,528	—	738,975,960	△2,569,568
イギリス・ポンド	—	—	—	—	164,494,992	—	162,922,500	△1,572,492
ユーロ	—	—	—	—	741,275,481	—	738,441,900	△2,833,581
合計	973,770,226	—	974,984,120	△1,213,894	1,647,316,001	—	1,640,340,360	△6,975,641

(注) 時価の算定方法

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。
 - ①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。
 - ②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28年2月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.7712円	1.7269円
(1万口当たり純資産額)	(17,712円)	(17,269円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年2月27日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.75 02/28/18	13,500,000.000	13,481,505.000	
		US T N/B 0.75 04/15/18	3,000,000.000	2,993,880.000	
		US T N/B 0.875 07/15/18	10,000,000.000	9,986,300.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	6,937,070.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	10,000,000.000	10,005,400.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,406,040.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	4,961,900.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,441,305.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,977,120.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,757,772.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	6,986,840.000	
		US T N/B 1.25 12/15/18	15,000,000.000	15,039,150.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	2,000,000.000	1,999,760.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	13,058,370.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,289,164.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,970,000.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,488,240.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	14,000,000.000	13,435,520.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	35,500,000.000	35,688,505.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,000,000.000	4,784,350.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	12,000,000.000	11,160,000.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	12,700,000.000	12,790,170.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,120,700.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	10,500,000.000	9,919,140.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	15,135,900.000	

US T N/B 1.625 05/15/26	11,500,000.000	10,840,475.000	
US T N/B 1.625 08/15/22	15,000,000.000	14,776,050.000	
US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,365,750.000	
US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	4,932,400.000	
US T N/B 1.75 03/31/22	3,000,000.000	2,986,380.000	
US T N/B 1.75 05/15/22	15,000,000.000	14,906,250.000	
US T N/B 1.75 05/15/23	15,000,000.000	14,746,800.000	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	4,948,400.000	
US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,037,920.000	
US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,040,770.000	
US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,136,620.000	
US T N/B 1.875 08/31/22	7,000,000.000	6,979,700.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	2,500,000.000	2,520,975.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,504,370.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,341,160.000	
US T N/B 2.0 02/28/21	11,000,000.000	11,148,610.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,143,400.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	12,000,000.000	11,747,760.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,095,100.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,499,528.000	
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,651,725.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,146,800.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	10,398,255.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,613,525.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	21,000,000.000	21,329,700.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,060,000.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,153,100.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,930,476.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,064,960.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,759,555.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	7,500,000.000	6,432,375.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,500,000.000	10,536,855.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,000,000.000	9,967,900.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	15,000,000.000	15,281,700.000	

US T N/B 2. 375 08/15/24	8, 900, 000. 000	9, 026, 469. 000	
US T N/B 2. 375 12/31/20	8, 300, 000. 000	8, 536, 633. 000	
US T N/B 2. 5 02/15/45	6, 000, 000. 000	5, 456, 700. 000	
US T N/B 2. 5 02/15/46	7, 000, 000. 000	6, 352, 500. 000	
US T N/B 2. 5 05/15/24	9, 000, 000. 000	9, 217, 260. 000	
US T N/B 2. 5 05/15/46	5, 000, 000. 000	4, 537, 500. 000	
US T N/B 2. 5 08/15/23	8, 000, 000. 000	8, 210, 000. 000	
US T N/B 2. 625 08/15/20	16, 500, 000. 000	17, 109, 675. 000	
US T N/B 2. 625 11/15/20	6, 000, 000. 000	6, 226, 860. 000	
US T N/B 2. 75 02/15/19	12, 000, 000. 000	12, 372, 600. 000	
US T N/B 2. 75 02/15/24	7, 000, 000. 000	7, 288, 190. 000	
US T N/B 2. 75 08/15/42	3, 890, 000. 000	3, 748, 987. 500	
US T N/B 2. 75 11/15/23	10, 000, 000. 000	10, 410, 900. 000	
US T N/B 2. 75 11/15/42	3, 400, 000. 000	3, 273, 282. 000	
US T N/B 2. 875 03/31/18	10, 000, 000. 000	10, 211, 700. 000	
US T N/B 2. 875 05/15/43	6, 070, 000. 000	5, 977, 493. 200	
US T N/B 2. 875 08/15/45	6, 400, 000. 000	6, 282, 944. 000	
US T N/B 2. 875 11/15/46	2, 500, 000. 000	2, 457, 800. 000	
US T N/B 3. 0 05/15/42	2, 270, 000. 000	2, 294, 811. 100	
US T N/B 3. 0 05/15/45	6, 500, 000. 000	6, 541, 080. 000	
US T N/B 3. 0 11/15/44	5, 800, 000. 000	5, 841, 180. 000	
US T N/B 3. 0 11/15/45	6, 000, 000. 000	6, 035, 100. 000	
US T N/B 3. 125 02/15/42	1, 800, 000. 000	1, 860, 876. 000	
US T N/B 3. 125 02/15/43	4, 600, 000. 000	4, 745, 544. 000	
US T N/B 3. 125 05/15/19	13, 000, 000. 000	13, 544, 830. 000	
US T N/B 3. 125 05/15/21	8, 000, 000. 000	8, 460, 000. 000	
US T N/B 3. 125 08/15/44	6, 100, 000. 000	6, 292, 516. 000	
US T N/B 3. 125 11/15/41	1, 800, 000. 000	1, 861, 020. 000	
US T N/B 3. 375 05/15/44	6, 690, 000. 000	7, 223, 594. 400	
US T N/B 3. 375 11/15/19	4, 000, 000. 000	4, 219, 840. 000	
US T N/B 3. 5 02/15/18	2, 000, 000. 000	2, 050, 220. 000	
US T N/B 3. 5 02/15/39	2, 000, 000. 000	2, 222, 960. 000	

US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,890,260.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	17,000,000.000	18,106,870.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,921,520.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,637,100.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,285,900.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	5,860,140.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,980,000.000	3,415,586.600	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	6,565,203.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,285,280.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,570,000.000	3,001,477.300	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	12,527,280.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,010,360.500	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,467,020.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	946,170.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,499,469.100	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,450,000.000	3,081,830.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,081,341.200	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,563,420.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,833,188.500	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,784,776.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,700,000.000	4,800,158.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,000,000.000	3,970,290.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,430,000.000	1,943,899.100	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,931,250.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	3,300,000.000	4,447,641.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,355,462.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,167,488.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,898,190.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	2,001,174.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	6,000,000.000	7,537,920.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,683,720.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,664,200.000	

	US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,609,840.000	
アメリカ・ドル 小計		950,710,000.000 (106,650,647,800)	973,505,935.000 (109,207,895,788)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.25 07/22/18	3,000,000.000	3,049,200.000	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	3,200,000.000	3,348,416.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,200,000.000	1,244,760.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,700,000.000	4,885,415.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,520,440.000	
	UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,500,000.000	1,589,670.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,900,000.000	3,153,431.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,500,000.000	3,857,560.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,700,000.000	2,182,069.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,800,000.000	3,198,580.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,300,000.000	4,300,890.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	3,250,000.000	4,443,075.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,480,000.000	4,064,720.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,600,000.000	3,998,800.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,403,720.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,262,790.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	3,200,000.000	3,691,744.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,200,000.000	3,785,980.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,714,000.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,350,000.000	4,740,250.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,450,000.000	3,360,910.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,850,000.000	2,696,560.000	

	UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,160,000.000	2,834,568.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,500,000.000	3,692,000.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,400,000.000	3,751,440.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,359,817.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,990,000.000	5,183,165.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,400,000.000	2,616,960.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,100,000.000	4,454,390.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,800,000.000	4,365,760.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	5,400,000.000	6,153,300.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,200,000.000	3,123,120.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,400,000.000	3,706,560.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	900,000.000	945,180.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,880,000.000	3,807,648.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,216,470.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	2,000,000.000	2,658,600.000	
	イギリス・ポンド 小計	97,530,000.000 (13,582,027,800)	126,361,958.000 (17,597,166,271)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,738,316.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,500,000.000	4,810,995.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,241,051.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,372,904.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,000,000.000	945,700.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,900,000.000	3,958,929.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	827,532.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,533,675.000	

	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,200,000.000	3,181,280.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	800,000.000	695,256.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,000,000.000	4,185,400.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	1,963,479.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	700,000.000	669,445.000	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	2,400,000.000	2,459,544.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	1,728,622.500	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,100,000.000	5,746,425.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,102,364.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,900,000.000	4,594,512.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,533,130.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,000,000.000	4,705,400.000	
オーストラリア・ドル 小計		54,750,000.000 (4,711,237,500)	58,993,959.500 (5,076,430,215)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,588,730.000	
	CANADA 0.5 11/01/18	4,600,000.000	4,583,578.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,384,688.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,600,000.000	1,610,288.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,450,000.000	2,470,359.500	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,822,590.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,684,445.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,900,000.000	1,937,829.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,904,904.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,500,000.000	2,691,475.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,218,864.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,000,000.000	1,094,100.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	900,000.000	1,014,588.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	5,135,502.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,300,000.000	4,655,825.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,300,000.000	2,839,235.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,945,606.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,350,000.000	3,059,183.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	5,500,000.000	5,746,840.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,860,000.000	2,673,582.600	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,800,000.000	2,552,598.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,800,000.000	2,685,564.000	

カナダ・ドル 小計		55,860,000.000 (4,778,264,400)	62,300,374.100 (5,329,174,001)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	880,000.000	875,600.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	814,880.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	310,000.000	328,234.200	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	610,000.000	645,075.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	419,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	481,822.400	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	861,840.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,711,200.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,421,472.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	539,040.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.000	1,105,000.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,550,000.000	1,617,735.000	
シンガポール・ドル 小計		10,240,000.000 (817,152,000)	10,821,298.600 (863,539,628)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	5,000,000.000	5,212,700.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,602,003.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,800,000.000	13,877,272.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,400,000.000	8,719,552.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	11,870,000.000	14,157,586.400	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	12,300,000.000	13,543,899.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	13,746,083.400	
スウェーデン・クローナ 小計		68,480,000.000 (849,836,800)	79,859,095.800 (991,051,379)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	4,000,000.000	4,066,880.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,103,900.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	13,470,000.000	15,291,548.100	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	15,094,950.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	13,900,000.000	15,666,690.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	17,000,000.000	29,377,700.000	
デンマーク・クローネ 小計		66,870,000.000 (1,065,907,800)	85,601,668.100 (1,364,490,590)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	2,000,000.000	1,990,240.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,876,684.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,952,032.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,400,000.000	8,220,808.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	9,100,000.000	10,159,240.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	7,124,816.000	
ノルウェー・クローネ 小計		36,460,000.000 (488,564,000)	39,323,820.000 (526,939,188)	

ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,912,400.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,094,840.000	
	POLAND 10/25/18	2,000,000.000	1,934,400.000	
	POLAND 2.5 07/25/18	1,500,000.000	1,514,850.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	3,809,610.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	3,070,000.000	3,138,154.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,166,387.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	5,000,000.000	5,124,500.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,212,995.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,485,985.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,899,820.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,840,000.000	2,185,920.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,520,400.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,122,336.000	
ポーランド・ズロチ 小計		48,470,000.000 (1,331,955,600)	50,122,597.000 (1,377,368,966)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,933,460.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,190,707.800	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,195,644.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,394,777.400	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	3,700,000.000	3,720,054.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,121,319.100	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	783,328.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,756,630.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,599,110.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,449,748.300	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	2,300,000.000	2,324,012.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,765,744.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,135,636.600	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,813,194.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,538,085.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,730,592.000	
マレーシア・リングgit 小計		37,430,000.000 (944,733,200)	37,452,042.700 (945,289,558)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	16,500,000.000	20,374,860.000	

	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	41,000,000.000	48,083,160.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	41,500,000.000	40,538,445.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	21,000,000.000	20,042,610.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,513,000.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	10,000,000.000	9,762,100.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	37,422,020.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	10,124,900.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,175,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	20,079,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,072,240.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	31,035,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,702,100.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	33,654,220.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,253,850.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	15,000,000.000	15,466,350.000	
メキシコ・ペソ 小計		325,000,000.000 (1,836,250,000)	339,299,555.000 (1,917,042,486)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	200,000.000	205,334.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	800,000.000	823,280.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,700,000.000	1,836,034.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	50,000.000	51,291.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,398,687.500	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,574,720.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,488,578.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,103,679.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,070,000.000	1,525,477.600	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,815,870.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,100,000.000	2,480,100.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,446,600.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	570,000.000	988,391.400	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,250,000.000	2,597,737.500	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,800,000.000	2,779,200.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	2,300,000.000	2,542,489.000	

AUSTRIA 4. 85 03/15/26	1, 500, 000. 000	2, 112, 855. 000	
AUSTRIA 6. 25 07/15/27	1, 150, 000. 000	1, 830, 512. 500	
BELGIUM 0. 8 06/22/25	2, 700, 000. 000	2, 790, 450. 000	
BELGIUM 1. 0 06/22/26	1, 400, 000. 000	1, 457, 484. 000	
BELGIUM 1. 0 06/22/31	1, 300, 000. 000	1, 287, 780. 000	
BELGIUM 1. 25 06/22/18	1, 600, 000. 000	1, 639, 808. 000	
BELGIUM 1. 6 06/22/47	900, 000. 000	879, 597. 000	
BELGIUM 1. 9 06/22/38	700, 000. 000	764, 827. 000	
BELGIUM 2. 15 06/22/66	400, 000. 000	412, 160. 000	
BELGIUM 2. 25 06/22/23	2, 000, 000. 000	2, 299, 460. 000	
BELGIUM 2. 6 06/22/24	2, 600, 000. 000	3, 059, 134. 000	
BELGIUM 3. 0 06/22/34	850, 000. 000	1, 094, 443. 000	
BELGIUM 3. 0 09/28/19	2, 100, 000. 000	2, 296, 350. 000	
BELGIUM 3. 75 06/22/45	1, 400, 000. 000	2, 085, 832. 000	
BELGIUM 3. 75 09/28/20	3, 000, 000. 000	3, 464, 430. 000	
BELGIUM 4. 0 03/28/18	500, 000. 000	525, 345. 000	
BELGIUM 4. 0 03/28/19	1, 950, 000. 000	2, 138, 643. 000	
BELGIUM 4. 0 03/28/22	2, 300, 000. 000	2, 812, 049. 000	
BELGIUM 4. 0 03/28/32	1, 200, 000. 000	1, 693, 872. 000	
BELGIUM 4. 25 03/28/41	2, 400, 000. 000	3, 773, 592. 000	
BELGIUM 4. 25 09/28/21	2, 150, 000. 000	2, 615, 926. 500	
BELGIUM 4. 25 09/28/22	2, 300, 000. 000	2, 879, 830. 000	
BELGIUM 4. 5 03/28/26	1, 600, 000. 000	2, 176, 608. 000	
BELGIUM 5. 0 03/28/35	2, 700, 000. 000	4, 395, 033. 000	
BELGIUM 5. 5 03/28/28	3, 050, 000. 000	4, 618, 737. 000	
BUNDESOBL 0. 25 10/16/20	1, 000, 000. 000	1, 039, 060. 000	
BUNDESOBL 0. 5 02/23/18	2, 500, 000. 000	2, 536, 125. 000	
BUNDESOBL 0. 5 04/12/19	3, 100, 000. 000	3, 197, 681. 000	
BUNDESOBL 04/09/21	3, 200, 000. 000	3, 299, 104. 000	
BUNDESOBL 1. 0 10/12/18	1, 800, 000. 000	1, 857, 528. 000	
BUNDESSCHAT 06/15/18	2, 300, 000. 000	2, 328, 773. 000	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/25	3, 900, 000. 000	4, 105, 257. 000	
DEUTSCHLAND 0. 5 02/15/26	4, 200, 000. 000	4, 382, 322. 000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2, 600, 000. 000	2, 571, 270. 000	
DEUTSCHLAND 1. 0 08/15/24	2, 600, 000. 000	2, 843, 412. 000	
DEUTSCHLAND 1. 0 08/15/25	3, 200, 000. 000	3, 492, 896. 000	
DEUTSCHLAND 1. 5 02/15/23	1, 000, 000. 000	1, 119, 780. 000	
DEUTSCHLAND 1. 5 05/15/23	3, 800, 000. 000	4, 265, 956. 000	
DEUTSCHLAND 1. 5 05/15/24	3, 800, 000. 000	4, 293, 126. 000	

DEUTSCHLAND 1. 5 09/04/22	2, 200, 000. 000	2, 453, 308. 000	
DEUTSCHLAND 1. 75 02/15/24	1, 500, 000. 000	1, 719, 120. 000	
DEUTSCHLAND 1. 75 07/04/22	3, 500, 000. 000	3, 940, 300. 000	
DEUTSCHLAND 2. 0 01/04/22	3, 300, 000. 000	3, 729, 231. 000	
DEUTSCHLAND 2. 0 08/15/23	3, 100, 000. 000	3, 592, 001. 000	
DEUTSCHLAND 2. 25 09/04/20	4, 200, 000. 000	4, 662, 756. 000	
DEUTSCHLAND 2. 25 09/04/21	3, 500, 000. 000	3, 974, 250. 000	
DEUTSCHLAND 2. 5 01/04/21	2, 700, 000. 000	3, 047, 085. 000	
DEUTSCHLAND 2. 5 07/04/44	2, 800, 000. 000	3, 863, 356. 000	
DEUTSCHLAND 2. 5 08/15/46	2, 780, 000. 000	3, 884, 382. 800	
DEUTSCHLAND 3. 0 07/04/20	4, 500, 000. 000	5, 091, 885. 000	
DEUTSCHLAND 3. 25 01/04/20	7, 700, 000. 000	8, 630, 391. 000	
DEUTSCHLAND 3. 25 07/04/21	3, 800, 000. 000	4, 470, 092. 000	
DEUTSCHLAND 3. 25 07/04/42	2, 050, 000. 000	3, 158, 230. 000	
DEUTSCHLAND 3. 5 07/04/19	5, 900, 000. 000	6, 525, 990. 000	
DEUTSCHLAND 3. 75 01/04/19	4, 900, 000. 000	5, 333, 650. 000	
DEUTSCHLAND 4. 0 01/04/37	3, 100, 000. 000	5, 002, 346. 000	
DEUTSCHLAND 4. 25 07/04/18	5, 200, 000. 000	5, 567, 900. 000	
DEUTSCHLAND 4. 25 07/04/39	2, 200, 000. 000	3, 769, 194. 000	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/28	1, 600, 000. 000	2, 405, 408. 000	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/34	3, 100, 000. 000	5, 241, 418. 000	
DEUTSCHLAND 4. 75 07/04/40	2, 200, 000. 000	4, 052, 752. 000	
DEUTSCHLAND 5. 5 01/04/31	2, 200, 000. 000	3, 706, 406. 000	
DEUTSCHLAND 5. 625 01/04/28	2, 360, 000. 000	3, 735, 030. 400	

DEUTSCHLAND 6. 25 01/04/24	1, 400, 000. 000	2, 039, 884. 000	
DEUTSCHLAND 6. 25 01/04/30	1, 500, 000. 000	2, 613, 600. 000	
DEUTSCHLAND 6. 5 07/04/27	1, 750, 000. 000	2, 889, 477. 500	
FINLAND 0. 375 09/15/20	500, 000. 000	516, 960. 000	
FINLAND 0. 5 04/15/26	700, 000. 000	709, 184. 000	
FINLAND 0. 75 04/15/31	450, 000. 000	448, 020. 000	
FINLAND 0. 875 09/15/25	300, 000. 000	315, 807. 000	
FINLAND 1. 125 09/15/18	400, 000. 000	411, 964. 000	
FINLAND 1. 5 04/15/23	1, 270, 000. 000	1, 399, 413. 000	
FINLAND 1. 625 09/15/22	400, 000. 000	442, 220. 000	
FINLAND 2. 0 04/15/24	800, 000. 000	913, 856. 000	
FINLAND 2. 625 07/04/42	660, 000. 000	888, 795. 600	
FINLAND 2. 75 07/04/28	780, 000. 000	970, 990. 800	
FINLAND 3. 375 04/15/20	1, 130, 000. 000	1, 272, 843. 300	
FINLAND 3. 5 04/15/21	800, 000. 000	934, 072. 000	
FINLAND 4. 0 07/04/25	1, 010, 000. 000	1, 334, 533. 200	
FINLAND 4. 375 07/04/19	810, 000. 000	908, 261. 100	
FRANCE BTAN 8. 5 04/25/23	2, 200, 000. 000	3, 306, 622. 000	
FRANCE OAT 0. 25 11/25/26	1, 500, 000. 000	1, 407, 090. 000	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/25	4, 300, 000. 000	4, 262, 547. 000	
FRANCE OAT 0. 5 05/25/26	2, 200, 000. 000	2, 135, 188. 000	
FRANCE OAT 0. 5 11/25/19	500, 000. 000	513, 100. 000	
FRANCE OAT 1. 0 05/25/18	2, 500, 000. 000	2, 548, 175. 000	
FRANCE OAT 1. 0 05/25/19	1, 700, 000. 000	1, 757, 834. 000	
FRANCE OAT 1. 0 11/25/18	1, 200, 000. 000	1, 232, 352. 000	
FRANCE OAT 1. 0 11/25/25	4, 700, 000. 000	4, 807, 630. 000	
FRANCE OAT 1. 25 05/25/36	1, 800, 000. 000	1, 688, 400. 000	
FRANCE OAT 1. 5 05/25/31	3, 700, 000. 000	3, 797, 828. 000	
FRANCE OAT 1. 75 05/25/23	4, 400, 000. 000	4, 812, 852. 000	
FRANCE OAT 1. 75 05/25/66	150, 000. 000	133, 620. 000	
FRANCE OAT 1. 75 11/25/24	6, 460, 000. 000	7, 075, 831. 800	

FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,200,000.000	3,622,432.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	5,268,042.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,300,000.000	4,971,703.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,700,000.000	10,710,352.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,940,000.000	6,968,748.600	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,123,090.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,550,000.000	4,607,261.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,800,000.000	9,026,862.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,323,307.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,940,000.000	8,573,676.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	7,200,000.000	8,397,360.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,347,450.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	3,900,000.000	4,105,764.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,662,400.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	2,874,227.200	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,010,000.000	5,753,788.600	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	6,200,000.000	6,839,344.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	6,900,000.000	7,452,690.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,600,000.000	8,321,346.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,300,000.000	6,639,587.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,100,000.000	6,247,334.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,100,000.000	6,142,415.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,600,000.000	7,475,506.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,205,105.100	

FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4, 200, 000. 000	5, 208, 798. 000	
IRISH 0. 8 03/15/22	800, 000. 000	834, 864. 000	
IRISH 1. 0 05/15/26	1, 000, 000. 000	1, 008, 000. 000	
IRISH 2. 0 02/18/45	1, 210, 000. 000	1, 207, 773. 600	
IRISH 2. 4 05/15/30	1, 100, 000. 000	1, 233, 056. 000	
IRISH 3. 4 03/18/24	1, 030, 000. 000	1, 240, 583. 500	
IRISH 3. 9 03/20/23	800, 000. 000	979, 032. 000	
IRISH 4. 4 06/18/19	1, 130, 000. 000	1, 256, 492. 200	
IRISH 4. 5 04/18/20	1, 450, 000. 000	1, 672, 821. 500	
IRISH 4. 5 10/18/18	740, 000. 000	800, 058. 400	
IRISH 5. 0 10/18/20	1, 400, 000. 000	1, 676, 920. 000	
IRISH 5. 4 03/13/25	1, 600, 000. 000	2, 188, 720. 000	
IRISH 5. 9 10/18/19	950, 000. 000	1, 109, 780. 500	
ITALY BTPS 0. 65 11/01/20	3, 600, 000. 000	3, 612, 240. 000	
ITALY BTPS 0. 95 03/15/23	2, 500, 000. 000	2, 435, 250. 000	
ITALY BTPS 1. 05 12/01/19	2, 000, 000. 000	2, 036, 760. 000	
ITALY BTPS 1. 25 12/01/26	500, 000. 000	459, 925. 000	
ITALY BTPS 1. 35 04/15/22	1, 500, 000. 000	1, 514, 955. 000	
ITALY BTPS 1. 5 06/01/25	2, 500, 000. 000	2, 418, 150. 000	
ITALY BTPS 1. 6 06/01/26	1, 500, 000. 000	1, 433, 400. 000	
ITALY BTPS 1. 65 03/01/32	3, 100, 000. 000	2, 772, 795. 000	
ITALY BTPS 2. 0 12/01/25	2, 700, 000. 000	2, 686, 473. 000	
ITALY BTPS 2. 15 12/15/21	1, 000, 000. 000	1, 052, 300. 000	
ITALY BTPS 2. 25 09/01/36	1, 000, 000. 000	920, 300. 000	
ITALY BTPS 2. 5 12/01/24	4, 000, 000. 000	4, 174, 480. 000	
ITALY BTPS 2. 7 03/01/47	1, 350, 000. 000	1, 210, 815. 000	
ITALY BTPS 2. 8 03/01/67	1, 100, 000. 000	921, 360. 000	
ITALY BTPS 3. 25 09/01/46	2, 300, 000. 000	2, 310, 580. 000	
ITALY BTPS 3. 5 03/01/30	3, 100, 000. 000	3, 424, 632. 000	
ITALY BTPS 3. 5 12/01/18	2, 100, 000. 000	2, 224, 845. 000	

ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,699,102.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,579,680.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	4,500,000.000	5,065,200.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,148,919.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,350,000.000	5,025,120.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	4,921,840.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,207,242.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	5,200,000.000	5,786,040.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	7,017,600.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	4,400,000.000	4,590,960.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	5,030,550.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,583,350.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,365,260.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,287,240.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,645,490.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	6,200,000.000	6,598,040.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,100,000.000	6,101,640.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,558,320.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,230,000.000	3,960,044.600	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,026,544.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	6,200,000.000	7,353,820.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,430,000.000	5,428,743.500	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,500,000.000	4,538,450.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	3,888,000.000	

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

	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,660,000.000	2,838,220.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	3,070,000.000	3,422,436.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,000,000.000	3,070,000.000	
	SPAIN 0.25 01/31/19	1,400,000.000	1,409,842.000	
	SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,734,782.000	
	SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,175,054.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	1,800,000.000	1,752,462.000	
	SPAIN 1.4 01/31/20	400,000.000	415,872.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,546,725.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,200,000.000	3,309,376.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,662,740.000	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,740,088.000	
	SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,124,020.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,400,000.000	3,770,940.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,294,267.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	500,000.000	516,310.000	
	SPAIN 3.75 10/31/18	2,700,000.000	2,881,791.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	3,400,000.000	4,020,806.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,495,680.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	4,300,000.000	4,565,482.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,265,106.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,600,000.000	6,240,136.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,544,119.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	2,500,000.000	2,610,875.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	4,700,000.000	5,227,481.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,600,000.000	4,520,916.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,832,480.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,755,038.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,397,002.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,200,000.000	3,029,400.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	2,928,420.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,800,000.000	2,578,968.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,200,000.000	4,067,488.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	4,200,000.000	5,117,364.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,000,000.000	4,389,450.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,669,252.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,800,000.000	3,858,372.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,322,250.000	
	ユーロ 小計	678,060,000.000 (80,370,451,800)	805,092,545.000 (95,427,619,359)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,923,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,637,214.000	

	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,458,497.600	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	19,660,000.000	18,899,158.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,631,480.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	4,000,000.000	3,908,640.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,009,284.400	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	7,000,000.000	7,050,820.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,176,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,960,611.800	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,243,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	15,646,970.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	2,857,950.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	3,000,000.000	2,856,660.000	
	南アフリカ・ランド 小計	160,740,000.000 (1,395,223,200)	148,260,485.800 (1,286,901,017)	
国債証券 合計		218,822,251,900 (218,822,251,900)	241,910,908,444 (241,910,908,444)	
合計		218,822,251,900 (218,822,251,900)	241,910,908,444 (241,910,908,444)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 124銘柄	44.08%	45.14%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.10%	7.27%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	2.05%	2.10%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	2.15%	2.20%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.40%	0.41%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.55%	0.56%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.21%	0.22%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.56%	0.57%
マレーシア・リンギット	国債証券 16銘柄	0.38%	0.39%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.77%	0.79%
ユーロ	国債証券 250銘柄	38.51%	39.45%
南アフリカ・ランド	国債証券 14銘柄	0.52%	0.53%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型

- (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29年2月28日から平成29年8月27日まで)の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年10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
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴 司

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光 夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型の平成29年2月28日から平成29年8月27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、D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型の平成29年8月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年2月28日から平成29年8月27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。

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

【中間財務諸表】

【D I A M バランス・ファンド＜D C 年金＞ 1 安定型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	313,077,974	330,077,015
親投資信託受益証券	9,420,316,494	10,016,045,356
未収入金	790,000	5,061,000
流動資産合計	9,734,184,468	10,351,183,371
資産合計	9,734,184,468	10,351,183,371
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,934,274	12,444,173
未払受託者報酬	1,557,966	1,597,841
未払委託者報酬	11,944,683	12,250,439
その他未払費用	233,606	239,602
流動負債合計	22,670,529	26,532,055
負債合計	22,670,529	26,532,055
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 6,231,110,374	※ 1 6,512,926,857
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,480,403,565	3,811,724,459
（分配準備積立金）	1,295,752,917	1,212,306,902
元本等合計	9,711,513,939	10,324,651,316
純資産合計	9,711,513,939	10,324,651,316
負債純資産合計	9,734,184,468	10,351,183,371

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期中間計算期間 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第15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
営業収益		
受取利息	221	172
有価証券売買等損益	91,575,859	183,979,862
営業収益合計	91,576,080	183,980,034
営業費用		
支払利息	78,334	126,436
受託者報酬	1,437,042	1,597,841
委託者報酬	11,017,607	12,250,439
その他費用	218,025	239,602
営業費用合計	12,751,008	14,214,318
営業利益又は営業損失（△）	78,825,072	169,765,716
経常利益又は経常損失（△）	78,825,072	169,765,716
中間純利益又は中間純損失（△）	78,825,072	169,765,716
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（△）	6,435,399	7,274,661
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,852,046,882	3,480,403,565
剰余金増加額又は欠損金減少額	308,762,234	406,867,880
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	308,762,234	406,867,880
剰余金減少額又は欠損金増加額	149,238,317	238,038,041
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	149,238,317	238,038,041
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,083,960,472	3,811,724,459

(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29年2月27日、当中間計算期間末日を平成29年8月27日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
1. ※1 期首元本額	5,756,501,296円	6,231,110,374円
期中追加設定元本額	1,177,511,256円	707,472,375円
期中一部解約元本額	702,902,178円	425,655,892円
2. 受益権の総数	6,231,110,374口	6,512,926,857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14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27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14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
1口当たり純資産額	1,5586円	1,5853円
(1万口当たり純資産額)	(15,586円)	(15,853円)

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型

- (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29年2月28日から平成29年8月27日まで)の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年10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
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成29年2月28日から平成29年8月27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、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成29年8月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年2月28日から平成29年8月27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。

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

【D I A Mバランス・ファンド＜D C 年金＞ 2 安定・成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	682,530,012	718,376,330
親投資信託受益証券	20,693,026,226	21,685,867,885
未収入金	2,890,000	5,270,000
流動資産合計	21,378,446,238	22,409,514,215
資産合計	21,378,446,238	22,409,514,215
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,044,480	21,136,706
未払受託者報酬	3,410,980	3,482,071
未払委託者報酬	29,562,168	30,178,329
その他未払費用	511,562	522,228
流動負債合計	43,529,190	55,319,334
負債合計	43,529,190	55,319,334
純資産の部		
元本等		
元本	※1 11,814,239,777	※1 12,051,065,419
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	9,520,677,271	10,303,129,462
（分配準備積立金）	4,543,965,384	4,339,453,418
元本等合計	21,334,917,048	22,354,194,881
純資産合計	21,334,917,048	22,354,194,881
負債純資産合計	21,378,446,238	22,409,514,215

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期中間計算期間 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第15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
営業収益		
受取利息	486	373
有価証券売買等損益	123,631,493	619,707,659
営業収益合計	123,631,979	619,708,032
営業費用		
支払利息	168,322	273,122
受託者報酬	3,145,251	3,482,071
委託者報酬	27,259,200	30,178,329
その他費用	477,333	522,228
営業費用合計	31,050,106	34,455,750
営業利益又は営業損失（△）	92,581,873	585,252,282
経常利益又は経常損失（△）	92,581,873	585,252,282
中間純利益又は中間純損失（△）	92,581,873	585,252,282
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（△）	8,087,611	17,922,501
期首剰余金又は期首欠損金（△）	7,621,616,347	9,520,677,271
剰余金増加額又は欠損金減少額	536,475,032	657,981,807
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	536,475,032	657,981,807
剰余金減少額又は欠損金増加額	252,506,638	442,859,397
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	252,506,638	442,859,397
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金（△）	7,990,079,003	10,303,129,462

(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29年2月27日、当中間計算期間末日を平成29年8月27日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
1. ※1 期首元本額	11,311,377,052円	11,814,239,777円
期中追加設定元本額	1,423,621,400円	786,025,179円
期中一部解約元本額	920,758,675円	549,199,537円
2. 受益権の総数	11,814,239,777口	12,051,065,419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14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27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14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
1口当たり純資産額	1,8059円	1,8550円
(1万口当たり純資産額)	(18,059円)	(18,550円)

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型

- (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29年2月28日から平成29年8月27日まで)の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年10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
業務執行社員 公認会計士

佐々木 貴子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

鶴田 光夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成29年2月28日から平成29年8月27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、D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の平成29年8月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年2月28日から平成29年8月27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。

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

【D I A Mバランス・ファンド＜D C 年金＞ 3 成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	544,167,446	571,439,502
親投資信託受益証券	15,968,245,361	16,820,639,832
未収入金	—	7,399,000
流動資産合計	16,512,412,807	17,399,478,334
資産合計	16,512,412,807	17,399,478,334
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,801,216	31,444,086
未払受託者報酬	2,621,230	2,702,724
未払委託者報酬	25,339,003	26,126,775
その他未払費用	393,103	405,329
流動負債合計	47,154,552	60,678,914
負債合計	47,154,552	60,678,914
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 8,020,226,146	※ 1 8,149,648,413
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	8,445,032,109	9,189,151,007
(分配準備積立金)	3,746,046,132	3,536,717,437
元本等合計	16,465,258,255	17,338,799,420
純資産合計	16,465,258,255	17,338,799,420
負債純資産合計	16,512,412,807	17,399,478,334

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期中間計算期間 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第15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
営業収益		
受取利息	375	296
有価証券売買等損益	20,432,624	631,428,471
営業収益合計	20,432,999	631,428,767
営業費用		
支払利息	130,875	214,260
受託者報酬	2,413,858	2,702,724
委託者報酬	23,334,373	26,126,775
その他費用	366,351	405,329
営業費用合計	26,245,457	29,449,088
営業利益又は営業損失（△）	△5,812,458	601,979,679
経常利益又は経常損失（△）	△5,812,458	601,979,679
中間純利益又は中間純損失（△）	△5,812,458	601,979,679
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（△）	5,057,217	23,844,590
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,657,808,213	8,445,032,109
剰余金増加額又は欠損金減少額	482,395,660	656,331,375
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	482,395,660	656,331,375
剰余金減少額又は欠損金増加額	259,076,939	490,347,566
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	259,076,939	490,347,566
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,870,257,259	9,189,151,007

(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29年2月27日、当中間計算期間末日を平成29年8月27日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
1. ※1 期首元本額	7,866,965,749円	8,020,226,146円
期中追加設定元本額	1,086,201,353円	594,634,456円
期中一部解約元本額	932,940,956円	465,212,189円
2. 受益権の総数	8,020,226,146口	8,149,648,413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14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27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14期 平成29年2月27日現在	第15期中間計算期間末 平成29年8月27日現在
1口当たり純資産額	2,0530円	2,1276円
(1万口当たり純資産額)	(20,530円)	(21,276円)

(参考)

「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型」、「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型」、「D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型」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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,770,713,779	3,891,910,670
株式	※2	280,719,581,820	283,916,074,540
派生商品評価勘定		746,900	202,084
未収配当金		549,786,376	327,136,998
前払金		—	58,130,000
流動資産合計		287,040,828,875	288,193,454,292
資産合計		287,040,828,875	288,193,454,292
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		39,445,944	44,585,028
前受金		2,090,100	—
未払解約金		1,869,829,000	190,477,000
流動負債合計		1,911,365,044	235,062,028
負債合計		1,911,365,044	235,062,028
純資産の部			
元本等			
元本	※1	125,576,804,116	120,510,549,029
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		159,552,659,715	167,447,843,235
元本等合計		285,129,463,831	287,958,392,264
純資産合計		285,129,463,831	287,958,392,264
負債純資産合計		287,040,828,875	288,193,454,292

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29年8月27日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	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	10,595,983,482円
同期中一部解約元本額	49,220,412,351円	15,662,238,569円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	6,296,121,588円	7,318,414,991円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,669,207,881円	1,881,378,764円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	5,012,187円	5,105,639円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	12,048,308円	11,833,220円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	23,525,414円	21,654,397円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	14,468,349円	10,612,586円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,463,058円	11,513,615円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,708,962円	13,981,629円
たわらノーロード T O P I X	－円	64,701,195円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	－円	4,377,204円

D I A M国内株式インデックス ファンド<DC年金>	36,554,930,032円	36,097,588,066円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1 安定型	816,514,087円	811,840,275円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>2 安定・成長型	2,899,738,685円	2,783,311,057円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>3 成長型	2,949,143,393円	2,885,043,983円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	382,332,675円	362,503,654円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	1,242,482,131円	1,198,095,555円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	1,100,776,018円	1,089,299,616円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	59,530,357円	52,032,182円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,318,320,660円	1,203,650,272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	24,674,329円
D I A M DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	35,217,725円	39,132,609円
D I A M DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	68,814,338円	89,571,554円
D I A M DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	140,148,670円	167,232,531円
投資のソムリエ	1,146,020,551円	2,870,667,157円
クルーズコントロール	1,099,018,981円	932,475,508円
投資のソムリエ<DC年金>	36,165,399円	147,051,071円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	114,712,450円	142,781,803円
D I A M DC バランス・F (成長型)	122,053,447円	164,239,120円
クルーズコントロール<DC年 金>	405,651円	331,014円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	10,061,702円	6,689,004円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	32,908,087円	24,035,454円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	13,983,088円	45,724,517円
ダイナミック・ナビゲーション	1,427,701円	1,473,296円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	75,809,247円	527,728,392円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	—円	407,248円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	—円	407,248円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	—円	206,766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）	313,751,716円	－円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	86,560,257円	80,669,348円
D I A Mグローバル・バランス ファンド 2 5 V A（適格機関投資家限定）	209,554,515円	164,059,642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	346,705,350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	21,693,887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	100,649,990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	25,914,260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	28,550,987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	50,194,251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	70,558,014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	1,299,071,713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	1,197,656,036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	3,240,153,266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	243,070,736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	194,131,284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	716,479,112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	2,806,063,448円
D I A Mグローバル β 私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	13,741,300円	30,638,371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	361, 255, 092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	3, 040, 779, 392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	17, 391, 056, 741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	624, 586, 881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, 985, 075, 031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	11, 153, 438, 379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	5, 294, 136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	1, 959, 932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	4, 529, 795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	9, 952, 669, 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)	94, 419, 937円	80, 157, 541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	31, 500, 167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	32, 188, 847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	71, 462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	117, 139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	556, 068, 690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, 542, 113, 531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	2, 030, 985, 091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	88, 675, 028円
計	125, 576, 804, 116円	120, 510, 549, 029円

2. 受益権の総数	125, 576, 804, 116口	120, 510, 549, 029口
3. ※2 差入代用有価証券	株式 3, 203, 000, 000円	株式 3, 079, 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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

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29年2月27日 現在				平成29年8月27日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	4,740,289,900	—	4,701,690,000	△38,599,900	4,132,620,000	—	4,088,320,000	△44,300,000
合計	4,740,289,900	—	4,701,690,000	△38,599,900	4,132,620,000	—	4,088,320,000	△44,300,000

(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ではありません。

(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29年8月27日現在
1口当たり純資産額	2.2706円	2.3895円
(1万口当たり純資産額)	(22,706円)	(23,895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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,480,771,002	1,951,143,194
国債証券		317,647,724,400	304,684,376,100
地方債証券		23,951,302,530	23,758,030,820
特殊債券		18,324,582,251	17,041,336,842
社債券		16,594,570,860	17,796,526,640
未収利息		1,174,107,807	1,094,512,156
前払費用		14,204,595	14,566,047
流動資産合計		381,187,263,445	366,340,491,799
資産合計		381,187,263,445	366,340,491,799
負債の部			
流動負債			
未払解約金		3,333,561,000	294,566,000
流動負債合計		3,333,561,000	294,566,000
負債合計		3,333,561,000	294,566,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	295,190,206,036	284,892,072,573
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		82,663,496,409	81,153,853,226
元本等合計		377,853,702,445	366,045,925,799
純資産合計		377,853,702,445	366,045,925,799
負債純資産合計		381,187,263,445	366,340,491,799

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29年8月27日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	311,246,557,550円	295,190,206,036円
同期中追加設定元本額	65,544,715,948円	32,539,413,506円
同期中一部解約元本額	81,601,067,462円	42,837,546,969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	13,320,166,360円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	141,332,941円	151,413,140円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	123,053,964円	126,987,244円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	42,096,310円	40,781,612円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	408,295,789円	315,111,047円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	117,006,883円	123,518,549円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	26,386,628円	26,333,446円
たわらノーロード 国内債券	1,032,184,471円	1,996,878,792円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円	755,274円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	－円	7,837,211円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,135,343,680円	12,374,758,839円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	4,912,270,839円	5,249,119,142円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	6,923,494,244円	7,535,754,579円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,718,978,952円	2,998,131,365円
D I A M DC バランス 3 0 インデックスファンド	1,657,494,852円	1,769,494,975円

D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1, 744, 690, 480円	1, 913, 448, 356円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	247, 785, 929円	287, 761, 432円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	98, 517, 017円	98, 646, 275円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2, 182, 976, 967円	2, 298, 817, 764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	3, 002, 910円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド (新興国 1 0)	356, 002, 601円	417, 117, 995円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド (新興国 2 0)	254, 997, 478円	345, 536, 973円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド (新興国 3 0)	63, 187, 247円	78, 704, 205円
投資のソムリエ	7, 588, 674, 489円	5, 341, 905, 147円
クルーズコントロール	2, 463, 848, 090円	2, 226, 559, 271円
投資のソムリエ<D C 年金>	240, 441, 643円	273, 333, 345円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN<D C 年金>	1, 159, 116, 457円	1, 549, 569, 213円
D I A M D C バランス・F (成長型)	121, 311, 364円	169, 417, 643円
クルーズコントロール<D C 年 金>	909, 502円	790, 247円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	6, 058, 111円	4, 246, 102円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	19, 630, 847円	15, 326, 866円
投資のソムリエ<D C 年金>リ スク抑制型	145, 993, 757円	339, 509, 470円
ダイナミック・ナビゲーション	460, 972円	496, 061円
リスク抑制世界 8 資産バラン スファンド	797, 399, 737円	3, 931, 353, 295円
投資のソムリエ (ターゲット・ イヤー 2 0 4 5)	— 円	622, 340円
投資のソムリエ (ターゲット・ イヤー 2 0 5 5)	— 円	622, 340円
リスク抑制世界 8 資産バラン スファンド (D C)	— 円	1, 560, 428円
みずほエマージングボンドオー プン	10, 801, 911円	10, 801, 911円
D I A M 高金利通貨ファンド	9, 608, 918円	9, 608, 918円
D I A M エマージング債券ファ ンド	9, 450, 010円	9, 450, 010円
D I A M 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	25, 691, 277, 038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 2 5 V A (適格機関投資家限定)	511,856,892円	502,180,629円
D I A Mグローバル・バランス ファンド 2 5 V A (適格機関投 資家限定)	452,644,236円	372,973,093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	262,394,021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	95,894,422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	285,949,720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	122,721,734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	72,110,371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	142,584,207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	200,462,834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	6,562,395,810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	3,402,320,293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	6,137,042,044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	690,558,750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	923,078,352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	4,076,060,442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	5,314,858,318円
D I A Mグローバル β 私募ファ ンド (適格機関投資家向け)	273,887,149円	580,487,825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	2,044,099,350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	4,537,388,454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	87,858,813,643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	1,183,019,519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	7,522,539,513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	28,169,215,103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	80,366,300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	9,283,086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	8,579,616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	31,426,320,310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	500,056,936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	139,232,149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	611,719,425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	471,274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	367,900円
	計	295,190,206,036円	284,892,072,573円
2.	受益権の総数	295,190,206,036口	284,892,072,573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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1口当たり純資産額	1,2800円	1,2849円
(1万口当たり純資産額)	(12,800円)	(12,849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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,507,142,684	6,360,564,486
コール・ローン		681,046,972	310,277,566
株式		263,147,490,307	262,967,520,240
投資信託受益証券		825,923,149	816,240,091
投資証券		6,315,863,305	6,294,754,541
派生商品評価勘定		90,791,280	7,832,750
未収入金		2,417,530	1,146,369
未収配当金		565,567,832	570,252,709
差入委託証拠金		1,456,599,809	1,520,101,370
流動資産合計		274,592,842,868	278,848,690,122
資産合計		274,592,842,868	278,848,690,122
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,503,362	77,441,706
未払解約金		658,103,000	287,106,000
流動負債合計		659,606,362	364,547,706
負債合計		659,606,362	364,547,706
純資産の部			
元本等			
元本	※ 1	91,611,980,480	89,009,367,050
剰余金			
剰余金又は欠損金 (△)		182,321,256,026	189,474,775,366
元本等合計		273,933,236,506	278,484,142,416
純資産合計		273,933,236,506	278,484,142,416
負債純資産合計		274,592,842,868	278,848,690,122

(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。 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。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1.	※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	101,062,929,782円	91,611,980,480円
	同期中追加設定元本額	17,462,001,997円	10,517,000,400円
	同期中一部解約元本額	26,912,951,299円	13,119,613,830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	1,957,218,700円	1,440,383,377円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,597,665円	3,913,381円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	12,813,496円	9,172,326円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	27,139,952円	24,908,017円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	13,284,546円	8,138,731円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	12,182,802円	8,923,833円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	16,970,640円	16,079,849円
	たわらノーロード 先進国株式	2,401,466,878円	4,052,738,348円
	たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	425,695円	425,349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	293,529,792円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	－円	3,341,651円
	D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	35,537,387,647円	36,097,322,263円
	D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1 安定型	169,317,804円	162,258,292円
	D I A Mバランス・ファンド< DC年金>2 安定・成長型	929,041,840円	857,172,909円
	D I A Mバランス・ファンド< DC年金>3 成長型	1,088,784,171円	1,048,118,299円
	D I A M DC バランス30 インデックスファンド	151,198,377円	138,531,931円
	D I A M DC バランス50 インデックスファンド	421,382,473円	397,281,370円
	D I A M DC バランス70 インデックスファンド	340,601,324円	331,073,744円
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	42,243,439円	36,336,313円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型>	932,693,027円	840,375,455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	191,635,544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	30,193,013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	68,768,146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	129,010,466円
投資のソムリエ	1,447,959,597円	3,321,555,870円
クルーズコントロール	423,103,664円	352,843,690円
投資のソムリエ＜DC年金＞	44,003,627円	170,098,291円
D I A M 8資産バランスファ ンドN＜DC年金＞	88,624,580円	109,137,965円
D I A M D C バランス・F （成長型）	44,097,862円	59,757,734円
クルーズコントロール＜DC年 金＞	156,043円	125,280円
D I A Mコア資産設計ファンド （堅実型）	2,581,654円	1,682,236円
D I A Mコア資産設計ファンド （積極型）	8,454,381円	6,079,540円
投資のソムリエ＜DC年金＞リ スク抑制型	19,173,147円	17,582,668円
ダイナミック・ナビゲーション	1,575,046円	1,627,656円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	104,007,220円	203,701,311円
ワールドアセットバランス（基 本コース）	111,316,911円	294,415,818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	705,648,689円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2045）	－円	343,592円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2055）	－円	343,592円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド（DC）	－円	79,152円
D I A M外国株式インデックス ファンドV A（適格機関投資家 専用）	163,368,838円	116,218,831円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド（適格機関投資家向 け）	3,207,285,574円	2,969,637,715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）	180,603,347円	－円
D I A M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	161,337,127円
外国株式パッシブ・ファンド2 （適格機関投資家限定）	－円	128,676,298円

D I A Mワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	28,887,946円	26,369,745円
D I A Mグローバル・バランス ファンド 2 5 V A (適格機関投 資家限定)	161,611,237円	125,291,159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)	298,410,591円	264,679,331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)	20,377,575円	16,568,661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)	135,252,737円	115,289,415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)	11,414,013円	9,887,115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)	15,373,489円	14,527,291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)	632,259,643円	38,327,644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)	427,409,243円	80,818,505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)	743,979,293円	661,010,320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)	870,032,675円	799,426,055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)	2,693,426,272円	2,473,599,845円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランス V A (適格機関投 資家限定)	1,053,591,911円	923,252,086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)	980,540,194円	444,076,458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)	1,217,509,769円	1,095,194,344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)	799,238,075円	705,291,435円
D I A Mグローバル β 私募ファ ンド (適格機関投資家向け)	3,672,039円	8,007,475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)	3,561,322,538円	1,233,413,814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, 507, 107, 240円	927, 870, 217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)	9, 475, 846, 807円	8, 852, 088, 361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)	519, 886, 797円	476, 975, 947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, 623, 806, 982円	1, 515, 919, 128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, 677, 224, 452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	20, 252, 172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	5, 992, 989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	12, 700, 892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	7, 600, 400, 055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	73, 955, 042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	163, 475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	268, 168円
	計	91, 611, 980, 480円	89, 009, 367, 050円
2.	受益権の総数	91, 611, 980, 480口	89, 009, 367, 050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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

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29年2月27日 現在				平成29年8月27日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	2,719,286,282	—	2,719,140,100	△146,182	—	—	—	—
アメリカ・ドル	1,783,590,450	—	1,783,503,000	△87,450	—	—	—	—
イギリス・ポンド	213,067,188	—	213,052,500	△14,688	—	—	—	—
オーストラリア・ドル	115,296,548	—	115,280,200	△16,348	—	—	—	—
カナダ・ドル	109,487,616	—	109,478,400	△9,216	—	—	—	—
ユーロ	497,844,480	—	497,826,000	△18,480	—	—	—	—
合計	2,719,286,282	—	2,719,140,100	△146,182	—	—	—	—

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - ① 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。
 - ② 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29年2月27日 現在				平成29年8月27日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	6,123,241,477	—	6,212,675,577	89,434,100	8,371,631,606	—	8,302,022,650	△69,608,956
合計	6,123,241,477	—	6,212,675,577	89,434,100	8,371,631,606	—	8,302,022,650	△69,608,956

(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。

(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29年8月27日現在
1口当たり純資産額	2.9901円	3.1287円
(1万口当たり純資産額)	(29,901円)	(31,287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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,516,479,320	2,111,529,078
コール・ローン		1,346,029,738	359,767,881
国債証券		241,910,908,444	235,278,927,579
派生商品評価勘定		—	472
未収入金		—	1,055,671,262
未収利息		2,166,219,241	1,976,931,322
前払費用		28,959,700	28,053,297
流動資産合計		247,968,596,443	240,810,880,891
資産合計		247,968,596,443	240,810,880,891
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,975,641	584,364
未払解約金		191,711,000	322,407,000
流動負債合計		198,686,641	322,991,364
負債合計		198,686,641	322,991,364
純資産の部			
元本等			
元本	※ 1	143,480,057,319	133,201,780,773
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		104,289,852,483	107,286,108,754
元本等合計		247,769,909,802	240,487,889,527
純資産合計		247,769,909,802	240,487,889,527
負債純資産合計		247,968,596,443	240,810,880,891

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	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	10,694,042,852円
同期中一部解約元本額	36,208,199,551円	20,972,319,398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	5,128,943,378円	6,524,050,795円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	13,691,042円	19,390,569円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	44,704,339円	51,264,285円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	62,814,032円	60,485,398円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	39,527,953円	40,359,577円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	42,616,554円	49,882,670円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	39,345,731円	39,062,793円
たわらノーロード 先進国債券	526,660,107円	897,942,560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	5,817,971円
D I AM外国債券インデックス ファンド<DC年金>	4,778,857,729円	4,884,847,798円
D I AMバランス・ファンド< DC年金>1安定型	447,249,853円	456,354,446円
D I AMバランス・ファンド< DC年金>2安定・成長型	1,429,659,466円	1,479,239,048円
D I AMバランス・ファンド< DC年金>3成長型	1,468,558,554円	1,548,288,758円
D I AM DC バランス30 インデックスファンド	361,249,152円	362,589,665円
D I AM DC バランス50 インデックスファンド	744,657,416円	756,493,662円
D I AM DC バランス70 インデックスファンド	555,306,358円	581,815,327円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	25,651,436円	26,186,839円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	563,298,507円	606,892,142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	9,272,496円
D I AM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	13,825,526円	15,591,816円
D I AM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	23,935,984円	31,628,971円
D I AM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	46,434,072円	55,878,622円
クルーズコントロール	1,781,261,902円	1,557,096,528円
D I AM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	44,703,644円	57,373,741円
D I AM DC バランス・F (成長型)	64,833,181円	87,500,709円
クルーズコントロール<DC年 金>	656,988円	552,847円
D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	8,685,786円	5,999,580円
D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	28,434,647円	21,382,317円
ダイナミック・ナビゲーション	336,463円	357,654円
D I AMパッシブ資産分散ファ ンド	1,570,963,668円	1,514,085,877円
D I AM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	7,162,811,142円
D I AM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	4,989,137,990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	4,108,580,021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）	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
D I A Mワールドバランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	114,026,758円	108,488,670円
D I A Mグローバル・バランス ファンド 2 5 V A（適格機関投 資家限定）	1,328,163,674円	1,060,187,461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）	815,717,319円	746,124,563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	68,110,463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	135,371,862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	34,852,982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	12,791,979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	101,276,172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	94,883,090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	4,076,034,841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	2,613,995,086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	4,357,003,266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	815,508,513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	918,435,093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	3,858,283,064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	13,841,645,959円

	D I A M グローバル β 私募ファンド（適格機関投資家向け）	19,119,506円	41,678,787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	727,471,761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	7,276,811,914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	15,593,670,209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	20,006,928,540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	21,388,392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	6,595,618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	6,095,418円
	D I A M 世界アセットバランスファンド 4 V A（適格機関投資家限定）	18,350,730,818円	17,854,444,739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	107,830,985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	130,272,155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	238,594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	156,579円
	計	143,480,057,319円	133,201,780,773円
2.	受益権の総数	143,480,057,319口	133,201,780,773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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

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29年2月27日 現在				平成29年8月27日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1 年超			(円)	うち 1 年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	—	—	—	—	171,944,908	—	172,528,800	△583,892
アメリカ・ドル	—	—	—	—	51,816,632	—	51,816,160	472
ユーロ	—	—	—	—	120,128,276	—	120,712,640	△584,364
買 建	1,647,316,001	—	1,640,340,360	△6,975,641	—	—	—	—
アメリカ・ドル	741,545,528	—	738,975,960	△2,569,568	—	—	—	—
イギリス・ポンド	164,494,992	—	162,922,500	△1,572,492	—	—	—	—
ユーロ	741,275,481	—	738,441,900	△2,833,581	—	—	—	—
合計	1,647,316,001	—	1,640,340,360	△6,975,641	171,944,908	—	172,528,800	△583,892

(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。
 - ①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。
 - ②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29年2月27日現在	平成29年8月27日現在
1 口当たり純資産額	1.7269円	1.8054円
(1万口当たり純資産額)	(17,269円)	(18,054円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

平成29年8月31日現在

I 資産総額	10,435,171,322円
II 負債総額	9,204,487円
III 純資産総額 (I - II)	10,425,966,835円
IV 発行済数量	6,549,250,303口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.5919円

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

平成29年8月31日現在

I 資産総額	22,642,835,279円
II 負債総額	7,440,868円
III 純資産総額 (I - II)	22,635,394,411円
IV 発行済数量	12,121,511,034口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.8674円

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

平成29年8月31日現在

I 資産総額	17,607,812,663円
II 負債総額	13,704,949円
III 純資産総額 (I - II)	17,594,107,714円
IV 発行済数量	8,195,334,699口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.1468円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

平成29年8月31日現在

I 資産総額	292,761,021,728円
II 負債総額	518,934,574円
III 純資産総額 (I - II)	292,242,087,154円
IV 発行済数量	120,725,068,215口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.4207円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年8月31日現在

I 資産総額	369,682,318,335円
II 負債総額	5,301,763,000円
III 純資産総額 (I - II)	364,380,555,335円
IV 発行済数量	283,439,985,240口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2856円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年8月31日現在

I 資産総額	282, 297, 381, 508円
II 負債総額	203, 395, 058円
III 純資産総額 (I - II)	282, 093, 986, 450円
IV 発行済数量	89, 257, 706, 241口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	3. 1604円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年8月31日現在

I 資産総額	243, 232, 589, 401円
II 負債総額	676, 125, 217円
III 純資産総額 (I - II)	242, 556, 464, 184円
IV 発行済数量	132, 796, 561, 304口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1. 8265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。

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成29年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（平成29年8月31日現在）

① 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。

② 投資運用の意思決定機構

1. 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。

2. 運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年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	1,166,008,899,767
追加型株式投資信託	862	11,851,677,827,117
単位型公社債投資信託	56	302,981,528,001
単位型株式投資信託	126	845,554,642,102
合計	1,082	14,166,222,896,987

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32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29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。

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

委託会社の財務諸表に引き続き、DIAMアセットマネジメント株式会社の第32期中間会計期間の中間財務諸表、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月7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 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

山野 浩 

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28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、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29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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	—	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	※1 29,219	※1 1,243,812
車両運搬具	※1 549	※1 —
器具備品	※1 184,683	※1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	—	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	—	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	—	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	—
時効後支払損引当金	—	216,466
本社移転費用引当金	—	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	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
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	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	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	—		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		—	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		—		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		—		2
雑収入	※1	6,693	※1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		—		31,945
投資信託償還損		—		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
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		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	※2	—	※2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		—
貸倒引当金戻入益		—		8,883
訴訟損失引当金戻入益		—		21,677
その他特別利益		—		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	※3	624	※3	23,600
固定資産売却損	※4	2,653	※4	10,323
投資有価証券評価損		—		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		—		30,000
本社移転費用	※5	—	※5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		△177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
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									5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	2,550,000	－	－	32,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	－	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	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	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
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	5,126,556	5,126,556			5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)			△98,949	△98,949	△98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	△98,949	△98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 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。 (2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
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	(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。 (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。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 ①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。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。 (5) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 (6) 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。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。
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。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。 2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

※1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
雑収入	4,715	8,183

※2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

※3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	—	16,052

※4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
建物	—	543
器具備品	2,653	9,779

※5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	—	942,315
旧本社不動産賃借料	—	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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額 (千円)	1株当たり配 当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当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28年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

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
平成29年6月21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					

（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、株価指数先物取引及び債券先物取引）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

①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。

②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。

③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31期（平成28年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,951,736	12,951,736	—
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	—
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	—
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	—
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	381,005	381,005	—
資産計	32,747,840	32,747,840	—
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	—
負債計	1,744,274	1,744,274	—

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	—

(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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
①非上場株式	77, 696	337, 468
②関係会社株式	3, 229, 196	3, 306, 296

①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 その他有価証券」には含めておりません。

②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31期 (平成28年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	12, 951, 736	—	—	—
(2) 金銭の信託	13, 094, 914	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	4, 460, 404	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	1, 859, 778	—	—	—
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	—	—	—	—

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 其他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

（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31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円）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31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
①株式	365,683	146,101	219,581
②投資信託	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
①株式	—	—	—
②投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
合計	381,005	159,101	221,903

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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			
①株式	609,710	146,101	463,608
②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			
①株式	—	—	—
②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。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	5,927	3,377	—

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。

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確定給付企業年金制度（積立型制度であります）及び退職一時金制度（非積立型制度であります）を採用しております。また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度（複数事業主制度を含む）

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	△ 51,531	△144,062
過去勤務費用の発生額	—	—
合併による増加	—	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	—	—
期待運用収益	—	16,033
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
退職給付の支払額	—	△28,876
合併による増加	—	1,336,984
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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29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	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	△79,449	△430,203
未認識過去勤務費用	△9,704	△4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
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	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	—	△16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(5) 年金資産に関する事項

①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。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29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%

②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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02%～1.09%
長期期待運用収益率	—	2.50%
予想昇給率	1.00%～8.73%	1.00%～8.73%

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31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	—	—
退職給付費用	—	22,562
退職給付の支払額	—	—
制度への拠出額	—	△36,177
合併による増加	—	△287,313
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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29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 一千円 当事業年度22,562千円

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44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

(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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	—
時効後支払損引当金	—	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	—	12,344
本社移転費用引当金	—	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	—
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	—	—
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
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	—	△114,171
繰延税金負債合計	—	△324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

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

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③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28年10月1日から平成29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 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	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	－千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん 74,319,216千円及び顧客関連資産 50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	一千円
営業利益	△4,483,082千円
経常利益	△4,483,082千円
税引前当期純利益	△4,483,082千円
当期純利益	△3,693,863千円
1株当たり当期純利益	△115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千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31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29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

①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。

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他 の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名,出向3名,転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2) 子会社及び関連会社等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払 増資の引受	800,617 912,600	未払費用 —	308,974 —
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	473,948	未払費用	157,130

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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3) 兄弟会社等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	—	兼務 1名	当社預り資 産の助言 金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払費 用 未払金	292,861 7,581
	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	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

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

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) 当社預り資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、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) 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5) 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6) 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せん。

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

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	—	7,449,532
固定資産合計	—	124,292
流動負債合計	—	1,665,547
固定負債合計	—	114,110
純資産合計	—	5,794,167
営業収益	—	1,093,658
税引前当期純利益	—	5,546,153
当期純利益	—	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
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	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(—)	(7,734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。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(参考) D I A Mアセットマネジメント株式会社の経理状況

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

湯原 尚 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

山野 浩 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：D I A Mアセットマネジメント株式会社）の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,080,224
未払金	2,651,649
未払償還金	49,873
未払手数料	1,865,871
その他未払金	735,905
未払費用	2,673,720
未払法人税等	907,554
未払消費税等	69,484
賞与引当金	724,711
訴訟損失引当金	30,000
その他	21,000
流動負債計	8,158,344
固定負債	
退職給付引当金	1,027,049
固定負債計	1,027,049
負債合計	9,185,394
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	27,317,845
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	24,580,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,114,551
株主資本計	31,746,323
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	142,035
評価・換算差額等計	142,035
純資産合計	31,888,358
負債・純資産合計	41,073,753

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産：定率法 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2) 無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4) 訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
①非上場株式	77,696
②関係会社株式	3,229,196
③差入保証金	1,808,323

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

③差入保証金は、本社オフィスの不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。 2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式(中間貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。 3. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
①株式	349,644	146,101	203,542
②債券	—	—	—
③その他(投資信託)	14,179	13,000	1,179
小計	363,823	159,101	204,721
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
①株式	—	—	—
②債券	—	—	—
③その他(投資信託)	—	—	—
小計	—	—	—
合計	363,823	159,101	204,721
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額77,696千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

(金銭の信託関係)

第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
1. 満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。 2. その他の金銭の信託(運用目的及び満期保有目的以外) 該当事項はありません。	

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	14,454,974	4,189,745	323,793	18,968,513

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

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

(1株当たり情報)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,328,681円	62銭
1株当たり中間純利益金額	77,562円	67銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
中間純利益	1,861,504千円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式に係る中間純利益	1,861,504千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第32期中間会計期間
(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 交付した株式数

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

6. 企業結合の主な目的

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

7. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

8. 実施予定の会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

(参考) みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

※当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

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

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

江見 睦生



指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井 純子



当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

湯原 尚 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

山野 浩 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

(1) 貸借対照表

(単位： 千円)

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

負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600
資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	4,716,474	4,716,474
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	17,872,927	19,042,177
自己株式	－	△377,863
株主資本合計	24,635,002	25,426,389
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	726,935	137,791
純資産合計	25,361,937	25,564,180
負債純資産合計	29,973,099	29,654,112

(2) 損益計算書

(単位： 千円)

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

有価証券償還損		2, 197	2, 641
ヘッジ会計に係る損失		2, 240	－
時効後支払損引当金繰入額		17, 685	－
雑損失		63, 198	6, 767
営業外費用合計		85, 321	9, 688
経常利益		1, 975, 847	2, 600, 528
特別利益			
投資有価証券売却益		10, 500	－
特別利益合計		10, 500	－
特別損失			
減損損失	※ 1	51, 292	－
事業再構築費用	※ 2	125, 173	－
外国税負担損失	※ 3	53, 547	－
貸倒引当金繰入		19, 534	－
特別損失合計		249, 548	－
税引前当期純利益		1, 736, 799	2, 600, 528
法人税、住民税及び事業税		616, 760	839, 827
法人税等調整額		16, 247	40, 166
法人税等合計		633, 008	879, 993
当期純利益		1, 103, 790	1, 720, 534

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位： 千円）

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位： 千円）

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

(4) 役員退職慰労引当金

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

(5) 時効後支払損引当金

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

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段…株価指数先物取引

ヘッジ対象…有価証券

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジの有効性評価の方法

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

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

1. 概要

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

2. 適用予定日

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

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

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

追加情報

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

(損益計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

※1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

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

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

※2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

※3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当するものではありません。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発効日
平成26年6月11日 第51回定時株主総会	普通株式	352,443,450	335	平成26年3月31日	平成26年6月12日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

- ① リース資産の内容
有形固定資産
主として、事務用機器及び車両運搬具であります。
- ② リース資産の減価償却の方法
重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスクの管理

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

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

②市場リスクの管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

資 産

(1) 現金及び預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (3) 未収運用受託報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

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

(単位:千円)

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

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度 (平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1 その他有価証券

前事業年度 (平成27年3月31日)

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

当事業年度（平成28年3月31日）

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
① 証券投資信託	2,698,875	2,500,000	198,875
小計	2,698,875	2,500,000	198,875
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
① 証券投資信託	583,151	583,423	△ 271
小計	583,151	583,423	△ 271
合計	3,282,026	3,083,423	198,603

- 2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものではありません。

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

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
① 証券投資信託	102,729	953	△ 2,197
合計	102,729	953	△ 2,197

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
① 証券投資信託	738,178	106,977	△ 2,920
合計	738,178	106,977	△ 2,920

(デリバティブ取引関係)

- 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連
前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

前事業年度（平成27年3月31日）

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

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

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

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

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものではありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位： 千円)

第54期中間会計期間 (平成28年 9 月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	4,120,018
未収委託者報酬	2,064,997
未収運用受託報酬	1,959,028
繰延税金資産	140,728
その他	398,383
貸倒引当金	△1,207
流動資産合計	8,681,950
固定資産	
有形固定資産	
工具、器具及び備品（純額）	62,971
有形固定資産合計	※1 62,971
無形固定資産	
	12,767
投資その他の資産	
投資有価証券	815,525
繰延税金資産	73,719
その他	638,830
貸倒引当金	△19,404
投資その他の資産合計	1,508,671
固定資産合計	1,584,410
資産合計	10,266,360
負債の部	
流動負債	
未払金	793,859
未払費用	1,675,771
未払法人税等	253,697
賞与引当金	319,200
その他	221,869
流動負債合計	3,264,398
固定負債	
役員退職慰労引当金	57,860
時効後支払損引当金	7,256
固定負債合計	65,116
負債合計	3,329,515
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,045,600
資本剰余金	
資本準備金	2,266,400
その他資本剰余金	1,103,259
資本剰余金合計	3,369,659
利益剰余金	
利益準備金	128,584
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	1,777,567
利益剰余金合計	1,906,152
自己株式	△377,863
株主資本合計	6,943,548
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△6,703

評価・換算差額等合計	△6,703
純資産合計	6,936,845
負債純資産合計	10,266,360

(2) 中間損益計算書

(単位： 千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位: 千円)

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

(4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

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

(5) 時効後支払損引当金

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

4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第54期中間会計期間 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日)

1 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

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

3 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成28年 9 月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。(注2)を参照ください。)

(単位: 千円)

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

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

資 産

(1) 現金及び預金

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

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

(1) 未払手数料

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

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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	60,720

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)

1 その他有価証券

種類	中間貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
① 証券投資信託	151,830	150,000	1,830
小計	151,830	150,000	1,830
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
① 証券投資信託	602,975	614,467	△11,491
小計	602,975	614,467	△11,491
合計	754,805	764,467	△9,661

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

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

1. 企業結合日

平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

(参考) 新光投信株式会社の経理状況

1. 財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

2. 監査証明について

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

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

小崎 忠信 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

福村 寛 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光投信株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

湯原 尚



指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

山野 浩



当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光投信株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 役員賞与引当金

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

(3) 外国税支払損失引当金

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

(4) 訴訟損失引当金

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

(5) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

①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。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(6) 役員退職慰労引当金

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

(7) 執行役員退職慰労引当金

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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

(未適用の会計基準)

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

(追加情報)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

※ 1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

※ 2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

(損益計算書関係)

※ 1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

※ 2. 特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

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

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

2. 自己株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

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

② 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

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

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

③ 流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注）2. 参照）。

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

（1）現金及び預金

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

（2）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（3）未収委託者報酬

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

（注）2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品 （単位：千円）

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

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	14,861,112	—	—	—
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	—	—	—

(有価証券関係)

1. 関連会社株式

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

2. その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

(5) 年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
①年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%
現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

関連当事者情報

1. 関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

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

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

（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。

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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	7,314,360
有価証券	101,520
未収委託者報酬	3,004,856
未収運用受託報酬	74,687
繰延税金資産	281,201
その他	334,195
流動資産合計	11,110,820
固定資産	
有形固定資産	
器具・備品（純額）	31,241
建設仮勘定	3,819
有形固定資産合計	※1 35,061
無形固定資産	
ソフトウェア	52,424
ソフトウェア仮勘定	20,936
その他	91
無形固定資産合計	73,452
投資その他の資産	
投資有価証券	2,589,863
長期繰延税金資産	22,056
前払年金費用	352,195
その他	29,332
投資その他の資産合計	2,993,448
固定資産合計	3,101,961
資産合計	14,212,782

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

① 関連会社株式

総平均法による原価法

② その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 訴訟損失引当金

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

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

①退職給付見込額の期間帰属方法

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

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

数理計算上の差異については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

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

(中間貸借対照表関係)

※1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

※2. 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

※1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、含まれておりません（（注）２．参照）。

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 未払手数料

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

(注) ２．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	276,151

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1. 関連会社株式

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

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	921,189	730,244	190,944
	小計	921,189	730,244	190,944
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	①国債・地方債等	-	-	-
	②社債	-	-	-
	③その他	-	-	-
	(3)その他	1,494,041	1,656,021	△161,979
	小計	1,494,041	1,656,021	△161,979
合計		2,415,231	2,386,265	28,965

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

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

(追加情報)

役員賞与引当金

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

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

役員退職慰労引当金

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

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

執行役員退職慰労引当金

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

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

繰延税金資産

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

（重要な後発事象）

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

1. 企業結合日

平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (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。

追加型証券投資信託

DIAM バランス・ファンド<DC 年金> 1 安定型

約 款

アセットマネジメント One 株式会社

運用の基本方針

約款第 17 条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。
- 2) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が 40%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が 30%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、当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目指して運用します。

（注）当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 TOPIX（東証株価指数、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）、外国債券についてはシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当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。

- 3) 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行い

ません。

- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用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。）を行うことができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことができます。

（３）投資制限

- 1) 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) 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。
- 3) 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) 同一銘柄の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、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 5) 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。
- 6) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第 22 条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第 23 条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、約款第 24 条の範囲で行います。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、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

委託者が基準価額水準、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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
DIAM バランス・ファンド＜DC年金＞1 安定型
約款

＜信託の種類、委託者および受託者＞

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメント One 株式会社を委託者としみずは信託銀行株式会社を受託者とします。

- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

＜信託事務の委託＞

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

＜信託の目的、金額および限度額＞

第 3 条 委託者は、金 100 万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金 1 兆円を限度として信託金を追加することができますものとしします。
- 3) 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 4) 委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

＜信託期間＞

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 49 条第 7 項、第 51 条第 1 項、第 52 条第 1 項、第 53 条第 1 項および第 55 条第 2 項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

＜受益権の分割および再分割＞

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権について 100 万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- 2) 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関す

る法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

第 6 条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第 7 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 5 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- 2) この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 27 条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- 3) 第 30 条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第 10 条 この信託の受益権は、平成 19 年 1 月 4 日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権

の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及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、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、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。）。

- 2) 委託者は、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つて、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、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、委託者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なわないものとします。

- 3) 委託者は、第5条第1項の規定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なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があつた場合、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ないます。
- 4) 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第 11 条 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係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜受益権の申込み単位、価額および手数料＞

第 12 条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1 口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- 2) 第 1 項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第 3 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- 3) 第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- 4) 前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については 1 口につき 1 円とします。）に乗じて得た額とします。
- 5) 前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第 46 条第 2 項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第 40 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 6) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）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、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜受益権の譲渡に係る記載または記録＞

第 13 条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

2) 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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なわれるよう通知するものとします。

3) 委託者は、第 1 項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

＜受益権の譲渡の対抗要件＞

第 14 条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

＜投資の対象とする資産の種類＞

第 15 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、約款第 22 条、第 23 条および第 24 条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第 16 条 委託者は、信託金を主として第 1 号から第 4 号までのアセットマネジメント One 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第 5 号以降の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号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、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- 2) 委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 3) 第1項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、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- 4) 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式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40を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、

有価証券の値上がり等により 100 分の 40 を超えることとなった場合には、これを調整します。

- 5) 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託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。
- 6) 委託者は、取得時において信託財産に属する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新株引受権証券および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 15 を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 前 3 項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株式、当該投資信託証券、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。

<運用の基本方針>

第 17 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

- 第 18 条 委託者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、証券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、証券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。
- 2) 前項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者が投資することを指図することができるものとします。

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

- 第 19 条 委託者は、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。
- 2) 前項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。

＜同一銘柄の転換社債等への投資制限＞

第 20 条 委託者は、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。

- 2) 前項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時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜信用取引の指図範囲＞

第 21 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けことの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

＜先物取引等の運用指図・目的・範囲＞

第 22 条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマ

ザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプ

レミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、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。

- 2) 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、原則として第4条に定める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。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 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。
- 6) 委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、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。

- 2) 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、原則として第4条に定める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。

- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- 6) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 7) 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。

- 8) 委託者は、金利先渡し取引および為替先渡し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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

＜デリバティブ取引等にかかる投資制限＞

第 24 条の 2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

＜有価証券の貸付けの指図および範囲＞

第 25 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 3) 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

＜公社債の空売りの指図範囲＞

第 26 条 委託者は、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。

- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

＜公社債の借入れ＞

第 27 条 委託者は、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

認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2) 前項の指図は、当該借入に係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入に係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 4) 第1項の借入に係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産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30を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の30を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

- 2) 前項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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第29条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約の指図>

第30条 委託者は、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。

- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、

マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 4) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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。

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- 2) 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- 3) 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- 4) 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法による

ほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第 35 条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第 36 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

- 第 37 条 委託者は、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。
- 2) 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、資金借入れ額は借入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。
 - 3) 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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 - 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第 38 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第 39 条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当が

ある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- 2) 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- 3) 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、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。ただし、第1計算期間は平成14年12月13日から平成16年2月25日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

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

<信託財産に関する報告>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 2) 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

<信託事務の諸費用>

第42条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき当該消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで …年10,000分の31

2. 平成 17 年 10 月 1 日から信託終了の日まで …年 10,000 分の 26
- 2) 前項の信託報酬は、毎年 8 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとしします。
- 3) 第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第 44 条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の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利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、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。
- 2) 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、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

- 第 45 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 47 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 47 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。
- 2) 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

第 46 条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- 2) 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、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委託者の指定する証券会社または登録金融機関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、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- 3) 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしします。
- 4) 前項および第 47 条第 4 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとしします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとしします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第 47 条 償還金は、信託終了後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関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します。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- 2) 一部解約金は、第 49 条第 1 項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 6 営業日目から当該受益者に支払います。
- 3) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。
- 4) 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第 48 条 受益者が、信託終了による償還金について第 47 条第 1 項に規定する支払い開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

第 49 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- 2) 平成 19 年 1 月 4 日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- 3) 委託者は、第 1 項の一部解約の実行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。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。
- 4) 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- 5) 委託者は、証券取引所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、第 1 項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- 6) 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受

益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。

- 7) 委託者は、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、受託者と合意の上、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、第51条の規定を準用するものとします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

第51条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- 2) 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全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。
- 3) 前項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者に対して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。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約を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、これらの事項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、全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。
- 6) 第3項から前項までの規定は、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、第3項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。

＜信託契約に関する監督官庁の命令＞

第 52 条 委託者は、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。

- 2) 委託者は、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、第 56 条の規定に従います。

＜委託者の登録取消等に伴う取扱い＞

第 53 条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- 2) 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者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、この信託は、第 56 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

＜委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い＞

第 54 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- 2) 委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

＜受託者の辞任および解任に伴う取扱い＞

第 55 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第 56 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- 2) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜信託約款の変更＞

第 56 条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書

面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全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。

- 3) 前項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者に対して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します。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- 5) 委託者は、当該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、これらの事項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、全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。

<反対者の買取請求権>

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公 告>

第58条 委託者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、次のアドレスに掲載します。

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

- 2) 前項の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ます。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第59条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- 2) 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第60条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

＜附 則＞

- 第 1 条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。
- 第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。
- 第 3 条 第 24 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- 第 4 条 第 24 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日

(信託契約締結日)

委 託 者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受 託 者 み ず ほ 信 託 銀 行 株 式 会 社

追加型証券投資信託

DIAM バランス・ファンド<DC 年金> 2 安定・成長型

約 款

アセットマネジメント One 株式会社

運用の基本方針

約款第 17 条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。
- 2) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が 60%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が 50%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、当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目指して運用します。

(注) 当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 TOPIX（東証株価指数、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）、外国債券についてはシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当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。

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

- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用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。）を行うことができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 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) 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。
- 3) 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) 同一銘柄の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、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 5) 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。
- 6) 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。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第 22 条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第 23 条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第 24 条の範囲で行います。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、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

委託者が基準価額水準、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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
DIAM バランス・ファンド＜DC年金＞ 2 安定・成長型
約款

＜信託の種類、委託者および受託者＞

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメント One 株式会社を委託者としみずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

＜信託事務の委託＞

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

＜信託の目的、金額および限度額＞

第 3 条 委託者は、金 100 万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金 1 兆円を限度として信託金を追加することができますものとしします。
- 3) 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 4) 委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

＜信託期間＞

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 49 条第 7 項、第 51 条第 1 項、第 52 条第 1 項、第 53 条第 1 項および第 55 条第 2 項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

＜受益権の分割および再分割＞

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権について 100 万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- 2) 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関す

る法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- 2) この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- 3) 第30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時の異なる受益権の内容>

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権

の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及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、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、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。）。

- 2) 委託者は、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つて、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、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、委託者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なわないものとします。

- 3) 委託者は、第5条第1項の規定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なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があつた場合、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ないます。

- 4) 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第 11 条 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係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜受益権の申込み単位、価額および手数料＞

第 12 条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1 口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- 2) 第 1 項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第 3 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- 3) 第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- 4) 前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については 1 口につき 1 円とします。）に乗じて得た額とします。
- 5) 前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第 46 条第 2 項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第 40 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 6) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）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、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜受益権の譲渡に係る記載または記録＞

第 13 条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

2) 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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なわれるよう通知するものとします。

3) 委託者は、第 1 項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

＜受益権の譲渡の対抗要件＞

第 14 条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

＜投資の対象とする資産の種類＞

第 15 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、約款第 22 条、第 23 条および第 24 条に定めるものに限りま。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

＜運用の指図範囲等＞

第 16 条 委託者は、信託金を主として第 1 号から第 4 号までのアセットマネジメント One 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第 5 号以降の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りします。）
21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号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、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- 2) 委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 3) 第1項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、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- 4) 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式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60を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の60を超えることとなった場合には、これを調整します。

- 5) 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託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。
- 6) 委託者は、取得時において信託財産に属する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新株引受権証券および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 15 を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 前 3 項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株式、当該投資信託証券、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。

<運用の基本方針>

第 17 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

- 第 18 条 委託者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、証券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、証券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。
- 2) 前項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者が投資することを指図することができるものとします。

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

- 第 19 条 委託者は、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。
- 2) 前項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。

＜同一銘柄の転換社債等への投資制限＞

第 20 条 委託者は、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。

- 2) 前項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時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜信用取引の指図範囲＞

第 21 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

＜先物取引等の運用指図・目的・範囲＞

第 22 条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。))を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに

第16条第2項第1号から第4号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、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。

3) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引に係る支

払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、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。

- 2) 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、原則として第4条に定める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。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 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。
- 6) 委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、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。

- 2) 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、原則として第4条に定める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。

- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- 6) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 7) 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。

- 8) 委託者は、金利先渡し取引および為替先渡し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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

＜デリバティブ取引等にかかる投資制限＞

第 24 条の 2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

＜有価証券の貸付けの指図および範囲＞

第 25 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 3) 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

＜公社債の空売りの指図範囲＞

第 26 条 委託者は、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。

- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

＜公社債の借入れ＞

第 27 条 委託者は、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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2) 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 4) 第 1 項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第 28 条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産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 50 を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により 100 分の 50 を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

- 2) 前項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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第 29 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約の指図>

第 30 条 委託者は、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。

- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファン

ドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 4) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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。

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- 2) 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- 3) 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、そ

の計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

- 4) 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第 35 条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第 36 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第 37 条 委託者は、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。

- 2) 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、資金借入れ額は借入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。
- 3) 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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第 38 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

＜受託者による資金の立替え＞

第 39 条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- 2) 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- 3) 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

＜信託の計算期間＞

第 40 条 この信託の計算期間は、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。ただし、第 1 計算期間は平成 14 年 12 月 13 日から平成 16 年 2 月 25 日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

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

＜信託財産に関する報告＞

第 41 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 2) 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

＜信託事務の諸費用＞

第 42 条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第 40 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年 8 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき当該消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

＜信託報酬等の総額および支弁の方法＞

第 43 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 40 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成 17 年 9 月 30 日まで …年 10,000 分の 34
 2. 平成 17 年 10 月 1 日から信託終了の日まで …年 10,000 分の 29
- 2) 前項の信託報酬は、毎年 8 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
- 3) 第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第 44 条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の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利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、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。
- 2) 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、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第 45 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 47 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 47 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- 2) 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

第 46 条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- 2) 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、受益者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、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- 3) 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- 4) 前項および第 47 条第 4 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第 47 条 償還金は、信託終了後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- 2) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 6 営業日目から当該受益者に支払います。
- 3) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。

- 4) 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

＜償還金の時効＞

第 48 条 受益者が、信託終了による償還金について第 47 条第 1 項に規定する支払い開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託者が受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

＜信託契約の一部解約＞

第 49 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

ただし、一部解約の実行の請求日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- 2) 平成 19 年 1 月 4 日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- 3) 委託者は、第 1 項の一部解約の実行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。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。
- 4) 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- 5) 委託者は、証券取引所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、第 1 項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- 6) 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。

- 7) 委託者は、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、受託者と合意の上、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、第51条の規定を準用するものとします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

- 第51条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。
- 2) 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全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。
- 3) 前項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者に対して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。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約を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、これらの事項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、全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。
- 6) 第3項から前項までの規定は、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、第3項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。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第 52 条 委託者は、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。

- 2) 委託者は、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、第 56 条の規定に従います。

＜委託者の登録取消等に伴う取扱い＞

第 53 条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- 2) 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者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、この信託は、第 56 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

＜委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い＞

第 54 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- 2) 委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する営業を承継させることがあります。

＜受託者の辞任および解任に伴う取扱い＞

第 55 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第 56 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- 2) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜信託約款の変更＞

第 56 条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全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。

- 3) 前項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者に対して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。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- 5) 委託者は、当該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、これらの事項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、全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。

<反対者の買取請求権>

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公 告>

第58条 委託者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、次のアドレスに掲載します。

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

- 2) 前項の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ます。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第59条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- 2) 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第60条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

<附 則>

第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別

の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

第 3 条 第 24 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 4 条 第 24 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日

(信託契約締結日)

委 託 者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受 託 者 み ず ほ 信 託 銀 行 株 式 会 社

追加型証券投資信託

DIAM バランス・ファンド<DC 年金> 3 成長型

約 款

アセットマネジメント One 株式会社

運用の基本方針

約款第 17 条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。
- 2) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が 80%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が 55%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、当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目指して運用します。

(注) 当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 TOPIX（東証株価指数、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）、外国債券についてはシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、当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。

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

- 4) 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用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。）を行うことができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 80%未満とします。
- 2) 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。
- 3) 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) 同一銘柄の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、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 5) 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。
- 6) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 55%以下とします。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第 22 条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第 23 条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第 24 条の範囲で行います。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、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

委託者が基準価額水準、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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
DIAM バランス・ファンド＜DC年金＞3 成長型
約款

＜信託の種類、委託者および受託者＞

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメント One 株式会社を委託者としみずは信託銀行株式会社を受託者とします。

- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

＜信託事務の委託＞

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

＜信託の目的、金額および限度額＞

第 3 条 委託者は、金 100 万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金 1 兆円を限度として信託金を追加することができますものとしします。
- 3) 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 4) 委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

＜信託期間＞

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 49 条第 7 項、第 51 条第 1 項、第 52 条第 1 項、第 53 条第 1 項および第 55 条第 2 項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

＜受益権の分割および再分割＞

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権について 100 万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- 2) 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第 6 条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第 7 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 5 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- 2) この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 28 条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- 3) 第 30 条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時の異なる受益権の内容>

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第 10 条 この信託の受益権は、平成 19 年 1 月 4 日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。

以下同じ。)の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)及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、以下「振替機関等」といいます。)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(以下、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。)

- 2) 委託者は、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、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、委託者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なわないものとし、

- 3) 委託者は、第5条第1項の規定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なうものとし、振替機関等は、委託者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ない、
- 4) 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権(受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。)を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとし、振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券(当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。)は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。)および登録金融機関(委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に

規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)に当該申請の手続きを委任することができます。

＜受益権の設定に係る受託者の通知＞

第 11 条 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係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜受益権の申込み単位、価額および手数料＞

第 12 条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1 口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- 2) 第 1 項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第 3 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- 3) 第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- 4) 前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については 1 口につき 1 円とします。）に乗じて得た額とします。
- 5) 前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第 46 条第 2 項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第 40 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 6) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所(金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買また

は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。) 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、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜受益権の譲渡に係る記載または記録＞

第13条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

2) 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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なわれるよう通知するものとします。

3) 委託者は、第1項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

＜受益権の譲渡の対抗要件＞

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

＜投資の対象とする資産の種類＞

第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限り。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第 16 条 委託者は、信託金を主として第 1 号から第 4 号までのアセットマネジメント One 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第 5 号以降の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

1 項第 10 号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)

18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第 5 号の証券または証書、第 16 号ならびに第 21 号の証券または証書のうち第 5 号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、第 6 号から第 10 号までの証券および第 16 号ならびに第 21 号の証券または証書のうち第 6 号から第 10 号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第 17 号の証券および第 18 号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- 2) 委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 3) 第 1 項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、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第 1 号から第 4 号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- 4) 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式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 80 以上となる投資の指図しません。ただし、有価証券の値上がり等により 100 分の 80 以上となった場合には、これを調整します。

- 5) 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託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。
- 6) 委託者は、取得時において信託財産に属する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新株引受権証券および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 15 を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 前 3 項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株式、当該投資信託証券、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。

<運用の基本方針>

第 17 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第 18 条 委託者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、証券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、証券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。

- 2) 前項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者が投資することを指図することができるものとします。

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第 19 条 委託者は、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。

- 2) 前項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。

＜同一銘柄の転換社債等への投資制限＞

第 20 条 委託者は、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。

- 2) 前項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時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜信用取引の指図範囲＞

第 21 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

＜先物取引等の運用指図・目的・範囲＞

第 22 条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 16 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファ

ンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引に係る支

払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、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。

- 2) 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、原則として第4条に定める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。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 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。
- 6) 委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、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。

- 2) 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、原則として第4条に定める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。

- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- 4) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- 6) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 7) 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。
- 8) 委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第 24 条の 2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

第 25 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 3) 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<公社債の空売りの指図範囲>

第 26 条 委託者は、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。

- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

<公社債の借入れ>

第 27 条 委託者は、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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2) 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 4) 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産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55を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の55を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

- 2) 前項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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第29条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外国為替予約の指図>

第30条 委託者は、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。

- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産

の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 4) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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。

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- 2) 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- 3) 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- 4) 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

＜一部解約の請求および有価証券の売却等の指図＞

第 35 条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

＜再投資の指図＞

第 36 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

＜資金の借入れ＞

第 37 条 委託者は、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。

- 2) 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、資金借入れ額は借入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。
- 3) 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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

＜損益の帰属＞

第 38 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

＜受託者による資金の立替え＞

第 39 条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることがで

きます。

- 2) 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- 3) 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、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。ただし、第1計算期間は平成14年12月13日から平成16年2月25日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

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

<信託財産に関する報告>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 2) 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

<信託事務の諸費用>

第42条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき当該消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで …年10,000分の37
2. 平成17年10月1日から信託終了の日まで …年10,000分の32

- 2) 前項の信託報酬は、毎年 8 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
- 3) 第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第 44 条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の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利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、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。
- 2) 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、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

- 第 45 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 47 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 47 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。
- 2) 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金の再投資等>

- 第 46 条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- 2) 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、受益者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、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- 3) 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- 4) 前項および第 47 条第 4 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第 47 条 償還金は、信託終了後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- 2) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 6 営業日目から当該受益者に支払います。
- 3) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。
- 4) 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第 48 条 受益者が、信託終了による償還金について第 47 条第 1 項に規定する支払い開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託者が受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

＜信託契約の一部解約＞

第 49 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

ただし、一部解約の実行の請求日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- 2) 平成 19 年 1 月 4 日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- 3) 委託者は、第 1 項の一部解約の実行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。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。
- 4) 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- 5) 委託者は、証券取引所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、第 1 項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- 6) 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。
- 7) 委託者は、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、受託者と合意の上、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、第 51 条の規定を準用するものとします。

＜質権口記載又は記録の受益権の取り扱い＞

第 50 条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

＜信託契約の解約＞

第 51 条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- 2) 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全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。
- 3) 前項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者に対して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。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約を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、これらの事項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、全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。
- 6) 第 3 項から前項までの規定は、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、第 3 項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。

＜信託契約に関する監督官庁の命令＞

第 52 条 委託者は、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。

- 2) 委託者は、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、第 56 条の規定に従います。

＜委託者の登録取消等に伴う取扱い＞

第 53 条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- 2) 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者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、この信託は、第 56 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

＜委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い＞

第 54 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- 2) 委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する営業を承継させることがあります。

＜受託者の辞任および解任に伴う取扱い＞

第 55 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第 56 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- 2) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜信託約款の変更＞

第 56 条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全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。
- 3) 前項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者に対して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。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第 1 項の信託約款の変更をしません。

- 5) 委託者は、当該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、これらの事項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、全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。

<反対者の買取請求権>

第 57 条 第 51 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第 51 条第 3 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 30 条の 2 の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公 告>

第 58 条 委託者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、次のアドレスに掲載します。

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

- 2) 前項の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ます。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第 59 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- 2) 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第 60 条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

<附 則>

第 1 条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得な

い事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとし
ます。

第 3 条 第 24 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 4 条 第 24 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 14 年 12 月 13 日

(信託契約締結日)

委 託 者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受 託 者 み ず ほ 信 託 銀 行 株 式 会 社

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- 1) 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指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。
- 6) 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- 4) 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。
- 5) 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。

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 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）に連動する投資成果を目指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。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 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、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) 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。
- 8) 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。
- 9) 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。

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA－BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA－BPI 総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 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。
- 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。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。
- 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、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 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) 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
- 7) スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
- 8) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
- 9) 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。
- 10) 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。
- 11) 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。

運用の基本方針

約款第 15 条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指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。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り
ます。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約
権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあら
かじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある
新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信
託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- 5) 有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
- 6) スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。
- 8) 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行いません。
- 9) 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。
- 10) 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。