投資信託説明書（請求目論見書）

使用開始日
2018年11月27日

Asset Management One

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2018年11月26日に関東財務局長に提出しており、2018年11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　菅野 暁
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
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】・・・

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（以上を総称して、または個別に「バランス・ファンド＜ＤＣ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、「ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型」を「バランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１」、「ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型」を「バランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２」、「ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型」を「バランス・ファンド＜ＤＣ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：2018年11月27日から2019年5月24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、販売会社に買付代金を支払うものとします。

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（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み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。

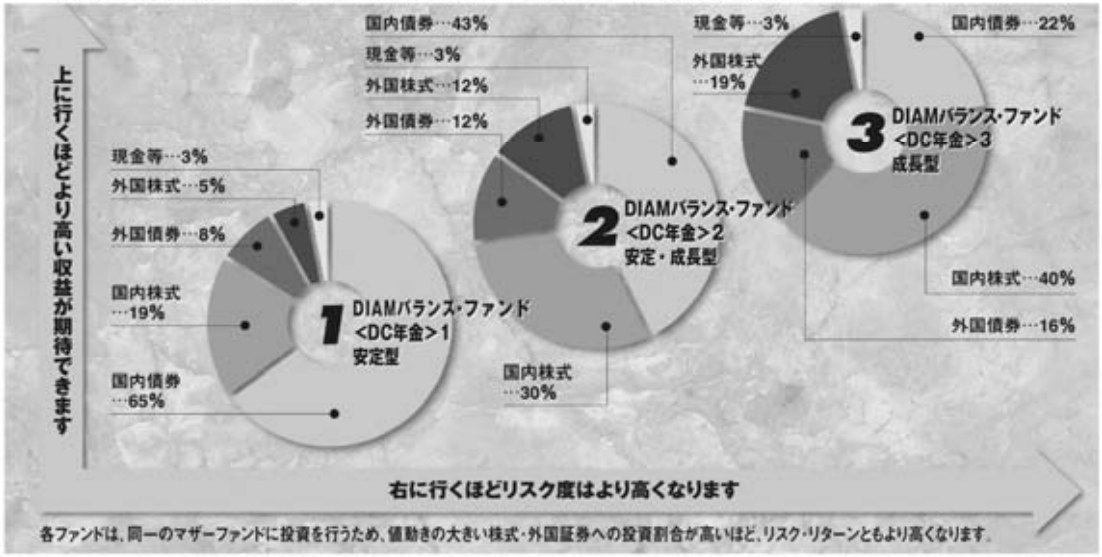
(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

2 ●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

3ファンドの基本アロケーション

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



●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 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 (　　) 資産複合	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

「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」

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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、債券）資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル （日本を含む） 日本 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	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （ＭＳＣＩコクサイ・インデックス、ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合、FTSE世界国債インデックス）

※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

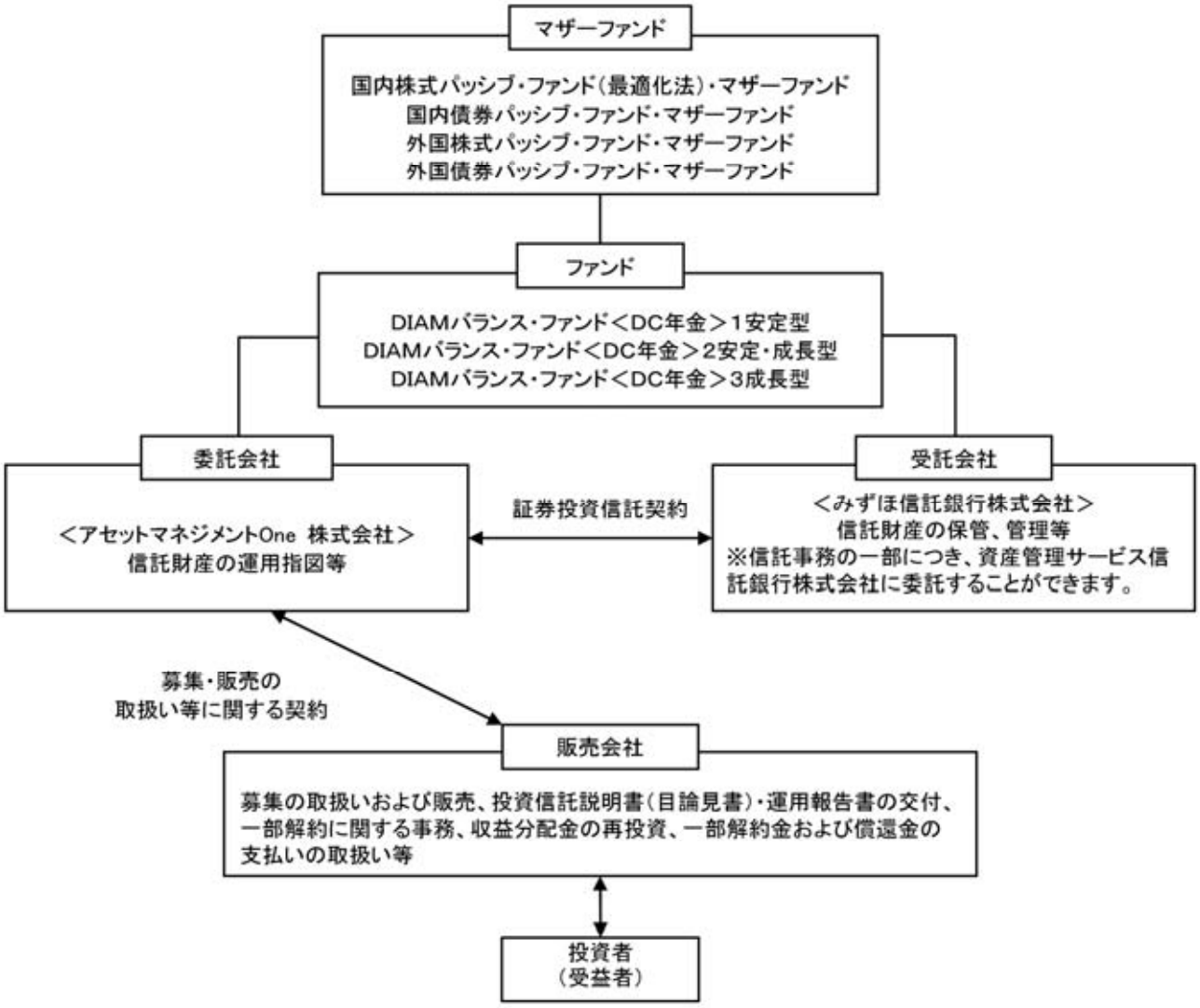
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）へ実質的に投資し、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の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

2002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
2005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

資本金の額

20億円（2018年8月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2018年8月31日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

＜基本方針＞

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

（注１）①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

②㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

⑥㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

⑦㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

（注３）本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指

数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

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

このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

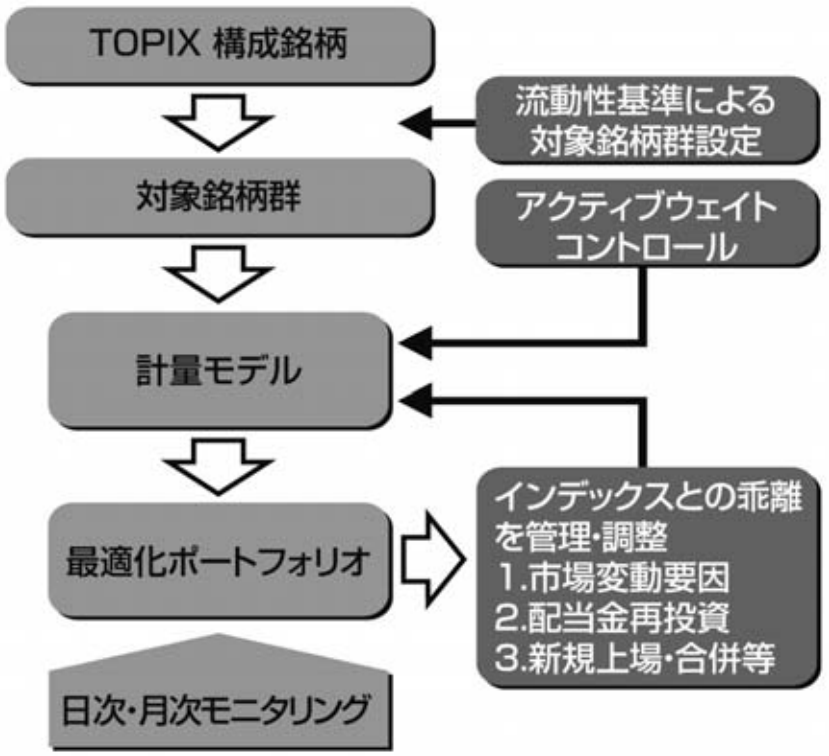
(12)協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
(13)特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
(14)コマーシャル・ペーパー
(15)新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
(16)外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
(17)証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
(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

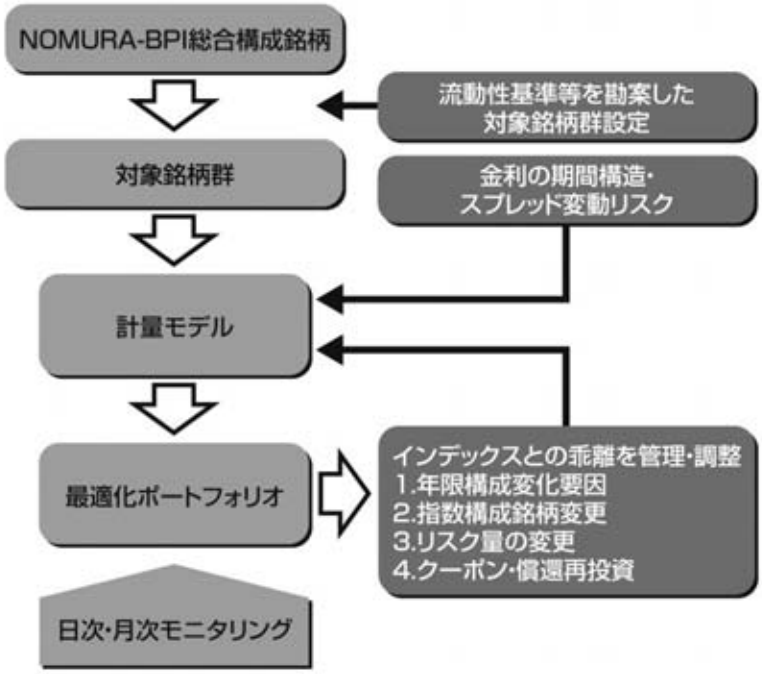
4．上記2．の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3．の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

（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

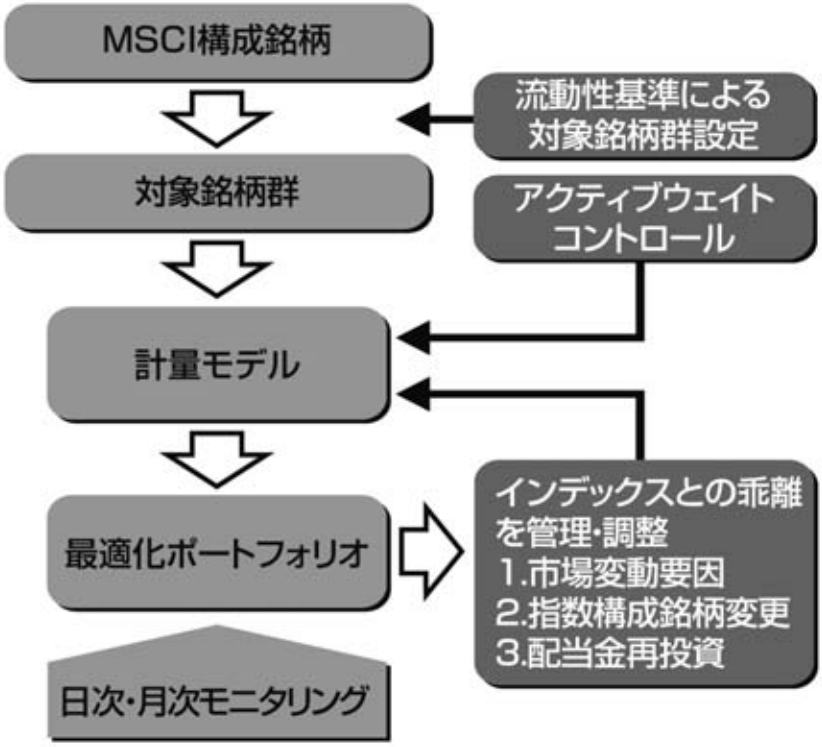
	
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ③外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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。
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。

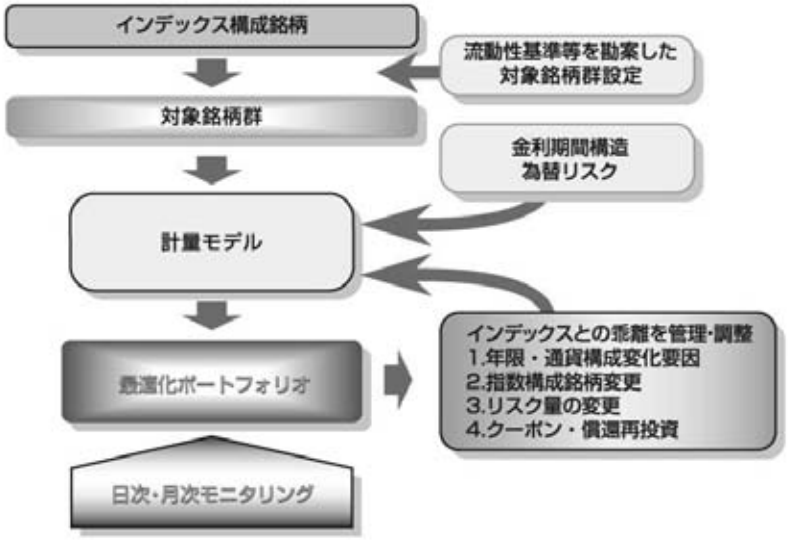
	2）最適化法によるポートフォリオの構築 ①債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 ②金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 ①、②が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3）インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資 
主な投資制限	①株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 ②株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

	⑦外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	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

	
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。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。

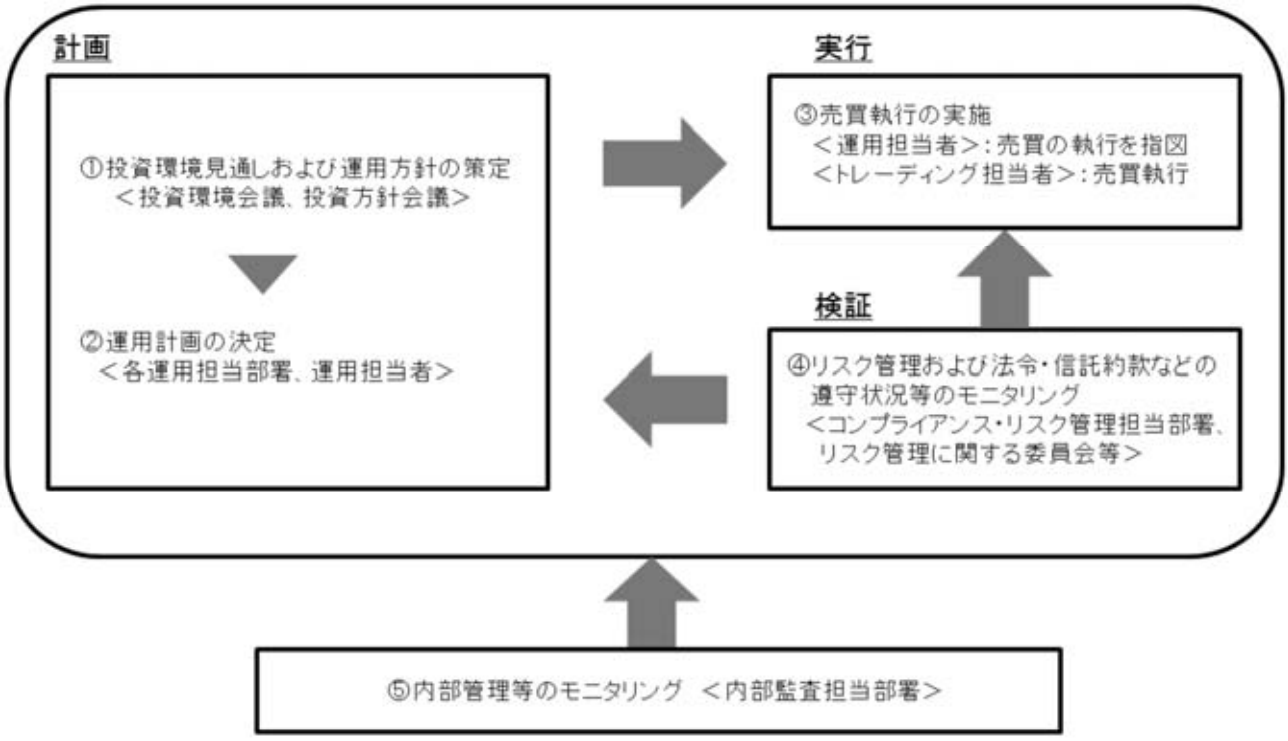
	2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
運用プロセス	1)流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 
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、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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④外貨建資産への投資には、制限を設けません。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

	⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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。

定期的に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2018年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

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

(6)投資する株式等の範囲（約款第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。

(7)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。

(8)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。

(9)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るものとします。

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

1)信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2)株式分割により取得する株券

3)有償増資により取得する株券

4)売出しにより取得する株券

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

6)信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(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

(10)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。

(11)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。

(12)金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第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。

(13)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。

(14)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。

(15)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。

(16)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。

(17)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。

(18)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。

(19)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。

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

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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。

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

○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が、各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流出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、これによる損失は購入者が負担することとなります。

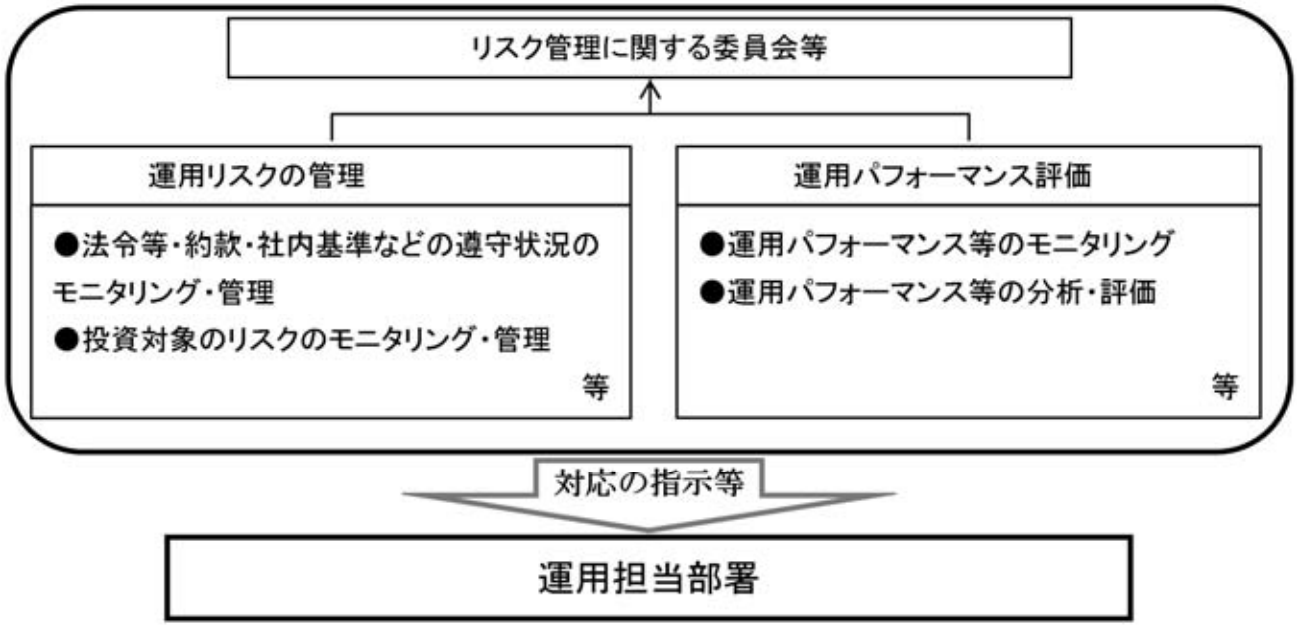
＜リスク管理体制＞

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

・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。

・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。

・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



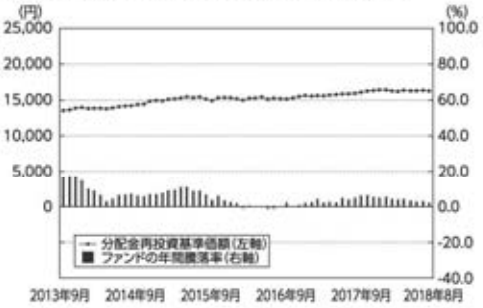
※リスク管理体制は2018年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

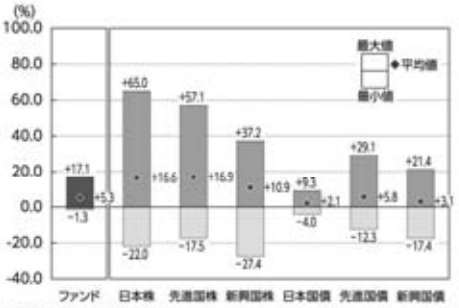
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

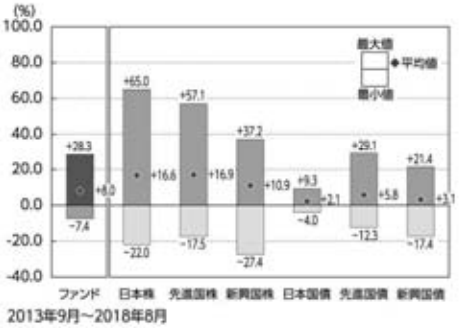
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型





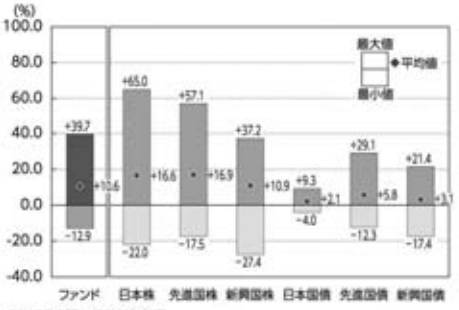
2013年9月～2018年8月

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型



2013年9月～2018年8月

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



2013年9月～2018年8月

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

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

＊各資産クラスの指数
日 本 株…東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債…NOMURA-BPI国債
先進国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
信託報酬 税込（税抜）	委託会社	販売会社	受託会社
ＤＩＡＭ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％
ＤＩＡＭ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％
ＤＩＡＭ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ます。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2018年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

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】

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型

平成30年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		11,151,377,486	97.00
	内　日本	11,151,377,486	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		345,088,348	3.00
純資産総額		11,496,465,834	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型

平成30年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		24,424,502,431	97.00
	内　日本	24,424,502,431	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		754,762,389	3.00
純資産総額		25,179,264,820	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型

平成30年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		19,332,202,640	97.00
	内　日本	19,332,202,640	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		598,446,095	3.00
純資産総額		19,930,648,735	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		11,995,820,000	4.00
	内　日本	11,995,820,000	4.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		283,854,610,400	83.22
	内　日本	283,854,610,400	83.22
地方債証券		22,208,024,720	6.51
	内　日本	22,208,024,720	6.51
特殊債券		17,018,209,482	4.99
	内　日本	17,018,209,482	4.99
社債券		15,048,669,410	4.41
	内　日本	14,648,845,410	4.29
	内　オランダ	200,788,000	0.06
	内　フランス	199,036,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,965,324,681	0.87
純資産総額		341,094,838,693	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

	内　シンガポール	1,403,610,830	0.44
	内　バミューダ	1,402,816,022	0.44
	内　フィンランド	1,272,633,354	0.40
	内　ベルギー	1,250,512,642	0.39
	内　ノルウェー	894,653,672	0.28
	内　ケイマン諸島	764,548,289	0.24
	内　オランダ領キュラソー	736,704,255	0.23
	内　イスラエル	662,320,137	0.21
	内　ルクセンブルグ	395,669,115	0.12
	内　オーストリア	273,826,834	0.09
	内　ニュージーランド	270,705,919	0.08
	内　パナマ	216,908,096	0.07
	内　ポルトガル	203,169,575	0.06
	内　リベリア	167,804,177	0.05
	内　イギリス領バージン諸島	97,221,097	0.03
	内　パプアニューギニア	68,123,476	0.02
	内　マン島	57,766,176	0.02
	内　モーリシャス	15,455,486	0.00
投資信託受益証券		746,472,883	0.23
	内　オーストラリア	608,568,224	0.19
	内　シンガポール	137,904,659	0.04
投資証券		6,787,379,474	2.12
	内　アメリカ	5,862,437,196	1.83
	内　イギリス	263,726,556	0.08
	内　オランダ	243,970,121	0.08
	内　フランス	190,526,083	0.06
	内　香港	180,339,273	0.06
	内　カナダ	46,380,245	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,957,149,949	1.55
純資産総額		320,390,565,941	100.00

その他資産の投資状況

平成30年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
為替予約取引（売建）		491,617,840	△0.15
	－	491,617,840	△0.15
株価指数先物取引（買建）		4,352,139,750	1.36
	内　アメリカ	3,029,583,528	0.95
	内　ドイツ	746,576,544	0.23
	内　イギリス	282,173,892	0.09
	内　カナダ	166,392,996	0.05
	内　オーストラリア	127,412,790	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型

平成30年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,820,836,814	1.2875 7,494,385,910	1.2831 7,468,715,716	－ －	64.97%
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	826,015,634	2.6746 2,209,292,685	2.6523 2,190,841,266	－ －	19.06%
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	507,051,470	1.7778 901,456,453	1.8047 915,075,787	－ －	7.96%
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	157,934,366	3.3775 533,435,985	3.6518 576,744,717	－ －	5.02%

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型

平成30年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	8,414,737,420	1.2874 10,833,467,981	1.2831 10,796,949,583	－ －	42.88%
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	2,847,953,760	2.6780 7,626,968,657	2.6523 7,553,627,757	－ －	30.00%
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	843,425,822	3.3796 2,850,510,237	3.6518 3,080,022,416	－ －	12.23%
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	1,658,947,568	1.7775 2,948,802,618	1.8047 2,993,902,675	－ －	11.89%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型

平成30年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,997,723,660	2.6786 8,029,897,915	2.6523 7,950,862,463	－ －	39.89%
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	3,381,984,559	1.2874 4,354,066,901	1.2831 4,339,424,387	－ －	21.77%
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	1,063,353,454	3.3794 3,593,545,928	3.6518 3,883,154,143	－ －	19.48%
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	1,750,297,361	1.7785 3,112,966,656	1.8047 3,158,761,647	－ －	15.85%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.00%
合計	97.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

20	日本	電気機器	139,700	2,265,510,748	2,249,868,500	－	0.75%
21	ダイキン工業 日本	株式 機械	158,500	12,218.86 1,936,690,552	14,170.00 2,245,945,000	－ －	0.75%
22	キヤノン 日本	株式 電気機器	624,600	4,052.58 2,531,245,392	3,563.00 2,225,449,800	－ －	0.74%
23	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	479,200	4,463.47 2,138,896,768	4,525.00 2,168,380,000	－ －	0.72%
24	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,141,800	1,468.95 1,677,252,355	1,882.00 2,148,867,600	－ －	0.72%
25	信越化学工業 日本	株式 化学	200,400	11,520.24 2,308,656,944	10,425.00 2,089,170,000	－ －	0.70%
26	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	206,400	10,438.62 2,154,533,010	10,055.00 2,075,352,000	－ －	0.69%
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,787,000	811.45 2,261,513,650	725.50 2,021,968,500	－ －	0.67%
28	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	427,800	5,994.30 2,564,363,530	4,653.00 1,990,553,400	－ －	0.66%
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	672,700	3,289.46 2,212,826,210	2,922.00 1,965,629,400	－ －	0.66%
30	資生堂 日本	株式 化学	230,600	5,713.92 1,317,632,225	7,824.00 1,804,214,400	－ －	0.60%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
株式	95.86%
合計	95.86%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年8月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	１２２回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.28 4,011,400,000	0.100000 2019/12/20	1.18%
2	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,100,000,000	103.16 3,198,092,000	102.85 3,188,474,000	0.400000 2025/9/20	0.93%
3	３３９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,100,000,000	103.17 3,198,423,500	102.82 3,187,482,000	0.400000 2025/6/20	0.93%
4	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.15 3,125,820,600	0.300000 2025/12/20	0.92%
5	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,100,000,000	100.58 3,118,239,500	100.09 3,102,914,000	0.100000 2028/3/20	0.91%
6	１３０回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.64 3,019,320,000	0.100000 2021/12/20	0.89%
7	３４２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	100.64 3,019,200,000	0.100000 2026/3/20	0.89%
8	３４３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	100.58 3,017,490,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
9	１２８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.57 3,017,220,000	0.100000 2021/6/20	0.88%
10	１２７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.53 3,016,050,000	0.100000 2021/3/20	0.88%
11	１２５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.44 3,013,230,000	0.100000 2020/9/20	0.88%
12	３４６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.42 3,012,750,000	0.100000 2027/3/20	0.88%
13	１２３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.47 3,014,100,000	100.33 3,010,170,000	0.100000 2020/3/20	0.88%
14	３２５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,900,000,000	104.00 3,016,047,000	103.57 3,003,588,000	0.800000 2022/9/20	0.88%
15	３４７回　利付国庫債券（１０年）	国債証券	2,900,000,000	100.51	100.34	0.100000	0.85%

	日本			2,914,810,000	2,910,121,000	2027/6/20	
16	３４８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.47 2,913,805,000	100.26 2,907,801,000	0.100000 2027/9/20	0.85%
17	１３３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,860,000,000	100.89 2,885,679,000	100.75 2,881,478,600	0.100000 2022/9/20	0.84%
18	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,800,000,000	100.68 2,819,100,000	100.56 2,815,708,000	0.100000 2026/9/20	0.83%
19	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,650,000,000	103.10 2,732,346,000	102.78 2,723,802,500	0.400000 2025/3/20	0.80%
20	３４５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.61 2,716,610,000	100.49 2,713,392,000	0.100000 2026/12/20	0.80%
21	３３４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,600,000,000	104.11 2,706,919,000	103.71 2,696,642,000	0.600000 2024/6/20	0.79%
22	３３３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.99 2,599,920,000	103.61 2,590,300,000	0.600000 2024/3/20	0.76%
23	３０５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	102.64 2,566,200,000	101.84 2,546,075,000	1.300000 2019/12/20	0.75%
24	１２６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.59 2,514,950,000	100.49 2,512,350,000	0.100000 2020/12/20	0.74%
25	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,350,000,000	103.58 2,434,192,000	103.24 2,426,163,500	0.500000 2024/9/20	0.71%
26	３２９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,270,000,000	104.73 2,377,375,100	104.21 2,365,567,000	0.800000 2023/6/20	0.69%
27	３１０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,300,000,000	102.89 2,366,654,000	102.26 2,352,118,000	1.000000 2020/9/20	0.69%
28	３４９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,310,000,000	100.48 2,321,187,700	100.18 2,314,250,400	0.100000 2027/12/20	0.68%
29	３３２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,210,000,000	103.92 2,296,693,300	103.50 2,287,482,600	0.600000 2023/12/20	0.67%
30	３１２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,200,000,000	103.74 2,282,456,000	103.01 2,266,330,000	1.200000 2020/12/20	0.66%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	376,469	18,639.60 7,017,232,829	24,991.83 9,408,649,925	－ －	2.94%
2	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,466	161,501.38 4,920,301,202	222,384.32 6,775,160,778	－ －	2.11%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	542,300	10,103.15 5,478,938,792	12,433.16 6,742,506,464	－ －	2.10%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	177,316	19,945.37 3,536,634,212	19,728.69 3,498,213,885	－ －	1.09%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,725	12,779.37 3,255,227,206	12,793.00 3,258,697,281	－ －	1.02%
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,300	119,018.14 2,773,122,738	137,616.66 3,206,468,345	－ －	1.00%
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	22,200	119,347.68 2,649,518,511	139,318.10 3,092,861,962	－ －	0.97%
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	198,834	14,408.76 2,864,952,173	14,987.54 2,980,033,920	－ －	0.93%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	315,280	8,495.50 2,678,461,901	8,941.44 2,819,057,392	－ －	0.88%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	722,337	3,554.52 2,567,564,232	3,443.97 2,487,707,391	－ －	0.78%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	348,201	6,609.70 2,301,504,189	6,492.56 2,260,718,530	－ －	0.71%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	94,579	22,304.93 2,109,578,475	23,294.83 2,203,202,199	－ －	0.69%
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	134,179	13,428.17 1,801,779,551	16,296.94 2,186,707,702	－ －	0.68%
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	231,295	8,856.73 2,048,518,542	9,315.93 2,154,728,954	－ －	0.67%
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式 ヘルスケア・プロバイダー	71,700	25,427.59	29,807.39	－	0.67%

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年8月31日現在

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

電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.70%
専門サービス		0.68%
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.67%
航空貨物・物流サービス		0.60%
不動産管理・開発		0.51%
電子装置・機器・部品		0.50%
エネルギー設備・サービス		0.49%
消費者金融		0.48%
商業サービス・用品		0.43%
複合小売り		0.42%
家庭用耐久財		0.39%
自動車部品		0.38%
建設関連製品		0.37%
建設・土木		0.35%
商社・流通業		0.34%
無線通信サービス		0.30%
建設資材		0.29%
容器・包装		0.28%
運送インフラ		0.19%
ガス		0.15%
旅客航空輸送業		0.14%
紙製品・林産品		0.12%
ヘルスケア・テクノロジー		0.08%
販売		0.07%
水道		0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.07%
海運業		0.06%
レジャー用品		0.06%
各種消費者サービス		0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.01%
合計		96.10%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

22	アメリカ	国債証券	1,177,236,000	1,136,491,862	1,140,070,659	2024/11/15	0.55%
23	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,155,024,000	98.12 1,133,401,950	97.80 1,129,659,672	2.000000 2021/11/15	0.55%
24	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,110,600,000	100.15 1,112,332,536	99.92 1,109,811,474	2.750000 2023/11/15	0.54%
25	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,110,600,000	98.62 1,095,329,250	98.25 1,091,164,500	2.125000 2021/9/30	0.53%
26	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,010,568,000	107.59 1,087,310,533	106.52 1,076,467,139	2.500000 2020/10/25	0.52%
27	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	1,110,600,000	95.85 1,064,589,319	95.85 1,064,610,054	1.750000 2023/1/31	0.52%
28	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	1,108,378,800	95.63 1,059,956,464	95.78 1,061,616,298	2.125000 2025/5/15	0.51%
29	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,043,964,000	99.99 1,043,880,482	99.86 1,042,575,527	2.750000 2024/2/15	0.50%
30	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,055,070,000	98.05 1,034,538,337	97.76 1,031,489,185	2.125000 2022/6/30	0.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.97%
合計	96.97%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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】

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型

該当事項はありません。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型

該当事項はありません。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ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30年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　３００９月	買建	692	11,878,899,208	11,995,820,000	4.00%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	－	アメリカ・ドル売／円買２０１８年０９月	売建	3,200,000	355,292,800	355,296,000	△0.11%
		ユーロ売／円買２０１８年０９月	売建	612,000	79,291,944	79,290,720	△0.02%
		イギリス・ポンド売／円買２０１８年０９月	売建	188,000	27,173,896	27,173,520	△0.01%
		カナダ・ドル売／円買２０１８年０９月	売建	208,000	17,773,184	17,773,600	△0.01%
		オーストラリア・ドル売／円買２０１８年０９月	売建	150,000	12,084,750	12,084,000	△0.00%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００ ＥＭＩＮＩ ＦＵＴ Ｓｅｐ１８	買建	188	2,966,461,188	3,029,583,528	0.95%
	ＥＵＲＥＸ取引所	ＤＪ ＥＵＲＯ ＳＴＯＸＸ ５０ Ｓｅｐ１８	買建	168	750,569,583	746,576,544	0.23%
	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ １００ ＩＮＤＥＸ ＦＵＴＵＲＥ Ｓｅｐ１８	買建	26	286,183,986	282,173,892	0.09%
	モントリオール取引所	Ｓ＆Ｐ／ＴＳＥ ６０ＩＸ ＦＵＴ Ｓｅｐ１８	買建	10	166,507,525	166,392,996	0.05%
	シドニー先物取引所	ＳＰＩ ２００ ＦＵＴＵＲＥＳ Ｓｅｐ１８	買建	10	125,837,255	127,412,790	0.04%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（平成30年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

ＤＩＡＭ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
第15計算期間末 （平成30年2月26日）	10,879	10,879	1.6264	1.6264
平成29年8月末日	10,425	－	1.5919	－
9月末日	10,530	－	1.6061	－
10月末日	10,703	－	1.6243	－
11月末日	10,839	－	1.6321	－
12月末日	10,926	－	1.6413	－
平成30年1月末日	10,960	－	1.6404	－
2月末日	10,952	－	1.6259	－
3月末日	11,039	－	1.6184	－
4月末日	11,131	－	1.6334	－
5月末日	11,213	－	1.6275	－
6月末日	11,299	－	1.6278	－
7月末日	11,477	－	1.6337	－
8月末日	11,496	－	1.6263	－

ＤＩＡＭ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
第15計算期間末 （平成30年2月26日）	23,907	23,907	1.9363	1.9363
平成29年8月末日	22,635	－	1.8674	－
9月末日	23,033	－	1.9013	－
10月末日	23,527	－	1.9378	－
11月末日	23,805	－	1.9503	－
12月末日	24,116	－	1.9696	－
平成30年1月末日	24,327	－	1.9714	－
2月末日	23,978	－	1.9353	－
3月末日	23,974	－	1.9160	－
4月末日	24,407	－	1.9483	－
5月末日	24,549	－	1.9354	－
6月末日	24,669	－	1.9358	－
7月末日	25,057	－	1.9524	－
8月末日	25,179	－	1.9466	－

ＤＩＡＭ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
第15計算期間末 (平成30年2月26日)	18,810	18,810	2.2555	2.2555
平成29年8月末日	17,594	－	2.1468	－
9月末日	17,990	－	2.2045	－
10月末日	18,512	－	2.2621	－
11月末日	18,727	－	2.2798	－
12月末日	19,067	－	2.3115	－
平成30年1月末日	19,299	－	2.3159	－
2月末日	18,871	－	2.2538	－
3月末日	18,762	－	2.2200	－
4月末日	19,238	－	2.2736	－
5月末日	19,293	－	2.2521	－
6月末日	19,398	－	2.2532	－
7月末日	19,819	－	2.2831	－
8月末日	19,930	－	2.2800	－

②【分配の推移】

ＤＩＡＭ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
第15計算期間	0.0000
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	－

ＤＩＡＭ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
第15計算期間	0.0000
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	－

ＤＩＡＭ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
第15計算期間	0.0000
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	－

③【収益率の推移】

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型

	収益率(%)
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
第15計算期間	4.4
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	△0.3

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

なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型

	収益率(%)
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
第15計算期間	7.2
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	△0.0

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型

	収益率(%)
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
第15計算期間	9.9
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	0.3

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

（４）【設定及び解約の実績】

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型

	設定口数	解約口数
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
第15計算期間	1,447,662,999	989,556,322
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	778,944,701	446,294,356

（注）　本邦外における設定及び解約はございません。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型

	設定口数	解約口数
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
第15計算期間	1,657,767,778	1,125,122,159
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	939,621,040	414,746,166

（注）　本邦外における設定及び解約はございません。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型

	設定口数	解約口数
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
第15計算期間	1,357,837,135	1,038,315,671
平成30年2月27日～ 平成30年8月26日	725,308,803	371,886,567

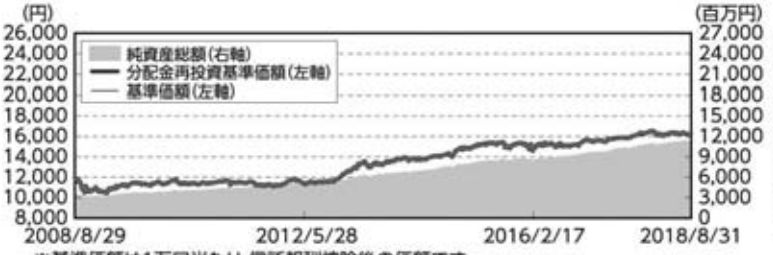
（注） 本邦外における設定及び解約はございません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2018年8月31日

DIAM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 〈2008年8月29日～2018年8月31日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日: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
第15期	(2018.02.26)	0円
	設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	64.97%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.06%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.96%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.02%

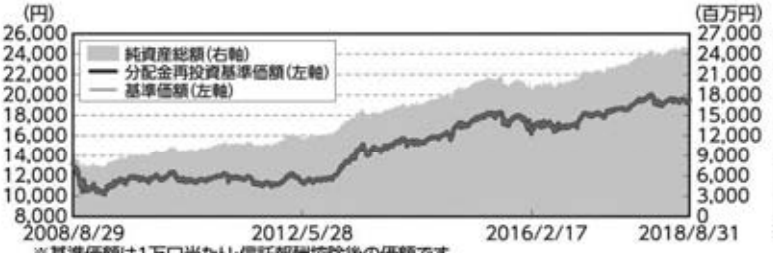
※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

DIAM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 〈2008年8月29日～2018年8月31日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日: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
第15期	(2018.02.26)	0円
	設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

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

データの基準日:2018年8月31日

主要な資産の状況

組入銘柄　※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	42.88%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30.00%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.23%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.89%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

DIAM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 〈2008年8月29日~2018年8月31日〉

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日: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
第15期	(2018.02.26)	0円
	設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

組入銘柄　※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	39.89%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.77%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.48%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.85%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

データの基準日:2018年8月31日

各マザーファンドの主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度による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1万口当たりに換算した基準価額で表示することがあります。）

基準価額は、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】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は2002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】

a.計算期間は原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとします。

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

（５）【その他】

イ．償還規定

a.委託会社は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。

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

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

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

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

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

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

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

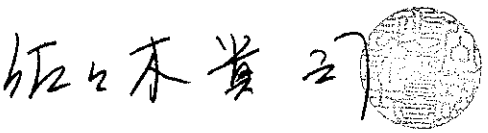
（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（平成29年2月28日から平成30年2月26日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

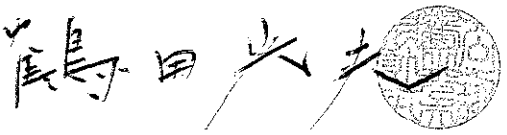
独立監査人の監査報告書

平成30年４月11日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型の平成30年２月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

１【財務諸表】

【ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	313,077,974	369,143,553
親投資信託受益証券	9,420,316,494	10,553,953,494
未収入金	790,000	－
流動資産合計	9,734,184,468	10,923,097,047
資産合計	9,734,184,468	10,923,097,047
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,934,274	28,458,074
未払受託者報酬	1,557,966	1,761,305
未払委託者報酬	11,944,683	13,503,671
その他未払費用	233,606	264,110
流動負債合計	22,670,529	43,987,160
負債合計	22,670,529	43,987,160
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,231,110,374	※1 6,689,217,051
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,480,403,565	4,189,892,836
（分配準備積立金）	1,295,752,917	1,509,647,786
元本等合計	9,711,513,939	10,879,109,887
純資産合計	9,711,513,939	10,879,109,887
負債純資産合計	9,734,184,468	10,923,097,047

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
営業収益		
受取利息	309	180
有価証券売買等損益	403,726,238	467,749,000
営業収益合計	403,726,547	467,749,180
営業費用		
支払利息	191,101	239,302
受託者報酬	2,995,008	3,359,146
委託者報酬	22,962,290	25,754,110
その他費用	451,631	503,712
営業費用合計	26,600,030	29,856,270
営業利益又は営業損失（△）	377,126,517	437,892,910
経常利益又は経常損失（△）	377,126,517	437,892,910
当期純利益又は当期純損失（△）	377,126,517	437,892,910
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（△）	23,371,348	41,314,811
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	624,783,271	868,615,874
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	624,783,271	868,615,874
剰余金減少額又は欠損金増加額	350,181,757	555,704,702
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	350,181,757	555,704,702
分配金	※1　－	※1　－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,480,403,565	4,189,892,836

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26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	1,447,662,999円
期中一部解約元本額		702,902,178円	989,556,322円
２．　受益権の総数		6,231,110,374口	6,689,217,051口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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（396,643,211円）、信託約款に規定される収益調整金（2,680,465,281円）及び分配準備積立金（1,113,004,575円）より分配対象収益は4,190,113,067円（1万口当たり6,263.98円）でありますが、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14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	366,920,264	416,848,422
合計	366,920,264	416,848,422

（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14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5586円 （15,586円）	1.6264円 （16,264円）

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年2月26日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	765,964,168	2,054,239,302	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,538,860,716	7,130,729,285	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	155,272,827	525,055,064	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	474,597,820	843,929,843	
親投資信託受益証券　合計		6,934,695,531	10,553,953,494	
合計		6,934,695,531	10,553,953,494	

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。

（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15期計算期間（平成29年2月28日から平成30年2月26日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成30年４月11日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　佐々木貴弘

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ＤＩＡＭ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30年２月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以　上

【ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	682,530,012	763,629,983
親投資信託受益証券	20,693,026,226	23,193,287,280
未収入金	2,890,000	－
流動資産合計	21,378,446,238	23,956,917,263
資産合計	21,378,446,238	23,956,917,263
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,044,480	11,476,474
未払受託者報酬	3,410,980	3,873,543
未払委託者報酬	29,562,168	33,571,118
その他未払費用	511,562	580,952
流動負債合計	43,529,190	49,502,087
負債合計	43,529,190	49,502,087
純資産の部		
元本等		
元本	※1 11,814,239,777	※1 12,346,885,396
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,520,677,271	11,560,529,780
（分配準備積立金）	4,543,965,384	5,613,716,489
元本等合計	21,334,917,048	23,907,415,176
純資産合計	21,334,917,048	23,907,415,176
負債純資産合計	21,378,446,238	23,956,917,263

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
営業収益		
受取利息	680	390
有価証券売買等損益	1,612,209,618	1,635,971,054
営業収益合計	1,612,210,298	1,635,971,444
営業費用		
支払利息	411,418	516,334
受託者報酬	6,556,231	7,355,614
委託者報酬	56,821,368	63,749,447
その他費用	988,895	1,103,180
営業費用合計	64,777,912	72,724,575
営業利益又は営業損失（△）	1,547,432,386	1,563,246,869
経常利益又は経常損失（△）	1,547,432,386	1,563,246,869
当期純利益又は当期純損失（△）	1,547,432,386	1,563,246,869
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	58,419,410	88,614,760
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	1,032,666,618	1,475,479,105
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,032,666,618	1,475,479,105
剰余金減少額又は欠損金増加額	622,618,670	910,258,705
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	622,618,670	910,258,705
分配金	※1　－	※1　－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,520,677,271	11,560,529,780

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26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	1,657,767,778円
	期中一部解約元本額	920,758,675円	1,125,122,159円
２．	受益権の総数	11,814,239,777口	12,346,885,396口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目		第14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　※１	分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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）でありますが、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（1,474,764,614円）、信託約款に規定される収益調整金（5,947,305,750円）及び分配準備積立金（4,138,951,875円）より分配対象収益は11,561,022,239円（1万口当たり9,363.51円）でありますが、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14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,531,599,648	1,551,900,349
合計	1,531,599,648	1,551,900,349

（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14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8059円 （18,059円）	1.9363円 （19,363円）

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年2月26日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	2,673,224,321	7,169,320,306	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,094,578,747	10,420,960,678	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	854,160,900	2,888,345,083	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,526,634,357	2,714,661,213	
親投資信託受益証券　合計		13,148,598,325	23,193,287,280	
合計		13,148,598,325	23,193,287,280	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ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15期計算期間（平成29年2月28日から平成30年2月26日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成30年４月11日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　[redacted]

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　[redacted]

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型の平成30年２月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

【ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	544,167,446	605,779,458
親投資信託受益証券	15,968,245,361	18,249,068,031
流動資産合計	16,512,412,807	18,854,847,489
資産合計	16,512,412,807	18,854,847,489
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,801,216	11,232,904
未払受託者報酬	2,621,230	3,046,048
未払委託者報酬	25,339,003	29,445,600
その他未払費用	393,103	456,824
流動負債合計	47,154,552	44,181,376
負債合計	47,154,552	44,181,376
純資産の部		
元本等		
元本	※1 8,020,226,146	※1 8,339,747,610
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,445,032,109	10,470,918,503
（分配準備積立金）	3,746,046,132	4,802,370,493
元本等合計	16,465,258,255	18,810,666,113
純資産合計	16,465,258,255	18,810,666,113
負債純資産合計	16,512,412,807	18,854,847,489

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
営業収益		
受取利息	525	309
有価証券売買等損益	1,717,761,331	1,700,106,670
営業収益合計	1,717,761,856	1,700,106,979
営業費用		
支払利息	321,113	408,389
受託者報酬	5,035,088	5,748,772
委託者報酬	48,673,376	55,572,375
その他費用	759,454	862,153
営業費用合計	54,789,031	62,591,689
営業利益又は営業損失（△）	1,662,972,825	1,637,515,290
経常利益又は経常損失（△）	1,662,972,825	1,637,515,290
当期純利益又は当期純損失（△）	1,662,972,825	1,637,515,290
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（△）	90,102,598	133,290,623
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	1,007,572,466	1,621,639,664
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,007,572,466	1,621,639,664
剰余金減少額又は欠損金増加額	793,218,797	1,099,977,937
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	793,218,797	1,099,977,937
分配金	※1　－	※1　－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,445,032,109	10,470,918,503

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26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	1,357,837,135円
期中一部解約元本額	932,940,956円	1,038,315,671円
２．　受益権の総数	8,020,226,146口	8,339,747,610口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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）でありますが、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（1,504,341,180円）、信託約款に規定される収益調整金（5,668,929,911円）及び分配準備積立金（3,298,029,313円）より分配対象収益は10,471,300,404円（1万口当たり12,555.90円）でありますが、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14期 自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	第15期 自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,639,737,447	1,623,527,808
合計	1,639,737,447	1,623,527,808

（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14期 平成29年2月27日現在	第15期 平成30年2月26日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0530円 （20,530円）	2.2555円 （22,555円）

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年2月26日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	2,791,900,084	7,487,596,835	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,297,220,345	4,244,841,472	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,042,632,432	3,525,661,568	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,682,020,108	2,990,968,156	
親投資信託受益証券　合計		8,813,772,969	18,249,068,031	
合計		8,813,772,969	18,249,068,031	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）
「ＤＩＡＭ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」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	142,969,149,329円	125,576,804,116円
同期中追加設定元本額	31,828,067,138円	22,269,571,713円
同期中一部解約元本額	49,220,412,351円	38,685,646,957円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	6,296,121,588円	9,036,126,148円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	1,669,207,881円	1,870,405,653円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,012,187円	4,013,213円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	12,048,308円	9,146,230円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	23,525,414円	16,684,426円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	14,468,349円	20,360,996円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	11,463,058円	15,401,869円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	14,708,962円	11,840,415円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	－円	149,657,723円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	－円	14,607,726円

たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	153,495円
たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	1,393,312円
たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	4,683,156円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	－円	14,974円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	－円	237,595円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	－円	811,003円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	－円	550,423円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	－円	1,175,545円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	－円	41,547円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	37,941円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	338,731円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	364,996円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	978,271円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	36,554,930,032円	36,793,469,763円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	816,514,087円	765,964,168円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,899,738,685円	2,673,224,321円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,949,143,393円	2,791,900,084円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	382,332,675円	329,271,189円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,242,482,131円	1,119,268,669円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,100,776,018円	1,054,683,588円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	59,530,357円	46,713,000円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,318,320,660円	1,161,767,467円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	28,435,219円	24,024,004円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	35,217,725円	39,477,748円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	68,814,338円	97,811,246円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	140,148,670円	189,483,338円
投資のソムリエ	1,146,020,551円	1,008,877,316円
クルーズコントロール	1,099,018,981円	201,841,066円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	36,165,399円	69,455,867円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	114,712,450円	147,946,865円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	122,053,447円	205,022,193円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	405,651円	74,862円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	10,061,702円	1,239,139円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	32,908,087円	3,802,586円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	13,983,088円	22,937,313円
ダイナミック・ナビゲーション	1,427,701円	726,871円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	75,809,247円	355,728,259円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	－円	668,403円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	－円	513,926円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	－円	108,503円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	1,237,938円
ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	313,751,716円	－円

ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	86,560,257円	70,701,371円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	209,554,515円	132,883,832円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	389,570,983円	292,283,119円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,792,261円	16,233,373円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	117,532,264円	70,408,344円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,346,280円	17,521,498円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	30,052,812円	21,833,378円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	831,235,040円	31,638,558円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	374,549,335円	56,259,704円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,451,571,979円	1,071,953,946円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,289,496,820円	1,013,017,452円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,504,438,578円	2,782,258,327円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	275,194,302円	201,418,412円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	426,211,367円	96,974,567円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	793,276,429円	591,732,801円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	3,115,298,558円	1,652,857,363円

ＤＩＡＭ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	10,313,671円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,034,605,688円	36,951,217円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,854,751,930円	1,108,127,625円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,487,572,950円	15,040,555,136円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	674,423,695円	541,254,717円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,103,188,596円	1,724,496,050円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,713,549,624円	9,829,818,156円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,605,415円	519,843円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	81,551円	9,093,798円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,672,150円	3,718,064円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,473,010,652円	8,747,496,476円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	94,419,937円	70,015,367円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,859,295円	27,507,643円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,633,726円	18,240,489円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	73,509円	15,682,249円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	119,539円	109,957円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ	612,913,713円	426,902,115円

	（１２１２）（適格機関投資家限定）		
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,622,373,744円	1,323,021,834円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	2,159,696,264円	1,764,382,103円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	91,571,301円	76,281,237円
	計	125,576,804,116円	109,160,728,872円
２．	受益権の総数	125,576,804,116口	109,160,728,872口
３．	※２　差入代用有価証券	株式　3,203,000,000円	株式　3,661,500,000円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月8日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月8日から平成30年2月26日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成29年2月27日 現在				平成30年2月26日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買　建	4,740,289,900	－	4,701,690,000	△38,599,900	5,334,250,000	－	5,320,705,000	△13,545,000
合計	4,740,289,900	－	4,701,690,000	△38,599,900	5,334,250,000	－	5,320,705,000	△13,545,000

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

平成30年2月26日現在

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

鹿島建設	558,000	1,029.00	574,182,000	
不動テトラ	96,500	195.00	18,817,500	
大末建設	4,100	1,049.00	4,300,900	
鉄建建設	7,700	3,150.00	24,255,000	
西松建設	29,300	2,740.00	80,282,000	
三井住友建設	91,600	638.00	58,440,800	
大豊建設	46,000	642.00	29,532,000	
前田建設工業	90,600	1,289.00	116,783,400	
佐田建設	8,400	488.00	4,099,200	
ナカノフドー建設	9,700	619.00	6,004,300	
奥村組	20,900	4,710.00	98,439,000	
東鉄工業	15,300	3,400.00	52,020,000	
イチケン	2,300	2,546.00	5,855,800	
淺沼組	45,000	454.00	20,430,000	
戸田建設	148,000	818.00	121,064,000	
熊谷組	19,900	3,210.00	63,879,000	
青木あすなろ建設	8,300	1,018.00	8,449,400	
北野建設	27,000	443.00	11,961,000	
植木組	1,600	2,714.00	4,342,400	
三井ホーム	16,000	722.00	11,552,000	
矢作建設工業	17,300	834.00	14,428,200	
ピーエス三菱	15,100	860.00	12,986,000	
日本ハウスホールディングス	24,300	664.00	16,135,200	
大東建託	46,000	18,135.00	834,210,000	
新日本建設	15,100	1,064.00	16,066,400	
ＮＩＰＰＯ	29,400	2,577.00	75,763,800	
東亜道路工業	2,600	4,280.00	11,128,000	
前田道路	40,000	2,388.00	95,520,000	
日本道路	3,400	5,880.00	19,992,000	
東亜建設工業	10,300	2,298.00	23,669,400	
若築建設	6,900	1,732.00	11,950,800	
東洋建設	39,900	552.00	22,024,800	
五洋建設	151,100	775.00	117,102,500	
世紀東急工業	17,200	732.00	12,590,400	
福田組	4,100	6,620.00	27,142,000	
日本ドライケミカル	1,500	2,556.00	3,834,000	
住友林業	81,200	1,852.00	150,382,400	
日本基礎技術	14,200	419.00	5,949,800	
日成ビルド工業	18,800	1,301.00	24,458,800	
ヤマダ・エスバイエルホーム	58,000	84.00	4,872,000	
巴コーポレーション	15,900	615.00	9,778,500	
大和ハウス工業	375,300	4,016.00	1,507,204,800	
ライト工業	24,500	1,186.00	29,057,000	
積水ハウス	413,300	1,922.50	794,569,250	
日特建設	10,900	671.00	7,313,900	
北陸電気工事	7,100	1,157.00	8,214,700	
ユアテック	20,000	855.00	17,100,000	

西部電気工業	2,100	2,791.00	5,861,100	
四電工	1,900	2,795.00	5,310,500	
中電工	16,400	3,065.00	50,266,000	
関電工	50,600	1,220.00	61,732,000	
きんでん	84,500	1,769.00	149,480,500	
東京エネシス	14,400	1,215.00	17,496,000	
トーエネック	3,600	3,255.00	11,718,000	
住友電設	10,100	2,282.00	23,048,200	
日本電設工業	19,500	2,228.00	43,446,000	
協和エクシオ	45,600	2,881.00	131,373,600	
新日本空調	9,800	1,617.00	15,846,600	
日本工営	7,300	2,934.00	21,418,200	
ＮＤＳ	2,000	4,470.00	8,940,000	
九電工	25,100	5,050.00	126,755,000	
三機工業	26,900	1,194.00	32,118,600	
日揮	109,400	2,417.00	264,419,800	
中外炉工業	3,900	2,473.00	9,644,700	
ヤマト	10,500	829.00	8,704,500	
太平電業	8,600	2,636.00	22,669,600	
高砂熱学工業	35,000	2,003.00	70,105,000	
三晃金属工業	1,400	4,225.00	5,915,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	12,300	2,807.00	34,526,100	
朝日工業社	2,600	3,545.00	9,217,000	
明星工業	23,000	786.00	18,078,000	
大氣社	16,800	3,715.00	62,412,000	
ダイダン	8,500	2,416.00	20,536,000	
日比谷総合設備	14,200	2,031.00	28,840,200	
東芝プラントシステム	27,500	2,110.00	58,025,000	
日本製粉	37,700	1,650.00	62,205,000	
日清製粉グループ本社	139,300	2,125.00	296,012,500	
日東富士製粉	800	4,855.00	3,884,000	
昭和産業	10,400	2,810.00	29,224,000	
鳥越製粉	10,100	988.00	9,978,800	
中部飼料	13,900	2,046.00	28,439,400	
フィード・ワン	76,600	247.00	18,920,200	
東洋精糖	2,000	1,216.00	2,432,000	
日本甜菜製糖	6,500	2,409.00	15,658,500	
三井製糖	9,000	4,245.00	38,205,000	
塩水港精糖	13,700	287.00	3,931,900	
日新製糖	5,400	2,254.00	12,171,600	
ＬＩＦＵＬＬ	37,700	1,115.00	42,035,500	
ジェイエイシーリクルートメント	8,700	2,310.00	20,097,000	
日本M＆Aセンター	37,500	6,840.00	256,500,000	
メンバーズ	2,700	1,049.00	2,832,300	
中広	1,200	734.00	880,800	
タケエイ	11,300	1,276.00	14,418,800	
トラスト・テック	4,900	3,325.00	16,292,500	

コシダカホールディングス	5,700	7,190.00	40,983,000	
パソナグループ	10,300	2,271.00	23,391,300	
ＣＤＳ	3,000	1,344.00	4,032,000	
リンクアンドモチベーション	19,900	1,121.00	22,307,900	
ＧＣＡ	12,400	958.00	11,879,200	
エス・エム・エス	21,400	4,345.00	92,983,000	
パーソルホールディングス	100,000	2,758.00	275,800,000	
リニカル	7,000	1,497.00	10,479,000	
クックパッド	34,100	602.00	20,528,200	
エスクリ	3,800	980.00	3,724,000	
アイ・ケイ・ケイ	6,400	766.00	4,902,400	
森永製菓	26,700	4,970.00	132,699,000	
中村屋	2,900	4,805.00	13,934,500	
江崎グリコ	31,800	5,270.00	167,586,000	
名糖産業	5,500	1,566.00	8,613,000	
井村屋グループ	4,500	4,120.00	18,540,000	
不二家	7,300	2,561.00	18,695,300	
山崎製パン	93,100	2,150.00	200,165,000	
第一屋製パン	2,000	1,141.00	2,282,000	
モロゾフ	1,900	6,730.00	12,787,000	
亀田製菓	7,100	5,160.00	36,636,000	
寿スピリッツ	11,000	6,040.00	66,440,000	
カルビー	51,800	3,650.00	189,070,000	
森永乳業	22,800	4,325.00	98,610,000	
六甲バター	5,700	2,329.00	13,275,300	
ヤクルト本社	68,100	7,720.00	525,732,000	
明治ホールディングス	75,300	7,940.00	597,882,000	
雪印メグミルク	27,400	2,859.00	78,336,600	
プリマハム	80,000	646.00	51,680,000	
日本ハム	98,000	2,435.00	238,630,000	
林兼産業	4,100	838.00	3,435,800	
丸大食品	61,000	505.00	30,805,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,000	4,365.00	34,920,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	73,300	908.00	66,556,400	
学情	5,000	1,623.00	8,115,000	
スタジオアリス	5,400	2,691.00	14,531,400	
シミックホールディングス	6,000	2,656.00	15,936,000	
システナ	8,900	4,395.00	39,115,500	
ＮＪＳ	2,700	1,666.00	4,498,200	
デジタルアーツ	5,500	3,945.00	21,697,500	
新日鉄住金ソリューションズ	17,500	2,848.00	49,840,000	
綜合警備保障	43,100	4,995.00	215,284,500	
キューブシステム	6,500	837.00	5,440,500	
いちご	159,800	456.00	72,868,800	
エイジア	1,700	1,548.00	2,631,600	
日本駐車場開発	135,100	186.00	25,128,600	
コア	4,700	1,325.00	6,227,500	

カカクコム	83,300	1,849.00	154,021,700	
アイロムグループ	3,700	3,150.00	11,655,000	
セントケア・ホールディング	4,600	743.00	3,417,800	
サイネックス	1,600	898.00	1,436,800	
ルネサンス	5,300	1,782.00	9,444,600	
ディップ	15,300	3,245.00	49,648,500	
ＳＢＳホールディングス	11,200	1,426.00	15,971,200	
オプトホールディング	7,600	1,246.00	9,469,600	
新日本科学	13,200	556.00	7,339,200	
ツクイ	25,500	845.00	21,547,500	
キャリアデザインセンター	2,500	2,151.00	5,377,500	
エムスリー	114,000	4,210.00	479,940,000	
ツカダ・グローバルホールディング	8,700	625.00	5,437,500	
ブラス	600	1,078.00	646,800	
アウトソーシング	32,300	2,253.00	72,771,900	
ウェルネット	11,000	1,172.00	12,892,000	
ワールドホールディングス	3,600	3,985.00	14,346,000	
ディー・エヌ・エー	58,400	1,956.00	114,230,400	
博報堂ＤＹホールディングス	150,600	1,574.00	237,044,400	
ぐるなび	17,200	1,496.00	25,731,200	
エスアールジータカミヤ	12,800	674.00	8,627,200	
ジャパンベストレスキューシステム	13,500	800.00	10,800,000	
ファンコミュニケーションズ	30,200	750.00	22,650,000	
ライク	4,300	1,970.00	8,471,000	
ビジネス・ブレークスルー	5,200	486.00	2,527,200	
ＷＤＢホールディングス	5,000	4,105.00	20,525,000	
ティア	5,700	1,035.00	5,899,500	
ＣＤＧ	1,000	1,812.00	1,812,000	
バリューコマース	9,700	1,339.00	12,988,300	
インフォマート	54,800	928.00	50,854,400	
サッポロホールディングス	41,600	3,200.00	133,120,000	
アサヒグループホールディングス	238,400	5,518.00	1,315,491,200	
キリンホールディングス	547,000	2,833.00	1,549,651,000	
宝ホールディングス	85,200	1,335.00	113,742,000	
オエノンホールディングス	32,500	436.00	14,170,000	
養命酒製造	3,500	2,338.00	8,183,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	79,900	4,045.00	323,195,500	
サントリー食品インターナショナル	87,000	5,030.00	437,610,000	
ダイドーグループホールディングス	5,800	6,620.00	38,396,000	
伊藤園	37,700	4,580.00	172,666,000	
キーコーヒー	11,200	2,138.00	23,945,600	
ユニカフェ	3,500	1,168.00	4,088,000	
ジャパンフーズ	1,600	1,502.00	2,403,200	
日清オイリオグループ	13,400	2,935.00	39,329,000	
不二製油グループ本社	30,800	3,165.00	97,482,000	
かどや製油	1,200	6,620.00	7,944,000	

Ｊ－オイルミルズ	5,900	3,710.00	21,889,000	
ローソン	28,300	7,160.00	202,628,000	
サンエー	8,400	5,440.00	45,696,000	
カワチ薬品	8,700	2,645.00	23,011,500	
エービーシー・マート	20,300	6,860.00	139,258,000	
ハードオフコーポレーション	4,900	1,157.00	5,669,300	
高千穂交易	4,300	1,253.00	5,387,900	
アスクル	9,700	3,895.00	37,781,500	
ゲオホールディングス	20,400	1,974.00	40,269,600	
アダストリア	17,200	2,304.00	39,628,800	
ジーフット	6,700	760.00	5,092,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,500	722.00	1,083,000	
伊藤忠食品	2,700	5,840.00	15,768,000	
くらコーポレーション	6,600	6,520.00	43,032,000	
キャンドゥ	5,300	1,760.00	9,328,000	
エレマテック	5,200	2,553.00	13,275,600	
パルグループホールディングス	5,700	3,005.00	17,128,500	
ＪＡＬＵＸ	3,200	3,230.00	10,336,000	
エディオン	43,400	1,298.00	56,333,200	
あらた	5,500	5,030.00	27,665,000	
サーラコーポレーション	19,200	683.00	13,113,600	
ワッツ	4,500	1,058.00	4,761,000	
トーメンデバイス	1,700	2,915.00	4,955,500	
ハローズ	4,200	2,468.00	10,365,600	
ＪＰホールディングス	34,100	317.00	10,809,700	
あみやき亭	2,400	5,280.00	12,672,000	
東京エレクトロン　デバイス	4,000	2,154.00	8,616,000	
ひらまつ	15,400	560.00	8,624,000	
フィールズ	8,500	1,195.00	10,157,500	
双日	660,700	351.00	231,905,700	
アルフレッサ　ホールディングス	124,100	2,377.00	294,985,700	
大黒天物産	2,700	5,260.00	14,202,000	
ハニーズホールディングス	10,800	1,039.00	11,221,200	
ファーマライズホールディングス	2,600	610.00	1,586,000	
キッコーマン	88,900	4,285.00	380,936,500	
味の素	261,700	1,962.00	513,455,400	
キユーピー	63,400	2,972.00	188,424,800	
ハウス食品グループ本社	43,400	3,670.00	159,278,000	
カゴメ	45,600	3,645.00	166,212,000	
焼津水産化学工業	5,500	1,218.00	6,699,000	
アリアケジャパン	10,400	8,520.00	88,608,000	
ピエトロ	1,500	1,687.00	2,530,500	
エバラ食品工業	2,500	2,165.00	5,412,500	
ニチレイ	54,200	2,721.00	147,478,200	
横浜冷凍	27,000	1,116.00	30,132,000	
東洋水産	62,400	4,210.00	262,704,000	
イートアンド	3,200	2,191.00	7,011,200	

大冷	1,300	2,213.00	2,876,900	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	1,707.00	2,901,900	
日清食品ホールディングス	49,600	7,380.00	366,048,000	
永谷園ホールディングス	12,000	1,505.00	18,060,000	
一正蒲鉾	4,400	1,278.00	5,623,200	
フジッコ	12,300	2,365.00	29,089,500	
ロック・フィールド	12,300	2,141.00	26,334,300	
日本たばこ産業	704,100	3,066.00	2,158,770,600	
ケンコーマヨネーズ	7,500	3,695.00	27,712,500	
わらべや日洋ホールディングス	7,500	2,558.00	19,185,000	
なとり	6,400	1,996.00	12,774,400	
イフジ産業	2,000	789.00	1,578,000	
ピックルスコーポレーション	1,700	1,866.00	3,172,200	
北の達人コーポレーション	32,700	736.00	24,067,200	
ユーグレナ	43,900	1,000.00	43,900,000	
片倉工業	13,700	1,385.00	18,974,500	
グンゼ	8,900	5,830.00	51,887,000	
ヒューリック	233,500	1,208.00	282,068,000	
神栄	1,500	1,470.00	2,205,000	
ラサ商事	5,000	948.00	4,740,000	
アルペン	8,600	2,468.00	21,224,800	
ハブ	2,100	1,250.00	2,625,000	
ラクーン	6,600	758.00	5,002,800	
クオール	12,300	2,289.00	28,154,700	
アルコニックス	11,800	2,449.00	28,898,200	
神戸物産	7,200	4,320.00	31,104,000	
ソリトンシステムズ	3,700	1,445.00	5,346,500	
ジンズ	7,600	5,420.00	41,192,000	
ビックカメラ	64,700	1,625.00	105,137,500	
ＤＣＭホールディングス	60,200	1,070.00	64,414,000	
ペッパーフードサービス	6,000	4,855.00	29,130,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	39,700	3,510.00	139,347,000	
東京一番フーズ	2,400	754.00	1,809,600	
ＤＤホールディングス	2,500	3,650.00	9,125,000	
あい　ホールディングス	17,900	2,864.00	51,265,600	
ディーブイエックス	4,000	1,273.00	5,092,000	
きちり	3,100	735.00	2,278,500	
アークランドサービスホールディングス	9,300	2,290.00	21,297,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	133,400	1,957.00	261,063,800	
ドトール・日レスホールディングス	19,600	2,514.00	49,274,400	
マツモトキヨシホールディングス	46,200	4,515.00	208,593,000	
ブロンコビリー	5,800	3,355.00	19,459,000	
スタートトゥデイ	109,700	2,904.00	318,568,800	
トレジャー・ファクトリー	3,300	845.00	2,788,500	
物語コーポレーション	3,200	10,010.00	32,032,000	
ココカラファイン	11,700	6,950.00	81,315,000	

三越伊勢丹ホールディングス	208,800	1,261.00	263,296,800	
東洋紡	43,900	2,088.00	91,663,200	
ユニチカ	34,600	718.00	24,842,800	
富士紡ホールディングス	6,600	4,430.00	29,238,000	
日清紡ホールディングス	69,300	1,637.00	113,444,100	
倉敷紡績	120,000	358.00	42,960,000	
ダイワボウホールディングス	9,500	4,265.00	40,517,500	
シキボウ	6,000	1,386.00	8,316,000	
日東紡績	16,900	2,509.00	42,402,100	
トヨタ紡織	33,000	2,344.00	77,352,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	20,700	2,906.00	60,154,200	
Ｈａｍｅｅ	2,800	1,910.00	5,348,000	
ラクト・ジャパン	1,600	3,835.00	6,136,000	
ウエルシアホールディングス	29,500	4,735.00	139,682,500	
クリエイトＳＤホールディングス	16,500	2,720.00	44,880,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,000	1,028.00	21,588,000	
八洲電機	8,700	899.00	7,821,300	
メディアスホールディングス	1,800	2,970.00	5,346,000	
ＵＫＣホールディングス	7,200	2,336.00	16,819,200	
ジューテックホールディングス	2,600	1,307.00	3,398,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	13,000	343.00	4,459,000	
大光	2,600	918.00	2,386,800	
ＯＣＨＩホールディングス	3,200	1,517.00	4,854,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	59,000	1,161.00	68,499,000	
ミサワ	1,800	447.00	804,600	
ティーライフ	1,500	1,294.00	1,941,000	
大阪工機	1,700	1,096.00	1,863,200	
エー・ピーカンパニー	2,200	821.00	1,806,200	
三洋貿易	6,100	2,364.00	14,420,400	
チムニー	3,400	2,939.00	9,992,600	
シュッピン	6,800	1,291.00	8,778,800	
ビューティガレージ	1,500	2,168.00	3,252,000	
ウイン・パートナーズ	8,100	1,838.00	14,887,800	
ネクステージ	11,400	1,052.00	11,992,800	
ジョイフル本田	16,400	3,660.00	60,024,000	
鳥貴族	4,100	3,030.00	12,423,000	
キリン堂ホールディングス	3,900	1,930.00	7,527,000	
ホットランド	6,500	1,290.00	8,385,000	
すかいらーく	69,300	1,485.00	102,910,500	
綿半ホールディングス	4,200	3,890.00	16,338,000	
日本毛織	33,400	1,093.00	36,506,200	
ダイトウボウ	18,800	117.00	2,199,600	
トーア紡コーポレーション	5,100	589.00	3,003,900	
ダイドーリミテッド	13,500	479.00	6,466,500	
ヨシックス	1,800	3,920.00	7,056,000	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,100	1,096.00	40,661,600	
三栄建築設計	4,500	2,183.00	9,823,500	
スター・マイカ	4,100	2,011.00	8,245,100	
野村不動産ホールディングス	74,400	2,649.00	197,085,600	
三重交通グループホールディングス	22,700	523.00	11,872,100	
サムティ	9,500	1,930.00	18,335,000	
ディア・ライフ	11,300	560.00	6,328,000	
コーセーアールイー	1,900	1,119.00	2,126,100	
エー・ディー・ワークス	150,000	44.00	6,600,000	
日本商業開発	6,300	1,900.00	11,970,000	
プレサンスコーポレーション	15,300	1,643.00	25,137,900	
ユニゾホールディングス	13,100	2,889.00	37,845,900	
ＴＨＥグローバル社	5,300	924.00	4,897,200	
日本管理センター	7,400	1,757.00	13,001,800	
サンセイランディック	3,300	1,382.00	4,560,600	
エストラスト	1,600	983.00	1,572,800	
フージャースホールディングス	27,200	828.00	22,521,600	
オープンハウス	18,200	6,690.00	121,758,000	
東急不動産ホールディングス	270,800	817.00	221,243,600	
飯田グループホールディングス	93,300	2,015.00	187,999,500	
ムゲンエステート	6,900	1,356.00	9,356,400	
帝国繊維	12,400	1,987.00	24,638,800	
ブックオフコーポレーション	6,400	849.00	5,433,600	
日本コークス工業	96,100	116.00	11,147,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	1,012.00	4,554,000	
ミタチ産業	2,600	1,641.00	4,266,600	
ＢＥＥＮＯＳ	1,500	1,686.00	2,529,000	
あさひ	8,300	1,358.00	11,271,400	
日本調剤	3,900	3,590.00	14,001,000	
コスモス薬品	5,600	19,970.00	111,832,000	
シップヘルスケアホールディングス	23,300	3,750.00	87,375,000	
トーエル	5,500	1,021.00	5,615,500	
一六堂	2,500	449.00	1,122,500	
ソフトクリエイトホールディングス	5,400	1,501.00	8,105,400	
オンリー	1,700	925.00	1,572,500	
セブン＆アイ・ホールディングス	468,100	4,448.00	2,082,108,800	
薬王堂	4,900	3,515.00	17,223,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	30,000	1,209.00	36,270,000	
明治電機工業	3,800	2,019.00	7,672,200	
ツルハホールディングス	24,200	15,500.00	375,100,000	
デリカフーズホールディングス	2,200	1,445.00	3,179,000	
スターティア	2,500	1,056.00	2,640,000	
サンマルクホールディングス	8,000	3,260.00	26,080,000	
フェリシモ	2,900	1,265.00	3,668,500	
トリドールホールディングス	13,800	3,770.00	52,026,000	

帝人	97,000	2,140.00	207,580,000	
東レ	861,500	1,100.50	948,080,750	
クラレ	199,900	1,874.00	374,612,600	
旭化成	740,700	1,381.00	1,022,906,700	
サカイオーベックス	3,100	2,739.00	8,490,900	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	6,600	1,432.00	9,451,200	
稲葉製作所	6,300	1,374.00	8,656,200	
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,392.00	7,654,400	
トーカロ	31,200	1,451.00	45,271,200	
アルファ	4,000	1,889.00	7,556,000	
ＳＵＭＣＯ	103,300	2,807.00	289,963,100	
川田テクノロジーズ	2,300	6,030.00	13,869,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,600	8,080.00	12,928,000	
ファーストブラザーズ	3,100	1,443.00	4,473,300	
ハウスドゥ	1,800	2,917.00	5,250,600	
シーアールイー	1,800	1,678.00	3,020,400	
ケイアイスター不動産	4,000	2,836.00	11,344,000	
住江織物	3,000	2,955.00	8,865,000	
日本フエルト	6,400	531.00	3,398,400	
イチカワ	8,000	382.00	3,056,000	
エコナックホールディングス	21,700	129.00	2,799,300	
日東製網	1,300	1,819.00	2,364,700	
芦森工業	2,400	2,407.00	5,776,800	
アツギ	7,900	1,212.00	9,574,800	
コメダホールディングス	20,600	2,078.00	42,806,800	
サツドラホールディングス	1,500	1,919.00	2,878,500	
ダイユー・リックホールディングス	5,200	1,265.00	6,578,000	
バロックジャパンリミテッド	8,900	926.00	8,241,400	
クスリのアオキホールディングス	8,900	6,020.00	53,578,000	
ダイニック	4,600	1,087.00	5,000,200	
共和レザー	6,900	996.00	6,872,400	
スシローグローバルホールディングス	10,700	4,815.00	51,520,500	
ＬＩＸＩＬビバ	10,600	2,169.00	22,991,400	
セーレン	27,300	2,121.00	57,903,300	
ソトー	4,400	1,079.00	4,747,600	
東海染工	1,700	1,580.00	2,686,000	
小松精練	18,200	1,133.00	20,620,600	
ワコールホールディングス	32,800	3,175.00	104,140,000	
ホギメディカル	7,500	8,570.00	64,275,000	
レナウン	32,300	187.00	6,040,100	
クラウディアホールディングス	2,900	564.00	1,635,600	
ＴＳＩホールディングス	44,800	768.00	34,406,400	
マツオカコーポレーション	2,100	3,910.00	8,211,000	
ＴＩＳ	37,100	3,960.00	146,916,000	
ネオス	3,400	425.00	1,445,000	
電算システム	3,900	1,984.00	7,737,600	
グリー	59,600	683.00	40,706,800	

コーエーテクモホールディングス	18,900	2,255.00	42,619,500	
三菱総合研究所	4,800	3,455.00	16,584,000	
ボルテージ	2,100	992.00	2,083,200	
電算	1,300	2,636.00	3,426,800	
ＡＧＳ	6,300	859.00	5,411,700	
ファインデックス	9,300	744.00	6,919,200	
ヒト・コミュニケーションズ	2,500	1,931.00	4,827,500	
ブレインパッド	2,400	2,393.00	5,743,200	
ＫＬａｂ	21,600	1,642.00	35,467,200	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,100	2,281.00	18,476,100	
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	983.00	1,769,400	
ネクソン	124,000	3,990.00	494,760,000	
アイスタイル	27,900	1,574.00	43,914,600	
エムアップ	3,700	1,139.00	4,214,300	
エイチーム	7,600	2,638.00	20,048,800	
テクノスジャパン	10,100	963.00	9,726,300	
ｅｎｉｓｈ	3,300	1,044.00	3,445,200	
コロプラ	36,100	989.00	35,702,900	
モバイルクリエイト	8,600	369.00	3,173,400	
オルトプラス	5,400	959.00	5,178,600	
ブロードリーフ	27,600	1,219.00	33,644,400	
ハーツユナイテッドグループ	5,900	1,595.00	9,410,500	
メディアドゥホールディングス	3,600	1,938.00	6,976,800	
ブイキューブ	6,900	507.00	3,498,300	
サイバーリンクス	1,800	1,327.00	2,388,600	
ディー・エル・イー	5,100	478.00	2,437,800	
フィックスターズ	1,900	8,340.00	15,846,000	
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	5,700	1,261.00	7,187,700	
オプティム	1,900	2,472.00	4,696,800	
セレス	3,400	1,846.00	6,276,400	
特種東海製紙	6,500	4,220.00	27,430,000	
ベリサーブ	1,400	3,235.00	4,529,000	
ティーガイア	11,100	3,005.00	33,355,500	
セック	1,100	3,375.00	3,712,500	
日本アジアグループ	11,700	544.00	6,364,800	
豆蔵ホールディングス	8,300	1,210.00	10,043,000	
テクマトリックス	6,100	1,744.00	10,638,400	
プロシップ	1,600	2,283.00	3,652,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	301,700	390.00	117,663,000	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	7,800	9,010.00	70,278,000	
ザッパラス	5,500	390.00	2,145,000	
システムリサーチ	1,100	2,373.00	2,610,300	
インターネットイニシアティブ	18,100	2,293.00	41,503,300	
さくらインターネット	13,300	770.00	10,241,000	
ＧＭＯクラウド	2,500	2,442.00	6,105,000	

ＳＲＡホールディングス	5,900	3,445.00	20,325,500	
ＭＩＮＯＲＩソリューションズ	2,200	1,576.00	3,467,200	
システムインテグレータ	1,600	1,102.00	1,763,200	
朝日ネット	10,200	525.00	5,355,000	
ｅＢＡＳＥ	2,200	1,241.00	2,730,200	
アドソル日進	4,300	1,345.00	5,783,500	
フリービット	7,400	923.00	6,830,200	
コムチュア	5,700	3,565.00	20,320,500	
サイバーコム	2,000	1,314.00	2,628,000	
王子ホールディングス	500,000	714.00	357,000,000	
日本製紙	53,200	2,158.00	114,805,600	
三菱製紙	16,900	685.00	11,576,500	
北越紀州製紙	66,300	706.00	46,807,800	
中越パルプ工業	4,700	1,900.00	8,930,000	
巴川製紙所	18,000	311.00	5,598,000	
大王製紙	47,300	1,545.00	73,078,500	
阿波製紙	2,900	648.00	1,879,200	
メディカル・データ・ビジョン	4,200	3,275.00	13,755,000	
ｇｕｍｉ	12,800	1,041.00	13,324,800	
ショーケース・ティービー	2,200	1,599.00	3,517,800	
モバイルファクトリー	2,100	1,357.00	2,849,700	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,700	3,285.00	5,584,500	
ＰＣＩホールディングス	1,900	3,275.00	6,222,500	
パイプドHD	1,800	1,485.00	2,673,000	
アイビーシー	1,200	1,714.00	2,056,800	
オープンドア	4,400	2,302.00	10,128,800	
マイネット	2,200	1,481.00	3,258,200	
アカツキ	2,200	6,130.00	13,486,000	
ＬＩＮＥ	33,600	4,340.00	145,824,000	
レンゴー	114,500	938.00	107,401,000	
トーモク	6,800	2,085.00	14,178,000	
ザ・パック	8,400	3,770.00	31,668,000	
シンクロ・フード	900	4,720.00	4,248,000	
オークネット	3,500	1,450.00	5,075,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	9,100	1,243.00	11,311,300	
マクロミル	10,400	2,895.00	30,108,000	
昭和電工	79,100	5,250.00	415,275,000	
住友化学	874,000	668.00	583,832,000	
住友精化	4,900	5,470.00	26,803,000	
日産化学工業	69,100	4,170.00	288,147,000	
ラサ工業	4,200	2,417.00	10,151,400	
クレハ	10,300	7,590.00	78,177,000	
多木化学	1,600	4,445.00	7,112,000	
テイカ	9,100	2,809.00	25,561,900	
石原産業	21,300	1,553.00	33,078,900	
片倉コープアグリ	2,900	1,279.00	3,709,100	

日東エフシー	6,900	781.00	5,388,900	
日本曹達	82,000	669.00	54,858,000	
東ソー	171,700	2,269.00	389,587,300	
トクヤマ	34,500	3,270.00	112,815,000	
セントラル硝子	24,200	2,441.00	59,072,200	
東亞合成	69,700	1,242.00	86,567,400	
大阪ソーダ	10,700	2,878.00	30,794,600	
関東電化工業	28,400	1,250.00	35,500,000	
デンカ	43,600	3,940.00	171,784,000	
イビデン	69,400	1,758.00	122,005,200	
信越化学工業	197,800	11,460.00	2,266,788,000	
日本カーバイド工業	3,800	2,254.00	8,565,200	
堺化学工業	8,100	3,050.00	24,705,000	
エア・ウォーター	97,900	2,161.00	211,561,900	
大陽日酸	91,500	1,569.00	143,563,500	
日本化学工業	4,400	3,375.00	14,850,000	
東邦アセチレン	1,700	1,565.00	2,660,500	
日本パーカライジング	60,700	1,928.00	117,029,600	
高圧ガス工業	17,600	909.00	15,998,400	
チタン工業	1,300	2,847.00	3,701,100	
四国化成工業	17,100	1,549.00	26,487,900	
戸田工業	2,400	3,745.00	8,988,000	
ステラ　ケミファ	6,100	2,839.00	17,317,900	
保土谷化学工業	3,900	4,885.00	19,051,500	
日本触媒	18,700	7,560.00	141,372,000	
大日精化工業	9,200	4,655.00	42,826,000	
カネカ	160,000	1,098.00	175,680,000	
協和発酵キリン	142,100	2,341.00	332,656,100	
三菱瓦斯化学	97,900	2,626.00	257,085,400	
三井化学	108,000	3,300.00	356,400,000	
ＪＳＲ	119,400	2,451.00	292,649,400	
東京応化工業	20,600	4,085.00	84,151,000	
大阪有機化学工業	7,700	1,556.00	11,981,200	
三菱ケミカルホールディングス	795,400	1,098.50	873,746,900	
ＫＨネオケム	18,200	3,115.00	56,693,000	
ダイセル	160,200	1,202.00	192,560,400	
住友ベークライト	96,000	935.00	89,760,000	
積水化学工業	246,700	2,024.00	499,320,800	
日本ゼオン	100,200	1,584.00	158,716,800	
アイカ工業	33,300	4,115.00	137,029,500	
宇部興産	59,800	3,310.00	197,938,000	
積水樹脂	18,300	2,482.00	45,420,600	
タキロンシーアイ	24,000	746.00	17,904,000	
旭有機材	7,000	2,127.00	14,889,000	
日立化成	58,700	2,425.00	142,347,500	
ニチバン	5,800	3,240.00	18,792,000	
リケンテクノス	25,600	536.00	13,721,600	

大倉工業	28,000	576.00	16,128,000	
積水化成品工業	14,900	1,190.00	17,731,000	
群栄化学工業	2,800	3,565.00	9,982,000	
タイガースポリマー	5,900	887.00	5,233,300	
ミライアル	3,900	2,068.00	8,065,200	
ダイキアクシス	4,000	1,699.00	6,796,000	
ダイキョーニシカワ	23,400	1,855.00	43,407,000	
竹本容器	1,300	2,500.00	3,250,000	
森六ホールディングス	4,500	3,040.00	13,680,000	
日本化薬	77,100	1,383.00	106,629,300	
カーリットホールディングス	11,000	1,185.00	13,035,000	
ＥＰＳホールディングス	16,300	2,296.00	37,424,800	
ソルクシーズ	4,300	1,116.00	4,798,800	
レッグス	2,700	928.00	2,505,600	
プレステージ・インターナショナル	22,500	1,417.00	31,882,500	
フェイス	3,900	1,168.00	4,555,200	
ハイマックス	1,500	1,857.00	2,785,500	
アミューズ	7,200	4,105.00	29,556,000	
野村総合研究所	74,400	4,670.00	347,448,000	
ドリームインキュベータ	3,600	2,796.00	10,065,600	
サイバネットシステム	9,200	760.00	6,992,000	
クイック	6,700	2,040.00	13,668,000	
ＴＡＣ	6,700	326.00	2,184,200	
ＣＥホールディングス	3,200	897.00	2,870,400	
ケネディクス	143,500	692.00	99,302,000	
日本システム技術	1,400	1,403.00	1,964,200	
電通	132,000	4,995.00	659,340,000	
インテージホールディングス	12,800	1,191.00	15,244,800	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	1,030.00	5,253,000	
東邦システムサイエンス	3,800	822.00	3,123,600	
ぴあ	3,600	5,510.00	19,836,000	
イオンファンタジー	3,500	4,815.00	16,852,500	
ソースネクスト	15,700	673.00	10,566,100	
シーティーエス	11,100	811.00	9,002,100	
ネクシィーズグループ	4,300	1,760.00	7,568,000	
メディカルシステムネットワーク	12,700	566.00	7,188,200	
日本精化	9,900	1,292.00	12,790,800	
扶桑化学工業	8,400	3,035.00	25,494,000	
ＡＤＥＫＡ	51,100	1,962.00	100,258,200	
日油	45,900	3,000.00	137,700,000	
ミヨシ油脂	4,400	1,422.00	6,256,800	
新日本理化	18,900	273.00	5,159,700	
ハリマ化成グループ	9,200	901.00	8,289,200	
花王	278,800	7,841.00	2,186,070,800	
第一工業製薬	23,000	795.00	18,285,000	
日華化学	3,800	1,187.00	4,510,600	
ニイタカ	1,700	1,854.00	3,151,800	

三洋化成工業	7,500	5,370.00	40,275,000	
武田薬品工業	417,700	6,064.00	2,532,932,800	
アステラス製薬	1,165,400	1,569.00	1,828,512,600	
大日本住友製薬	84,100	1,670.00	140,447,000	
塩野義製薬	162,200	5,688.00	922,593,600	
田辺三菱製薬	138,400	2,293.00	317,351,200	
わかもと製薬	14,000	282.00	3,948,000	
あすか製薬	12,900	2,172.00	28,018,800	
日本新薬	29,700	5,970.00	177,309,000	
ビオフェルミン製薬	1,900	2,897.00	5,504,300	
中外製薬	118,200	5,540.00	654,828,000	
科研製薬	20,500	6,030.00	123,615,000	
エーザイ	135,700	5,746.00	779,732,200	
理研ビタミン	4,300	4,085.00	17,565,500	
ロート製薬	62,300	3,015.00	187,834,500	
小野薬品工業	267,800	3,060.00	819,468,000	
久光製薬	33,500	7,710.00	258,285,000	
有機合成薬品工業	8,000	298.00	2,384,000	
持田製薬	7,900	7,840.00	61,936,000	
参天製薬	214,700	1,737.00	372,933,900	
扶桑薬品工業	4,000	2,859.00	11,436,000	
日本ケミファ	1,500	4,585.00	6,877,500	
ツムラ	40,500	3,600.00	145,800,000	
日医工	29,900	1,716.00	51,308,400	
テルモ	173,800	5,620.00	976,756,000	
みらかホールディングス	32,300	4,165.00	134,529,500	
キッセイ薬品工業	21,000	2,949.00	61,929,000	
生化学工業	22,000	2,093.00	46,046,000	
栄研化学	9,200	5,130.00	47,196,000	
日水製薬	4,800	1,347.00	6,465,600	
鳥居薬品	7,100	2,979.00	21,150,900	
ＪＣＲファーマ	8,000	5,410.00	43,280,000	
東和薬品	5,400	6,830.00	36,882,000	
富士製薬工業	3,900	4,445.00	17,335,500	
沢井製薬	22,800	5,130.00	116,964,000	
ゼリア新薬工業	24,300	2,141.00	52,026,300	
第一三共	324,500	3,875.00	1,257,437,500	
キョーリン製薬ホールディングス	31,700	2,093.00	66,348,100	
大幸薬品	6,000	2,118.00	12,708,000	
ダイト	6,600	3,545.00	23,397,000	
大塚ホールディングス	235,700	5,361.00	1,263,587,700	
大正製薬ホールディングス	25,400	9,850.00	250,190,000	
ペプチドリーム	50,800	5,020.00	255,016,000	
大日本塗料	13,600	1,597.00	21,719,200	
日本ペイントホールディングス	91,700	3,875.00	355,337,500	
関西ペイント	124,800	2,705.00	337,584,000	
神東塗料	9,000	255.00	2,295,000	

中国塗料	34,100	1,112.00	37,919,200	
日本特殊塗料	7,500	2,007.00	15,052,500	
藤倉化成	15,000	689.00	10,335,000	
太陽ホールディングス	9,100	4,845.00	44,089,500	
ＤＩＣ	46,900	3,985.00	186,896,500	
サカタインクス	24,200	1,403.00	33,952,600	
東洋インキＳＣホールディングス	117,000	686.00	80,262,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	7,900	1,390.00	10,981,000	
アルプス技研	9,500	2,325.00	22,087,500	
サニックス	17,400	279.00	4,854,600	
ダイオーズ	2,200	1,335.00	2,937,000	
日本空調サービス	11,400	762.00	8,686,800	
オリエンタルランド	128,000	10,640.00	1,361,920,000	
フォーカスシステムズ	6,300	939.00	5,915,700	
ダスキン	29,100	2,647.00	77,027,700	
パーク２４	62,000	2,566.00	159,092,000	
明光ネットワークジャパン	13,700	1,305.00	17,878,500	
ファルコホールディングス	5,600	1,789.00	10,018,400	
クレスコ	2,500	3,770.00	9,425,000	
フジ・メディア・ホールディングス	116,500	1,856.00	216,224,000	
秀英予備校	2,400	491.00	1,178,400	
田谷	2,000	704.00	1,408,000	
ラウンドワン	33,600	1,825.00	61,320,000	
リゾートトラスト	45,900	2,425.00	111,307,500	
オービック	35,100	8,690.00	305,019,000	
ジャストシステム	18,100	2,359.00	42,697,900	
ＴＤＣソフト	4,900	1,186.00	5,811,400	
ヤフー	802,300	535.00	429,230,500	
ビー・エム・エル	13,900	2,739.00	38,072,100	
ワタベウェディング	1,800	605.00	1,089,000	
トレンドマイクロ	54,300	6,090.00	330,687,000	
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,355.00	23,170,500	
インフォメーション・ディベロプメント	3,500	1,424.00	4,984,000	
リソー教育	18,400	817.00	15,032,800	
日本オラクル	18,000	8,420.00	151,560,000	
早稲田アカデミー	1,600	1,683.00	2,692,800	
アルファシステムズ	3,700	2,382.00	8,813,400	
フューチャー	15,100	1,244.00	18,784,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,400	1,124.00	9,441,600	
ソフトバンク・テクノロジー	4,700	2,081.00	9,780,700	
トーセ	3,000	1,908.00	5,724,000	
ユー・エス・エス	132,300	2,203.00	291,456,900	
オービックビジネスコンサルタント	5,700	6,240.00	35,568,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	25,300	4,370.00	110,561,000	
アイティフォー	13,600	785.00	10,676,000	
東京個別指導学院	3,800	1,304.00	4,955,200	

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

ＪＣＵ	7,000	5,320.00	37,240,000	
新田ゼラチン	7,800	819.00	6,388,200	
ＯＡＴアグリオ	1,600	2,898.00	4,636,800	
デクセリアルズ	29,000	1,398.00	40,542,000	
アース製薬	8,500	5,300.00	45,050,000	
北興化学工業	11,700	764.00	8,938,800	
大成ラミック	3,500	3,175.00	11,112,500	
クミアイ化学工業	51,600	668.00	34,468,800	
日本農薬	29,600	634.00	18,766,400	
昭和シェル石油	106,100	1,419.00	150,555,900	
富士興産	4,100	633.00	2,595,300	
ニチレキ	14,500	1,455.00	21,097,500	
ユシロ化学工業	6,400	1,878.00	12,019,200	
ビーピー・カストロール	4,900	1,785.00	8,746,500	
富士石油	27,600	450.00	12,420,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,100	1,907.00	7,818,700	
出光興産	95,200	4,105.00	390,796,000	
ＪＸＴＧホールディングス	1,809,700	674.30	1,220,280,710	
コスモエネルギーホールディングス	32,800	3,865.00	126,772,000	
横浜ゴム	65,600	2,653.00	174,036,800	
東洋ゴム工業	67,200	2,013.00	135,273,600	
ブリヂストン	400,800	4,812.00	1,928,649,600	
住友ゴム工業	116,700	2,102.00	245,303,400	
藤倉ゴム工業	9,900	837.00	8,286,300	
オカモト	39,000	1,123.00	43,797,000	
アキレス	8,600	2,238.00	19,246,800	
フコク	5,000	1,058.00	5,290,000	
ニッタ	11,700	4,125.00	48,262,500	
クリエートメディック	3,800	1,177.00	4,472,600	
住友理工	22,000	1,093.00	24,046,000	
三ツ星ベルト	28,000	1,192.00	33,376,000	
バンドー化学	21,600	1,223.00	26,416,800	
旭硝子	115,900	4,555.00	527,924,500	
日本板硝子	57,300	875.00	50,137,500	
石塚硝子	1,500	2,724.00	4,086,000	
有沢製作所	19,000	1,100.00	20,900,000	
日本山村硝子	47,000	185.00	8,695,000	
日本電気硝子	49,000	3,325.00	162,925,000	
オハラ	4,500	2,950.00	13,275,000	
住友大阪セメント	220,000	495.00	108,900,000	
太平洋セメント	71,600	4,000.00	286,400,000	
リソルホールディングス	1,200	4,530.00	5,436,000	
日本ヒューム	11,400	814.00	9,279,600	
日本コンクリート工業	24,500	478.00	11,711,000	
三谷セキサン	5,900	2,591.00	15,286,900	
アジアパイルホールディングス	14,700	682.00	10,025,400	
東海カーボン	103,000	1,884.00	194,052,000	

日本カーボン	5,800	6,250.00	36,250,000	
東洋炭素	7,400	4,090.00	30,266,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,700	5,430.00	36,381,000	
ＴＯＴＯ	87,200	5,760.00	502,272,000	
日本碍子	138,400	2,017.00	279,152,800	
日本特殊陶業	97,300	2,731.00	265,726,300	
ダントーホールディングス	9,000	149.00	1,341,000	
ＭＡＲＵＷＡ	3,900	8,420.00	32,838,000	
品川リフラクトリーズ	3,000	3,050.00	9,150,000	
黒崎播磨	2,200	5,090.00	11,198,000	
ヨータイ	6,800	887.00	6,031,600	
イソライト工業	5,800	929.00	5,388,200	
東京窯業	14,500	456.00	6,612,000	
ニッカトー	3,900	1,103.00	4,301,700	
フジミインコーポレーテッド	10,100	2,600.00	26,260,000	
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,242.00	3,105,000	
ニチアス	62,000	1,429.00	88,598,000	
新日鐵住金	501,800	2,626.00	1,317,726,800	
神戸製鋼所	205,300	1,222.00	250,876,600	
中山製鋼所	15,500	708.00	10,974,000	
合同製鐵	6,100	2,090.00	12,749,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	302,800	2,518.00	762,450,400	
日新製鋼	30,900	1,434.00	44,310,600	
東京製鐵	60,100	880.00	52,888,000	
共英製鋼	12,600	1,887.00	23,776,200	
大和工業	23,800	3,140.00	74,732,000	
東京鐵鋼	4,600	1,745.00	8,027,000	
大阪製鐵	7,400	2,179.00	16,124,600	
淀川製鋼所	16,400	3,130.00	51,332,000	
東洋鋼鈑	28,400	713.00	20,249,200	
丸一鋼管	39,700	3,375.00	133,987,500	
モリ工業	3,700	3,770.00	13,949,000	
大同特殊鋼	19,900	5,850.00	116,415,000	
日本高周波鋼業	4,200	835.00	3,507,000	
日本冶金工業	92,800	329.00	30,531,200	
山陽特殊製鋼	12,900	2,388.00	30,805,200	
愛知製鋼	6,300	4,635.00	29,200,500	
日立金属	120,800	1,392.00	168,153,600	
日本金属	2,800	2,764.00	7,739,200	
大平洋金属	6,900	3,330.00	22,977,000	
新日本電工	67,200	387.00	26,006,400	
栗本鐵工所	5,700	2,124.00	12,106,800	
虹　技	1,700	2,074.00	3,525,800	
日本鋳鉄管	12,000	170.00	2,040,000	
日本製鋼所	36,600	3,360.00	122,976,000	
三菱製鋼	8,300	2,680.00	22,244,000	

日亜鋼業	16,500	358.00	5,907,000	
日本精線	1,800	4,955.00	8,919,000	
大紀アルミニウム工業所	18,500	840.00	15,540,000	
日本軽金属ホールディングス	327,400	293.00	95,928,200	
三井金属鉱業	30,300	5,110.00	154,833,000	
東邦亜鉛	6,200	5,750.00	35,650,000	
三菱マテリアル	74,100	3,395.00	251,569,500	
住友金属鉱山	143,300	5,021.00	719,509,300	
ＤＯＷＡホールディングス	28,400	4,035.00	114,594,000	
古河機械金属	18,500	2,270.00	41,995,000	
エス・サイエンス	53,400	83.00	4,432,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	2,739.00	32,046,300	
東邦チタニウム	20,100	1,507.00	30,290,700	
ＵＡＣＪ	17,000	2,595.00	44,115,000	
古河電気工業	37,300	5,910.00	220,443,000	
住友電気工業	419,200	1,702.00	713,478,400	
フジクラ	135,400	778.00	105,341,200	
昭和電線ホールディングス	14,100	1,033.00	14,565,300	
東京特殊電線	1,400	3,340.00	4,676,000	
タツタ電線	22,300	721.00	16,078,300	
カナレ電気	1,900	2,207.00	4,193,300	
平河ヒューテック	5,600	1,227.00	6,871,200	
リョービ	13,800	2,960.00	40,848,000	
アーレスティ	13,800	1,017.00	14,034,600	
アサヒホールディングス	18,800	2,043.00	38,408,400	
東洋製罐グループホールディングス	76,600	1,593.00	122,023,800	
ホッカンホールディングス	28,000	393.00	11,004,000	
コロナ	6,200	1,385.00	8,587,000	
横河ブリッジホールディングス	20,900	2,561.00	53,524,900	
ＯＳＪＢホールディングス	56,300	313.00	17,621,900	
駒井ハルテック	2,500	2,712.00	6,780,000	
高田機工	1,000	4,215.00	4,215,000	
三和ホールディングス	107,500	1,487.00	159,852,500	
文化シヤッター	33,000	1,009.00	33,297,000	
三協立山	15,500	1,547.00	23,978,500	
アルインコ	8,200	1,181.00	9,684,200	
東洋シヤッター	2,900	615.00	1,783,500	
ＬＩＸＩＬグループ	165,300	2,655.00	438,871,500	
日本フイルコン	8,700	681.00	5,924,700	
ノーリツ	25,000	1,917.00	47,925,000	
長府製作所	12,600	2,490.00	31,374,000	
リンナイ	20,000	9,760.00	195,200,000	
ユニプレス	21,900	2,575.00	56,392,500	
ダイニチ工業	6,000	907.00	5,442,000	
日東精工	15,500	609.00	9,439,500	
三洋工業	1,400	2,175.00	3,045,000	
岡部	22,700	1,004.00	22,790,800	

ジーテクト	12,400	2,125.00	26,350,000	
中国工業	1,700	748.00	1,271,600	
東プレ	20,900	3,220.00	67,298,000	
高周波熱錬	21,600	1,096.00	23,673,600	
東京製綱	8,100	2,090.00	16,929,000	
サンコール	6,300	793.00	4,995,900	
モリテックスチール	6,600	1,010.00	6,666,000	
パイオラックス	16,600	2,992.00	49,667,200	
エイチワン	8,300	1,521.00	12,624,300	
日本発条	111,700	1,109.00	123,875,300	
中央発條	1,300	3,625.00	4,712,500	
アドバネクス	1,800	4,270.00	7,686,000	
三浦工業	48,500	3,035.00	147,197,500	
タクマ	38,000	1,283.00	48,754,000	
テクノプロ・ホールディングス	19,300	6,280.00	121,204,000	
アトラ	1,900	903.00	1,715,700	
インターワークス	2,400	1,137.00	2,728,800	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,500	1,363.00	4,770,500	
ファーストロジック	1,700	952.00	1,618,400	
三機サービス	1,200	2,248.00	2,697,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	4,900	2,669.00	13,078,100	
デザインワン・ジャパン	2,100	1,156.00	2,427,600	
イー・ガーディアン	5,500	3,280.00	18,040,000	
リブセンス	7,100	553.00	3,926,300	
ジャパンマテリアル	29,700	1,430.00	42,471,000	
ベクトル	13,000	2,183.00	28,379,000	
ウチヤマホールディングス	5,400	651.00	3,515,400	
ライクキッズネクスト	1,100	1,958.00	2,153,800	
キャリアリンク	3,100	560.00	1,736,000	
ＩＢＪ	8,600	1,213.00	10,431,800	
アサンテ	3,900	1,920.00	7,488,000	
Ｎ・フィールド	6,100	2,016.00	12,297,600	
バリューＨＲ	2,500	2,211.00	5,527,500	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	2,200	8,270.00	18,194,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,131.00	4,976,400	
ＥＲＩホールディングス	3,100	957.00	2,966,700	
アビスト	1,500	4,905.00	7,357,500	
シグマクシス	4,300	1,715.00	7,374,500	
ウィルグループ	4,700	1,599.00	7,515,300	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,900	478.00	7,122,200	
日本ビューホテル	2,400	1,530.00	3,672,000	
リクルートホールディングス	835,900	2,667.50	2,229,763,250	
エラン	2,700	1,550.00	4,185,000	
ツガミ	30,000	1,461.00	43,830,000	
オークマ	13,100	6,800.00	89,080,000	
東芝機械	63,000	776.00	48,888,000	

アマダホールディングス	173,000	1,456.00	251,888,000	
アイダエンジニアリング	28,500	1,473.00	41,980,500	
滝澤鉄工所	3,500	2,198.00	7,693,000	
富士機械製造	33,600	2,193.00	73,684,800	
牧野フライス製作所	56,000	1,093.00	61,208,000	
オーエスジー	51,700	2,515.00	130,025,500	
ダイジェット工業	1,400	2,104.00	2,945,600	
旭ダイヤモンド工業	33,300	1,311.00	43,656,300	
ＤＭＧ森精機	62,100	2,137.00	132,707,700	
ソディック	24,400	1,418.00	34,599,200	
ディスコ	15,200	24,650.00	374,680,000	
日東工器	6,900	2,983.00	20,582,700	
日進工具	3,000	3,425.00	10,275,000	
パンチ工業	9,400	1,304.00	12,257,600	
冨士ダイス	4,300	1,108.00	4,764,400	
土木管理総合試験所	3,300	712.00	2,349,600	
日本郵政	614,800	1,290.00	793,092,000	
ベルシステム２４ホールディングス	18,200	1,488.00	27,081,600	
鎌倉新書	1,500	2,309.00	3,463,500	
一蔵	1,400	1,072.00	1,500,800	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1,900	1,724.00	3,275,600	
グローバルグループ	1,200	1,434.00	1,720,800	
エボラブルアジア	2,200	2,236.00	4,919,200	
ストライク	1,000	6,310.00	6,310,000	
ソラスト	6,500	2,885.00	18,752,500	
セラク	1,900	764.00	1,451,600	
インソース	1,300	3,610.00	4,693,000	
豊田自動織機	91,800	6,900.00	633,420,000	
豊和工業	6,200	1,635.00	10,137,000	
ＯＫＫ	4,300	1,192.00	5,125,600	
石川製作所	2,900	3,115.00	9,033,500	
東洋機械金属	8,800	950.00	8,360,000	
津田駒工業	27,000	275.00	7,425,000	
エンシュウ	29,000	180.00	5,220,000	
島精機製作所	14,200	7,050.00	100,110,000	
オプトラン	8,200	4,065.00	33,333,000	
ＮＣホールディングス	3,600	769.00	2,768,400	
フリュー	8,000	1,079.00	8,632,000	
ヤマシンフィルタ	15,300	1,328.00	20,318,400	
日阪製作所	16,100	1,117.00	17,983,700	
やまびこ	21,700	1,708.00	37,063,600	
平田機工	3,100	10,200.00	31,620,000	
ペガサスミシン製造	10,500	759.00	7,969,500	
ナブテスコ	61,700	4,525.00	279,192,500	
三井海洋開発	11,900	2,711.00	32,260,900	
レオン自動機	10,000	2,362.00	23,620,000	
ＳＭＣ	35,600	46,110.00	1,641,516,000	

新川	9,200	1,172.00	10,782,400	
ホソカワミクロン	4,200	7,900.00	33,180,000	
ユニオンツール	5,100	3,825.00	19,507,500	
オイレス工業	14,500	2,387.00	34,611,500	
日精エー・エス・ビー機械	3,800	7,960.00	30,248,000	
サトーホールディングス	14,800	3,690.00	54,612,000	
技研製作所	5,700	2,914.00	16,609,800	
日本エアーテック	3,900	955.00	3,724,500	
日精樹脂工業	9,400	1,693.00	15,914,200	
オカダアイヨン	3,300	1,675.00	5,527,500	
ワイエイシイホールディングス	3,800	974.00	3,701,200	
小松製作所	547,500	3,990.00	2,184,525,000	
住友重機械工業	64,900	4,240.00	275,176,000	
日立建機	53,000	4,730.00	250,690,000	
日工	3,100	2,475.00	7,672,500	
巴工業	4,800	1,983.00	9,518,400	
井関農機	11,300	2,230.00	25,199,000	
ＴＯＷＡ	8,800	1,691.00	14,880,800	
丸山製作所	2,500	1,872.00	4,680,000	
北川鉄工所	5,400	2,839.00	15,330,600	
シンニッタン	8,700	944.00	8,212,800	
ローツェ	5,600	2,519.00	14,106,400	
タカキタ	3,600	832.00	2,995,200	
クボタ	608,200	2,000.00	1,216,400,000	
荏原実業	3,300	2,184.00	7,207,200	
東洋エンジニアリング	15,000	1,030.00	15,450,000	
三菱化工機	3,900	2,234.00	8,712,600	
月島機械	22,500	1,566.00	35,235,000	
帝国電機製作所	7,900	1,702.00	13,445,800	
東京機械製作所	4,500	591.00	2,659,500	
新東工業	26,900	1,256.00	33,786,400	
澁谷工業	9,900	4,255.00	42,124,500	
アイチコーポレーション	19,600	746.00	14,621,600	
小森コーポレーション	28,500	1,429.00	40,726,500	
鶴見製作所	9,500	2,022.00	19,209,000	
住友精密工業	19,000	411.00	7,809,000	
酒井重工業	2,100	4,960.00	10,416,000	
荏原製作所	46,600	3,935.00	183,371,000	
石井鐵工所	1,800	2,110.00	3,798,000	
酉島製作所	11,600	1,006.00	11,669,600	
北越工業	12,800	1,242.00	15,897,600	
千代田化工建設	82,500	1,028.00	84,810,000	
ダイキン工業	154,800	12,690.00	1,964,412,000	
オルガノ	4,100	3,325.00	13,632,500	
トーヨーカネツ	4,800	3,465.00	16,632,000	
栗田工業	61,400	3,230.00	198,322,000	
椿本チエイン	67,000	904.00	60,568,000	

大同工業	4,300	1,573.00	6,763,900	
日機装	39,200	1,217.00	47,706,400	
木村化工機	9,600	524.00	5,030,400	
新興プランテック	24,500	1,022.00	25,039,000	
アネスト岩田	19,100	1,160.00	22,156,000	
ダイフク	57,700	6,990.00	403,323,000	
サムコ	3,100	1,269.00	3,933,900	
加藤製作所	5,400	2,672.00	14,428,800	
油研工業	2,200	3,265.00	7,183,000	
タダノ	54,700	1,716.00	93,865,200	
フジテック	36,300	1,425.00	51,727,500	
ＣＫＤ	31,500	2,725.00	85,837,500	
キトー	8,600	2,110.00	18,146,000	
平和	35,100	2,349.00	82,449,900	
理想科学工業	11,200	2,255.00	25,256,000	
ＳＡＮＫＹＯ	28,400	3,830.00	108,772,000	
日本金銭機械	10,500	1,318.00	13,839,000	
マースエンジニアリング	7,200	2,517.00	18,122,400	
福島工業	7,000	4,750.00	33,250,000	
オーイズミ	4,800	539.00	2,587,200	
ダイコク電機	5,200	1,732.00	9,006,400	
竹内製作所	19,000	2,485.00	47,215,000	
アマノ	35,100	2,990.00	104,949,000	
ＪＵＫＩ	16,800	1,674.00	28,123,200	
サンデンホールディングス	13,800	1,703.00	23,501,400	
蛇の目ミシン工業	10,300	771.00	7,941,300	
ブラザー工業	138,500	2,648.00	366,748,000	
マックス	17,400	1,521.00	26,465,400	
モリタホールディングス	18,200	2,005.00	36,491,000	
グローリー	33,800	4,045.00	136,721,000	
新晃工業	11,500	1,967.00	22,620,500	
大和冷機工業	18,200	1,238.00	22,531,600	
セガサミーホールディングス	112,500	1,593.00	179,212,500	
日本ピストンリング	4,100	2,451.00	10,049,100	
リケン	5,200	6,310.00	32,812,000	
ＴＰＲ	12,700	3,070.00	38,989,000	
ツバキ・ナカシマ	11,400	3,210.00	36,594,000	
ホシザキ	35,700	9,680.00	345,576,000	
大豊工業	9,200	1,584.00	14,572,800	
日本精工	232,900	1,620.00	377,298,000	
ＮＴＮ	262,400	470.00	123,328,000	
ジェイテクト	120,800	1,683.00	203,306,400	
不二越	105,000	677.00	71,085,000	
ミネベアミツミ	210,500	2,403.00	505,831,500	
日本トムソン	36,300	812.00	29,475,600	
ＴＨＫ	70,700	4,755.00	336,178,500	
ユーシン精機	5,000	3,590.00	17,950,000	

前澤給装工業	4,400	1,932.00	8,500,800	
イーグル工業	14,000	1,993.00	27,902,000	
前澤工業	7,800	434.00	3,385,200	
日本ピラー工業	11,500	1,677.00	19,285,500	
キッツ	50,500	887.00	44,793,500	
日立製作所	2,723,000	827.50	2,253,282,500	
三菱電機	1,133,900	1,821.00	2,064,831,900	
富士電機	342,000	814.00	278,388,000	
東洋電機製造	4,500	1,762.00	7,929,000	
安川電機	131,400	4,895.00	643,203,000	
シンフォニア　テクノロジー	73,000	375.00	27,375,000	
明電舎	96,000	416.00	39,936,000	
オリジン電気	3,300	1,888.00	6,230,400	
山洋電気	5,500	8,150.00	44,825,000	
デンヨー	10,500	1,821.00	19,120,500	
キャリアインデックス	1,100	2,161.00	2,377,100	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	800	6,410.00	5,128,000	
三櫻工業	14,400	777.00	11,188,800	
マキタ	147,900	5,030.00	743,937,000	
東芝テック	81,000	656.00	53,136,000	
芝浦メカトロニクス	17,000	502.00	8,534,000	
マブチモーター	31,600	5,440.00	171,904,000	
日本電産	136,500	16,755.00	2,287,057,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,100	2,872.00	11,775,200	
東光高岳	5,700	1,662.00	9,473,400	
ダブル・スコープ	16,500	1,502.00	24,783,000	
宮越ホールディングス	4,300	719.00	3,091,700	
ダイヘン	62,000	845.00	52,390,000	
田淵電機	15,800	286.00	4,518,800	
ヤーマン	16,400	1,736.00	28,470,400	
ＪＶＣケンウッド	83,300	385.00	32,070,500	
ミマキエンジニアリング	10,200	929.00	9,475,800	
第一精工	5,300	2,846.00	15,083,800	
日新電機	26,600	1,061.00	28,222,600	
大崎電気工業	24,300	819.00	19,901,700	
オムロン	120,500	6,290.00	757,945,000	
日東工業	18,200	1,867.00	33,979,400	
ＩＤＥＣ	14,000	2,879.00	40,306,000	
不二電機工業	1,300	1,363.00	1,771,900	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	204,000	599.00	122,196,000	
サクサホールディングス	2,900	2,198.00	6,374,200	
メルコホールディングス	5,500	3,600.00	19,800,000	
テクノメディカ	2,700	1,966.00	5,308,200	
日本電気	146,700	3,245.00	476,041,500	
富士通	1,166,000	649.50	757,317,000	
沖電気工業	46,000	1,482.00	68,172,000	
岩崎通信機	5,000	790.00	3,950,000	

電気興業	6,400	3,335.00	21,344,000	
サンケン電気	66,000	841.00	55,506,000	
ナカヨ	2,200	2,055.00	4,521,000	
アイホン	6,400	1,778.00	11,379,200	
ルネサスエレクトロニクス	58,700	1,210.00	71,027,000	
セイコーエプソン	168,800	2,069.00	349,247,200	
ワコム	88,000	553.00	48,664,000	
アルバック	26,100	6,260.00	163,386,000	
アクセル	4,700	842.00	3,957,400	
ＥＩＺＯ	10,400	5,080.00	52,832,000	
ジャパンディスプレイ	233,000	223.00	51,959,000	
日本信号	31,300	1,078.00	33,741,400	
京三製作所	27,000	769.00	20,763,000	
能美防災	15,000	2,310.00	34,650,000	
ホーチキ	8,200	1,998.00	16,383,600	
エレコム	9,800	2,366.00	23,186,800	
パナソニック	1,295,400	1,670.50	2,163,965,700	
シャープ	79,000	3,730.00	294,670,000	
アンリツ	82,700	1,344.00	111,148,800	
富士通ゼネラル	34,600	2,074.00	71,760,400	
ソニー	757,500	5,382.00	4,076,865,000	
ＴＤＫ	59,300	9,700.00	575,210,000	
帝国通信工業	5,000	1,409.00	7,045,000	
タムラ製作所	43,700	819.00	35,790,300	
アルプス電気	97,700	2,841.00	277,565,700	
池上通信機	36,000	172.00	6,192,000	
パイオニア	189,000	195.00	36,855,000	
日本電波工業	10,300	704.00	7,251,200	
鈴木	4,500	1,257.00	5,656,500	
日本トリム	2,400	5,670.00	13,608,000	
ローランド　ディー．ジー．	5,800	2,786.00	16,158,800	
フォスター電機	13,300	2,985.00	39,700,500	
クラリオン	60,000	348.00	20,880,000	
ＳＭＫ	29,000	471.00	13,659,000	
ヨコオ	7,400	2,139.00	15,828,600	
ティアック	84,000	46.00	3,864,000	
ホシデン	28,600	1,556.00	44,501,600	
ヒロセ電機	18,300	15,550.00	284,565,000	
日本航空電子工業	29,000	1,581.00	45,849,000	
ＴＯＡ	12,200	1,412.00	17,226,400	
マクセルホールディングス	22,500	2,132.00	47,970,000	
古野電気	13,500	758.00	10,233,000	
ユニデンホールディングス	31,000	312.00	9,672,000	
アルパイン	27,000	2,189.00	59,103,000	
スミダコーポレーション	11,600	1,657.00	19,221,200	
アイコム	6,300	2,746.00	17,299,800	
リオン	4,800	2,961.00	14,212,800	

本多通信工業	8,800	1,224.00	10,771,200	
船井電機	11,500	762.00	8,763,000	
横河電機	113,500	2,193.00	248,905,500	
新電元工業	4,000	8,180.00	32,720,000	
アズビル	34,000	4,770.00	162,180,000	
東亜ディーケーケー	5,600	1,303.00	7,296,800	
日本光電工業	47,400	2,965.00	140,541,000	
チノー	3,900	1,676.00	6,536,400	
共和電業	13,000	451.00	5,863,000	
日本電子材料	4,500	741.00	3,334,500	
堀場製作所	22,500	7,950.00	178,875,000	
アドバンテスト	63,200	2,242.00	141,694,400	
小野測器	4,800	820.00	3,936,000	
エスペック	10,100	2,623.00	26,492,300	
キーエンス	55,700	65,570.00	3,652,249,000	
日置電機	5,900	3,510.00	20,709,000	
シスメックス	88,200	8,820.00	777,924,000	
日本マイクロニクス	19,700	1,129.00	22,241,300	
メガチップス	8,900	3,695.00	32,885,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,600	6,550.00	43,230,000	
イマジカ・ロボット　ホールディングス	9,400	1,201.00	11,289,400	
澤藤電機	1,200	2,206.00	2,647,200	
デンソー	251,600	6,305.00	1,586,338,000	
コーセル	15,700	1,650.00	25,905,000	
イリソ電子工業	9,500	7,010.00	66,595,000	
新日本無線	6,900	886.00	6,113,400	
オプテックスグループ	9,200	5,630.00	51,796,000	
千代田インテグレ	5,500	2,488.00	13,684,000	
アイ・オー・データ機器	4,700	1,148.00	5,395,600	
レーザーテック	23,200	4,275.00	99,180,000	
スタンレー電気	86,700	4,205.00	364,573,500	
岩崎電気	4,400	1,694.00	7,453,600	
ウシオ電機	68,800	1,467.00	100,929,600	
岡谷電機産業	6,100	756.00	4,611,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9,700	1,088.00	10,553,600	
日本セラミック	11,500	2,915.00	33,522,500	
遠藤照明	5,800	1,131.00	6,559,800	
古河電池	8,100	1,044.00	8,456,400	
双信電機	5,000	711.00	3,555,000	
山一電機	8,200	1,875.00	15,375,000	
図研	7,400	1,819.00	13,460,600	
日本電子	41,000	853.00	34,973,000	
カシオ計算機	91,200	1,574.00	143,548,800	
ファナック	107,800	27,380.00	2,951,564,000	
日本シイエムケイ	20,000	991.00	19,820,000	
エンプラス	5,100	3,800.00	19,380,000	

大真空	4,200	1,394.00	5,854,800	
ローム	50,900	11,100.00	564,990,000	
浜松ホトニクス	82,600	4,140.00	341,964,000	
三井ハイテック	15,000	2,056.00	30,840,000	
新光電気工業	42,800	873.00	37,364,400	
京セラ	186,100	6,283.00	1,169,266,300	
協栄産業	1,400	2,005.00	2,807,000	
太陽誘電	50,900	1,839.00	93,605,100	
村田製作所	119,000	14,860.00	1,768,340,000	
ユーシン	17,100	756.00	12,927,600	
双葉電子工業	18,500	2,309.00	42,716,500	
日東電工	85,600	8,882.00	760,299,200	
北陸電気工業	4,600	1,764.00	8,114,400	
東海理化電機製作所	29,800	2,326.00	69,314,800	
ニチコン	35,700	1,343.00	47,945,100	
日本ケミコン	9,200	2,857.00	26,284,400	
ＫＯＡ	15,700	2,274.00	35,701,800	
三井造船	41,000	1,950.00	79,950,000	
日立造船	89,900	543.00	48,815,700	
三菱重工業	190,000	4,404.00	836,760,000	
川崎重工業	88,200	3,980.00	351,036,000	
ＩＨＩ	87,100	3,595.00	313,124,500	
名村造船所	34,000	637.00	21,658,000	
サノヤスホールディングス	13,800	260.00	3,588,000	
日本車輌製造	41,000	307.00	12,587,000	
三菱ロジスネクスト	13,500	948.00	12,798,000	
近畿車輌	1,700	2,675.00	4,547,500	
ＦＰＧ	39,100	1,430.00	55,913,000	
島根銀行	2,400	1,417.00	3,400,800	
じもとホールディングス	75,700	189.00	14,307,300	
全国保証	31,500	4,695.00	147,892,500	
めぶきフィナンシャルグループ	581,100	437.00	253,940,700	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	15,100	2,760.00	41,676,000	
九州フィナンシャルグループ	183,400	607.00	111,323,800	
かんぽ生命保険	42,200	2,711.00	114,404,200	
ゆうちょ銀行	316,800	1,473.00	466,646,400	
富山第一銀行	28,500	512.00	14,592,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	680,000	633.00	430,440,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	75,800	1,327.00	100,586,600	
マーキュリアインベストメント	2,300	1,280.00	2,944,000	
アルヒ	9,600	1,504.00	14,438,400	
日産自動車	1,337,300	1,129.00	1,509,811,700	
いすゞ自動車	328,600	1,720.50	565,356,300	
トヨタ自動車	1,378,500	7,323.00	10,094,755,500	＊
日野自動車	161,800	1,437.00	232,506,600	

三菱自動車工業	419,700	850.00	356,745,000	
エフテック	7,300	1,339.00	9,774,700	
レシップホールディングス	4,100	903.00	3,702,300	
ＧＭＢ	1,900	1,796.00	3,412,400	
ファルテック	2,000	1,441.00	2,882,000	
武蔵精密工業	12,100	3,745.00	45,314,500	
日産車体	44,300	1,053.00	46,647,900	
新明和工業	49,300	948.00	46,736,400	
極東開発工業	21,100	1,690.00	35,659,000	
日信工業	23,000	1,904.00	43,792,000	
トピー工業	9,300	3,275.00	30,457,500	
ティラド	4,100	4,050.00	16,605,000	
曙ブレーキ工業	52,700	309.00	16,284,300	
タチエス	19,200	1,916.00	36,787,200	
ＮＯＫ	60,900	2,285.00	139,156,500	
フタバ産業	34,700	957.00	33,207,900	
ＫＹＢ	11,800	5,580.00	65,844,000	
市光工業	17,000	1,139.00	19,363,000	
大同メタル工業	14,300	1,325.00	18,947,500	
プレス工業	60,200	673.00	40,514,600	
ミクニ	14,400	706.00	10,166,400	
太平洋工業	23,700	1,500.00	35,550,000	
ケーヒン	26,000	2,211.00	57,486,000	
河西工業	13,900	1,463.00	20,335,700	
アイシン精機	93,400	6,300.00	588,420,000	
マツダ	355,900	1,504.50	535,451,550	
今仙電機製作所	10,500	1,216.00	12,768,000	
本田技研工業	1,020,400	3,893.00	3,972,417,200	
スズキ	224,700	6,073.00	1,364,603,100	
ＳＵＢＡＲＵ	352,000	3,778.00	1,329,856,000	
安永	5,500	2,538.00	13,959,000	
ヤマハ発動機	160,100	3,455.00	553,145,500	
ショーワ	29,400	1,662.00	48,862,800	
小糸製作所	67,900	7,450.00	505,855,000	
ＴＢＫ	13,500	547.00	7,384,500	
エクセディ	13,700	3,435.00	47,059,500	
ミツバ	20,900	1,428.00	29,845,200	
豊田合成	41,200	2,644.00	108,932,800	
愛三工業	19,900	1,246.00	24,795,400	
盟和産業	1,700	1,383.00	2,351,100	
日本プラスト	4,600	976.00	4,489,600	
ヨロズ	11,500	1,949.00	22,413,500	
エフ・シー・シー	18,500	3,080.00	56,980,000	
新家工業	2,600	2,470.00	6,422,000	
シマノ	45,700	15,750.00	719,775,000	
テイ・エス　テック	26,300	4,325.00	113,747,500	
ジャムコ	5,700	2,394.00	13,645,800	

小野建	9,700	1,992.00	19,322,400	
はるやまホールディングス	5,200	1,105.00	5,746,000	
ノジマ	19,600	2,544.00	49,862,400	
佐鳥電機	8,200	1,109.00	9,093,800	
カッパ・クリエイト	13,900	1,295.00	18,000,500	
エコートレーディング	2,500	721.00	1,802,500	
伯東	6,800	1,700.00	11,560,000	
コンドーテック	8,900	981.00	8,730,900	
中山福	6,400	765.00	4,896,000	
ライトオン	9,400	937.00	8,807,800	
ナガイレーベン	14,800	2,871.00	42,490,800	
ジーンズメイト	3,400	848.00	2,883,200	
三菱食品	12,300	3,085.00	37,945,500	
良品計画	14,800	35,700.00	528,360,000	
三城ホールディングス	13,800	529.00	7,300,200	
松田産業	8,100	2,006.00	16,248,600	
第一興商	16,600	5,660.00	93,956,000	
メディパルホールディングス	111,900	2,171.00	242,934,900	
アドヴァン	11,400	1,074.00	12,243,600	
ＳＰＫ	2,400	3,065.00	7,356,000	
萩原電気	3,800	3,455.00	13,129,000	
アルビス	2,500	3,225.00	8,062,500	
アズワン	8,700	7,200.00	62,640,000	
スズデン	3,900	1,802.00	7,027,800	
尾家産業	3,300	1,343.00	4,431,900	
シモジマ	6,800	1,128.00	7,670,400	
ドウシシャ	11,800	2,397.00	28,284,600	
小津産業	2,500	2,218.00	5,545,000	
コナカ	14,300	590.00	8,437,000	
高速	6,600	1,242.00	8,197,200	
ハウス　オブ　ローゼ	1,400	1,815.00	2,541,000	
Ｇ－７ホールディングス	3,300	2,558.00	8,441,400	
たけびし	3,900	1,865.00	7,273,500	
イオン北海道	11,200	787.00	8,814,400	
コジマ	19,300	356.00	6,870,800	
ヒマラヤ	3,100	1,298.00	4,023,800	
コーナン商事	15,900	2,530.00	40,227,000	
ネットワンシステムズ	45,400	1,623.00	73,684,200	
エコス	4,500	1,241.00	5,584,500	
ワタミ	13,200	1,323.00	17,463,600	
マルシェ	3,000	824.00	2,472,000	
リックス	2,500	2,104.00	5,260,000	
システムソフト	26,500	142.00	3,763,000	
ドンキホーテホールディングス	72,400	5,940.00	430,056,000	
丸文	9,900	1,102.00	10,909,800	
西松屋チェーン	24,500	1,243.00	30,453,500	
ゼンショーホールディングス	57,900	2,242.00	129,811,800	

ハピネット	7,600	1,736.00	13,193,600	
幸楽苑ホールディングス	7,100	1,922.00	13,646,200	
ハークスレイ	2,700	1,092.00	2,948,400	
橋本総業ホールディングス	2,300	1,848.00	4,250,400	
日本ライフライン	31,800	3,435.00	109,233,000	
サイゼリヤ	16,600	3,000.00	49,800,000	
エクセル	4,500	2,707.00	12,181,500	
ＶＴホールディングス	37,800	586.00	22,150,800	
マルカキカイ	3,600	2,102.00	7,567,200	
アルゴグラフィックス	5,100	3,595.00	18,334,500	
魚力	3,100	1,209.00	3,747,900	
ＩＤＯＭ	33,900	712.00	24,136,800	
日本エム・ディ・エム	7,500	1,057.00	7,927,500	
ポプラ	3,000	866.00	2,598,000	
フジ・コーポレーション	1,900	2,652.00	5,038,800	
ユナイテッドアローズ	13,800	4,360.00	60,168,000	
進和	6,600	2,312.00	15,259,200	
エスケイジャパン	2,400	671.00	1,610,400	
ダイトロン	5,100	2,417.00	12,326,700	
ハイデイ日高	14,640	2,751.00	40,274,640	
シークス	7,100	5,060.00	35,926,000	
京都きもの友禅	7,300	797.00	5,818,100	
コロワイド	37,100	2,483.00	92,119,300	
ピーシーデポコーポレーション	16,700	793.00	13,243,100	
田中商事	3,500	729.00	2,551,500	
オーハシテクニカ	6,300	1,804.00	11,365,200	
壱番屋	7,900	4,490.00	35,471,000	
白銅	4,000	2,493.00	9,972,000	
トップカルチャー	4,100	497.00	2,037,700	
ＰＬＡＮＴ	2,600	1,364.00	3,546,400	
スギホールディングス	24,500	5,820.00	142,590,000	
島津製作所	135,500	2,760.00	373,980,000	
ＪＭＳ	10,500	627.00	6,583,500	
クボテック	2,500	541.00	1,352,500	
長野計器	8,900	1,270.00	11,303,000	
ブイ・テクノロジー	2,700	25,130.00	67,851,000	
スター精密	18,200	2,173.00	39,548,600	
東京計器	7,200	1,252.00	9,014,400	
愛知時計電機	1,500	4,510.00	6,765,000	
インターアクション	4,400	1,084.00	4,769,600	
オーバル	11,200	312.00	3,494,400	
東京精密	20,500	4,460.00	91,430,000	
マニー	13,800	4,030.00	55,614,000	
ニコン	197,600	2,205.00	435,708,000	
トプコン	60,900	2,354.00	143,358,600	
オリンパス	168,900	4,240.00	716,136,000	
理研計器	10,800	2,372.00	25,617,600	

ＳＣＲＥＥＮホールディングス	21,500	9,600.00	206,400,000	
キヤノン電子	10,400	2,550.00	26,520,000	
タムロン	9,100	2,511.00	22,850,100	
ＨＯＹＡ	230,900	5,511.00	1,272,489,900	
シード	1,200	5,400.00	6,480,000	
ノーリツ鋼機	11,500	2,447.00	28,140,500	
エー・アンド・デイ	10,400	675.00	7,020,000	
キヤノン	610,400	4,033.00	2,461,743,200	
リコー	340,900	1,161.00	395,784,900	
シチズン時計	135,300	814.00	110,134,200	
リズム時計工業	4,300	2,276.00	9,786,800	
大研医器	10,100	766.00	7,736,600	
メニコン	15,600	2,724.00	42,494,400	
中本パックス	2,200	2,301.00	5,062,200	
スノーピーク	3,500	1,211.00	4,238,500	
パラマウントベッドホールディングス	12,000	5,590.00	67,080,000	
トランザクション	5,100	1,079.00	5,502,900	
ＳＨＯ－ＢＩ	3,900	417.00	1,626,300	
ニホンフラッシュ	5,300	2,738.00	14,511,400	
前田工繊	11,400	1,977.00	22,537,800	
永大産業	15,000	564.00	8,460,000	
アートネイチャー	12,100	780.00	9,438,000	
バンダイナムコホールディングス	117,200	3,545.00	415,474,000	
アイフィスジャパン	2,400	716.00	1,718,400	
共立印刷	18,900	370.00	6,993,000	
ＳＨＯＥＩ	5,100	4,665.00	23,791,500	
フランスベッドホールディングス	13,400	996.00	13,346,400	
マーベラス	18,900	921.00	17,406,900	
パイロットコーポレーション	19,800	5,580.00	110,484,000	
萩原工業	6,300	1,847.00	11,636,100	
エイベックス	20,600	1,610.00	33,166,000	
トッパン・フォームズ	24,300	1,233.00	29,961,900	
フジシールインターナショナル	25,400	3,555.00	90,297,000	
タカラトミー	47,500	1,161.00	55,147,500	
廣済堂	10,600	522.00	5,533,200	
Ａｓ－ｍｅエステール	3,400	979.00	3,328,600	
アーク	47,900	129.00	6,179,100	
レック	6,700	3,115.00	20,870,500	
タカノ	5,000	963.00	4,815,000	
プロネクサス	10,600	1,328.00	14,076,800	
ホクシン	8,200	190.00	1,558,000	
ウッドワン	3,800	1,457.00	5,536,600	
大建工業	8,800	2,774.00	24,411,200	
きもと	19,400	418.00	8,109,200	
凸版印刷	320,000	940.00	300,800,000	
大日本印刷	148,400	2,269.00	336,719,600	
図書印刷	7,600	957.00	7,273,200	

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

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

明和産業	10,400	499.00	5,189,600	
キムラタン	55,500	44.00	2,442,000	
ゴールドウイン	3,400	12,140.00	41,276,000	
ユニ・チャーム	240,400	3,002.00	721,680,800	
デサント	27,100	1,709.00	46,313,900	
キング	5,800	649.00	3,764,200	
ワキタ	23,800	1,284.00	30,559,200	
ヤマトインターナショナル	8,100	476.00	3,855,600	
東邦ホールディングス	33,100	2,534.00	83,875,400	
サンゲツ	37,700	2,254.00	84,975,800	
ミツウロコグループホールディングス	16,200	777.00	12,587,400	
シナネンホールディングス	5,300	2,702.00	14,320,600	
伊藤忠エネクス	24,700	1,054.00	26,033,800	
サンリオ	31,400	1,975.00	62,015,000	
サンワ　テクノス	6,600	2,159.00	14,249,400	
リョーサン	14,000	4,015.00	56,210,000	
新光商事	12,300	1,982.00	24,378,600	
トーホー	5,000	2,485.00	12,425,000	
三信電気	10,300	1,962.00	20,208,600	
東陽テクニカ	12,900	974.00	12,564,600	
モスフードサービス	14,600	3,265.00	47,669,000	
加賀電子	10,100	2,753.00	27,805,300	
三益半導体工業	8,700	2,014.00	17,521,800	
ソーダニッカ	11,600	702.00	8,143,200	
立花エレテック	7,600	2,220.00	16,872,000	
木曽路	13,700	2,727.00	37,359,900	
ＳＲＳホールディングス	13,200	971.00	12,817,200	
千趣会	20,200	628.00	12,685,600	
タカキュー	9,000	218.00	1,962,000	
ケーヨー	20,700	628.00	12,999,600	
上新電機	13,200	3,820.00	50,424,000	
日本瓦斯	20,500	4,580.00	93,890,000	
ロイヤルホールディングス	19,800	2,852.00	56,469,600	
東天紅	800	1,868.00	1,494,400	
いなげや	12,400	1,796.00	22,270,400	
島忠	27,000	3,565.00	96,255,000	
チヨダ	13,200	2,745.00	36,234,000	
ライフコーポレーション	8,500	2,839.00	24,131,500	
リンガーハット	13,800	2,412.00	33,285,600	
さが美グループホールディングス	10,000	120.00	1,200,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	14,000	737.00	10,318,000	
テンアライド	10,600	481.00	5,098,600	
ＡＯＫＩホールディングス	22,300	1,720.00	38,356,000	
オークワ	16,000	1,104.00	17,664,000	
コメリ	17,200	3,130.00	53,836,000	
青山商事	21,400	4,485.00	95,979,000	
しまむら	13,000	12,740.00	165,620,000	

はせがわ	5,900	487.00	2,873,300	
高島屋	175,000	1,089.00	190,575,000	
松屋	22,500	1,547.00	34,807,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	52,900	2,092.00	110,666,800	
近鉄百貨店	4,300	3,885.00	16,705,500	
パルコ	10,700	1,482.00	15,857,400	
丸井グループ	107,000	2,042.00	218,494,000	
クレディセゾン	84,900	1,883.00	159,866,700	
アクシアル　リテイリング	9,300	4,260.00	39,618,000	
井筒屋	6,300	400.00	2,520,000	
イオン	429,700	1,826.00	784,632,200	
イズミ	20,200	6,940.00	140,188,000	
東武ストア	1,300	3,015.00	3,919,500	
フォーバル	4,900	961.00	4,708,900	
平和堂	22,700	2,458.00	55,796,600	
フジ	13,100	2,212.00	28,977,200	
ヤオコー	12,700	5,770.00	73,279,000	
ゼビオホールディングス	15,200	2,151.00	32,695,200	
ケーズホールディングス	47,300	2,980.00	140,954,000	
ＰＡＬＴＡＣ	15,700	5,390.00	84,623,000	
三谷産業	12,100	451.00	5,457,100	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,600	592.00	3,907,200	
日産東京販売ホールディングス	16,400	404.00	6,625,600	
新生銀行	96,800	1,711.00	165,624,800	
あおぞら銀行	66,600	4,430.00	295,038,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,901,700	769.60	6,081,148,320	
りそなホールディングス	1,227,400	622.60	764,179,240	
三井住友トラスト・ホールディングス	219,900	4,371.00	961,182,900	
三井住友フィナンシャルグループ	846,500	4,721.00	3,996,326,500	
第四銀行	13,700	4,980.00	68,226,000	
北越銀行	11,200	2,456.00	27,507,200	
千葉銀行	401,000	900.00	360,900,000	
群馬銀行	227,100	661.00	150,113,100	
武蔵野銀行	17,800	3,665.00	65,237,000	
千葉興業銀行	30,800	506.00	15,584,800	
筑波銀行	46,600	366.00	17,055,600	
七十七銀行	35,100	2,717.00	95,366,700	
青森銀行	8,700	3,415.00	29,710,500	
秋田銀行	7,200	2,916.00	20,995,200	
山形銀行	12,600	2,382.00	30,013,200	
岩手銀行	7,800	4,350.00	33,930,000	
東邦銀行	99,900	408.00	40,759,200	
東北銀行	5,800	1,491.00	8,647,800	
みちのく銀行	7,200	1,805.00	12,996,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	454,000	564.00	256,056,000	
静岡銀行	295,000	1,114.00	328,630,000	
十六銀行	15,000	2,921.00	43,815,000	

スルガ銀行	114,400	1,875.00	214,500,000	
八十二銀行	202,400	654.00	132,369,600	
山梨中央銀行	69,000	446.00	30,774,000	
大垣共立銀行	17,700	2,810.00	49,737,000	
福井銀行	9,600	2,609.00	25,046,400	
北國銀行	12,700	4,495.00	57,086,500	
清水銀行	3,800	3,015.00	11,457,000	
富山銀行	2,200	3,970.00	8,734,000	
滋賀銀行	105,000	566.00	59,430,000	
南都銀行	13,100	3,020.00	39,562,000	
百五銀行	107,300	537.00	57,620,100	
京都銀行	42,700	6,080.00	259,616,000	
紀陽銀行	42,000	1,781.00	74,802,000	
三重銀行	5,000	2,353.00	11,765,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	74,400	1,575.00	117,180,000	
広島銀行	165,100	853.00	140,830,300	
山陰合同銀行	66,300	1,031.00	68,355,300	
中国銀行	77,300	1,353.00	104,586,900	
鳥取銀行	3,600	1,742.00	6,271,200	
伊予銀行	159,600	874.00	139,490,400	
百十四銀行	119,000	366.00	43,554,000	
四国銀行	17,100	1,564.00	26,744,400	
阿波銀行	90,000	677.00	60,930,000	
大分銀行	6,400	4,175.00	26,720,000	
宮崎銀行	7,400	3,505.00	25,937,000	
佐賀銀行	6,800	2,542.00	17,285,600	
十八銀行	69,000	291.00	20,079,000	
沖縄銀行	10,900	4,405.00	48,014,500	
琉球銀行	21,700	1,641.00	35,609,700	
セブン銀行	419,500	378.00	158,571,000	
みずほフィナンシャルグループ	15,195,200	201.20	3,057,274,240	
高知銀行	4,100	1,407.00	5,768,700	
山口フィナンシャルグループ	105,000	1,301.00	136,605,000	
アクリーティブ	6,300	336.00	2,116,800	
芙蓉総合リース	12,800	7,170.00	91,776,000	
興銀リース	21,000	2,797.00	58,737,000	
東京センチュリー	22,500	6,060.00	136,350,000	
ＳＢＩホールディングス	126,500	2,436.00	308,154,000	
日本証券金融	45,800	664.00	30,411,200	
アイフル	187,800	376.00	70,612,800	
日本アジア投資	10,100	365.00	3,686,500	
長野銀行	3,700	1,902.00	7,037,400	
名古屋銀行	9,000	4,005.00	36,045,000	
北洋銀行	168,600	376.00	63,393,600	
愛知銀行	3,800	5,450.00	20,710,000	
第三銀行	6,300	1,656.00	10,432,800	
中京銀行	4,600	2,331.00	10,722,600	

大光銀行	3,800	2,402.00	9,127,600	
愛媛銀行	15,600	1,322.00	20,623,200	
トマト銀行	4,300	1,570.00	6,751,000	
みなと銀行	10,100	2,091.00	21,119,100	
京葉銀行	99,000	504.00	49,896,000	
関西アーバン銀行	15,600	1,429.00	22,292,400	
栃木銀行	57,900	443.00	25,649,700	
北日本銀行	3,500	3,030.00	10,605,000	
東和銀行	19,600	1,425.00	27,930,000	
福島銀行	10,600	805.00	8,533,000	
大東銀行	5,400	1,403.00	7,576,200	
リコーリース	8,800	3,640.00	32,032,000	
イオンフィナンシャルサービス	79,400	2,555.00	202,867,000	
アコム	224,900	486.00	109,301,400	
ジャックス	13,600	2,511.00	34,149,600	
オリエントコーポレーション	242,100	173.00	41,883,300	
日立キャピタル	30,800	2,832.00	87,225,600	
アプラスフィナンシャル	54,400	111.00	6,038,400	
オリックス	746,000	1,941.50	1,448,359,000	
三菱ＵＦＪリース	283,900	687.00	195,039,300	
ジャフコ	16,100	5,390.00	86,779,000	
九州リースサービス	4,800	883.00	4,238,400	
トモニホールディングス	92,200	504.00	46,468,800	
大和証券グループ本社	957,000	732.30	700,811,100	
野村ホールディングス	1,924,000	666.00	1,281,384,000	
岡三証券グループ	95,000	698.00	66,310,000	
丸三証券	35,600	1,054.00	37,522,400	
東洋証券	40,000	318.00	12,720,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,800	802.00	99,287,600	
光世証券	2,700	1,421.00	3,836,700	
水戸証券	34,700	431.00	14,955,700	
いちよし証券	23,500	1,284.00	30,174,000	
松井証券	54,700	1,078.00	58,966,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	219,300	4,142.00	908,340,600	
だいこう証券ビジネス	5,500	683.00	3,756,500	
日本取引所グループ	328,600	1,862.00	611,853,200	
マネックスグループ	118,700	392.00	46,530,400	
カブドットコム証券	71,600	385.00	27,566,000	
極東証券	15,000	1,577.00	23,655,000	
岩井コスモホールディングス	11,400	1,436.00	16,370,400	
藍澤證券	20,900	801.00	16,740,900	
フィデアホールディングス	108,600	200.00	21,720,000	
池田泉州ホールディングス	118,600	424.00	50,286,400	
アニコム　ホールディングス	7,600	3,470.00	26,372,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	292,400	3,352.00	980,124,800	

ソニーフィナンシャルホールディングス	91,900	1,985.00	182,421,500	
マネーパートナーズグループ	14,300	409.00	5,848,700	
小林洋行	3,300	299.00	986,700	
第一生命ホールディングス	632,700	2,124.00	1,343,854,800	
東京海上ホールディングス	421,300	4,942.00	2,082,064,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	2,700	1,409.00	3,804,300	
イー・ギャランティ	3,000	4,115.00	12,345,000	
アサックス	1,600	1,928.00	3,084,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,600	2,143.00	9,857,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	345,900	1,784.50	617,258,550	
アドバンスクリエイト	2,600	1,953.00	5,077,800	
三井不動産	558,500	2,638.00	1,473,323,000	
三菱地所	832,500	1,913.00	1,592,572,500	
平和不動産	19,800	2,064.00	40,867,200	
東京建物	122,200	1,722.00	210,428,400	
ダイビル	28,800	1,357.00	39,081,600	
京阪神ビルディング	18,600	872.00	16,219,200	
住友不動産	268,000	3,963.00	1,062,084,000	
太平洋興発	4,700	1,079.00	5,071,300	
大京	17,800	2,299.00	40,922,200	
テーオーシー	38,600	867.00	33,466,200	
東京楽天地	1,800	5,190.00	9,342,000	
レオパレス２１	133,500	831.00	110,938,500	
スターツコーポレーション	15,200	2,840.00	43,168,000	
フジ住宅	14,300	886.00	12,669,800	
空港施設	11,700	640.00	7,488,000	
明和地所	6,200	837.00	5,189,400	
ゴールドクレスト	8,800	2,252.00	19,817,600	
リログループ	59,300	3,045.00	180,568,500	
日本エスリード	4,400	2,277.00	10,018,800	
日神不動産	14,900	809.00	12,054,100	
日本エスコン	20,100	1,004.00	20,180,400	
タカラレーベン	52,400	488.00	25,571,200	
サンヨーハウジング名古屋	5,800	1,240.00	7,192,000	
イオンモール	72,100	2,192.00	158,043,200	
ファースト住建	4,200	1,756.00	7,375,200	
ランド	241,400	16.00	3,862,400	
カチタス	11,400	3,055.00	34,827,000	
東祥	6,700	4,035.00	27,034,500	
トーセイ	13,600	1,362.00	18,523,200	
穴吹興産	1,200	3,075.00	3,690,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	69,500	1,345.00	93,477,500	
サンフロンティア不動産	12,600	1,227.00	15,460,200	
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	897.00	7,714,200	
インテリックス	3,200	1,138.00	3,641,600	
ランドビジネス	6,900	333.00	2,297,700	

グランディハウス	9,900	491.00	4,860,900	
東武鉄道	121,200	3,340.00	404,808,000	
相鉄ホールディングス	36,300	2,871.00	104,217,300	
東京急行電鉄	308,000	1,753.00	539,924,000	
京浜急行電鉄	155,300	1,952.00	303,145,600	
小田急電鉄	168,600	2,191.00	369,402,600	
京王電鉄	63,400	4,715.00	298,931,000	
京成電鉄	78,900	3,535.00	278,911,500	
富士急行	15,500	2,786.00	43,183,000	
新京成電鉄	2,900	2,210.00	6,409,000	
東日本旅客鉄道	203,700	10,125.00	2,062,462,500	
西日本旅客鉄道	102,300	7,482.00	765,408,600	
東海旅客鉄道	101,500	20,185.00	2,048,777,500	
西武ホールディングス	144,500	1,849.00	267,180,500	
鴻池運輸	16,000	1,901.00	30,416,000	
西日本鉄道	31,400	2,912.00	91,436,800	
ハマキョウレックス	8,000	3,575.00	28,600,000	
サカイ引越センター	6,000	5,660.00	33,960,000	
近鉄グループホールディングス	107,400	4,155.00	446,247,000	
阪急阪神ホールディングス	143,200	3,980.00	569,936,000	
南海電気鉄道	50,900	2,731.00	139,007,900	
京阪ホールディングス	47,800	3,420.00	163,476,000	
神戸電鉄	2,600	3,980.00	10,348,000	
名古屋鉄道	83,300	2,769.00	230,657,700	
山陽電気鉄道	8,300	2,766.00	22,957,800	
トランコム	3,000	6,960.00	20,880,000	
日本通運	42,200	7,360.00	310,592,000	
ヤマトホールディングス	188,300	2,796.50	526,580,950	
山九	27,600	5,160.00	142,416,000	
日新	9,300	2,815.00	26,179,500	
丸運	6,000	365.00	2,190,000	
丸全昭和運輸	38,000	521.00	19,798,000	
センコーグループホールディングス	64,600	786.00	50,775,600	
トナミホールディングス	2,600	5,630.00	14,638,000	
ニッコンホールディングス	40,800	2,753.00	112,322,400	
日本石油輸送	1,300	3,330.00	4,329,000	
福山通運	15,700	4,670.00	73,319,000	
セイノーホールディングス	80,400	1,868.00	150,187,200	
神奈川中央交通	2,700	3,700.00	9,990,000	
日立物流	23,600	2,647.00	62,469,200	
丸和運輸機関	5,700	3,790.00	21,603,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	11,800	1,579.00	18,632,200	
日本郵船	89,800	2,350.00	211,030,000	
商船三井	67,900	3,420.00	232,218,000	
川崎汽船	49,600	2,627.00	130,299,200	
ＮＳユナイテッド海運	5,100	2,333.00	11,898,300	
明治海運	11,400	463.00	5,278,200	

飯野海運	54,700	565.00	30,905,500	
共栄タンカー	800	2,073.00	1,658,400	
九州旅客鉄道	90,100	3,365.00	303,186,500	
ＳＧホールディングス	76,100	2,324.00	176,856,400	
日本航空	199,200	4,057.00	808,154,400	
ＡＮＡホールディングス	210,500	4,291.00	903,255,500	
パスコ	10,000	339.00	3,390,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,300	4,540.00	10,442,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,498.00	1,348,200	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,400	3,520.00	15,488,000	
三菱倉庫	37,100	2,522.00	93,566,200	
三井倉庫ホールディングス	61,000	361.00	22,021,000	
住友倉庫	74,000	743.00	54,982,000	
澁澤倉庫	5,900	1,937.00	11,428,300	
ヤマタネ	5,600	1,987.00	11,127,200	
東陽倉庫	19,500	378.00	7,371,000	
乾汽船	8,300	808.00	6,706,400	
日本トランスシティ	26,000	441.00	11,466,000	
ケイヒン	2,100	1,777.00	3,731,700	
中央倉庫	6,600	1,102.00	7,273,200	
川西倉庫	2,200	2,023.00	4,450,600	
安田倉庫	9,700	1,031.00	10,000,700	
東洋埠頭	3,200	1,764.00	5,644,800	
宇徳	9,400	511.00	4,803,400	
上組	67,600	2,360.00	159,536,000	
サンリツ	2,800	819.00	2,293,200	
キムラユニティー	2,900	1,167.00	3,384,300	
キユーソー流通システム	3,100	2,596.00	8,047,600	
近鉄エクスプレス	20,300	2,078.00	42,183,400	
東海運	6,100	418.00	2,549,800	
エーアイテイー	7,700	1,130.00	8,701,000	
内外トランスライン	3,800	1,844.00	7,007,200	
日本コンセプト	2,100	1,551.00	3,257,100	
東京放送ホールディングス	67,000	2,441.00	163,547,000	
日本テレビホールディングス	102,200	2,051.00	209,612,200	
朝日放送	11,000	909.00	9,999,000	
テレビ朝日ホールディングス	30,500	2,338.00	71,309,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	84,900	490.00	41,601,000	
テレビ東京ホールディングス	9,100	2,751.00	25,034,100	
日本ＢＳ放送	3,800	1,370.00	5,206,000	
ビジョン	2,900	2,868.00	8,317,200	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,900	979.00	2,839,100	
ワイヤレスゲート	5,200	1,189.00	6,182,800	
コネクシオ	7,900	2,368.00	18,707,200	
日本通信	100,800	130.00	13,104,000	

クロップス	2,400	925.00	2,220,000	
日本電信電話	798,500	4,976.00	3,973,336,000	
ＫＤＤＩ	1,001,900	2,673.50	2,678,579,650	
光通信	13,400	15,740.00	210,916,000	
ＮＴＴドコモ	823,700	2,740.00	2,256,938,000	
エムティーアイ	15,000	636.00	9,540,000	
ＧＭＯインターネット	40,500	1,894.00	76,707,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,800	747.00	1,344,600	
カドカワ	32,400	1,251.00	40,532,400	
学研ホールディングス	3,700	4,990.00	18,463,000	
ゼンリン	13,500	3,450.00	46,575,000	
昭文社	5,100	775.00	3,952,500	
インプレスホールディングス	9,500	238.00	2,261,000	
東京電力ホールディングス	905,100	416.00	376,521,600	
中部電力	346,900	1,462.00	507,167,800	
関西電力	462,700	1,339.50	619,786,650	
中国電力	156,700	1,265.00	198,225,500	
北陸電力	111,100	862.00	95,768,200	
東北電力	265,500	1,414.00	375,417,000	
四国電力	102,100	1,224.00	124,970,400	
九州電力	250,400	1,217.00	304,736,800	
北海道電力	113,700	637.00	72,426,900	
沖縄電力	18,300	2,875.00	52,612,500	
電源開発	90,200	2,756.00	248,591,200	
エフオン	5,700	1,204.00	6,862,800	
イーレックス	17,800	812.00	14,453,600	
東京瓦斯	241,900	2,716.50	657,121,350	
大阪瓦斯	220,000	2,184.50	480,590,000	
東邦瓦斯	56,200	3,265.00	183,493,000	
北海道瓦斯	31,000	300.00	9,300,000	
広島ガス	23,400	415.00	9,711,000	
西部瓦斯	13,800	2,834.00	39,109,200	
静岡ガス	32,200	898.00	28,915,600	
メタウォーター	6,400	3,205.00	20,512,000	
アイネット	6,300	1,544.00	9,727,200	
松竹	7,400	15,230.00	112,702,000	
東宝	73,200	3,470.00	254,004,000	
エイチ・アイ・エス	16,900	3,925.00	66,332,500	
東映	4,200	11,570.00	48,594,000	
ラックランド	2,100	2,183.00	4,584,300	
エヌ・ティ・ティ・データ	345,600	1,100.00	380,160,000	
共立メンテナンス	19,300	4,670.00	90,131,000	
イチネンホールディングス	12,100	1,498.00	18,125,800	
建設技術研究所	7,500	1,378.00	10,335,000	
スペース	7,000	1,381.00	9,667,000	
長　大	3,300	851.00	2,808,300	

アインホールディングス	15,000	7,220.00	108,300,000	
燦ホールディングス	2,600	2,649.00	6,887,400	
ピー・シー・エー	1,700	1,861.00	3,163,700	
スバル興業	800	6,530.00	5,224,000	
東京テアトル	4,500	1,475.00	6,637,500	
タナベ経営	2,100	1,839.00	3,861,900	
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	1,929.00	3,665,100	
ナガワ	2,200	4,480.00	9,856,000	
よみうりランド	2,400	4,715.00	11,316,000	
東京都競馬	8,100	3,745.00	30,334,500	
常磐興産	4,400	1,894.00	8,333,600	
カナモト	16,500	3,430.00	56,595,000	
東京ドーム	43,900	1,008.00	44,251,200	
ＤＴＳ	11,600	3,820.00	44,312,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,700	4,580.00	236,786,000	
シーイーシー	6,600	3,280.00	21,648,000	
カプコン	23,800	4,425.00	105,315,000	
西尾レントオール	9,500	3,390.00	32,205,000	
アイ・エス・ビー	2,200	1,381.00	3,038,200	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	62,000	38.00	2,356,000	
日本空港ビルデング	32,700	4,070.00	133,089,000	
トランス・コスモス	12,000	2,868.00	34,416,000	
乃村工藝社	25,300	2,144.00	54,243,200	
ジャステック	6,500	1,286.00	8,359,000	
ＳＣＳＫ	25,700	4,365.00	112,180,500	
藤田観光	4,300	3,235.00	13,910,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,700	1,806.00	12,100,200	
日本管財	11,600	2,113.00	24,510,800	
トーカイ	10,500	2,527.00	26,533,500	
白洋舎	1,200	3,365.00	4,038,000	
セコム	115,000	7,850.00	902,750,000	
日本システムウエア	3,700	2,592.00	9,590,400	
セントラル警備保障	5,200	2,644.00	13,748,800	
アイネス	14,100	1,094.00	15,425,400	
丹青社	22,200	1,077.00	23,909,400	
メイテック	12,700	6,100.00	77,470,000	
ＴＫＣ	10,400	4,585.00	47,684,000	
富士ソフト	15,400	4,045.00	62,293,000	
応用地質	12,200	1,552.00	18,934,400	
船井総研ホールディングス	22,500	2,118.00	47,655,000	
ＮＳＤ	18,300	2,231.00	40,827,300	
進学会ホールディングス	5,000	608.00	3,040,000	
丸紅建材リース	11,000	235.00	2,585,000	
オオバ	8,600	678.00	5,830,800	
コナミホールディングス	45,500	5,740.00	261,170,000	

いであ	2,200	1,123.00	2,470,600	
学究社	3,000	1,745.00	5,235,000	
ベネッセホールディングス	39,700	3,980.00	158,006,000	
イオンディライト	13,400	3,820.00	51,188,000	
ナック	7,300	1,002.00	7,314,600	
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,413.00	7,721,600	
ニチイ学館	20,600	1,193.00	24,575,800	
ダイセキ	18,200	3,185.00	57,967,000	
ステップ	4,000	1,791.00	7,164,000	
日鉄住金物産	8,700	6,150.00	53,505,000	
泉州電業	3,700	2,960.00	10,952,000	
元気寿司	2,800	2,703.00	7,568,400	
トラスコ中山	23,200	2,832.00	65,702,400	
ヤマダ電機	374,300	690.00	258,267,000	
オートバックスセブン	44,400	2,109.00	93,639,600	
モリト	8,900	972.00	8,650,800	
アークランドサカモト	18,900	1,767.00	33,396,300	
ニトリホールディングス	44,300	17,565.00	778,129,500	
グルメ杵屋	8,000	1,173.00	9,384,000	
愛眼	9,100	494.00	4,495,400	
ケーユーホールディングス	5,800	1,112.00	6,449,600	
吉野家ホールディングス	36,700	1,915.00	70,280,500	
加藤産業	17,400	3,690.00	64,206,000	
イノテック	9,700	1,280.00	12,416,000	
イエローハット	10,500	3,255.00	34,177,500	
松屋フーズ	5,400	3,975.00	21,465,000	
ＪＢＣＣホールディングス	8,800	1,147.00	10,093,600	
ＪＫホールディングス	11,200	913.00	10,225,600	
サガミチェーン	14,900	1,408.00	20,979,200	
日伝	9,300	2,196.00	20,422,800	
関西スーパーマーケット	8,400	1,131.00	9,500,400	
ミロク情報サービス	9,800	3,190.00	31,262,000	
北沢産業	9,500	359.00	3,410,500	
杉本商事	6,000	1,877.00	11,262,000	
因幡電機産業	14,700	5,010.00	73,647,000	
王将フードサービス	8,200	5,110.00	41,902,000	
プレナス	12,500	2,086.00	26,075,000	
ミニストップ	8,300	2,167.00	17,986,100	
アークス	20,900	2,500.00	52,250,000	
バローホールディングス	26,000	2,939.00	76,414,000	
バイテックホールディングス	5,100	1,776.00	9,057,600	
東テク	3,700	2,429.00	8,987,300	
ミスミグループ本社	129,600	3,105.00	402,408,000	
藤久	900	1,690.00	1,521,000	
アルテック	9,600	348.00	3,340,800	
ベルク	5,000	6,030.00	30,150,000	
大　庄	6,000	1,653.00	9,918,000	

タキヒヨー	3,700	2,240.00	8,288,000	
ファーストリテイリング	18,700	43,330.00	810,271,000	
ソフトバンクグループ	503,700	9,050.00	4,558,485,000	
蔵王産業	1,800	1,863.00	3,353,400	
スズケン	50,900	4,290.00	218,361,000	
サンドラッグ	47,300	4,935.00	233,425,500	
サックスバー　ホールディングス	10,500	1,163.00	12,211,500	
ジェコス	7,700	1,275.00	9,817,500	
ヤマザワ	2,300	1,721.00	3,958,300	
やまや	2,300	2,974.00	6,840,200	
ルネサスイーストン	10,200	762.00	7,772,400	
ベルーナ	27,400	1,265.00	34,661,000	
合計	137,498,640		287,790,562,310	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘　柄	株　式　数
トヨタ自動車	500,000

（２）株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	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	61,855,153,624円
同期中一部解約元本額	81,601,067,462円	82,988,617,959円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	10,994,419,624円	14,134,325,523円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	141,332,941円	133,630,997円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	123,053,964円	110,362,927円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	42,096,310円	35,282,821円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	408,295,789円	683,723,247円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	117,006,883円	186,801,804円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	26,386,628円	25,093,209円
たわらノーロード　国内債券	1,032,184,471円	3,053,849,271円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ向け＞	755,274円	754,493円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	－円	28,763,462円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	2,797,390円
たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	6,736,262円
たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	1,846,591円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	－円	427,592円

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	－円	2,978,010円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	－円	4,270,909円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	－円	1,180,680円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	－円	401,500円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	－円	1,023,651円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	371,890円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	1,490,812円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	457,571円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	61,604円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,135,343,680円	12,519,073,028円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	4,912,270,839円	5,538,860,716円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	6,923,494,244円	8,094,578,747円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,718,978,952円	3,297,220,345円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,657,494,852円	1,822,404,385円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,744,690,480円	2,021,440,802円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	247,785,929円	317,189,866円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	98,517,017円	88,286,247円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,182,976,967円	2,216,731,348円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	1,831,280円	2,224,336円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	356,002,601円	474,201,213円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	254,997,478円	434,763,343円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	63,187,247円	99,374,518円
投資のソムリエ	7,588,674,489円	3,477,837,094円
クルーズコントロール	2,463,848,090円	444,343,713円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	240,441,643円	239,353,124円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	1,159,116,457円	1,836,523,487円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	121,311,364円	232,011,746円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	909,502円	165,091円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	6,058,111円	1,123,528円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	19,630,847円	3,353,398円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	145,993,757円	479,665,477円
ダイナミック・ナビゲーション	460,972円	187,857円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	797,399,737円	7,432,216,368円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	－円	627,520円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	－円	487,386円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	－円	2,441,185円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	1,160,053円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	－円
ＤＩＡＭ高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	31,037,609,957円	22,730,596,257円
ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	548,565,885円	－円

ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	511,856,892円	496,308,197円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	452,644,236円	341,395,897円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	278,222,935円	250,881,142円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	113,027,666円	79,938,561円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	315,455,060円	223,396,523円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	131,854,367円	92,500,119円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	72,187,907円	59,711,189円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,253,845,204円	100,150,915円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,015,599,225円	178,394,585円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,998,400,243円	6,083,808,272円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,474,267,418円	3,221,440,007円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,265,110,925円	5,882,071,810円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	734,607,542円	647,151,905円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	1,931,112,724円	512,238,067円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,285,930,749円	3,765,931,500円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	5,583,515,787円	3,503,037,017円

ＤＩＡＭ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	194,752,933円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,572,131,426円	229,020,962円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,745,903,203円	1,835,245,523円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	88,332,879,239円	85,219,076,699円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,204,275,501円	1,149,665,356円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,547,500,500円	7,349,516,600円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,992,746,964円	28,046,381,699円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,642,492円	8,994,522円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	369,888円	49,160,062円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,244,501円	8,006,452円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,327,804,436円	31,135,137,178円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	547,765,920円	497,599,388円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	139,363,216円	137,417,719円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	640,261,286円	395,041,757円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	454,852円	118,842,206円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	351,483円	393,617円
計	295,190,206,036円	274,056,741,701円

２．　受益権の総数	295,190,206,036口	274,056,741,701口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,861,783,300	405,859,100
地方債証券	52,629,642	14,402,409
特殊債券	14,982,365	5,464,632
社債券	25,950,390	5,513,390
合計	1,955,345,697	431,239,531

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月15日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月15日から平成30年2月26日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１口当たり純資産額	1.2800円	1.2874円
（1万口当たり純資産額）	（12,800円）	（12,874円）

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年2月26日現在

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

３１０回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,367,022,000	
３１２回　利付国庫債券（１０年）	2,200,000,000	2,282,456,000	
３１３回　利付国庫債券（１０年）	1,790,000,000	1,868,777,900	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,566,510,000	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,043,970,000	
３１８回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,040,400,000	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,570,605,000	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,564,860,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,614,600,000	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,079,640,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,562,535,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	519,700,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	620,000,000	647,422,600	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,553,730,000	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	1,800,000,000	1,886,418,000	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,260,012,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,560,420,000	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,082,740,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	2,100,000,000	2,189,817,000	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,075,100,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,557,945,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,332,448,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,065,180,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	1,800,000,000	1,859,400,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,583,400,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	3,500,000,000	3,590,370,000	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,029,040,000	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,027,420,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	3,500,000,000	3,529,925,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	3,500,000,000	3,527,720,000	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,021,690,000	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	3,500,000,000	3,522,715,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	3,360,000,000	3,380,798,400	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	380,000,000	382,040,600	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	130,703,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	126,773,000	
３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	251,910,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	268,178,000	
５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	251,848,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	258,434,000	
７回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	385,518,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	243,698,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	482,660,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	380,553,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	376,401,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	659,815,000	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	267,570,000	

１６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	536,284,000	
１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	265,084,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	820,000,000	1,073,880,200	
１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	262,570,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	404,688,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	394,755,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	470,000,000	635,660,900	
２３回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	812,154,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	406,731,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	528,776,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	937,909,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	953,673,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,230,327,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,217,646,000	
３０回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,204,011,000	
３１回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,189,647,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,481,535,000	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,674,933,000	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,601,832,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,684,358,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,687,894,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,791,482,000	
３８回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,132,758,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	1,026,240,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	768,807,400	
４１回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	990,016,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	990,472,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	990,928,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	992,496,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	750,000,000	894,517,500	
４６回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,073,538,000	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,218,890,000	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,286,802,000	
４９回　利付国庫債券（３０年）	990,000,000	1,158,042,600	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,017,480,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	977,570,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,031,668,000	
５３回　利付国庫債券（３０年）	820,000,000	789,922,400	
５４回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	912,906,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	810,584,000	
５６回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	910,881,000	
５７回　利付国庫債券（３０年）	630,000,000	636,892,200	
４３回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	900,841,400	
４５回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	947,007,000	
４６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	527,080,000	
４７回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,006,886,000	
４８回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	537,095,000	

５０回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	828,648,600	
５１回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	642,372,000	
５２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	593,670,000	
５４回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	762,125,000	
５５回　利付国庫債券（２０年）	810,000,000	880,194,600	
５７回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,228,547,300	
５８回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	655,404,000	
６０回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	633,211,600	
６１回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	844,920,000	
６２回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	838,408,000	
６４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	666,888,000	
６５回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,227,446,000	
６７回　利付国庫債券（２０年）	870,000,000	974,800,200	
７０回　利付国庫債券（２０年）	1,250,000,000	1,445,575,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	1,250,000,000	1,428,250,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	901,247,800	
７５回　利付国庫債券（２０年）	870,000,000	1,002,779,400	
７８回　利付国庫債券（２０年）	890,000,000	1,016,522,400	
８１回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,188,403,700	
８３回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	909,667,200	
８５回　利付国庫債券（２０年）	1,040,000,000	1,217,871,200	
８８回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,430,448,000	
９０回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,425,948,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,539,096,000	
９３回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	825,643,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	950,824,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,453,476,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,689,562,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,680,938,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,578,044,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,312,725,200	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,575,769,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,822,725,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	1,320,000,000	1,579,789,200	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	1,170,000,000	1,443,089,700	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,838,595,000	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,843,650,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,990,720,000	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	210,000,000	258,793,500	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	1,000,000,000	1,222,810,000	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,078,785,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,820,205,000	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	2,109,955,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	1,410,000,000	1,772,158,500	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	854,798,000	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	845,719,000	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,815,615,000	

	１３２回　利付国庫債券（２０年）	1,260,000,000	1,509,895,800	
	１３３回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	218,111,400	
	１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,092,375,000	
	１３５回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	960,104,000	
	１３７回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,357,254,300	
	１３８回　利付国庫債券（２０年）	100,000,000	117,347,000	
	１４０回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,924,544,000	
	１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,650,000,000	1,987,375,500	
	１４２回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	304,680,000	
	１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,720,000,000	2,047,969,600	
	１４４回　利付国庫債券（２０年）	260,000,000	305,819,800	
	１４５回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,689,310,000	
	１４６回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,691,354,000	
	１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	2,028,950,000	
	１４８回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,531,894,000	
	１４９回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	2,240,518,000	
	１５０回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,745,145,000	
	１５１回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	2,034,792,000	
	１５２回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,469,559,000	
	１５３回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,947,639,000	
	１５４回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,692,705,000	
	１５５回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,749,408,000	
	１５６回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,482,525,000	
	１５７回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,236,664,000	
	１５８回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,502,550,000	
	１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,525,785,000	
	１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,342,887,000	
	１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,140,000,000	1,153,976,400	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,212,732,000	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	810,000,000	817,233,300	
国債証券　合計		269,120,000,000	295,128,432,800	
地方債証券	６８０回　東京都公募公債	200,000,000	205,592,000	
	６８５回　東京都公募公債	500,000,000	512,750,000	
	６８８回　東京都公募公債	200,000,000	204,676,000	
	６９７回　東京都公募公債	500,000,000	517,920,000	
	７０１回　東京都公募公債	700,000,000	724,010,000	
	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	518,630,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	313,380,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	416,004,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	114,404,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	238,364,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	356,157,000	
	２１年度６回　北海道公募公債	200,000,000	204,710,000	
	２２年度１２回　北海道公募公債	200,000,000	207,384,000	
	１６６回　神奈川県公募公債	300,000,000	306,234,000	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	311,046,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	309,162,000	

３３６回　大阪府公募公債	200,000,000	205,970,000	
３４５回　大阪府公募公債	300,000,000	310,467,000	
３５６回　大阪府公募公債	200,000,000	207,924,000	
３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	310,362,000	
３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	314,397,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	359,520,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	205,218,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	319,365,000	
２１年度５回　静岡県公募公債	197,000,000	201,263,080	
２２年度８回　静岡県公募公債	200,000,000	205,150,000	
２３年度９回　静岡県公募公債	200,000,000	207,632,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	115,564,000	
２２年度６回　愛知県公募公債	200,000,000	205,580,000	
２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	521,570,000	
２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	312,828,000	
２２年度１回　広島県公募公債	200,000,000	206,034,000	
２１年度４回　埼玉県公募公債	200,000,000	204,056,000	
２３年度２回　埼玉県公募公債	200,000,000	207,546,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	413,956,000	
２１年度３回　福岡県公募公債	200,000,000	204,552,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	207,642,000	
２１年度６回　千葉県公募公債	200,000,000	204,352,000	
２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	310,320,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	208,714,000	
８０回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,266,000	
９４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,536,000	
９９回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	726,635,000	
１０６回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,082,000	
１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,295,000	
１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	726,145,000	
１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,105,000	
１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,700,000	
１２６回　共同発行市場公募地方債	793,900,000	827,688,384	
１２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,920,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,476,000	
１３７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,010,000	
１３９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,715,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,285,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,116,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,460,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,460,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,655,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	465,520,500	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	120,040,000	
２２年度３回　横浜市公募公債	200,000,000	205,842,000	
２２年度５回　横浜市公募公債	200,000,000	206,910,000	
２３年度４回　横浜市公募公債	450,000,000	467,014,500	

	２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	418,216,000	
	２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	208,066,000	
	２回　川崎市公募公債　１５年	100,000,000	103,718,000	
	２１年度２回　北九州市公募公債	200,000,000	204,850,000	
	２３年度１回　千葉市公募公債	200,000,000	208,462,000	
地方債証券　合計		22,040,900,000	22,904,593,464	
特殊債券	４８回　高速道路機構債	700,000,000	712,663,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	723,611,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	103,527,000	
	９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,960,000	
	１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	323,541,000	
	７８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	711,739,000	
	８２回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,041,000	
	８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	306,351,000	
	１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	415,580,000	
	１８０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,036,960,000	
	１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,440,000	
	１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	523,985,000	
	１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	346,595,700	
	２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,855,000	
	３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	801,816,000	
	８回　政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	663,329,940	
	３回　政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,269,470	
	５回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,590,000	
	８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,578,000	
	１０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	513,575,000	
	１５回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,100,000	
	２０回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,749,000	
	２４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,520,000	
	３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,886,000	
	４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	416,916,000	
	５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,795,000	
	５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	566,205,720	
	６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,272,000	
	３７回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	306,549,000	
	６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	48,447,000	51,333,472	

	８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	34,120,000	36,131,715	
	９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	51,051,000	54,080,876	
	２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	53,952,000	57,541,426	
	１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	21,292,000	22,046,588	
	１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	107,395,000	110,583,557	
	４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,908,000	32,188,790	
	４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,246,000	19,417,575	
	４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,000,000	73,275,930	
	５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,321,000	54,291,972	
	１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,180,000	93,892,271	
	２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,215,000	192,372,965	
	３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	317,256,000	336,665,722	
	い第７６９号　利付商工債	200,000,000	200,398,000	
	い第７７９号　利付商工債	200,000,000	200,440,000	
	２９３回　利附信金中金債	400,000,000	400,948,000	
	３０２回　利附信金中金債	300,000,000	300,888,000	
	３２５回　利附信金中金債	400,000,000	399,236,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	519,330,000	
特殊債券　合計		15,296,383,000	15,762,062,689	
社債券	３３７回　東京交通債	200,000,000	213,312,000	
	２７回　ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,974,000	
	２２回　中日本高速道路債券	300,000,000	307,830,000	
	７回　キリンホールディングス社債	100,000,000	102,580,000	
	９回　日本たばこ産業社債	200,000,000	200,650,000	
	４１回　住友化学社債	100,000,000	102,456,000	
	１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,460,000	
	６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	104,586,000	
	８回　ブリヂストン社債	200,000,000	200,612,000	
	２３回　ジェイ　エフ　イー　ホールディングス社債	100,000,000	99,736,000	
	３０回　豊田自動織機社債	200,000,000	199,756,000	
	１２回　パナソニック社債	200,000,000	201,138,000	
	１３回　パナソニック社債	100,000,000	101,530,000	
	５６回　日産自動車社債	100,000,000	100,870,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	208,426,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	205,880,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	104,195,000	
	４５回　住友商事社債	100,000,000	103,566,000	
	４７回　住友商事社債	100,000,000	103,237,000	
	４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	103,514,000	
	７回　みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	103,001,000	
	５７回　東京三菱銀行社債	200,000,000	219,638,000	

７回　東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	207,184,000	
２５回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	206,314,000	
２８回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	208,198,000	
３２回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	300,000,000	313,686,000	
４回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,419,000	
６回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,877,000	
７回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	200,000,000	206,568,000	
９回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	104,582,000	
１２回　住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,287,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,784,000	
１０回　セブン銀行社債	100,000,000	103,270,000	
２０回　三井住友銀行劣後社債	200,000,000	205,850,000	
２２回　三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,628,000	
２３回　三井住友銀行劣後社債	400,000,000	416,392,000	
１４回　みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	206,368,000	
１５回　トヨタファイナンス社債	200,000,000	208,312,000	
４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	205,960,000	
１６４回　オリックス社債	100,000,000	101,427,000	
１４回　大和証券グループ本社社債	100,000,000	102,388,000	
２６回　野村ホールディングス社債	100,000,000	103,587,000	
４２回　野村ホールディングス社債	200,000,000	204,972,000	
４６回　野村ホールディングス社債	200,000,000	200,860,000	
３８回　三井不動産社債	200,000,000	205,610,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	113,175,000	
９６回　三菱地所社債	200,000,000	204,148,000	
８７回　住友不動産社債	100,000,000	101,304,000	
１５回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	319,617,000	
１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,172,000	
２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,846,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	341,220,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	229,132,000	
９回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	218,046,000	
１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	332,016,000	
５回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,953,000	
６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,228,000	
１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	315,315,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	221,942,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,507,000	
１５回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,600,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	141,494,400	
６０回　日本電信電話社債	300,000,000	309,861,000	
４９６回　中部電力社債	500,000,000	514,380,000	
５１８回　中部電力社債	200,000,000	200,076,000	
４９２回　関西電力社債	200,000,000	201,226,000	
４９３回　関西電力社債	200,000,000	201,358,000	
３７７回　中国電力社債	400,000,000	419,564,000	
３７９回　中国電力社債	300,000,000	304,830,000	

	２６０回　北陸電力社債	100,000,000	105,077,000	
	３０１回　北陸電力社債	100,000,000	104,863,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	105,831,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	420,968,000	
	４７３回　東北電力社債	300,000,000	304,641,000	
	２５３回　四国電力社債	200,000,000	208,486,000	
	４２３回　九州電力社債	200,000,000	202,848,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	210,948,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	418,476,000	
	３２０回　北海道電力社債	200,000,000	203,076,000	
	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	167,092,240	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	301,188,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	224,966,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	312,579,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	314,265,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	106,588,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	103,711,000	
社債券　合計		16,181,000,000	16,876,083,640	
合計		322,638,283,000	350,671,172,593	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額		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	20,138,120,617円
	同期中一部解約元本額	26,912,951,299円	25,870,306,663円

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

たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	325,553円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	349,076円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	1,079,503円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	35,537,387,647円	37,329,263,860円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	169,317,804円	155,272,827円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	929,041,840円	854,160,900円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,088,784,171円	1,042,632,432円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	151,198,377円	128,651,065円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	421,382,473円	385,326,790円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	340,601,324円	332,068,806円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	42,243,439円	32,623,606円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	932,693,027円	811,105,505円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	215,631,374円	186,981,108円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	27,054,593円	31,116,597円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	52,812,992円	76,880,278円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	106,602,334円	149,320,860円
投資のソムリエ	1,447,959,597円	525,467,955円
クルーズコントロール	423,103,664円	81,781,664円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	44,003,627円	36,100,432円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	88,624,580円	116,625,994円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	44,097,862円	76,361,478円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	156,043円	30,467円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,581,654円	402,135円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	8,454,381円	1,245,127円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	19,173,147円	18,021,302円
ダイナミック・ナビゲーション	1,575,046円	395,905円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	104,007,220円	279,057,463円
ワールドアセットバランス（基本コース）	111,316,911円	621,453,988円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	145,454,314円	2,329,368,925円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	－円	765,901円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	－円	590,045円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	－円	86,101円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	1,328,385円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	163,368,838円	94,665,820円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	3,207,285,574円	2,918,652,247円
ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	180,603,347円	－円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	392,000円	161,164,985円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	－円	208,761,652円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,887,946円	23,652,082円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	161,611,237円	103,714,081円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	298,410,591円	228,512,241円

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,377,575円	12,671,338円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	135,252,737円	82,511,736円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,414,013円	6,831,650円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,373,489円	11,417,217円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	632,259,643円	24,714,283円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	427,409,243円	65,916,546円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	743,979,293円	557,553,761円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	870,032,675円	691,799,410円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,693,426,272円	2,171,548,593円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	1,053,591,911円	786,997,339円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	980,540,194円	225,669,532円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,217,509,769円	924,836,705円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	799,238,075円	430,329,218円
ＤＩＡＭ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	2,754,975円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,561,322,538円	128,701,947円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,507,107,240円	349,183,417円

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,475,846,807円	7,824,134,623円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	519,886,797円	422,676,347円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,623,806,982円	1,345,791,625円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,051,606,509円	5,115,080,431円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,152,055円	2,032,372円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	239,046円	28,378,177円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,078,140円	10,651,080円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,108,064,369円	6,827,085,597円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	84,358,582円	42,301,326円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	169,337円	36,544,094円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	274,012円	257,372円
計	91,611,980,480円	85,879,794,434円
２．　受益権の総数	91,611,980,480口	85,879,794,434口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,851,257,751	4,722,071,531
投資信託受益証券	△1,845,255	12,729,300
投資証券	145,524,021	91,277,789
合計	1,994,936,517	4,826,078,620

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月16日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月16日から平成30年2月26日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年2月27日 現在				平成30年2月26日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	－	－	－	－	42,579,342	－	42,579,000	342
イギリス・ポンド	－	－	－	－	42,579,342	－	42,579,000	342
買　建	2,719,286,282	－	2,719,140,100	△146,182	328,600,107	－	328,448,150	△151,957
アメリカ・ドル	1,783,590,450	－	1,783,503,000	△87,450	240,630,998	－	240,535,060	△95,938
イギリス・ポンド	213,067,188	－	213,052,500	△14,688	7,468,550	－	7,470,000	1,450
オーストラリア・ドル	115,296,548	－	115,280,200	△16,348	－	－	－	－
カナダ・ドル	109,487,616	－	109,478,400	△9,216	9,609,349	－	9,623,880	14,531
ユーロ	497,844,480	－	497,826,000	△18,480	70,891,210	－	70,819,210	△72,000
合計	2,719,286,282	－	2,719,140,100	△146,182	371,179,449	－	371,027,150	△151,615

（注）時価の算定方法

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

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はありません。

株式関連

種類	平成29年2月27日 現在				平成30年2月26日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買　建	6,123,241,477	－	6,212,675,577	89,434,100	7,903,918,528	－	7,901,986,765	△1,931,763
合計	6,123,241,477	－	6,212,675,577	89,434,100	7,903,918,528	－	7,901,986,765	△1,931,763

（注）１．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。
３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

平成30年2月26日現在

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

AMEREN CORP	17,312	56.350	975,531.200	
ARROW ELECTRONICS INC	5,756	82.840	476,827.040	
AUTOLIV INC	6,197	146.830	909,905.510	
AUTODESK INC	14,259	115.030	1,640,212.770	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,205	117.650	3,671,268.250	
AUTOZONE INC	2,015	725.000	1,460,875.000	
AVERY DENNISON CORP	6,262	119.130	745,992.060	
AVNET INC	10,288	42.620	438,474.560	
BALL CORP	24,324	39.730	966,392.520	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	89,717	202.760	18,191,018.920	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	56.900	4,196,318.100	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	68.360	2,384,123.360	
BECTON DICKINSON & CO	18,586	220.340	4,095,239.240	
AMETEK INC	16,775	76.760	1,287,649.000	
VERIZON COMM INC	287,466	48.290	13,881,733.140	
WR BERKLEY CORP	8,134	69.040	561,571.360	
BEST BUY CO INC	19,210	73.170	1,405,595.700	
YUM! BRANDS INC	23,738	79.800	1,894,292.400	
FIRSTENERGY CORP	30,796	33.800	1,040,904.800	
H&R BLOCK INC	16,114	26.820	432,177.480	
BOEING CO	39,546	356.660	14,104,476.360	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	57.850	471,940.300	
BORGWARNER INC	14,648	52.320	766,383.360	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,541	27.200	2,653,115.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	92.630	916,481.220	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,233	111.650	807,564.450	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	636.100	1,169,151.800	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,634	67.950	7,925,280.300	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	190.010	719,757.880	
INGREDION INC	5,305	128.730	682,912.650	
ONEOK INC	26,177	58.020	1,518,789.540	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,418	112.440	496,759.920	
UNITED RENTALS INC	6,332	179.090	1,133,997.880	
SEMPRA ENERGY	16,912	109.570	1,853,047.840	
FEDEX CORP	18,103	252.220	4,565,938.660	
VERISIGN INC	6,321	117.640	743,602.440	
AMPHENOL CORP	21,490	90.830	1,951,936.700	
BROWN-FORMAN CORP	13,612	69.550	946,714.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.270	796,866.840	
CSX CORP	63,992	55.840	3,573,313.280	

CABOT OIL & GAS CORP	32,261	24.460	789,104.060	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	44.120	619,886.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	53.290	1,098,466.770	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	217.460	2,661,710.400	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	69.310	1,533,483.750	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	68.760	1,713,224.160	
CATERPILLAR INC	42,278	162.410	6,866,369.980	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	104.310	1,025,575.920	
CELGENE CORP	54,731	95.610	5,232,830.910	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	92.810	1,011,257.760	
CENTURYLINK INC	63,680	18.210	1,159,612.800	
CERNER CORP	20,809	64.530	1,342,804.770	
JPMORGAN CHASE & CO	248,945	117.310	29,203,737.950	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	49.120	924,536.640	
CIGNA CORP	17,595	194.790	3,427,330.050	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	75.800	832,435.600	
CINTAS CORP	6,282	169.990	1,067,877.180	
CISCO SYSTEMS INC	354,512	44.000	15,598,528.000	
CLOROX COMPANY	9,331	129.430	1,207,711.330	
COCA-COLA CO/THE	286,256	44.040	12,606,714.240	
COGNEX CORP	11,508	54.200	623,733.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,819	70.300	4,205,275.700	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,436	142.170	3,189,726.120	
COMERICA INC	12,068	98.680	1,190,870.240	
COMCAST CORP-CL A	333,255	39.500	13,163,572.500	
CA INC	22,732	35.430	805,394.760	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	36.280	1,027,558.440	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	77.630	1,688,452.500	
CMS ENERGY CORP	19,291	43.860	846,103.260	
COOPER COS INC	3,794	230.540	874,668.760	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	78.660	1,089,834.300	
CORNING INC	65,641	29.300	1,923,281.300	
WR GRACE & CO	3,314	67.720	224,424.080	
SEALED AIR CORP	13,870	42.660	591,694.200	
CUMMINS INC	11,239	169.530	1,905,347.670	
DR HORTON INC	24,498	44.470	1,089,426.060	
DANAHER CORP	44,524	99.330	4,422,568.920	
MOODY'S CORP	11,822	169.300	2,001,464.600	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	41,589	82.530	3,432,340.170	
TARGET CORP	37,486	75.410	2,826,819.260	
DEERE & CO	19,364	166.240	3,219,071.360	
MORGAN STANLEY	96,261	56.070	5,397,354.270	

REPUBLIC SERVICES INC	17,375	66.400	1,153,700.000	
COSTAR GROUP INC	2,278	354.910	808,484.980	
THE WALT DISNEY CO	108,774	107.250	11,666,011.500	
DOLLAR TREE INC	17,493	106.610	1,864,928.730	
DOVER CORP	10,736	102.730	1,102,909.280	
OMNICOM GROUP	16,993	77.310	1,313,728.830	
DTE ENERGY CO	13,122	104.700	1,373,873.400	
DUKE ENERGY CORP	49,292	77.220	3,806,328.240	
FLOWSERVE CORP	8,406	44.260	372,049.560	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	95.350	899,722.600	
EBAY INC	70,731	43.680	3,089,530.080	
BANK OF AMERICA CORP	708,728	32.030	22,700,557.840	
CITIGROUP INC	193,450	77.080	14,911,126.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	103.440	1,054,363.920	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	51.380	962,861.200	
EATON CORP PLC	32,234	82.220	2,650,279.480	
EATON VANCE CORP	9,184	55.450	509,252.800	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	39.740	829,651.980	
DISH NETWORK CORP	16,150	44.480	718,352.000	
ECOLAB INC	19,009	130.840	2,487,137.560	
ELECTRONIC ARTS INC	21,766	127.100	2,766,458.600	
SALESFORCE.COM INC	48,240	114.960	5,545,670.400	
EMERSON ELECTRIC CO	45,625	72.190	3,293,668.750	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	82.590	678,972.390	
ENTERGY CORP	12,199	77.740	948,350.260	
EOG RESOURCES INC	39,963	108.830	4,349,173.290	
EQUIFAX INC	8,495	115.400	980,323.000	
EQT CORP	17,149	52.080	893,119.920	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	142.390	2,297,320.260	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	65.520	822,276.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	38,911	77.000	2,996,147.000	
EXXON MOBIL CORP	298,736	77.530	23,161,002.080	
FMC CORP	8,970	85.720	768,908.400	
NEXTERA ENERGY INC	33,513	156.260	5,236,741.380	
ASSURANT INC	4,089	88.560	362,121.840	
FASTENAL CO	21,654	55.200	1,195,300.800	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	33.450	1,745,186.850	
M&T BANK CORP	9,799	193.510	1,896,204.490	
FISERV INC	14,095	146.190	2,060,548.050	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	48.490	563,599.270	
MACY'S INC	19,266	26.740	515,172.840	
FORD MOTOR CO	261,895	10.700	2,802,276.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	39.310	877,163.340	
FREEPORT-MCMORAN INC	96,812	19.550	1,892,674.600	
FLEX LTD	35,913	17.960	644,997.480	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	68.990	840,022.240	

	GAP INC/THE	18,295	32.690	598,063.550	
	DENTSPLY SIRONA INC	17,477	57.670	1,007,898.590	
	GENERAL DYNAMICS CORP	17,942	221.000	3,965,182.000	
	GENERAL MILLS INC	38,727	52.980	2,051,756.460	
	GENUINE PARTS CO	9,785	94.530	924,976.050	
	GILEAD SCIENCES INC	91,960	80.910	7,440,483.600	
	GARTNER INC	7,153	116.990	836,829.470	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	29.520	534,223.440	
	MCKESSON CORP	15,054	152.650	2,297,993.100	
	NVIDIA CORP	42,645	245.930	10,487,684.850	
	GENERAL ELECTRIC CO	608,018	14.490	8,810,180.820	
	WW GRAINGER INC	3,832	266.190	1,020,040.080	
	HALLIBURTON CO	61,528	48.450	2,981,031.600	
	MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	65.880	1,944,909.360	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,381	266.770	6,770,889.370	
	HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	46.610	601,315.610	
	HARRIS CORP	8,954	158.800	1,421,895.200	
	HASBRO INC	7,736	97.470	754,027.920	
	HENRY SCHEIN INC	11,426	68.050	777,539.300	
	HELMERICH & PAYNE INC	7,213	66.860	482,261.180	
	HERSHEY FOODS CORP	10,132	96.950	982,297.400	
	HP INC	122,725	22.130	2,715,904.250	
	F5 NETWORKS INC	4,874	147.330	718,086.420	
	CROWN HOLDINGS INC NPR	7,781	50.870	395,819.470	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	118.040	406,883.880	
	JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.120	724,568.800	
	HOLLYFRONTIER CORP	11,051	45.000	497,295.000	
	HOLOGIC INC	19,133	39.210	750,204.930	
	UNUM GROUP	16,000	51.730	827,680.000	
	HOME DEPOT INC	83,442	188.350	15,716,300.700	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	83.050	1,070,265.350	
	HORMEL FOODS CORP	19,345	32.640	631,420.800	
	CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.730	886,028.960	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	209.710	490,092.270	
	HUMANA INC	10,468	271.190	2,838,816.920	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	121.110	717,818.970	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	15.990	1,201,824.390	
	RED HAT INC	12,098	146.620	1,773,808.760	
	BIOGEN INC	14,861	292.780	4,351,003.580	
	IDEX CORP	4,699	140.240	658,987.760	
	ILLINOIS TOOL WORKS	22,032	163.960	3,612,366.720	
	INTUIT INC	16,934	171.780	2,908,922.520	
	IDEXX LABORATORIES INC	6,255	187.610	1,173,500.550	

INGERSOLL-RAND PLC	16,730	90.150	1,508,209.500	
INTEL CORP	331,236	47.730	15,809,894.280	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	145.820	813,383.960	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	59.500	1,688,312.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	24.240	706,765.680	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	62.350	494,497.850	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,173	121.950	508,897.350	
INCYTE CORP	12,360	87.800	1,085,208.000	
JOHNSON & JOHNSON	189,511	132.020	25,019,242.220	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	54.040	1,379,641.200	
KLA-TENCOR CORP	11,724	110.470	1,295,150.280	
DEVON ENERGY CORP	34,184	31.430	1,074,403.120	
WESTAR ENERGY INC	9,911	50.760	503,082.360	
KELLOGG CO	18,922	68.540	1,296,913.880	
EAST WEST BANCORP INC	8,509	66.270	563,891.430	
KEYCORP	71,550	20.970	1,500,403.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	24,202	113.650	2,750,557.300	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,616	549.750	4,736,646.000	
KOHLS CORP	11,357	66.470	754,899.790	
KROGER CO	62,093	27.420	1,702,590.060	
LAM RESEARCH CORP	11,522	193.100	2,224,898.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	119.360	734,899.520	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	67.360	850,217.920	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	44.770	429,254.760	
LENNAR CORP	16,200	59.040	956,448.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	24.970	535,906.140	
ELI LILLY & CO	70,283	78.750	5,534,786.250	
L BRANDS INC	16,262	48.710	792,122.020	
LINCOLN NATIONAL CORP	14,163	78.020	1,104,997.260	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,982	105.610	5,067,379.020	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	22,357	70.700	1,580,639.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,240	358.690	6,542,505.600	
LOEWS CORP	21,346	50.340	1,074,557.640	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	13.450	184,224.650	
LOWE'S COS INC	58,178	97.490	5,671,773.220	
DOMINION ENERGY INC	45,131	75.520	3,408,293.120	
SCANA CORP	10,902	39.290	428,339.580	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	35.380	1,139,165.240	
MCCORMICK & CO INC	7,476	106.220	794,100.720	
MCDONALD'S CORPORATION	57,515	163.060	9,378,395.900	

S&P GLOBAL INC	18,409	191.670	3,528,453.030	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	242.940	693,593.700	
MANPOWERGROUP INC	4,257	122.580	521,823.060	
MARKEL CORPORATION	989	1,121.900	1,109,559.100	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	14,774	135.640	2,003,945.360	
MARSH & MCLENNAN COS	35,821	83.570	2,993,560.970	
MASCO CORP	23,043	43.020	991,309.860	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	211.580	928,201.460	
MATTEL INC	24,003	16.640	399,409.920	
METLIFE INC	64,937	47.470	3,082,559.390	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	62.000	1,261,204.000	
MEDTRONIC PLC	95,177	80.390	7,651,279.030	
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,052	72.070	3,607,247.640	
CVS HEALTH CORP	71,913	68.160	4,901,590.080	
MERCK & CO. INC.	193,111	54.870	10,596,000.570	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	172.370	1,236,927.120	
MICROSOFT CORP	516,674	94.060	48,598,356.440	
MICRON TECH INC	76,146	46.530	3,543,073.380	
MIDDLEBY CORP	4,100	134.350	550,835.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,331	85.160	1,305,587.960	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	23.250	615,264.750	
3M CO	42,407	237.020	10,051,307.140	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,042	251.390	1,016,118.380	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,582	106.730	1,129,416.860	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	108.820	788,618.540	
MYLAN NV	31,344	41.450	1,299,208.800	
ILLUMINA INC	10,453	233.840	2,444,329.520	
XCEL ENERGY INC	37,554	44.770	1,681,292.580	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	36.070	971,653.660	
NETAPP INC	18,387	59.620	1,096,232.940	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	24.660	338,828.400	
NEWELL BRANDS INC	36,206	26.800	970,320.800	
NEWMONT MINING CORP	38,093	38.690	1,473,818.170	
NVR INC	236	2,998.800	707,716.800	
NIKE INC-CL B	92,505	68.160	6,305,140.800	
NOBLE ENERGY INC	31,005	30.660	950,613.300	
NORDSTROM INC	9,487	53.560	508,123.720	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,973	142.620	2,848,549.260	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	59.470	1,372,864.950	
NISOURCE INC	22,198	23.600	523,872.800	
TAPESTRY INC	19,175	50.650	971,213.750	

NORTHERN TRUST CORP	16,090	106.560	1,714,550.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,569	351.510	4,066,619.190	
WELLS FARGO & CO	332,695	59.170	19,685,563.150	
NUCOR CORP	23,780	66.940	1,591,833.200	
MONSANTO CO	30,856	121.740	3,756,409.440	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	55.710	887,293.170	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,007	99.040	3,269,013.280	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,121	68.320	3,697,546.720	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,814	139.510	532,091.140	
OGE ENERGY CORP	16,028	32.950	528,122.600	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	254.130	1,620,078.750	
ORACLE CORP	218,956	50.500	11,057,278.000	
PACCAR INC	24,457	71.320	1,744,273.240	
EXELON CORP	69,910	38.240	2,673,358.400	
PARKER HANNIFIN CORP	8,808	183.570	1,616,884.560	
PAYCHEX INC	23,141	66.470	1,538,182.270	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	49.790	324,929.540	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	265.070	1,392,942.850	
PPL CORPORATION	45,666	30.340	1,385,506.440	
PEPSICO INC	100,305	109.680	11,001,452.400	
PENTAIR PLC	11,775	71.390	840,617.250	
PFIZER INC	419,744	36.260	15,219,917.440	
CONOCOPHILLIPS	86,115	57.050	4,912,860.750	
PVH CORP	5,387	148.860	801,908.820	
PG&E CORP	34,361	41.140	1,413,611.540	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	180.000	2,188,440.000	
ALTRIA GROUP INC	135,928	64.590	8,779,589.520	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,538	160.090	5,529,188.420	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	117.040	450,018.800	
GARMIN LTD	7,795	60.350	470,428.250	
AETNA INC	23,744	175.550	4,168,259.200	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	58.150	571,091.150	
PPG INDUSTRIES INC	17,674	117.460	2,075,988.040	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	242.170	591,136.970	
PRAXAIR INC	20,519	155.620	3,193,166.780	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,869	189.810	5,859,244.890	
T ROWE PRICE GROUP INC	16,303	112.300	1,830,826.900	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	102.600	1,064,782.800	
PROCTER & GAMBLE CO	179,972	81.050	14,586,730.600	
PROGRESSIVE CORP	41,336	57.710	2,385,500.560	

	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	50.530	1,875,420.950	
	PULTE GROUP INC	21,209	29.270	620,787.430	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	14.070	427,559.160	
	GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	114.460	1,232,619.740	
	QUALCOMM INC	104,228	63.320	6,599,716.960	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	91.470	931,804.890	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	129.850	331,117.500	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	323.860	1,832,723.740	
	REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	156.330	725,683.860	
	AUTONATION INC	5,772	52.460	302,799.120	
	RESMED INC	9,394	95.420	896,375.480	
	US BANCORP	118,641	55.490	6,583,389.090	
	SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	55.350	404,995.950	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	87.980	763,138.520	
	ROSS STORES INC	28,189	78.870	2,223,266.430	
	ROLLINS INC	5,357	51.180	274,171.260	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	6,983	281.140	1,963,200.620	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	185.470	1,644,562.490	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	130.200	1,600,548.600	
	RAYTHEON COMPANY	20,463	218.240	4,465,845.120	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	242.090	931,562.320	
	ACCENTURE PLC-CL A	43,740	162.950	7,127,433.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	106,478	43.750	4,658,412.500	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	159.960	1,415,486.040	
	ROCKWELL COLLINS INC	12,086	137.130	1,657,353.180	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	139.740	2,760,563.700	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,718	99.820	2,267,710.760	
	PRICELINE GROUP INC	3,460	1,907.020	6,598,289.200	
	SCHLUMBERGER LTD	98,476	66.500	6,548,654.000	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	83,988	52.740	4,429,527.120	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	118.850	1,684,698.750	
	BUNGE LTD	10,334	76.620	791,791.080	
	SEI INVESTMENTS CO	9,315	73.490	684,559.350	
	ANTHEM INC	18,448	235.240	4,339,707.520	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	98.420	1,206,333.940	

	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	63.150	1,354,062.300	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	398.200	2,372,475.600	
	CENTENE CORP	12,713	100.450	1,277,020.850	
	SVB FINANCIAL GROUP	3,468	248.080	860,341.440	
	IAC INTERACTIVE CORP	5,050	153.990	777,649.500	
	SMITH (A.O.) CORP	9,565	66.410	635,211.650	
	ACUITY BRANDS INC	3,087	146.560	452,430.720	
	SNAP-ON INC	3,932	160.220	629,985.040	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,203	108.980	3,291,522.940	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,273	116.320	613,355.360	
	EDISON INTERNATIONAL	21,963	62.170	1,365,439.710	
	SOUTHERN CO	70,353	44.070	3,100,456.710	
	BB&T CORP	55,828	55.360	3,090,638.080	
	SOUTHWEST AIRLINES	11,352	57.990	658,302.480	
	AT&T INC	432,405	36.720	15,877,911.600	
	CHEVRON CORP	133,469	112.590	15,027,274.710	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	10,528	160.940	1,694,376.320	
	STATE STREET CORP	27,099	104.500	2,831,845.500	
	STARBUCKS CORP	101,469	56.140	5,696,469.660	
	STEEL DYNAMICS INC	15,309	47.470	726,718.230	
	STRYKER CORP	24,140	161.700	3,903,438.000	
	NETFLIX INC	30,587	285.930	8,745,740.910	
	STERICYCLE INC	6,853	60.050	411,522.650	
	SUNTRUST BANKS INC	34,756	71.290	2,477,755.240	
	SYMANTEC CORP	41,694	27.430	1,143,666.420	
	KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	48.600	475,939.800	
	SYNOPSYS INC	10,656	85.240	908,317.440	
	SYSCO CORP	35,926	59.680	2,144,063.680	
	INTUITIVE SURGICAL INC	7,788	427.510	3,329,447.880	
	TELEFLEX INC	3,203	255.270	817,629.810	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	20.040	1,279,614.120	
	ANDEAVOR	11,500	94.530	1,087,095.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	69,626	107.040	7,452,767.040	
	TEXTRON INC	19,076	59.280	1,130,825.280	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,065	211.710	5,941,641.150	
	TIFFANY & CO	8,733	104.170	909,716.610	
	TOLL BROTHERS INC	9,526	46.550	443,435.300	
	TORCHMARK CORP	7,699	86.510	666,040.490	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	88.820	1,001,800.780	
	DAVITA INC	10,878	73.180	796,052.040	

TRACTOR SUPPLY CO	9,276	65.860	610,917.360	
TRIMBLE INC	20,073	38.670	776,222.910	
TYSON FOODS INC	21,621	75.080	1,623,304.680	
UGI CORP	12,068	44.150	532,802.200	
MARATHON OIL CORP	58,747	15.540	912,928.380	
UNION PACIFIC CORP	56,617	134.970	7,641,596.490	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	53,690	133.150	7,148,823.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,378	230.160	15,737,880.480	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	116.410	739,319.910	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	121.170	829,772.160	
VF CORP	24,309	75.750	1,841,406.750	
CBS CORP	23,781	55.120	1,310,808.720	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	165.900	2,943,397.800	
VULCAN MATERIALS CO	8,964	121.690	1,090,829.160	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	70.360	4,452,802.960	
WALMART INC	106,126	92.890	9,858,044.140	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	85.490	2,754,145.840	
WATERS CORP	5,963	208.470	1,243,106.610	
ALLERGAN PLC	23,313	162.090	3,778,804.170	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	7,671	124.550	955,423.050	
VAIL RESORTS INC	2,598	210.720	547,450.560	
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	89.140	1,828,796.240	
WABTEC CORP	5,497	83.400	458,449.800	
WHIRLPOOL CORP	5,553	171.440	952,006.320	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	108.230	1,464,243.670	
WYNN RESORTS LTD	6,279	167.130	1,049,409.270	
NASDAQ INC	9,132	80.480	734,943.360	
CME GROUP INC	24,203	164.020	3,969,776.060	
WILLIAMS COS INC	61,081	28.740	1,755,467.940	
LKQ CORP	22,948	40.100	920,214.800	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	39.420	645,817.860	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	61.850	1,429,786.450	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	55.480	1,033,647.880	
CARMAX INC	13,513	62.760	848,075.880	
XEROX CORP	17,455	30.870	538,835.850	
XILINX INC	16,837	70.050	1,179,431.850	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	98.700	691,196.100	
TJX COMPANIES INC	43,999	77.960	3,430,162.040	
ZIONS BANCORP	16,584	55.680	923,397.120	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.150	546,260.000	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	62.120	975,284.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	38.000	649,800.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	121.420	734,712.420	
SIGNATURE BANK	4,171	152.490	636,035.790	
CBRE GROUP INC	20,976	45.950	963,847.200	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	32.270	401,277.450	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	19.650	1,660,149.900	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	228.850	745,135.600	
T-MOBILE US INC	21,188	60.060	1,272,551.280	
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	74.330	2,110,005.710	
MOSAIC CO/THE	26,525	28.740	762,328.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	27,332	37.620	1,028,229.840	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	38.010	2,863,673.400	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	39.760	217,606.480	
CELANESE CORP	9,491	103.950	986,589.450	
DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	10,423	24.010	250,256.230	
EXPEDIA INC	8,709	106.380	926,463.420	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	44.120	815,117.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	160.280	1,695,441.840	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	31.370	1,311,830.660	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	72.480	3,050,320.800	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	17.020	250,125.920	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	33.740	830,408.880	
LIVE NATION	8,864	48.270	427,865.280	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	315.820	570,686.740	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	67.570	418,325.870	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	297.780	1,135,137.360	
MASTERCARD INC	67,015	175.760	11,778,556.400	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	28.460	840,452.260	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	119.590	889,271.240	
HANESBRANDS INC	27,619	19.940	550,722.860	
WESTERN UNION CO	35,222	20.240	712,893.280	
OWENS CORNING	7,333	84.900	622,571.700	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	65.830	613,667.260	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	50.920	589,959.120	

SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,576	92.390	699,946.640	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	28.270	511,658.730	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	101.380	844,495.400	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	19.690	447,868.740	
DELTA AIR LINES INC	9,473	53.460	506,426.580	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	50.250	319,288.500	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	79.420	2,158,397.340	
TE CONNECTIVITY LTD	24,311	102.270	2,486,285.970	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	152.810	1,612,451.120	
WABCO HOLDING INC	3,176	141.240	448,578.240	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	81.860	547,070.380	
VMWARE INC	5,491	126.420	694,172.220	
MERCADOLIBRE INC	2,861	387.260	1,107,950.860	
ULTA BEAUTY INC	4,332	207.110	897,200.520	
INVESCO LTD	29,824	33.190	989,858.560	
MSCI INC	6,462	144.990	936,925.380	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	108,948	106.110	11,560,472.280	
VISA INC	130,002	122.930	15,981,145.860	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	115.370	1,450,431.640	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	80.630	966,914.960	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	87.750	577,833.750	
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	16,085	22.740	365,772.900	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	66.810	2,450,123.130	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	63.520	738,356.480	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	103.610	189,191.860	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	133,961	17.010	2,278,676.610	
XYLEM INC	12,873	75.930	977,446.890	
ALKERMES PLC	12,053	58.600	706,305.800	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,062	111.600	2,573,719.200	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	265.020	922,004.580	
SPLUNK INC	10,674	95.120	1,015,310.880	
HCA HEALTHCARE INC	20,173	100.840	2,034,245.320	

VERISK ANALYTICS INC	10,053	101.540	1,020,781.620	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	147.460	587,923.020	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	206.180	1,349,241.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	95.280	1,016,447.040	
CIT GROUP INC	9,287	54.140	502,798.180	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	125.440	2,841,466.880	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	46.970	772,421.650	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.360	146,016.000	
LEAR CORP	5,132	189.130	970,615.160	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,040	108.750	765,600.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	50.490	536,860.170	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	97.200	1,881,306.000	
FORTINET INC	11,399	49.870	568,468.130	
AON PLC	18,487	141.910	2,623,490.170	
TESLA INC	9,357	352.050	3,294,131.850	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	54.050	615,737.600	
GENERAL MOTORS CO	91,138	40.910	3,728,455.580	
WORLDPAY INC	10,448	78.020	815,152.960	
TRIPADVISOR INC	9,263	42.300	391,824.900	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	28.060	881,336.540	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	9,958	64.720	644,481.760	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	51.040	690,316.000	
APTIV PLC	19,069	93.060	1,774,561.140	
PHILLIPS 66	30,976	91.830	2,844,526.080	
FACEBOOK INC	167,584	183.290	30,716,471.360	
IQVIA HOLDINGS INC	10,051	99.780	1,002,888.780	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	127.930	902,418.220	
SERVICENOW INC	12,206	160.400	1,957,842.400	
PALO ALTO NETWORKS INC	6,215	165.540	1,028,831.100	
TESARO INC	2,646	60.740	160,718.040	
WORKDAY INC	9,187	127.330	1,169,780.710	
ABBVIE INC	112,299	118.750	13,335,506.250	
ZOETIS INC	34,425	82.790	2,850,045.750	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	57.900	707,769.600	
COTY INC	31,440	20.760	652,694.400	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	16.500	499,339.500	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	36.540	471,037.140	
CDW CORP	10,824	72.040	779,760.960	
SPRINT CORP	63,882	5.300	338,574.600	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	53.390	544,524.610	

ARCONIC INC	27,513	25.130	691,401.690	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	37.190	323,255.480	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,175	34.340	452,429.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	42.290	211,703.740	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	41.990	561,322.320	
XL GROUP LTD	17,166	43.450	745,862.700	
BROADCOM LTD	28,737	253.710	7,290,864.270	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	71.780	1,082,011.720	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	15.300	235,773.000	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	28.030	796,164.120	
TECHNIPFMC LTD	32,556	30.700	999,469.200	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	55.340	348,143.940	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	18.950	249,438.850	
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	61.550	429,619.000	
TWITTER INC	43,692	32.660	1,426,980.720	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	21.530	168,730.610	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	38.730	500,391.600	
ALLEGION PLC	5,402	86.170	465,490.340	
PERRIGO CO PLC	8,553	88.250	754,802.250	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	83.810	1,240,052.760	
ARAMARK	17,307	42.100	728,624.700	
SABRE CORP	17,624	23.810	419,627.440	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	26.210	457,469.340	
ARISTA NETWORKS INC	3,158	245.920	776,615.360	
IHS MARKIT LTD	27,511	47.430	1,304,846.730	
FNF GROUP	17,760	39.720	705,427.200	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	37.150	2,135,567.750	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	46.430	1,617,853.350	
CDK GLOBAL INC	8,309	70.000	581,630.000	
QORVO INC	8,784	80.130	703,861.920	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	36.320	413,648.480	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	91.750	717,301.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	31.810	467,925.100	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	33.260	892,698.400	
TRANSUNION	10,341	58.450	604,431.450	
SQUARE INC	17,376	44.860	779,487.360	
DOWDUPONT INC	165,219	73.260	12,103,943.940	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	14,000	38.760	542,640.000	
WESTROCK CO	17,744	66.110	1,173,055.840	
KRAFT HEINZ CO	43,818	69.020	3,024,318.360	

	FORTIVE CORP	21,682	77.140	1,672,549.480	
	WASTE CONNECTIONS INC	18,879	71.060	1,341,541.740	
	ALPHABET INC-CL A	20,892	1,128.090	23,568,056.280	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	18.140	2,054,209.880	
	PAYPAL HOLDINGS INC	81,079	79.690	6,461,185.510	
	FIRST DATA CORP	22,035	16.040	353,441.400	
	DXC TECHNOLOGY CO	19,649	103.980	2,043,103.020	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	46.690	379,776.460	
	ALPHABET INC-CL C	22,297	1,126.790	25,124,036.630	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	213.410	1,257,411.720	
	CHEMOURS CO	12,723	51.080	649,890.840	
	ATHENE HOLDING LTD	8,984	48.230	433,298.320	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,583	365.060	4,958,609.980	
	VISTRA ENERGY CORP	15,825	19.020	300,991.500	
アメリカ・ドル　小計		21,976,886		1,700,394,079.470 (181,806,134,977)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	8.998	233,093.190	
	ASHTEAD GROUP	35,233	20.530	723,333.490	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	17.660	263,081.020	
	BHP BILLITON PLC	153,323	15.160	2,324,376.680	
	BARCLAYS PLC	1,164,260	2.098	2,442,617.480	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.494	355,362.900	
	BT GROUP PLC	576,686	2.440	1,407,113.840	
	SKY PLC	72,210	11.045	797,559.450	
	BUNZL PLC	22,241	20.110	447,266.510	
	EASYJET PLC	13,628	16.315	222,340.820	
	CAPITA PLC	54,894	1.817	99,742.390	
	AVIVA PLC	277,861	5.008	1,391,527.880	
	CRODA INTERNATIONAL	8,407	45.380	381,509.660	
	DIAGEO PLC	179,703	24.775	4,452,141.820	
	SCHRODERS PLC	6,697	34.270	229,506.190	
	DCC PLC	5,936	67.600	401,273.600	
	NATIONAL GRID PLC	229,884	7.580	1,742,520.720	
	GKN PLC	134,180	4.265	572,277.700	
	KINGFISHER PLC	165,680	3.530	584,850.400	
	BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.650	1,272,244.400	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	162,930	44.600	7,266,678.000	
	COBHAM PLC	142,739	1.209	172,571.450	
	NEXT PLC	9,731	49.290	479,640.990	
	IMPERIAL BRANDS PLC	65,739	26.145	1,718,746.150	
	IMI PLC	21,218	12.470	264,588.460	
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	31.600	395,853.200	
	ANGLO AMERICAN PLC	93,573	17.884	1,673,459.530	
	COMPASS GROUP PLC	115,111	15.265	1,757,169.410	

HSBC HOLDINGS PLC	1,415,041	7.234	10,236,406.590	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.593	1,098,521.850	
CENTRICA PLC	392,766	1.441	565,975.800	
UNILEVER PLC	89,305	37.605	3,358,314.520	
MEGGITT PLC	62,181	4.713	293,059.050	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.240	348,727.680	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,714	6.868	238,415.750	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.398	517,367.870	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	26.450	669,396.600	
PEARSON PLC	65,009	7.000	455,063.000	
PERSIMMON PLC	23,150	24.720	572,268.000	
PRUDENTIAL PLC	182,973	18.325	3,352,980.220	
RIO TINTO PLC	85,976	40.015	3,440,329.640	
VODAFONE GROUP PLC	1,906,594	2.038	3,885,638.570	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,231	59.200	2,796,075.200	
RELX PLC	72,305	15.180	1,097,589.900	
OLD MUTUAL PLC	339,296	2.541	862,151.130	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.368	978,771.480	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	246,107	2.684	660,551.180	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.225	458,922.900	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.265	290,392.600	
SSE PLC	73,043	12.515	914,133.140	
BP PLC	1,384,828	4.761	6,593,166.100	
SHIRE PLC	65,457	30.240	1,979,419.680	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.980	595,191.580	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.880	503,713.600	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	8.296	1,970,573.760	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,055,136	0.686	3,467,823.290	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.904	481,753.880	
TESCO PLC	562,988	2.054	1,156,377.350	
3I GROUP PLC	66,784	9.370	625,766.080	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.650	836,860.750	
GLAXOSMITHKLINE PLC	345,537	12.960	4,478,159.520	
WEIR GROUP	18,336	20.040	367,453.440	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	40.560	887,777.280	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.630	141,232.260	
WPP PLC	90,628	13.555	1,228,462.540	
FERGUSON PLC	18,238	52.220	952,388.360	
ASTRAZENECA PLC	88,762	47.520	4,217,970.240	
WHITBREAD PLC	12,159	38.990	474,079.410	

	CARNIVAL PLC	13,153	47.970	630,949.410	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.994	360,148.260	
	JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.376	312,347.480	
	INTERTEK GROUP PLC	11,273	49.320	555,984.360	
	BURBERRY GROUP PLC	29,893	15.405	460,501.660	
	INVESTEC PLC	50,655	6.350	321,659.250	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	46.290	572,236.980	
	ITV PLC	247,210	1.705	421,493.050	
	SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.555	279,542.550	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	60.140	420,859.720	
	G4S PLC	122,250	2.609	318,950.250	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.230	305,622.390	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	38.510	413,058.260	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	319,445	22.585	7,214,665.320	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	261,972	22.850	5,986,060.200	
	TUI AG-DI	30,153	15.460	466,165.380	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	3.761	692,712.260	
	EXPERIAN PLC	62,214	15.630	972,404.820	
	MONDI PLC	24,061	18.775	451,745.270	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	17.175	365,655.750	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	13.110	205,027.290	
	GLENCORE PLC	865,423	3.962	3,428,805.920	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.882	437,478.100	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	6.084	186,267.740	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	24.590	329,653.540	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.114	250,297.600	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	5.700	313,842.000	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.445	172,377.460	
	WORLDPAY INC	10,775	55.010	592,732.750	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	20.310	656,866.020	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.625	276,761.500	
イギリス・ポンド　小計		21,463,355		130,494,541.660 (19,497,189,470)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	24.350	1,909,721.800	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	20.640	2,127,179.040	

	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.406	1,017,571.380	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	510.300	898,128.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	313.700	815,620.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.470	764,388.170	
	NICE LTD	4,035	337.000	1,359,795.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.850	656,405.400	
イスラエル・シュケル　小計		437,969		9,548,808.790 (292,861,966)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	68.070	756,598.050	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	203,883	28.440	5,798,432.520	
	AMCOR LTD	80,741	14.160	1,143,292.560	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	239,994	30.490	7,317,417.060	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	12.740	389,449.060	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	5.180	591,167.500	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.480	949,758.120	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.440	446,320.160	
	AMP LTD	200,498	5.250	1,052,614.500	
	ASX LTD	10,290	58.100	597,849.000	
	BHP BILLITON LTD	232,053	30.680	7,119,386.040	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	34.600	724,731.600	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	4.520	100,262.640	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	18.120	689,284.800	
	CSL LIMITED	32,212	160.910	5,183,232.920	
	REA GROUP LTD	4,119	78.440	323,094.360	
	TRANSURBAN GROUP	149,591	11.420	1,708,329.220	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.050	439,839.050	
	COCHLEAR LTD	3,992	181.500	724,548.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	9.160	1,114,964.360	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	121,208	75.460	9,146,355.680	
	BORAL LIMITED	86,101	7.780	669,865.780	
	RIO TINTO LIMITED	26,822	80.850	2,168,558.700	
	APA GROUP	73,253	8.260	605,069.780	
	ARISTOCRAT LEISU	37,393	24.460	914,632.780	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	7.990	1,370,053.290	
	TPG TELECOM LTD	28,719	6.230	178,919.370	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	56.310	184,415.250	

	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	23.120	658,665.680	
	ORICA LTD	25,308	18.780	475,284.240	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	46.120	401,659.080	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	15.490	572,216.090	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.470	550,791.100	
	MACQUARIE GROUP LTD	21,627	101.970	2,205,305.190	
	SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.500	1,257,943.500	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	29.780	5,744,025.960	
	NEWCREST MINING LTD	51,533	22.120	1,139,909.960	
	OIL SEARCH LTD	93,715	7.560	708,485.400	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.800	518,418.800	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.730	1,023,534.700	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.560	574,079.920	
	SANTOS LTD	133,862	5.120	685,373.440	
	SONIC HEALTHCARE	26,192	24.120	631,751.040	
	TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.730	597,626.040	
	WESFARMERS LTD	81,021	42.530	3,445,823.130	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.330	430,148.290	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,249	28.580	1,721,916.420	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	91,294	26.920	2,457,634.480	
	SEEK LTD	25,899	20.320	526,267.680	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	41.010	187,866.810	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.665	274,834.890	
	AGL ENERGY LTD	46,315	21.560	998,551.400	
	BRAMBLES LTD	115,255	9.640	1,111,058.200	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	13.400	440,337.400	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.680	651,381.120	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	17.630	895,410.070	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	1.920	286,170.240	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	3.260	577,593.760	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.350	1,229,640.950	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD-RTS	6,694	1.770	11,848.380	
オーストラリア・ドル　小計		5,323,388		85,399,995.510 (7,153,957,624)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	51.390	829,485.990	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	62.410	1,917,734.480	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	15.400	1,288,179.200	
	ATCO LTD	7,193	42.140	303,113.020	
	BANK OF MONTREAL	45,451	99.460	4,520,556.460	
	BANK OF NOVA SCOTIA	84,484	78.390	6,622,700.760	

NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	63.760	1,514,682.560	
BCE INC	11,568	56.300	651,278.400	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	57,500	51.190	2,943,425.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	23.650	610,619.350	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.980	603,427.700	
SAPUTO INC	14,101	40.450	570,385.450	
BLACKBERRY LTD	39,652	15.910	630,863.320	
CGI GROUP INC	15,228	73.860	1,124,740.080	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	66.100	749,574.000	
CAE INC	23,000	23.530	541,190.000	
CAMECO CORP	32,627	11.650	380,104.550	
ROGERS COMM-CL B	25,967	58.640	1,522,704.880	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29,471	119.000	3,507,049.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	40.750	3,236,365.000	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	176.150	856,441.300	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	33.560	306,033.640	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	52,687	97.860	5,155,949.820	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.830	226,399.110	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	37.700	525,161.000	
OPEN TEXT CORP	19,756	44.840	885,859.040	
EMPIRE CO LTD	15,093	23.210	350,308.530	
KINROSS GOLD CORP	99,741	4.550	453,821.550	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	34.050	336,822.600	
FORTIS INC	29,002	42.240	1,225,044.480	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	21.100	1,166,745.600	
TELUS CORP	15,945	46.570	742,558.650	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	34.500	664,056.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	34.570	744,706.940	
ENBRIDGE INC	112,614	42.740	4,813,122.360	
IGM FINANCIAL INC	8,426	39.300	331,141.800	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.540	311,502.300	
MANULIFE FINANCIAL CORP	136,517	24.380	3,328,284.460	
LINAMAR CORP	3,827	70.730	270,683.710	
LOBLAW CO LTD	15,354	64.860	995,860.440	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	55.640	362,995.360	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	71.590	1,814,019.010	
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,842	54.220	2,214,453.240	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	644.000	1,278,340.000	

METRO INC	12,389	40.370	500,143.930	
HUSKY ENERGY INC	28,749	16.910	486,145.590	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.540	381,523.680	
METHANEX CORP	7,381	75.010	553,648.810	
ONEX CORP	6,646	92.170	612,561.820	
GOLDCORP INC	51,066	16.270	830,843.820	
POWER CORP OF CANADA	25,052	30.530	764,837.560	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	33.610	587,637.240	
ROYAL BANK OF CANADA	103,945	102.560	10,660,599.200	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	57.250	751,921.500	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	236.400	2,507,494.800	
SHAW COMM INC-B	27,548	25.090	691,179.320	
SUNCOR ENERGY INC	116,895	43.600	5,096,622.000	
LUNDIN MINING CORP	35,268	8.540	301,188.720	
ENCANA CORP	69,257	14.000	969,598.000	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	37.400	1,533,998.400	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	50.480	1,033,275.120	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	131,189	73.970	9,704,050.330	
TRANSCANADA CORP	62,895	58.250	3,663,633.750	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	92.050	524,316.800	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	103.160	320,311.800	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	97.720	1,053,910.200	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	24.770	840,768.110	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	840.510	1,255,721.940	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	12,787	92.960	1,188,679.520	
CI FINANCIAL CORP	20,695	28.830	596,636.850	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	19.820	312,739.780	
KEYERA CORP	13,728	33.560	460,711.680	
ALTAGAS LTD	12,538	26.560	333,009.280	
PEMBINA PIPELINE CORP	30,850	42.490	1,310,816.500	
DOLLARAMA INC	7,504	153.030	1,148,337.120	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	9.630	775,648.350	
VERMILION ENERGY INC	8,291	43.730	362,565.430	
ARC RESOURCES LTD	22,997	13.170	302,870.490	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	4.950	151,623.450	
INTER PIPELINE LTD	24,083	22.880	551,019.040	
NUTRIEN LTD	45,351	63.800	2,893,393.800	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	29.490	441,199.890	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	16.120	277,763.720	

	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	75.300	1,156,080.900	
	SHOPIFY INC	5,021	173.280	870,038.880	
	HYDRO ONE LTD	13,354	21.000	280,434.000	
カナダ・ドル　小計		2,893,366		122,467,991.260 (10,339,972,502)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.390	423,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	3.240	263,736.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.640	326,568.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.360	249,170.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	124,200	29.590	3,675,078.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	12.660	367,140.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	37.830	224,861.520	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.200	219,960.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.530	518,817.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.590	690,769.850	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.300	541,320.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	7.960	783,264.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.000	355,800.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	13.370	3,014,306.610	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.380	2,000,696.360	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.170	530,575.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	28.070	2,652,615.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.380	339,390.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.130	287,960.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.470	277,536.000	
シンガポール・ドル　小計		3,458,374		17,743,313.740 (1,436,498,680)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	167,395	17.440	2,919,368.800	
	NESTLE SA-REGISTERED	219,706	75.760	16,644,926.560	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	84.120	3,149,284.560	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	49,663	222.050	11,027,669.150	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	225.000	637,875.000	
	SIKA INHABER	151	7,720.000	1,165,720.000	
	SGS SA-REG	405	2,409.000	975,645.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	157,558	79.380	12,506,954.040	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	149.700	617,811.900	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,929.000	277,776.000	

	CLARIANT AG-REG	12,888	23.570	303,770.160	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	514.000	922,630.000	
	ABB LTD	126,278	23.310	2,943,540.180	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	75.840	935,941.440	
	GEBERIT AG	2,801	427.400	1,197,147.400	
	LONZA GROUP AG-REG	5,389	240.400	1,295,515.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,695.000	427,125.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	68,300.000	614,700.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,158.000	1,493,336.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,843	312.800	3,391,690.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	55.460	1,812,210.960	
	SONOVA HOLDING AG	3,168	147.450	467,121.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	163.250	601,902.750	
	STRAUMANN HOLDING AG	600	654.500	392,700.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	404.500	790,797.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	77.150	354,272.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	218.000	362,534.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	339.800	756,055.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	134.500	410,225.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	616.000	340,648.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	89.000	533,110.000	
	DUFRY GROUP	2,390	137.250	328,027.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	688.500	875,772.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	61.520	936,765.040	
	SWISS RE LTD	20,638	97.440	2,010,966.720	
	UBS GROUP AG	260,639	18.080	4,712,353.120	
スイス・フラン　小計		1,172,858		79,133,889.180 (9,045,003,533)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	353.000	17,077,081.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	25,793	314.200	8,104,160.600	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	55.940	12,404,583.120	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	103.900	1,366,596.700	
	LUNDBERGS B	3,691	636.000	2,347,476.000	
	SKF AB-B SHS	24,866	174.950	4,350,306.700	
	SANDVIK AB	76,781	151.350	11,620,804.350	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	95,918	97.460	9,348,168.280	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	166.850	3,533,716.150	
	SWEDBANK AB	66,507	207.900	13,826,805.300	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	115.500	12,518,814.000	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	157.750	17,931,758.000	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	354.600	4,071,162.600	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	99.160	2,674,940.160	

	NORDEA AB	218,620	94.100	20,572,142.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	200.200	2,282,880.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	275.000	5,277,525.000	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	142.650	3,437,579.700	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	367.800	12,288,933.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	138.500	9,203,048.000	
	ASSA ABLOY AB-B	68,613	183.300	12,576,762.900	
	TELIA CO AB	184,927	38.740	7,164,071.980	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	194.200	3,260,618.000	
	BOLIDEN AB	21,855	290.400	6,346,692.000	
	ALFA LAVAL AB	17,411	200.200	3,485,682.200	
	KINNEVIK AB-B	18,310	298.200	5,460,042.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	564.000	3,007,248.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	298.900	1,769,488.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	88.180	2,970,960.560	
	HEXAGON AB	18,360	491.000	9,014,760.000	
	ESSITY AB-B	39,797	226.300	9,006,061.100	
スウェーデン・クローナ　小計		1,662,709		238,300,868.600 (3,119,358,370)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	744.200	5,454,986.000	
	A P MOLLER A/S	481	10,040.000	4,829,240.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	9,600.000	2,620,800.000	
	DANSKE BANK A/S	50,188	248.600	12,476,736.800	
	GENMAB A/S	3,899	1,241.000	4,838,659.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	317.900	5,055,881.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,728	323.700	42,640,353.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	447.000	7,066,176.000	
	TDC A/S	68,939	49.590	3,418,685.010	
	COLOPLAST-B	8,286	525.400	4,353,464.400	
	DSV A/S	13,040	482.200	6,287,888.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	220.000	1,438,140.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	319.100	1,544,444.000	
	TRYG A/S	11,107	147.300	1,636,061.100	
	PANDORA A/S	8,251	609.600	5,029,809.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	509.000	3,923,372.000	
	ISS A/S	11,125	228.200	2,538,725.000	
	ORSTED A/S	11,600	379.600	4,403,360.000	
デンマーク・クローネ　小計		377,044		119,556,782.110 (2,108,981,636)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.380	625,188.960	
	FISHER & PAYKEL	37,249	13.300	495,411.700	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	6.500	489,326.500	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.370	537,929.510	

ニュージーランド・ドル　小計		370,145		2,147,856.670 (167,253,599)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	24,816	157.700	3,913,483.200	
	DNB ASA	70,426	155.500	10,951,243.000	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	56.160	5,159,924.640	
	TELENOR ASA	53,178	180.050	9,574,698.900	
	ORKLA ASA	61,421	85.780	5,268,693.380	
	STATOIL ASA	81,414	180.950	14,731,863.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	360.500	4,066,079.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	144.700	2,414,030.100	
ノルウェー・クローネ　小計		411,096		56,080,016.020 (763,809,819)	
ユーロ	CRH PLC	58,956	28.000	1,650,768.000	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	95.700	597,742.200	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	81.900	948,074.400	
	UMICORE	15,320	46.180	707,477.600	
	AIR LIQUIDE	29,845	102.850	3,069,558.250	
	AIRBUS SE	41,270	98.300	4,056,841.000	
	AXA	139,550	25.480	3,555,734.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	20.120	696,594.640	
	ADIDAS AG	13,503	181.800	2,454,845.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.365	1,321,313.170	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	38,521	19.560	753,470.760	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,399.000	219,643.000	
	DANONE	43,686	65.820	2,875,412.520	
	SAFRAN SA	22,050	90.300	1,991,115.000	
	INTESA SANPAOLO	934,915	3.083	2,882,342.940	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	3.240	165,816.720	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,705	87.050	1,976,470.250	
	ACCOR SA	10,552	47.270	498,793.040	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	31.630	239,217.690	
	BOUYGUES	13,996	42.840	599,588.640	
	BNP PARIBAS	78,814	64.890	5,114,240.460	
	RELX NV	70,826	17.275	1,223,519.150	
	THALES SA	8,128	92.160	749,076.480	
	CAPGEMINI SA	11,481	101.650	1,167,043.650	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	46.060	196,399.840	
	INGENICO GROUP	4,334	73.040	316,555.360	
	UNICREDIT SPA	142,664	17.234	2,458,671.370	
	NATIXIS	70,166	7.056	495,091.290	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,216	84.240	1,113,315.840	
	COMMERZBANK AG	72,573	12.854	932,853.340	
	EIFFAGE	4,777	92.560	442,159.120	

FRESENIUS SE & CO KGAA	28,530	63.480	1,811,084.400	
UNITED INTERNET	9,882	55.760	551,020.320	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	47.080	261,105.680	
PUBLICIS GROUPE	15,068	60.920	917,942.560	
MAN SE	3,396	95.200	323,299.200	
FAURECIA	3,831	69.640	266,790.840	
IBERDROLA SA	416,818	6.104	2,544,257.070	
ENI SPA	177,297	13.790	2,444,925.630	
IMERYS SA	2,256	83.750	188,940.000	
JERONIMO MARTINS	19,517	17.595	343,401.610	
KBC GROUPE	18,378	74.520	1,369,528.560	
HANNOVER RUECK SE	3,642	111.700	406,811.400	
WARTSILA OYJ	11,645	58.560	681,931.200	
L'OREAL	18,067	178.700	3,228,572.900	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	19,742	246.750	4,871,338.500	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	24.420	234,432.000	
GEA GROUP AG	11,838	38.810	459,432.780	
BOLLORE	71,347	4.538	323,772.680	
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.866	418,357.860	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	125.300	1,518,385.400	
CONTINENTAL AG	7,776	226.800	1,763,596.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	37.430	2,618,003.920	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.700	183,210.200	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	38.130	358,383.870	
AXEL SPRINGER SE	3,067	73.200	224,504.400	
OMV AG	9,766	47.000	459,002.000	
PERNOD-RICARD	15,401	134.600	2,072,974.600	
PEUGEOT SA	42,232	17.930	757,219.760	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	10,591	68.520	725,695.320	
RENAULT SA	12,442	87.790	1,092,283.180	
REPSOL SA	82,664	14.155	1,170,108.920	
REMY COINTREAU	1,860	109.900	204,414.000	
MERCK KGAA	9,551	82.340	786,429.340	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	45.375	1,620,159.750	
RWE AG	39,183	16.575	649,458.220	
SEB SA	1,405	167.500	235,337.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	50.000	580,100.000	
SOCIETE GENERALE-A	54,209	46.535	2,522,615.810	
VINCI S.A.	35,362	82.900	2,931,509.800	
SODEXO	6,286	99.680	626,588.480	
SOLVAY SA	5,036	114.600	577,125.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	38,899	72.000	2,800,728.000	
VIVENDI SA	72,630	20.900	1,517,967.000	

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

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

ANDRITZ AG	6,265	48.600	304,479.000	
MAPFRE SA	84,474	2.772	234,161.920	
ESSILOR INTL	14,632	109.850	1,607,325.200	
SNAM SPA	158,419	3.771	597,398.040	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	13.950	1,193,910.750	
ENAGAS	18,095	21.490	388,861.550	
WENDEL	2,220	142.100	315,462.000	
WIRECARD AG	7,990	98.740	788,932.600	
TENARIS SA	30,372	14.240	432,497.280	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.732	579,863.310	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.619	308,011.920	
ATLANTIA SPA	34,969	25.490	891,359.810	
ILIAD SA	2,102	197.650	415,460.300	
PROXIMUS	8,922	26.820	239,288.040	
SES FDR	24,585	11.405	280,391.920	
TERNA SPA	81,915	4.658	381,560.070	
GRIFOLS SA	18,800	23.550	442,740.000	
FERROVIAL SA	36,997	17.805	658,731.580	
LANXESS AG	6,856	68.120	467,030.720	
NESTE OYJ	8,839	61.760	545,896.640	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	31.800	306,583.800	
RECORDATI SPA	6,859	29.060	199,322.540	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.230	221,682.090	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,134	138.000	432,492.000	
KONE OYJ	23,717	44.880	1,064,418.960	
ENGIE	129,539	12.975	1,680,768.520	
ALSTOM	12,046	34.200	411,973.200	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	56.650	205,866.100	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.450	231,399.900	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	10.610	368,761.160	
IPSEN SA	2,487	122.000	303,414.000	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	34.550	922,968.700	
ARKEMA SA	3,796	106.400	403,894.400	
LEGRAND SA	19,920	64.400	1,282,848.000	
ADP	2,313	167.100	386,502.300	
ORION OYJ	8,051	26.890	216,491.390	
RTL GROUP SA	3,446	71.300	245,699.800	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.850	563,126.850	
SYMRISE AG	7,926	66.740	528,981.240	
SCOR SE	13,875	34.780	482,572.500	
REXEL SA	23,245	14.620	339,841.900	
PRYSMIAN SPA	14,925	26.540	396,109.500	
CAIXABANK	262,372	3.978	1,043,715.810	

	BUREAU VERITAS SA	21,480	21.970	471,915.600	
	GETLINK	37,646	10.540	396,788.840	
	SUEZ SA	25,406	11.270	286,325.620	
	AMADEUS IT GROUP SA	30,169	59.340	1,790,228.460	
	BRENNTAG AG	9,600	52.100	500,160.000	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.686	299,178.440	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.460	352,574.500	
	EDENRED	13,195	28.750	379,356.250	
	BANKIA SA	63,197	4.082	257,970.150	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.079	251,025.730	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	73.600	384,044.800	
	OSRAM LICHT AG	7,017	66.240	464,806.080	
	KION GROUP AG	4,686	71.360	334,392.960	
	VONOVIA SE	35,308	38.100	1,345,234.800	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.800	571,638.600	
	FERRARI NV	8,338	104.500	871,321.000	
	METRO AG	10,774	15.645	168,559.230	
	INNOGY SE	9,769	32.400	316,515.600	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	11.360	893,407.200	
	AIB GROUP PLC	52,322	5.230	273,644.060	
	LINDE AG-TENDER	13,375	186.000	2,487,750.000	
	NN GROUP NV	21,965	36.300	797,329.500	
	ZALANDO SE	6,674	47.820	319,150.680	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	17.620	1,351,788.780	
	AENA SME SA	5,256	167.250	879,066.000	
	ABN AMRO GROUP NV	29,129	25.530	743,663.370	
	EXOR NV	7,726	59.600	460,469.600	
	ALTICE NV-A	43,403	7.622	330,817.660	
	COVESTRO AG	10,500	93.540	982,170.000	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	53,680	86.610	4,649,224.800	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.712	268,580.680	
	AMUNDI SA	3,894	67.280	261,988.320	
	SCHAEFFLER AG	12,644	13.420	169,682.480	
	UNIPER SE	13,897	25.420	353,261.740	
ユーロ　小計		13,906,573		279,425,320.740 (36,713,692,893)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	114.900	1,907,340.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.820	3,086,480.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	34.350	2,619,531.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	77.450	9,255,275.000	
	PCCW LTD	331,000	4.520	1,496,120.000	

	LI & FUNG LTD	532,400	3.980	2,118,952.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	65.850	3,226,650.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	79,040	285.800	22,589,632.000	
	MTR CORP	118,500	41.800	4,953,300.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	27.500	1,732,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	196.300	10,992,800.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	50.650	4,246,698.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	65.700	6,340,050.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	28.900	2,767,175.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	610,046	15.320	9,345,904.720	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	44.100	2,205,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	67.400	11,053,600.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	33,000	35.400	1,168,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	39.650	10,388,300.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	31.950	1,613,475.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.740	5,180,462.840	
	SINO LAND CO	255,400	13.820	3,529,628.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	128.000	13,184,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	77.500	2,325,000.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	49.500	5,618,250.000	
	WHEELOCK & CO LTD	56,000	56.150	3,144,400.000	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	258,000	4.940	1,274,520.000	
	MINTH GROUP LTD	44,000	46.400	2,041,600.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.600	1,185,600.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	27.200	3,383,680.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	23.200	1,503,360.000	
	AIA GROUP LTD	849,627	63.650	54,078,758.550	
	HKT TRUST / HKT LTD	282,000	9.980	2,814,360.000	
	SANDS CHINA LTD	169,200	44.000	7,444,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	26.450	2,756,090.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	51.050	4,888,037.500	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.310	1,681,300.000	
	WH GROUP LTD	530,500	9.390	4,981,395.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	99.300	19,793,667.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	67.550	12,451,626.600	
香港・ドル　小計		7,342,247		266,367,519.410	

			(3,641,243,990)	
合計	80,796,010		276,085,959,059 (276,085,959,059)	

（2）株式以外の有価証券

平成30年2月26日現在

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	63,819.000	595,431.270	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	998,491.990	
		GPT GROUP	144,955.000	688,536.250	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	653,852.500	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	624,102.130	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,473,361.920	
		STOCKLAND	126,459.000	510,894.360	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	670,698.640	
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,223,905.900	
	オーストラリア・ドル　小計		1,584,164.000	7,439,274.960 (623,188,063)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	520,087.540	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	392,030.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	370,753.000	
	シンガポール・ドル　小計		591,906.000	1,282,870.540 (103,861,199)	
投資信託受益証券　合計			2,176,070	727,049,262 (727,049,262)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	484,960.440	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	895,835.600	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,354,415.910	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	804,740.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,642.000	1,542,816.420	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,350,992.960	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	344,128.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	513,861.600	
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	316,846.660	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,166.000	3,110,653.040	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,545,059.600	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	623,250.900	
		EQUINIX INC	5,448.000	2,151,088.320	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,542,719.300	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,028,169.480	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	705,010.600	

	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,144.000	480,413.920	
	GGP INC	43,463.000	935,323.760	
	HCP INC	34,130.000	763,146.800	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	982,533.870	
	INVITATION HOMES INC	22,567.000	495,345.650	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	615,709.400	
	KIMCO REALTY	32,980.000	503,274.800	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	468,639.270	
	MID AMERICA	8,123.000	715,230.150	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	403,729.760	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,387,057.160	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,182,027.680	
	REALTY INCOME CORP	18,985.000	953,047.000	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	666,458.940	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,412,665.170	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	21,825.000	3,419,104.500	
	SL GREEN	5,382.000	525,390.840	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	535,071.040	
	UDR INC	17,458.000	596,016.120	
	VENTAS INC	25,041.000	1,264,820.910	
	VEREIT INC	72,429.000	499,035.810	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	826,318.370	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,442,735.560	
	WEYERHAEUSER CO	51,939.000	1,838,640.600	
アメリカ・ドル　小計		910,976.000	46,226,287.050 (4,942,514,611)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	467,448.980	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	279,129.390	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,974.000	359,651.750	
	SEGRO PLC	61,113.000	358,977.760	
イギリス・ポンド　小計		229,574.000	1,465,207.880 (218,916,709)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	215,604.880	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	228,039.750	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	76,582.120	
カナダ・ドル　小計		23,005.000	520,226.750 (43,922,744)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	207,472.650	
	GECINA SA	3,670.000	569,217.000	
	ICADE	2,234.000	184,863.500	
	KLEPIERRE	17,042.000	584,540.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,390,403.550	

	ユーロ　小計		32,510.000	2,936,497.300 (385,826,380)	
	香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	10,660,200.000	
	香港・ドル　小計		163,500.000	10,660,200.000 (145,724,934)	
投資証券　合計			1,359,565	5,736,905,378 (5,736,905,378)	
合計				6,463,954,640 (6,463,954,640)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比 率
アメリカ・ドル	株式　602銘柄 投資証券　40銘柄	62.60% -%	-% -%	-% 1.70%	66.09%
イギリス・ポンド	株式　99銘柄 投資証券　4銘柄	6.71% -%	-% -%	-% 0.08%	6.98%
イスラエル・シュケル	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	2.46% -%	-% 0.21%	-% -%	2.75%
カナダ・ドル	株式　86銘柄 投資証券　3銘柄	3.56% -%	-% -%	-% 0.02%	3.68%
シンガポール・ドル	株式　20銘柄 投資信託 受益証券　3銘柄	0.49% -%	-% 0.04%	-% -%	0.55%
スイス・フラン	株式　36銘柄	3.11%	-%	-%	3.20%
スウェーデン・クローナ	株式　31銘柄	1.07%	-%	-%	1.10%
デンマーク・クローネ	株式　18銘柄	0.73%	-%	-%	0.75%
ニュージーランド・ドル	株式　4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式　8銘柄	0.26%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式　237銘柄 投資証券　5銘柄	12.64% -%	-% -%	-% 0.13%	13.13%
香港・ドル	株式　40銘柄 投資証券　1銘柄	1.25% -%	-% -%	-% 0.05%	1.34%

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,516,479,320	2,427,443,670
コール・ローン		1,346,029,738	409,777,133
国債証券		241,910,908,444	211,625,176,962
派生商品評価勘定		－	189,709
未収利息		2,166,219,241	1,890,523,698
前払費用		28,959,700	30,377,614
流動資産合計		247,968,596,443	216,383,488,786
資産合計		247,968,596,443	216,383,488,786
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,975,641	124,925
未払解約金		191,711,000	343,581,000
流動負債合計		198,686,641	343,705,925
負債合計		198,686,641	343,705,925
純資産の部			
元本等			
元本	※1	143,480,057,319	121,490,410,134
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		104,289,852,483	94,549,372,727
元本等合計		247,769,909,802	216,039,782,861
純資産合計		247,769,909,802	216,039,782,861
負債純資産合計		247,968,596,443	216,383,488,786

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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30年2月26日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	149,167,353,470円	143,480,057,319円
同期中追加設定元本額	30,520,903,400円	24,072,066,564円
同期中一部解約元本額	36,208,199,551円	46,061,713,749円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	5,128,943,378円	8,178,188,221円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	13,691,042円	16,550,949円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	44,704,339円	43,087,731円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	62,814,032円	50,607,050円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	39,527,953円	84,738,289円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	42,616,554円	73,029,025円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	39,345,731円	35,964,363円
たわらノーロード　先進国債券	526,660,107円	1,550,612,754円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	606,412円	606,412円

たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	－円	21,598,989円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	170,191円
たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	1,177,165円
たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	532,097円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	－円	28,212円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	－円	563,219円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	－円	751,296円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	－円	147,764円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	57,145円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	343,053円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	193,352円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	262,467円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	4,778,857,729円	5,032,915,649円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	447,249,853円	474,597,820円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,429,659,466円	1,526,634,357円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,468,558,554円	1,682,020,108円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	361,249,152円	366,252,324円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	744,657,416円	780,311,672円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	555,306,358円	633,352,049円

マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	25,651,436円	23,441,361円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	563,298,507円	585,178,050円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	6,021,349円	6,898,943円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	13,825,526円	17,867,916円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	23,935,984円	39,193,230円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	46,434,072円	71,081,407円
クルーズコントロール	1,781,261,902円	471,522,151円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	44,703,644円	67,264,964円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	64,833,181円	121,175,646円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	656,988円	175,031円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	8,685,786円	1,547,650円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	28,434,647円	4,761,061円
ダイナミック・ナビゲーション	336,463円	135,460円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,570,963,668円	1,427,367,462円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	7,162,874,811円	6,984,591,409円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	4,298,221,851円	4,074,076,473円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	3,975,487,139円	3,765,907,771円
ＤＩＡＭアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定）	411,883,612円	－円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	577,394,424円	576,382,992円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	114,026,758円	107,448,126円

ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,328,163,674円	968,520,974円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	815,717,319円	708,041,760円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	83,054,540円	57,495,581円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	153,614,760円	107,057,634円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	38,607,745円	26,555,966円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,058,720円	10,750,815円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,656,036,644円	72,188,716円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	497,398,018円	85,457,559円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,483,992,277円	3,796,951,947円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,756,191,387円	2,498,788,864円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,587,547,137円	4,222,249,727円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	895,832,183円	766,253,872円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	1,987,647,480円	515,526,816円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,199,114,002円	3,592,931,221円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	15,062,291,264円	8,998,213,463円
ＤＩＡＭ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	13,975,529円

ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,036,987,121円	82,547,070円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,186,558,463円	2,967,288,873円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,133,768,314円	15,212,015,467円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,496,046,357円	19,892,468,598円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,346,082円	2,361,904円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	270,776円	34,508,457円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,037,223円	5,621,656円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,350,730,818円	17,700,778,938円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	120,985,005円	107,612,203円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	141,168,530円	83,137,353円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	237,910円	59,633,095円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	154,240円	165,250円
計	143,480,057,319円	121,490,410,134円
２．　受益権の総数	143,480,057,319口	121,490,410,134口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成28年2月26日 至　平成29年2月27日	自　平成29年2月28日 至　平成30年2月26日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,483,683,375	461,126,505
合計	1,483,683,375	461,126,505

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月22日から平成29年2月27日まで及び平成30年2月22日から平成30年2月26日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年2月27日 現在				平成30年2月26日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	－	－	－	－	326,384,024	－	326,319,240	64,784
アメリカ・ドル	－	－	－	－	112,189,343	－	112,143,010	46,333
イギリス・ポンド	－	－	－	－	23,904,192	－	23,904,000	192
マレーシア・リンギット	－	－	－	－	35,800,875	－	35,925,800	△124,925
ユーロ	－	－	－	－	130,597,950	－	130,470,270	127,680
南アフリカ・ランド	－	－	－	－	23,891,664	－	23,876,160	15,504
買　建	1,647,316,001	－	1,640,340,360	△6,975,641	－	－	－	－
アメリカ・ドル	741,545,528	－	738,975,960	△2,569,568	－	－	－	－
イギリス・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	326,384,024	－	326,319,240	64,784

（注）時価の算定方法

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

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はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年2月27日現在	平成30年2月26日現在
１口当たり純資産額	1.7269円	1.7782円
（1万口当たり純資産額）	（17,269円）	（17,782円）

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年2月26日現在

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.875 07/31/19	15,000,000.000	14,733,300.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,267,395.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	15,000,000.000	14,724,600.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,364,410.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,863,710.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,599,120.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,766,150.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,461,196.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	12,908,480.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,184,773.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,768,400.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,428,880.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,553,750.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	11,000,000.000	10,253,980.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,282,500.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,022,600.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	14,923,800.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,736,955.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,120,665.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,178,250.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	4,800,000.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,339,757.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,231,584.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,695,360.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	12,500,000.000	12,044,875.000	

		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,905,740.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,845,290.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,890,770.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,640,840.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	10,000,000.000	9,474,200.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	17,500,000.000	17,145,800.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,224,595.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,019,015.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,833,080.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	10,000,000.000	9,570,300.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,502,840.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,948,400.000	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,218,000.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,527,990.000	
		US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,397,415.000	
		US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,962,850.000	
		US T N/B 2.125 05/15/25	5,000,000.000	4,779,250.000	
		US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,329,950.000	
		US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,870,200.000	
		US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,984,760.000	
		US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,867,900.000	
		US T N/B 2.125 09/30/24	10,000,000.000	9,608,500.000	
		US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,476,746.000	
		US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,821,840.000	
		US T N/B 2.25 02/15/27	12,000,000.000	11,400,000.000	
		US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,442,500.000	
		US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,578,720.000	
		US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,730,050.000	
		US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,253,804.000	
		US T N/B 2.25 11/15/25	10,000,000.000	9,595,300.000	
		US T N/B 2.25 11/15/27	2,100,000.000	1,986,453.000	
		US T N/B 2.25 12/31/23	2,500,000.000	2,437,875.000	
		US T N/B 2.375 05/15/27	6,000,000.000	5,754,360.000	
		US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,694,855.000	

		US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,300,581.000	
		US T N/B 2.5 02/15/45	5,500,000.000	4,840,385.000	
		US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,385,150.000	
		US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,877,600.000	
		US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,855,148.000	
		US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,932,480.000	
		US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,617,810.000	
		US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,042,840.000	
		US T N/B 2.75 02/15/19	12,000,000.000	12,078,240.000	
		US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,413,160.000	
		US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,617,104.000	
		US T N/B 2.75 08/15/47	6,100,000.000	5,616,758.000	
		US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,032,800.000	
		US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,173,390.000	
		US T N/B 2.875 05/15/43	4,700,000.000	4,480,040.000	
		US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,641,966.000	
		US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,160,376.000	
		US T N/B 3.0 02/15/47	5,200,000.000	5,040,308.000	
		US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,222,284.600	
		US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,858,950.000	
		US T N/B 3.0 05/15/47	6,900,000.000	6,685,410.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	4,960,107.000	
		US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,786,042.000	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,800,972.000	
		US T N/B 3.125 02/15/43	3,600,000.000	3,591,828.000	
		US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,152,750.000	
		US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,167,760.000	
		US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,580,220.000	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,801,404.000	
		US T N/B 3.375 05/15/44	5,200,000.000	5,409,612.000	
		US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,078,560.000	
		US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,387,542.000	
		US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,367,920.000	

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

		UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,000,000.000	1,948,920.000	
		UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,750,814.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,414,832.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,000,000.000	1,811,800.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,400,000.000	4,464,812.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,000,000.000	996,700.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,150,000.000	3,250,390.500	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	900,000.000	875,070.000	
		UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,700,000.000	1,749,028.000	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,400,000.000	2,516,160.000	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,965,116.000	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,650,000.000	2,075,155.500	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,189,000.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,800,000.000	3,539,760.000	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,650,000.000	3,509,660.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,000,000.000	3,212,800.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,100,000.000	3,119,970.000	
		UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,301,882.000	
		UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,113,730.000	
		UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	2,033,797.500	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,700,000.000	2,842,060.000	
		UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,577,587.000	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,341,800.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,424,425.000	

		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,700,000.000	2,398,530.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,120,121.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,826,252.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,080,000.000	3,141,008.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,238,929.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,040,000.000	3,420,672.000	
		UK TREASURY 4.5 03/07/19	400,000.000	415,876.000	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,350,000.000	3,238,770.000	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,200,000.000	3,307,700.000	
		UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,850,000.000	2,000,072.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	2,289,560.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,800,000.000	2,680,020.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,535,287.300	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,941,435.000	
		UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,091,357.000	
	イギリス・ポンド　小計		83,200,000.000 (12,430,912,000)	101,968,195.300 (15,235,068,060)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,800,000.000	3,999,082.000	
		AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,600,000.000	2,692,248.000	
		AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,114,400.000	
		AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,379,384.000	
		AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,150,000.000	1,140,455.000	
		AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,400,000.000	2,283,840.000	
		AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,135,247.000	
		AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	845,379.000	

		AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,520,985.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,881,092.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,669,328.000	
		AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,144,175.000	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,221,210.000	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,206,950.000	
		AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	889,650.000	
		AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,500,000.000	1,605,225.000	
		AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	3,998,088.000	
		AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,757,295.000	
		AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,168,008.000	
		AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,447,300.000	
		AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,000,000.000	4,575,520.000	
	オーストラリア・ドル　小計		52,700,000.000 (4,414,679,000)	55,674,861.000 (4,663,883,106)	
	カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,478,510.000	
		CANADA 0.75 08/01/19	7,200,000.000	7,103,664.000	
		CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,336,544.000	
		CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	576,078.000	
		CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	716,680.000	
		CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	765,208.000	
		CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,287,488.000	
		CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,236,083.000	
		CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,607,928.000	
		CANADA 1.75 03/01/19	1,100,000.000	1,102,013.000	
		CANADA 1.75 03/01/23	600,000.000	591,450.000	
		CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,507,290.000	
		CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,634,384.000	
		CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,020,783.000	
		CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,557,445.000	
		CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	829,590.000	
		CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,897,212.000	
		CANADA 3.5 06/01/20	3,800,000.000	3,940,638.000	
		CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,310,077.000	
		CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,796,644.000	

	CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,301,174.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,600,000.000	2,235,968.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,145,376.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,220,747.000	
カナダ・ドル　小計		50,650,000.000 (4,276,379,500)	54,198,974.000 (4,576,019,375)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	979,700.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	804,880.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	502,500.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	410,000.000	399,032.500	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	539,550.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	413,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	473,570.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	846,450.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,680,320.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,389,178.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	520,200.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	980,532.000	
シンガポール・ドル　小計		9,250,000.000 (748,880,000)	9,529,312.500 (771,493,140)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,218,540.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,427,306.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	10,300,000.000	11,832,537.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,423,630.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,864,850.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,800,000.000	9,262,000.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	13,146,373.800	
スウェーデン・クローナ　小計		66,280,000.000 (867,605,200)	75,175,236.800 (984,043,850)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	3,000,000.000	2,939,490.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,910,850.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	13,470,000.000	14,782,112.700	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,509,300.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	7,900,000.000	8,522,915.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	14,900,000.000	24,398,303.000	
デンマーク・クローネ　小計		57,770,000.000 (1,019,062,800)	71,062,970.700 (1,253,550,803)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,879,400.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	500,000.000	494,730.000	

	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,816,948.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,815,840.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,400,000.000	8,016,938.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	11,500,000.000	12,470,600.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	6,871,600.000	
ノルウェー・クローネ　小計		43,360,000.000 (590,563,200)	45,366,056.000 (617,885,683)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,994,480.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,174,700.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	3,976,800.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	3,977,190.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,300,000.000	2,147,579.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	2,500,000.000	2,562,200.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	4,700,000.000	4,737,271.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,295,765.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,511,340.200	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,863,774.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,763,582.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,647,360.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,137,056.000	
ポーランド・ズロチ　小計		43,900,000.000 (1,382,411,000)	45,789,097.600 (1,441,898,683)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,954,460.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,198,320.600	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,202,618.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,411,945.000	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,931,720.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,121,621.600	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	784,272.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,769,525.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,615,500.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,446,230.500	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,744,289.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,127,071.300	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,802,646.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,526,790.000	

	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,719,008.000	
マレーシア・リンギット　小計		33,430,000.000 (913,641,900)	33,356,017.600 (911,619,961)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,796,950.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	39,590,250.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	26,000,000.000	24,899,940.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,453,350.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,048,140.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,901,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,919,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,022,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	21,778,020.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,988,240.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,321,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,075,900.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,313,180.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	32,916,730.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,023,750.000	
メキシコ・ペソ　小計		287,000,000.000 (1,653,120,000)	294,048,850.000 (1,693,721,376)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	250,000.000	253,282.500	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,308,372.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	346,150.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,050,680.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	229,261.700	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	400,000.000	352,548.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,354,425.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,520,820.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,446,060.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	107,106.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,057,437.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,120,059.900	

		AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,739,760.000	
		AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,147,950.000	
		AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,384,680.000	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,374,115.000	
		AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,873,740.000	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	2,456,850.000	
		AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,050,000.000	1,104,243.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,300,000.000	1,745,601.000	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,730,359.000	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	149,760.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,039,300.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,098,438.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,538,610.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,274,637.000	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	150,000.000	150,126.000	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	879,705.000	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	950,000.000	1,020,613.500	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	744,520.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,891,420.000	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	2,964,442.000	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,062,075.000	
		BELGIUM 3.0 09/28/19	1,300,000.000	1,372,852.000	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,663,552.100	
		BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,435,928.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/19	1,050,000.000	1,102,174.500	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	1,800,000.000	2,103,840.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,305,461.500	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	2,000,000.000	3,077,000.000	
		BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,494,516.000	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,332,083.000	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,572,636.000	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	2,500,000.000	3,928,475.000	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	2,700,000.000	3,928,851.000	
		BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,528,605.000	
		BUNDESOBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,141,509.000	
		BUNDESOBL 04/08/22	3,000,000.000	3,021,000.000	
		BUNDESOBL 04/09/21	2,200,000.000	2,225,740.000	
		BUNDESSCHAT 03/15/19	2,600,000.000	2,618,538.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,500,000.000	3,411,870.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,700,000.000	2,737,773.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,200,000.000	3,220,512.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,700,000.000	1,684,411.000	

		DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,688,028.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,728,544.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,352,192.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,259,390.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,692,125.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,161,040.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,649,662.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,641,765.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,400,000.000	2,600,112.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	4,400,000.000	4,778,840.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,657,575.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,491,900.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,100,000.000	3,378,070.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,385,240.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,452,355.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,489,291.000	
		DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,250,200.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,858,876.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,529,890.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,850,000.000	2,646,647.000	
		DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	4,400,000.000	4,648,160.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,800,000.000	4,204,900.000	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,642,769.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	2,000,709.000	

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

		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,900,000.000	2,806,040.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,200,000.000	4,373,964.000	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,767,268.000	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,186,812.500	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,249,356.000	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,901,175.000	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,474,480.000	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,000,000.000	4,411,400.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,532,970.000	
		FRANCE OAT 2.5 10/25/20	8,700,000.000	9,363,114.000	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,716,800.000	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,976,386.000	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,000,000.000	4,037,880.000	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,850,156.000	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,009,733.000	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,840,000.000	5,960,944.000	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/21	6,300,000.000	7,102,053.000	
		FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,074,342.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,811,920.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,940,000.000	3,158,843.800	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,200,000.000	4,658,784.000	
		FRANCE OAT 4.25 04/25/19	2,000,000.000	2,112,840.000	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,900,000.000	7,245,613.000	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,900,000.000	6,162,819.000	

		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,749,169.000	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,408,132.000	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,800,000.000	6,140,002.000	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,097,584.000	
		FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	4,835,754.000	
		IRISH 0.8 03/15/22	1,150,000.000	1,187,513.000	
		IRISH 1.0 05/15/26	1,350,000.000	1,368,036.000	
		IRISH 1.7 05/15/37	750,000.000	757,417.500	
		IRISH 2.0 02/18/45	890,000.000	925,190.600	
		IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,240,063.000	
		IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,095,279.600	
		IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	829,969.000	
		IRISH 4.4 06/18/19	480,000.000	511,156.800	
		IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,250,333.700	
		IRISH 5.0 10/18/20	1,000,000.000	1,143,420.000	
		IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,671,982.200	
		IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,050,985.000	
		ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,694,339.000	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,044,791.000	
		ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,649,680.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,497,750.000	
		ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,041,780.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,895,080.000	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,568,100.000	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,542,945.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,480,525.000	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,471,350.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,800,000.000	2,531,956.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	600,000.000	618,360.000	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,750,490.000	

		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,300,000.000	1,300,052.000	
		ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,334,640.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,800,000.000	2,844,520.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,397,400.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,078,319.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,260,120.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,541,430.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,400,000.000	1,250,900.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	2,082,240.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	250,000.000	265,597.500	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	3,287,716.000	
		ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,647,985.000	
		ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,549,320.000	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,565,440.000	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,175,766.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,500,000.000	4,141,900.000	
		ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	4,060,750.000	
		ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,998,820.000	
		ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	6,831,936.000	
		ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,899,150.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/19	5,100,000.000	5,349,135.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,388,052.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,493,340.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,647,114.000	

		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,270,500.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,487,730.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,971,200.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,050,000.000	2,678,530.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,400,000.000	5,165,160.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,951,280.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,677,520.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	3,992,100.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,750,000.000	3,664,925.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,500,000.000	4,549,650.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,715,490.000	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,032,900.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	3,341,760.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,700,000.000	5,173,710.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,588,980.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,573,280.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,717,950.000	
		NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,183,561.500	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,674,721.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,900,000.000	1,883,850.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,456,322.000	
		NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,911,932.000	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,175,560.000	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,215,620.000	

		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,709,774.000	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,095,064.400	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,540,000.000	2,070,961.200	
		NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,060,000.000	2,327,594.000	
		NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,829,401.500	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,700,000.000	2,011,100.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,800,000.000	2,744,946.000	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,539,120.000	
		NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,200,000.000	1,277,268.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,328,640.000	
		SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	400,236.000	
		SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,206,248.000	
		SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,738,114.000	
		SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,163,231.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	2,600,000.000	2,595,398.000	
		SPAIN 1.4 01/31/20	400,000.000	412,240.000	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,400,000.000	1,393,616.000	
		SPAIN 1.5 04/30/27	2,600,000.000	2,616,640.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,607,525.000	
		SPAIN 1.95 04/30/26	2,500,000.000	2,636,800.000	
		SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,740,068.000	
		SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,795,936.000	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,000,000.000	1,033,000.000	
		SPAIN 2.75 04/30/19	1,400,000.000	1,451,184.000	
		SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	3,027,483.000	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	1,902,762.000	
		SPAIN 3.45 07/30/66	950,000.000	1,079,694.000	
		SPAIN 3.8 04/30/24	2,700,000.000	3,188,673.000	
		SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,359,720.000	
		SPAIN 4.2 01/31/37	2,380,000.000	3,106,399.800	
		SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,523,106.000	
		SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,780,746.000	
		SPAIN 4.6 07/30/19	4,100,000.000	4,388,435.000	
		SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,273,348.000	
		SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,958,060.000	
		SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,721,972.000	
		SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,280,654.000	
		SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,870,000.000	

		SPAIN 5.15 10/31/28	2,100,000.000	2,821,350.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,253,240.000	
		SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,469,732.000	
		SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,219,704.000	
		SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,561,624.000	
		SPAIN 5.85 01/31/22	2,700,000.000	3,292,812.000	
		SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,426,175.000	
		SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,314,540.000	
	ユーロ　小計		580,280,000.000 (76,242,989,200)	673,553,896.500 (88,498,246,461)	
	南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	28,859,250.000	
		SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	11,342,814.000	
		SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	9,001,927.200	
		SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	10,160,000.000	10,105,644.000	
		SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	10,187,120.000	
		SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	10,137,800.000	
		SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,661,638.000	
		SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,674,600.000	
		SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	10,547,569.800	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,789,600.000	
		SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	16,682,100.000	
		SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	3,020,340.000	
		SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	8,060,560.000	
	南アフリカ・ランド　小計		155,240,000.000 (1,435,970,000)	150,070,963.000 (1,388,156,408)	
国債証券　合計			196,452,987,000 (196,452,987,000)	211,625,176,962 (211,625,176,962)	
合計			196,452,987,000 (196,452,987,000)	211,625,176,962 (211,625,176,962)	

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

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	122銘柄	41.47%	42.33%
イギリス・ポンド	国債証券	40銘柄	7.05%	7.20%
オーストラリア・ドル	国債証券	21銘柄	2.16%	2.20%
カナダ・ドル	国債証券	24銘柄	2.12%	2.16%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	0.36%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.46%	0.46%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.58%	0.59%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	0.29%	0.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.67%	0.68%
マレーシア・リンギット	国債証券	15銘柄	0.42%	0.43%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.78%	0.80%
ユーロ	国債証券	257銘柄	40.96%	41.82%
南アフリカ・ランド	国債証券	13銘柄	0.64%	0.66%

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ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30年2月27日から平成30年8月26日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成３０年１０月１２日

アセットマネジメントOne株式会社

取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型の平成３０年２月２７日から平成３０年８月２６日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型の平成３０年８月２６日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成３０年２月２７日から平成３０年８月２６日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

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

利害関係

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

以　上

【中間財務諸表】

【ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	369,143,553	368,715,322
親投資信託受益証券	10,553,953,494	11,045,563,272
未収入金	－	939,000
流動資産合計	10,923,097,047	11,415,217,594
資産合計	10,923,097,047	11,415,217,594
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,458,074	14,404,672
未払受託者報酬	1,761,305	1,777,503
未払委託者報酬	13,503,671	13,627,743
その他未払費用	264,110	236,911
流動負債合計	43,987,160	30,046,829
負債合計	43,987,160	30,046,829
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,689,217,051	※1 7,021,867,396
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,189,892,836	4,363,303,369
（分配準備積立金）	1,509,647,786	1,414,651,923
元本等合計	10,879,109,887	11,385,170,765
純資産合計	10,879,109,887	11,385,170,765
負債純資産合計	10,923,097,047	11,415,217,594

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第16期中間計算期間 自　平成30年2月27日 至　平成30年8月26日
営業収益		
受取利息	172	－
有価証券売買等損益	183,979,862	△19,825,222
営業収益合計	183,980,034	△19,825,222
営業費用		
支払利息	126,436	144,940
受託者報酬	1,597,841	1,777,503
委託者報酬	12,250,439	13,627,743
その他費用	239,602	237,235
営業費用合計	14,214,318	15,787,421
営業利益又は営業損失（△）	169,765,716	△35,612,643
経常利益又は経常損失（△）	169,765,716	△35,612,643
中間純利益又は中間純損失（△）	169,765,716	△35,612,643
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（△）	7,274,661	251,527
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,480,403,565	4,189,892,836
剰余金増加額又は欠損金減少額	406,867,880	488,789,565
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	406,867,880	488,789,565
剰余金減少額又は欠損金増加額	238,038,041	279,514,862
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	238,038,041	279,514,862
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,811,724,459	4,363,303,369

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

項目			第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
１．	※１	期首元本額	6,231,110,374円	6,689,217,051円
		期中追加設定元本額	1,447,662,999円	778,944,701円
		期中一部解約元本額	989,556,322円	446,294,356円
２．		受益権の総数	6,689,217,051口	7,021,867,396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15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6264円 （16,264円）	1.6214円 （16,214円）

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ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30年2月27日から平成30年8月26日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成３０年１０月１２日

アセットマネジメントOne株式会社

取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型の平成３０年２月２７日から平成３０年８月２６日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型の平成３０年８月２６日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成３０年２月２７日から平成３０年８月２６日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

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

利害関係

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

以　上

【ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	763,629,983	786,919,463
親投資信託受益証券	23,193,287,280	24,175,060,005
未収入金	－	4,583,000
流動資産合計	23,956,917,263	24,966,562,468
資産合計	23,956,917,263	24,966,562,468
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,476,474	12,570,932
未払受託者報酬	3,873,543	3,888,021
未払委託者報酬	33,571,118	33,696,527
その他未払費用	580,952	470,972
流動負債合計	49,502,087	50,626,452
負債合計	49,502,087	50,626,452
純資産の部		
元本等		
元本	※1 12,346,885,396	※1 12,871,760,270
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	11,560,529,780	12,044,175,746
（分配準備積立金）	5,613,716,489	5,432,367,340
元本等合計	23,907,415,176	24,915,936,016
純資産合計	23,907,415,176	24,915,936,016
負債純資産合計	23,956,917,263	24,966,562,468

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第16期中間計算期間 自　平成30年2月27日 至　平成30年8月26日
営業収益		
受取利息	373	－
有価証券売買等損益	619,707,659	29,336,725
営業収益合計	619,708,032	29,336,725
営業費用		
支払利息	273,122	312,582
受託者報酬	3,482,071	3,888,021
委託者報酬	30,178,329	33,696,527
その他費用	522,228	471,650
営業費用合計	34,455,750	38,368,780
営業利益又は営業損失（△）	585,252,282	△9,032,055
経常利益又は経常損失（△）	585,252,282	△9,032,055
中間純利益又は中間純損失（△）	585,252,282	△9,032,055
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（△）	17,922,501	26,885
期首剰余金又は期首欠損金（△）	9,520,677,271	11,560,529,780
剰余金増加額又は欠損金減少額	657,981,807	880,981,024
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	657,981,807	880,981,024
剰余金減少額又は欠損金増加額	442,859,397	388,276,118
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	442,859,397	388,276,118
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	10,303,129,462	12,044,175,746

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

項目			第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
１．	※１	期首元本額	11,814,239,777円	12,346,885,396円
		期中追加設定元本額	1,657,767,778円	939,621,040円
		期中一部解約元本額	1,125,122,159円	414,746,166円
２．		受益権の総数	12,346,885,396口	12,871,760,270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15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9363円 （19,363円）	1.9357円 （19,357円）

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ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30年2月27日から平成30年8月26日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成３０年１０月１２日

アセットマネジメントOne株式会社

取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型の平成３０年２月２７日から平成３０年８月２６日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型の平成３０年８月２６日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成３０年２月２７日から平成３０年８月２６日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

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

以　上

【ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	605,779,458	631,286,583
親投資信託受益証券	18,249,068,031	19,080,201,815
未収入金	－	2,631,000
流動資産合計	18,854,847,489	19,714,119,398
資産合計	18,854,847,489	19,714,119,398
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,232,904	18,320,556
未払受託者報酬	3,046,048	3,062,745
未払委託者報酬	29,445,600	29,606,939
その他未払費用	456,824	408,278
流動負債合計	44,181,376	51,398,518
負債合計	44,181,376	51,398,518
純資産の部		
元本等		
元本	※1 8,339,747,610	※1 8,693,169,846
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	10,470,918,503	10,969,551,034
（分配準備積立金）	4,802,370,493	4,597,682,697
元本等合計	18,810,666,113	19,662,720,880
純資産合計	18,810,666,113	19,662,720,880
負債純資産合計	18,854,847,489	19,714,119,398

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第16期中間計算期間 自　平成30年2月27日 至　平成30年8月26日
営業収益		
受取利息	296	－
有価証券売買等損益	631,428,471	87,113,784
営業収益合計	631,428,767	87,113,784
営業費用		
支払利息	214,260	248,718
受託者報酬	2,702,724	3,062,745
委託者報酬	26,126,775	29,606,939
その他費用	405,329	408,826
営業費用合計	29,449,088	33,327,228
営業利益又は営業損失（△）	601,979,679	53,786,556
経常利益又は経常損失（△）	601,979,679	53,786,556
中間純利益又は中間純損失（△）	601,979,679	53,786,556
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（△）	23,844,590	644,096
期首剰余金又は期首欠損金（△）	8,445,032,109	10,470,918,503
剰余金増加額又は欠損金減少額	656,331,375	912,322,365
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	656,331,375	912,322,365
剰余金減少額又は欠損金増加額	490,347,566	466,832,294
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	490,347,566	466,832,294
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	9,189,151,007	10,969,551,034

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

項目			第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
１．	※１	期首元本額	8,020,226,146円	8,339,747,610円
		期中追加設定元本額	1,357,837,135円	725,308,803円
		期中一部解約元本額	1,038,315,671円	371,886,567円
２．		受益権の総数	8,339,747,610口	8,693,169,846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15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第15期 平成30年2月26日現在	第16期中間計算期間末 平成30年8月26日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2555円 （22,555円）	2.2619円 （22,619円）

（参考）
「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」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

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

たわらノーロード　バランス（堅実型）	153,495円	1,164,826円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,393,312円	8,195,189円
たわらノーロード　バランス（積極型）	4,683,156円	22,467,607円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	14,974円	103,038円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	237,595円	4,618,991円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	811,003円	13,908,748円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	550,423円	11,372,822円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	1,175,545円	27,452,407円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	41,547円	39,297円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	37,941円	62,022円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	338,731円	525,021円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	364,996円	516,621円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	978,271円	1,503,679円
ＤＩＡM国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	36,793,469,763円	37,599,643,704円
ＤＩＡMバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	765,964,168円	826,015,634円
ＤＩＡMバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,673,224,321円	2,829,930,215円
ＤＩＡMバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,791,900,084円	2,969,870,571円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	329,271,189円	340,043,581円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,119,268,669円	1,137,903,112円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,054,683,588円	1,077,371,976円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	46,713,000円	42,726,996円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,161,767,467円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	24,024,004円	25,558,900円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	39,477,748円	270,331,358円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	97,811,246円	167,203,982円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	189,483,338円	298,842,348円
投資のソムリエ	1,008,877,316円	3,733,168,917円
クルーズコントロール	201,841,066円	553,189,076円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	69,455,867円	320,084,595円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	147,946,865円	181,234,136円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	205,022,193円	238,317,143円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	74,862円	284,731円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,239,139円	4,631,357円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	3,802,586円	13,361,782円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	22,937,313円	75,739,501円
ダイナミック・ナビゲーション	726,871円	1,352,404円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	355,728,259円	1,429,060,856円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	668,403円	926,042円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	513,926円	612,380円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	108,503円	405,176円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,237,938円	1,339,795円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	12,005,064円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	224,601,077円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	18,666円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	70,701,371円	66,349,091円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	－円	55,599,022円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	132,883,832円	121,450,190円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	292,283,119円	283,810,695円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,233,373円	15,658,176円

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	70,408,344円	64,258,293円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,521,498円	16,556,137円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,833,378円	16,604,468円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,638,558円	30,147,733円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	56,259,704円	53,104,673円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,071,953,946円	1,021,470,527円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,013,017,452円	964,117,312円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,782,258,327円	2,687,967,000円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	201,418,412円	195,753,274円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	96,974,567円	57,961,714円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	591,732,801円	556,308,883円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	1,652,857,363円	639,831,487円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	10,313,671円	10,313,671円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,951,217円	7,990,925円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,108,127,625円	131,575,177円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,040,555,136円	12,470,167,745円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	541,254,717円	489,095,827円

	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,724,496,050円	1,712,184,865円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,829,818,156円	9,814,477,692円
	ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	519,843円	3,168,817円
	ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,093,798円	3,009,532円
	ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,718,064円	3,771,978円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,747,496,476円	8,747,585,084円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	70,015,367円	67,982,651円
	ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,507,643円	27,670,484円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,240,489円	25,126,872円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,682,249円	99,008円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	109,957円	112,661円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド7ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	426,902,115円	426,902,115円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド7ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,323,021,834円	1,311,785,878円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド7ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,764,382,103円	1,737,262,933円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド7ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	76,281,237円	72,414,656円
	計	109,160,728,872円	112,713,729,794円
2.	受益権の総数	109,160,728,872口	112,713,729,794口
3.	※2　差入代用有価証券	株式　3,661,500,000円	株式　3,415,000,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(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30年2月26日 現在				平成30年8月26日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	5,334,250,000	－	5,320,705,000	△13,545,000	11,269,290,000	－	11,237,985,000	△31,305,000
合計	5,334,250,000	－	5,320,705,000	△13,545,000	11,269,290,000	－	11,237,985,000	△31,305,000

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	295,190,206,036円	274,056,741,701円
同期中追加設定元本額	61,855,153,624円	47,635,239,089円
同期中一部解約元本額	82,988,617,959円	55,890,235,788円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	14,134,325,523円	16,509,709,845円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	133,630,997円	115,144,060円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	110,362,927円	94,261,015円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	35,282,821円	27,467,152円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	683,723,247円	787,011,069円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	186,801,804円	236,327,754円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	25,093,209円	34,379,730円
たわらノーロード　国内債券	3,053,849,271円	4,398,088,575円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ向け＞	754,493円	－円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	28,763,462円	94,038,522円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	2,797,390円	20,800,822円
たわらノーロード　バランス（標準型）	6,736,262円	38,914,907円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,846,591円	8,710,746円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	427,592円	2,816,059円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	2,978,010円	56,314,841円

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	4,270,909円	66,795,910円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	1,180,680円	18,697,198円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	401,500円	9,501,392円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,023,651円	1,176,551円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	371,890円	548,776円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,490,812円	2,384,892円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	457,571円	618,961円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	61,604円	17,517円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,519,073,028円	12,774,208,291円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	5,538,860,716円	5,766,313,017円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	8,094,578,747円	8,363,942,965円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,297,220,345円	3,367,362,272円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,822,404,385円	1,821,729,032円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,021,440,802円	2,018,598,534円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	317,189,866円	312,782,929円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	88,286,247円	91,445,749円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,216,731,348円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	2,224,336円	2,359,537円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	474,201,213円	3,123,603,503円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	434,763,343円	714,797,157円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	99,374,518円	154,352,179円
投資のソムリエ	3,477,837,094円	7,845,796,116円
クルーズコントロール	444,343,713円	1,099,977,204円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	239,353,124円	677,064,863円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	1,836,523,487円	2,154,893,017円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	232,011,746円	266,330,235円

クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	165,091円	567,014円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,123,528円	3,651,342円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	3,353,398円	10,629,737円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	479,665,477円	478,364,215円
ダイナミック・ナビゲーション	187,857円	506,835円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	7,432,216,368円	8,912,388,595円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	627,520円	1,609,206円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	487,386円	1,072,314円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,441,185円	2,543,831円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,160,053円	1,815,598円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	63,046,896円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	189,645,802円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	290,676円
ＤＩＡＭ高金利通貨ファンド	9,608,918円	－円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	22,730,596,257円	22,717,118,849円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	496,308,197円	455,162,625円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	341,395,897円	302,746,387円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	250,881,142円	235,640,644円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	79,938,561円	75,915,475円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	223,396,523円	200,702,999円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	92,500,119円	86,056,017円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,711,189円	45,988,258円

ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	100,150,915円	93,942,151円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	178,394,585円	165,598,275円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,083,808,272円	5,683,391,571円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,221,440,007円	3,004,319,509円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,882,071,810円	5,583,026,340円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	647,151,905円	610,886,850円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	512,238,067円	302,213,535円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,765,931,500円	3,474,467,407円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	3,503,037,017円	1,329,306,025円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	194,752,933円	194,752,933円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	229,020,962円	49,834,475円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,835,245,523円	211,867,260円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	85,219,076,699円	69,092,938,468円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,149,665,356円	1,015,816,629円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,349,516,600円	7,115,433,846円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,046,381,699円	27,182,725,864円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,994,522円	53,264,492円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,160,062円	15,718,576円

ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,006,452円	7,833,813円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,135,137,178円	30,290,314,374円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	497,599,388円	466,616,785円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	137,417,719円	134,082,420円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	395,041,757円	522,909,535円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	118,842,206円	722,683円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	393,617円	390,551円
計	274,056,741,701円	265,801,745,002円
２．　受益権の総数	274,056,741,701口	265,801,745,002口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
１口当たり純資産額	1.2874円	1.2838円
（1万口当たり純資産額）	（12,874円）	（12,838円）

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	6,182円	14,657円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	35,270円	54,160円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	325,553円	539,785円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	349,076円	534,911円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	1,079,503円	1,720,718円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	37,329,263,860円	39,093,061,099円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	155,272,827円	157,934,366円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	854,160,900円	844,713,859円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,042,632,432円	1,063,353,454円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	128,651,065円	125,933,936円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	385,326,790円	368,798,945円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	332,068,806円	325,611,636円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	32,623,606円	31,471,673円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	811,105,505円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	186,981,108円	207,736,689円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	31,116,597円	197,173,243円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	76,880,278円	123,203,307円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	149,320,860円	219,697,514円
投資のソムリエ	525,467,955円	601,661,539円
クルーズコントロール	81,781,664円	199,752,269円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	36,100,432円	51,742,082円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	116,625,994円	135,881,702円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	76,361,478円	83,183,962円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	30,467円	103,020円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	402,135円	1,318,564円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	1,245,127円	3,879,936円

投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	18,021,302円	39,216,469円
ダイナミック・ナビゲーション	395,905円	1,462,343円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	279,057,463円	740,579,897円
ワールドアセットバランス（基本コース）	621,453,988円	673,654,585円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,329,368,925円	2,544,034,446円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	765,901円	1,070,129円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	590,045円	712,337円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	86,101円	209,708円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,328,385円	1,458,362円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	4,349,695円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	120,108,970円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	13,989円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	94,665,820円	91,706,011円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	2,918,652,247円	2,873,943,255円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	161,164,985円	158,382,887円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	208,761,652円	206,261,351円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,652,082円	21,290,066円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	103,714,081円	91,029,251円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	228,512,241円	212,722,371円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,671,338円	11,736,080円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	82,511,736円	72,274,879円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,831,650円	6,199,154円

ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,417,217円	8,295,438円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,714,283円	22,596,166円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	65,916,546円	59,719,480円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	557,553,761円	510,427,759円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	691,799,410円	632,269,267円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,171,548,593円	2,014,686,740円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	786,997,339円	733,673,656円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	225,669,532円	130,996,877円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	924,836,705円	835,413,387円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	430,329,218円	159,943,333円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	2,754,975円	2,754,975円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	128,701,947円	26,800,521円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	349,183,417円	38,157,282円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,824,134,623円	6,231,333,074円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	422,676,347円	366,651,102円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,345,791,625円	1,283,322,385円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,115,080,431円	4,903,329,936円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,032,372円	11,898,559円

ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,378,177円	9,050,979円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,651,080円	10,400,016円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,827,085,597円	6,556,587,283円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,301,326円	56,855,133円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,544,094円	223,830円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	257,372円	254,361円
計	85,879,794,434円	87,836,885,848円
２．　受益権の総数	85,879,794,434口	87,836,885,848口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(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30年2月26日 現在				平成30年8月26日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	42,579,342	－	42,579,000	342	700,759,373	－	702,302,670	△1,543,297
アメリカ・ドル	－	－	－	－	512,111,774	－	513,476,880	△1,365,106
イギリス・ポンド	42,579,342	－	42,579,000	342	25,986,669	－	25,985,960	709
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	25,247,688	－	25,225,200	22,488
カナダ・ドル	－	－	－	－	25,106,910	－	25,113,350	△6,440
ユーロ	－	－	－	－	112,306,332	－	112,501,280	△194,948
買　建	328,600,107	－	328,448,150	△151,957	－	－	－	－
アメリカ・ドル	240,630,998	－	240,535,060	△95,938	－	－	－	－
イギリス・ポンド	7,468,550	－	7,470,000	1,450	－	－	－	－
カナダ・ドル	9,609,349	－	9,623,880	14,531	－	－	－	－
ユーロ	70,891,210	－	70,819,210	△72,000	－	－	－	－
合計	371,179,449	－	371,027,150	△151,615	700,759,373	－	702,302,670	△1,543,297

（注）時価の算定方法

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

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はありません。

株式関連

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

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	21,598,989円	70,203,069円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	170,191円	1,265,983円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,177,165円	6,785,461円
たわらノーロード　バランス（積極型）	532,097円	2,503,965円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	28,212円	153,154円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	563,219円	12,295,496円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	751,296円	17,977,713円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	147,764円	5,618,618円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	－円	2,703,070円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	57,145円	107,329円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	343,053円	776,467円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	193,352円	410,614円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	262,467円	654,174円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	5,032,915,649円	5,103,020,045円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	474,597,820円	506,635,287円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,526,634,357円	1,658,947,568円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,682,020,108円	1,750,297,361円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	366,252,324円	375,880,904円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	780,311,672円	818,524,847円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	633,352,049円	640,824,377円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	23,441,361円	23,582,221円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	585,178,050円	599,670,192円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	6,898,943円	9,563,624円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	17,867,916円	116,556,212円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	39,193,230円	65,609,092円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	71,081,407円	108,940,806円
クルーズコントロール	471,522,151円	1,176,430,807円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	67,264,964円	79,382,168円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	121,175,646円	140,180,554円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	175,031円	605,716円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,547,650円	5,233,641円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	4,761,061円	15,199,986円
ダイナミック・ナビゲーション	135,460円	362,192円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	13,033,689円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	11,075円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,427,367,462円	1,343,048,507円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6,984,591,409円	6,905,362,322円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	4,074,076,473円	4,034,028,935円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	3,765,907,771円	3,317,960,151円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	576,382,992円	6,089,139,432円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,448,126円	98,447,200円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	968,520,974円	865,553,058円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	708,041,760円	673,936,192円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,495,581円	54,234,282円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,057,634円	95,349,652円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,555,966円	24,565,759円

ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,750,815円	8,207,078円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	72,188,716円	67,112,843円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	85,457,559円	78,798,617円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,796,951,947円	3,542,245,525円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,498,788,864円	2,325,205,914円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,222,249,727円	3,988,538,303円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	766,253,872円	728,225,171円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	515,526,816円	302,506,981円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,592,931,221円	3,306,642,102円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	8,998,213,463円	3,455,343,587円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	13,975,529円	13,975,529円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	82,547,070円	17,793,458円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,967,288,873円	342,809,371円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,212,015,467円	12,335,191,066円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,892,468,598円	19,419,236,137円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,361,904円	14,183,366円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,508,457円	11,197,861円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,621,656円	5,596,870円

	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,700,778,938円	17,309,780,028円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,612,203円	100,875,970円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	83,137,353円	112,194,198円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,633,095円	368,536円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	165,250円	166,959円
	計	121,490,410,134円	114,462,156,951円
２．	受益権の総数	121,490,410,134口	114,462,156,951口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年2月26日現在	平成30年8月26日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(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30年2月26日 現在				平成30年8月26日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	326,384,024	－	326,319,240	64,784	407,380,000	－	407,361,208	18,792
アメリカ・ドル	112,189,343	－	112,143,010	46,333	－	－	－	－
イギリス・ポンド	23,904,192	－	23,904,000	192	363,210,000	－	363,200,078	9,922
シンガポール・ドル	－	－	－	－	21,280,000	－	21,279,999	1
マレーシア・リンギット	35,800,875	－	35,925,800	△124,925	－	－	－	－
ユーロ	130,597,950	－	130,470,270	127,680	－	－	－	－
南アフリカ・ランド	23,891,664	－	23,876,160	15,504	22,890,000	－	22,881,131	8,869
合計	326,384,024	－	326,319,240	64,784	407,380,000	－	407,361,208	18,792

（注）時価の算定方法

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

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はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型

平成30年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	11,502,278,358円
Ⅱ　負債総額	5,812,524円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,496,465,834円
Ⅳ　発行済数量	7,069,080,488口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6263円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型

平成30年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	25,203,160,848円
Ⅱ　負債総額	23,896,028円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,179,264,820円
Ⅳ　発行済数量	12,935,317,418口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9466円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型

平成30年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	19,947,624,988円
Ⅱ　負債総額	16,976,253円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,930,648,735円
Ⅳ　発行済数量	8,741,390,016口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2800円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	207,009,561,575円
Ⅱ　負債総額	417,922,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	206,591,639,575円
Ⅳ　発行済数量	114,473,190,657口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8047円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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（2018年8月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2018年8月31日現在）

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。

2018年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,207,316,840,603
追加型株式投資信託	853	13,043,312,848,128
単位型公社債投資信託	48	194,109,113,884
単位型株式投資信託	146	978,340,252,718
合計	1,085	15,423,079,055,333

３【委託会社等の経理状況】

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

2．財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成３０年５月３０日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚

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２９年４月１日から平成３０年３月３１日までの第３３期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

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

以　　上

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(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 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、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。
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、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 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。 (4) 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。 (5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

第33期　（自平成29年4月1日　至平成30年3月31日）
当社は、当事業年度においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。 これにより、従来の方法と比べて、当事業年度末の減価償却費が413,260千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ同額減少しております。

追加情報

第33期　（自平成29年4月1日　至平成30年3月31日）
当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準適用指針第1号　平成28年12月16日）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第2号　平成19年2月7日）を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。 本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1．有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1．関係会社に対する事項

（千円）

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

※2．固定資産売却益の内訳

（千円）

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

※3. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

※4. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

※5. 本社移転費用の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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32期（平成29年3月31日現在）

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

第33期（平成30年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資　産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び (4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負　債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
①非上場株式	337,468	272,464
②関係会社株式	3,306,296	3,229,196

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32期（平成29年3月31日現在）

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

第33期（平成30年3月31日現在）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期（平成29年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
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。

第33期（平成30年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	1,267,157	146,101	1,121,055
②投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	－	－	－
②投資信託	3,995	4,000	△ 4
小計	3,995	4,000	△ 4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

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

3．当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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

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

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

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

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

4．減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

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

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

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

（千円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

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

（注）特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

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。

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

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

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

（千円）

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金負債合計	△369,581	△281,720
繰延税金資産の純額	1,571,992	1,699,533

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

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

（企業結合等関係）

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

1．結合当事企業

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

2．企業結合日

平成28年10月1日

3．企業結合の方法

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29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12．被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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32期（自平成28年4月1日　至平成29年3月31日）

該当はありません。

第33期（自平成29年4月1日　至平成30年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第32期（自平成28年4月1日　至平成29年3月31日）

該当はありません。

第33期（自平成29年4月1日　至平成30年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第32期（自平成28年4月1日　至平成29年3月31日）

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

第33期（自平成29年4月1日　至平成30年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（注2）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（注3）運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

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

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

４【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の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

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

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、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 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。

10）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、

当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（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るものとします。

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ないません。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ないます。

＜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。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第 20 条の 2　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＜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書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(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 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、その業務を行うに充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」と言います。）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ヵ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付けが中止された場合には、受益者は当該受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り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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、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。

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

（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るものとします。
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ないません。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ないます。

＜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。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第 20 条の 2　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＜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書の権利行使により取得する株券
2．株式分割により取得する株券
3．有償増資により取得する株券
4．売出しにより取得する株券

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

６．信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(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 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、その業務を行うに充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」と言います。）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 ヵ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付けが中止された場合には、受益者は当該受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り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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、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。

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

（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るものとします。

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ないません。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ないます。

＜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 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。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第 20 条の 2　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＜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書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

３．有償増資により取得する株券
４．売出しにより取得する株券
５．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
６．信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(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、その業務を行うに充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」と言います。）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 ヵ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付けが中止された場合には、受益者は当該受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り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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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ます。
2）株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
3）同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4）同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
5）外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
6）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条の範囲で行ないます。
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。
12）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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、「FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を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、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、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条の範囲で行ないます。
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。
11）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。