

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年5月7日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 中島 敬雄
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいますが、）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】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位となります。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成26年5月8日から平成27年5月8日まで

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（９）【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとし、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、販売会社所定の方法により、販売会社に買付代金を支払うものとし、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みの方法

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みの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」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

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

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

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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。

当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 主に国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資を行い、「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。

東証株価指数（TOPIX）とは

東証株価指数（TOPIX）とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株式指数で、東京証券取引所第1部に上場されている全ての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。

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

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

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

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

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

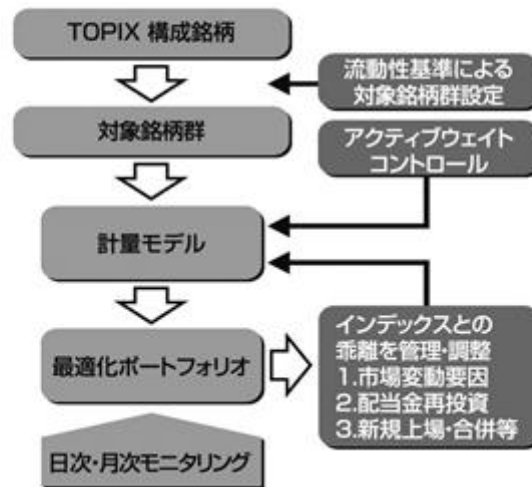
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

- 2** 流動性を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックス「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」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。
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。



- 3** 株式(株価指数先物取引を含みます。)の実質組入比率は、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。
株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

分配方針

年1回の決算時(2月7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

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

「国内」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産

「株式」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

補足分類

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル () 日本		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファン ド	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（株式））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資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株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（株式））に分類されます。

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

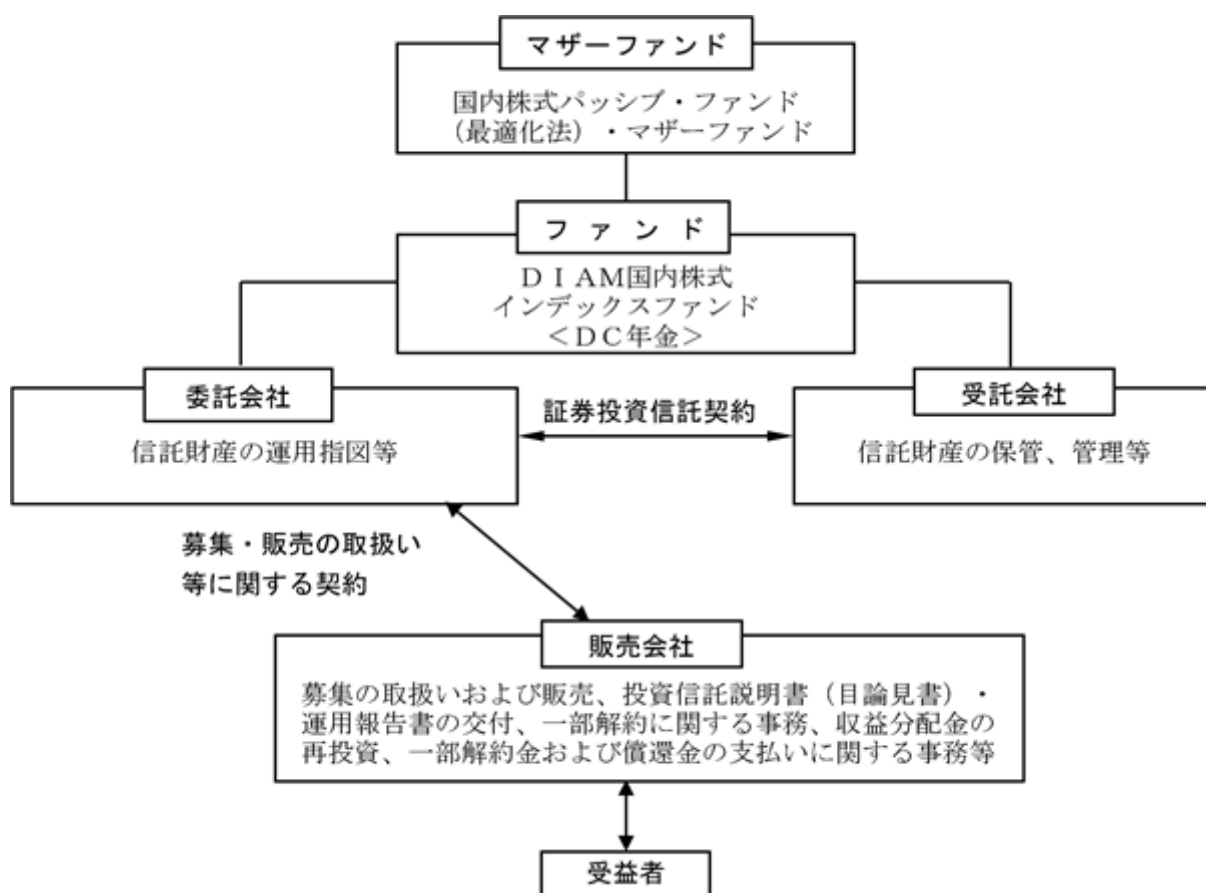
「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

（２）【ファンドの沿革】

平成14年11月15日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
平成17年10月 1日 信託報酬率の変更

（３）【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

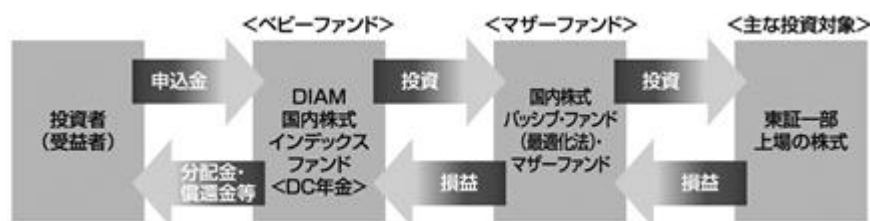
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

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の受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成26年2月28日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（平成26年2月28日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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。

<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。）の実質組入比率は、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) 株式の実質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) 有価証券等の効率的な運用に資するため、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を行うことができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに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。

（２）【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（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20条、第21条に定めるものに限りません。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券(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) 株券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 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。）

6) 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。）

7) 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。）

8) 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。）

9) 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。）

10) コマーシャル・ペーパー

11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～10)の証券または証書の性質を有するもの

12) 外国貸付債権信託受益権（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。）

13) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）

14) 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。）

15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

16) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)

- 17) 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。)
- 18) 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
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1)の証券または証書、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)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、2)から6)までの証券ならびに11)および14)の証券または証書のうち2)から6)までの性質を有するものを以下「公社債」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

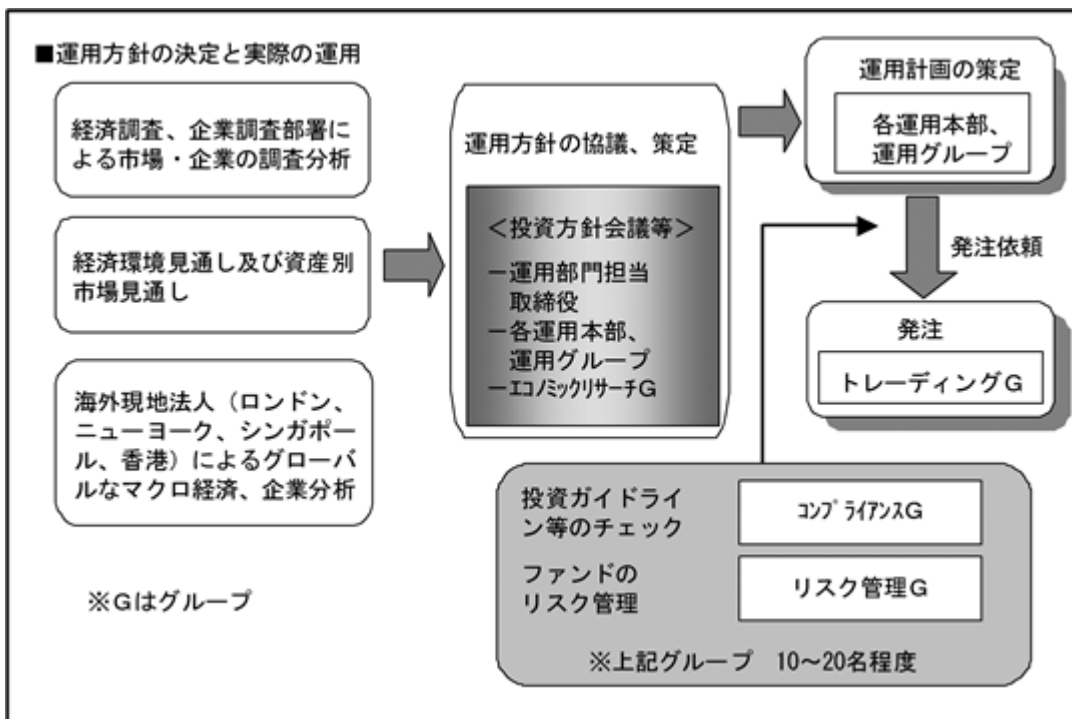
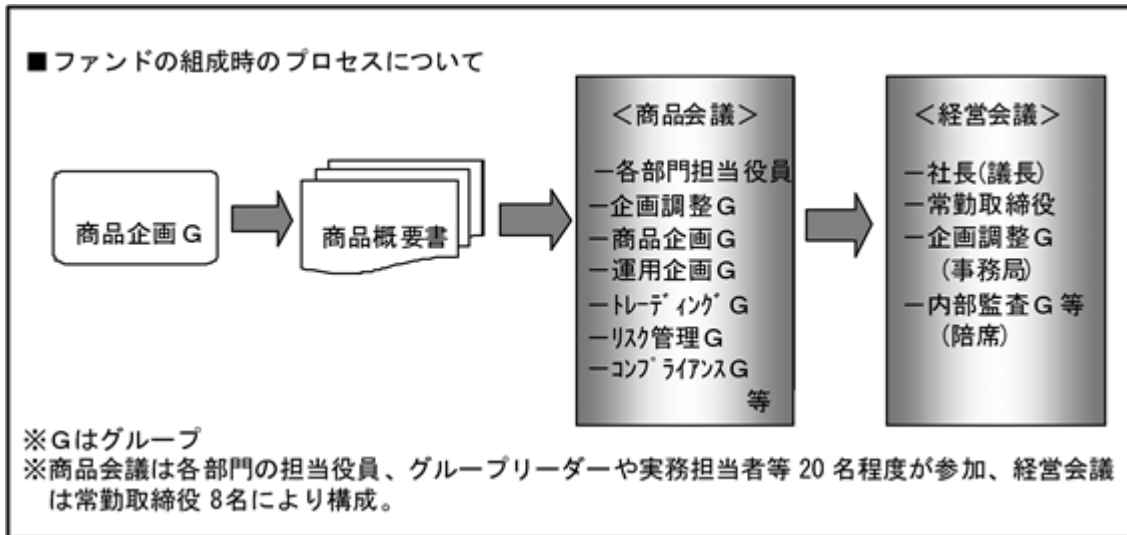
4.上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

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

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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

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

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

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

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

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として2月7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。

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、貸付有価証券にかか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かか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、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、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かかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、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。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、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。）に対し支払われます。販売会社は、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) 株式への実質投資割合（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

2) 外貨建資産への実質投資割合（約款「運用の基本方針」(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10%以下とします。

3) マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

4) 投資する株式等の範囲（約款第18条）

委託会社が投資することを指図する株式は、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、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については、この限りではありません。

5) 信用取引の指図範囲（約款第19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.～5.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.～5.に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

1. 信託財産に属する株券
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. 売り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(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。))の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

6) 先物取引等の運用指図・目的(約款第20条)

- (a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、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わが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を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。))。
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

7) 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21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、原則として当ファンドの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行うものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

8) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第22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)の1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

9) 特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第24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。

10) 外貨為替予約の指図（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、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

(b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産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。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(c) 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。

11) 資金の借入れ（約款第33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。

12) 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。

13) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

(1) 基準価額の主な変動要因

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

株価変動リスク

当ファンドは株式に実質的に投資します。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。

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) 分配金に関する留意点

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

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

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

(3)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。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（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が、当該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株式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、基準価額と当該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、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、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

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

当ファンドは受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃の場合、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

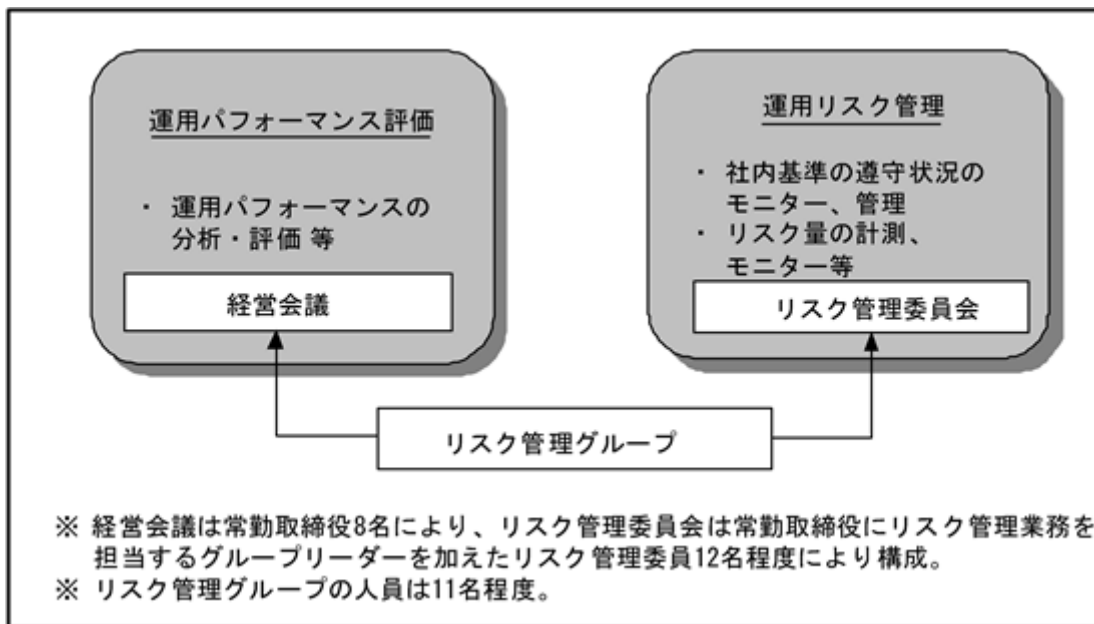
イ.当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。

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。

<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.2376%（税抜0.22%）

信託報酬の配分（税抜）	
委託会社	年率0.08%
販売会社	年率0.11%
受託会社	年率0.03%

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎年8月7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】

イ.信託財産留保額

ありません。

ロ.その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	63,769,076,732	100.01
内 日本	63,769,076,732	100.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,584,022	0.01
純資産総額	63,760,492,710	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成26年2月28日現在

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

その他資産の投資状況

平成26年2月28日現在

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

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

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	37,793,561,745	1.6558 62,582,003,188	1.6873 63,769,076,732	- -	100.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.01%
合計	100.01%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年2月28日現在

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

18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	328,300	7,583.00 2,489,498,900	7,942.00 2,607,358,600	- -	0.82%
19	パナソニック 日本	株式 電気機器	2,039,100	1,192.00 2,430,607,200	1,276.00 2,601,891,600	- -	0.81%
20	三井物産 日本	株式 卸売業	1,621,900	1,489.00 2,415,009,100	1,564.00 2,536,651,600	- -	0.79%
21	三井不動産 日本	株式 不動産業	830,000	3,230.00 2,680,900,000	3,027.00 2,512,410,000	- -	0.79%
22	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	3,600,900	693.00 2,495,423,700	687.00 2,473,818,300	- -	0.77%
23	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,451,300	1,606.00 2,330,787,800	1,701.00 2,468,661,300	- -	0.77%
24	デンソー 日本	株式 輸送用機器	441,000	5,180.00 2,284,380,000	5,440.00 2,399,040,000	- -	0.75%
25	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	7,899,000	304.00 2,401,296,000	297.00 2,346,003,000	- -	0.73%
26	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,505,100	884.00 2,214,508,400	911.00 2,282,146,100	- -	0.71%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,785,000	1,188.00 2,120,580,000	1,205.00 2,150,925,000	- -	0.67%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	585,800	3,591.00 2,103,607,800	3,667.00 2,148,128,600	- -	0.67%
29	東京海上HD 日本	株式 保険業	682,300	2,997.00 2,044,853,100	3,012.00 2,055,087,600	- -	0.64%
30	三菱重工業 日本	株式 機械	3,178,000	638.00 2,027,564,000	625.00 1,986,250,000	- -	0.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
株式	96.06%
合計	96.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.18%
輸送用機器		11.27%
銀行業		9.00%
情報・通信業		7.08%
化学		5.18%
機械		5.05%
医薬品		4.51%
卸売業		4.49%
小売業		3.91%
食料品		3.73%
陸運業		3.62%
不動産業		3.10%
建設業		2.44%
サービス業		2.34%
電気・ガス業		2.16%
保険業		2.09%
証券、商品先物取引業		1.63%
鉄鋼		1.58%
その他製品		1.39%
精密機器		1.36%
その他金融業		1.24%
非鉄金属		0.99%
ガラス・土石製品		0.96%
ゴム製品		0.89%
繊維製品		0.70%
金属製品		0.69%
石油・石炭製品		0.59%
空運業		0.49%
鉱業		0.45%
海運業		0.37%
パルプ・紙		0.29%
倉庫・運輸関連業	0.22%	
水産・農林業	0.07%	
合計	96.06%	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先 物取引	東京証券 取引所	TOPIX 先 物 2603月	買建	1,047	12,503,985,745	12,679,170,000	3.97%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2計算期間末 (平成17年2月7日)	4,179	4,179	1.4271	1.4271
第3計算期間末 (平成18年2月7日)	24,604	24,604	2.1436	2.1436
第4計算期間末 (平成19年2月7日)	32,044	32,044	2.1853	2.1853
第5計算期間末 (平成20年2月7日)	30,110	30,110	1.6674	1.6674
第6計算期間末 (平成21年2月9日)	22,737	22,737	1.0115	1.0115
第7計算期間末 (平成22年2月8日)	31,206	31,206	1.1660	1.1660
第8計算期間末 (平成23年2月7日)	38,104	38,104	1.2631	1.2631
第9計算期間末 (平成24年2月7日)	35,526	35,526	1.0602	1.0602
第10計算期間末 (平成25年2月7日)	49,488	49,488	1.3587	1.3587
第11計算期間末 (平成26年2月7日)	61,898	61,898	1.6948	1.6948
平成25年2月末日	50,212	-	1.3677	-
3月末日	54,480	-	1.4637	-
4月末日	60,984	-	1.6478	-
5月末日	59,940	-	1.6062	-
6月末日	58,589	-	1.6045	-
7月末日	58,604	-	1.6010	-
8月末日	57,470	-	1.5652	-
9月末日	62,709	-	1.7016	-
10月末日	62,760	-	1.7015	-
11月末日	64,822	-	1.7931	-
12月末日	67,525	-	1.8562	-
平成26年1月末日	63,748	-	1.7394	-
2月末日	63,760	-	1.7270	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第2計算期間	13.6
第3計算期間	50.2
第4計算期間	1.9
第5計算期間	23.7
第6計算期間	39.3
第7計算期間	15.3
第8計算期間	8.3
第9計算期間	16.1
第10計算期間	28.2
第11計算期間	24.7

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第2計算期間	2,786,767,317	196,338,675
第3計算期間	10,152,833,879	1,603,466,761
第4計算期間	7,400,148,798	4,214,916,172
第5計算期間	8,779,618,539	5,384,513,066
第6計算期間	8,569,368,552	4,148,881,796
第7計算期間	8,901,159,838	4,615,887,504
第8計算期間	7,387,878,523	3,984,381,861
第9計算期間	8,287,509,892	4,947,169,536
第10計算期間	9,700,581,703	6,785,126,872
第11計算期間	16,783,744,888	16,684,231,460

(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:2014年2月28日

基準価額・純資産の推移

(2004年2月27日～2014年2月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2002年11月15日)
※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第7期	(2010.02.08)	0円
第8期	(2011.02.07)	0円
第9期	(2012.02.07)	0円
第10期	(2013.02.07)	0円
第11期	(2014.02.07)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.01%

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

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

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.97

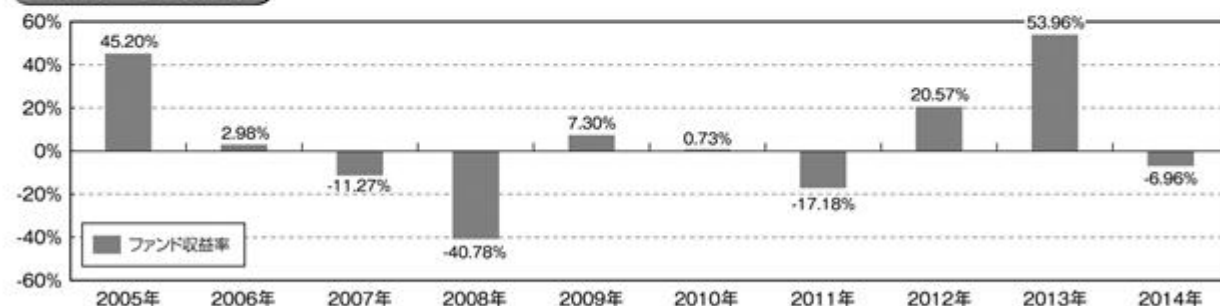
組入上位5業種(国内株式)

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

組入上位10銘柄

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、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再投資する「累積投資（自動引きぞく）専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

お申込価額（発行価格）

- ・お申込日の基準価額 とします。
収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。
「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

- ・基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されません。
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
 - ・販売会社へのお問い合わせ
 - ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位とします。

お申込手数料

ありません。

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、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】

解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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。

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

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、解約の請求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。解約の請求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実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

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を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、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。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ：URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（2）【保管】

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

（3）【信託期間】

信託期間は平成14年11月15日から原則として無期限です。

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8日から翌年2月7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. 委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ま

す。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

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

八．関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

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

ホ．運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（毎年2月7日。休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資される性質を有します。収益分配金は、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。) に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間（平成25年2月8日から平成26年2月7日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 平成25年2月7日現在	第11期 平成26年2月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	252,657,144	576,694,677
親投資信託受益証券	49,487,031,897	61,897,534,059
流動資産合計	49,739,689,041	62,474,228,736
資産合計	49,739,689,041	62,474,228,736
負債の部		
流動負債		
未払解約金	204,772,282	501,156,820
未払受託者報酬	6,243,467	10,014,200
未払委託者報酬	39,542,218	63,423,515
その他未払費用	988,461	1,585,485
流動負債合計	251,546,428	576,180,020
負債合計	251,546,428	576,180,020
純資産の部		
元本等		
元本	1 36,423,666,137	1 36,523,179,565
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,064,476,476	25,374,869,151
（分配準備積立金）	1,340,103,990	9,085,776,686
元本等合計	49,488,142,613	61,898,048,716
純資産合計	49,488,142,613	61,898,048,716
負債純資産合計	49,739,689,041	62,474,228,736

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第10期		第11期	
	自	平成24年2月8日 平成25年2月7日	自	平成25年2月8日 平成26年2月7日
営業収益				
受取利息		64,126		184,490
有価証券売買等損益		10,817,841,180		12,405,662,162
営業収益合計		10,817,905,306		12,405,846,652
営業費用				
受託者報酬		12,034,563		19,009,572
委託者報酬		76,219,485		120,394,377
その他費用		1,905,304		3,009,659
営業費用合計		90,159,352		142,413,608
営業利益又は営業損失（ ）		10,727,745,954		12,263,433,044
経常利益又は経常損失（ ）		10,727,745,954		12,263,433,044
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,727,745,954		12,263,433,044
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（ ）		373,177,356		3,963,013,024
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,018,711,794		13,064,476,476
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,122,686,754		10,768,822,392
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,122,686,754		10,768,822,392
剰余金減少額又は欠損金増加額		431,490,670		6,758,849,737
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		431,490,670		6,758,849,737
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,064,476,476		25,374,869,151

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期 平成25年2月7日現在	第11期 平成26年2月7日現在
1 . 1 期首元本額	33,508,211,306円	36,423,666,137円
期中追加設定元本額	9,700,581,703円	16,783,744,888円
期中一部解約元本額	6,785,126,872円	16,684,231,460円
2 . 受益権の総数	36,423,666,137口	36,523,179,565口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日	第11期 自 平成25年2月8日 至 平成26年2月7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（63,974円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（17,435,069,454円）及び分配準備積立金（1,340,040,016円）より分配対象収益は18,775,173,444円（1万口当たり5,154.66円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（152,993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（8,235,065,563円）、信託約款に規定される収益調整金（17,975,922,339円）及び分配準備積立金（850,558,130円）より分配対象収益は27,061,699,025円（1万口当たり7,409.46円）ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期	第11期
	自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日	自 平成25年2月8日 至 平成26年2月7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、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 平成25年2月7日現在	第11期 平成26年2月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第10期 平成25年2月7日現在	第11期 平成26年2月7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	10,756,762,943	11,044,532,374
合計	10,756,762,943	11,044,532,374

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第10期 平成25年2月7日現在	第11期 平成26年2月7日現在
1口当たり純資産額	1.3587円	1.6948円
（1万口当たり純資産額）	(13,587円)	(16,948円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年2月7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	37,386,768,579	61,897,534,059	
親投資信託受益証券 合計		37,386,768,579	61,897,534,059	
合計		37,386,768,579	61,897,534,059	

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）

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成25年2月7日現在	平成26年2月7日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,428,250,326	10,341,076,428
株式	2	300,995,330,408	301,374,444,140
派生商品評価勘定		123,804,084	109,030,070
未収入金		-	22,086,600
未収配当金		327,925,207	284,826,643
前払金		-	507,595,000
流動資産合計		303,875,310,025	312,639,058,881
資産合計		303,875,310,025	312,639,058,881
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		35,216	353,025,920
前受金		113,911,000	-
未払解約金		654,635,000	60,211,000
流動負債合計		768,581,216	413,236,920
負債合計		768,581,216	413,236,920
純資産の部			
元本等			
元本	1	228,887,294,836	188,590,646,846
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		74,219,433,973	123,635,175,115
元本等合計		303,106,728,809	312,225,821,961
純資産合計		303,106,728,809	312,225,821,961
負債純資産合計		303,875,310,025	312,639,058,881

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年2月7日現在	平成26年2月7日現在
1. 1 本報告書における開示対象 ファンドの期首における当該 親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	249,229,464,222円 50,371,879,068円 70,714,048,454円	228,887,294,836円 37,989,184,033円 78,285,832,023円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M D C 国内株式イン デックスファンド	3,414,040,001円	3,970,207,848円
D I A M国内株式パッシブ・ ファンド	1,141,796,064円	1,370,448,970円
D I A M国内株式インデック スファンド< D C 年金 >	37,368,445,139円	37,386,768,579円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 1 安定型	866,462,466円	748,709,896円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 2 安定・成長型	3,337,620,222円	2,859,610,081円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 3 成長型	3,562,974,990円	3,039,958,422円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	474,683,047円	386,095,927円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,538,790,047円	1,267,213,606円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,201,444,752円	1,088,127,674円
マネックス資産設計ファンド < 隔月分配型 >	122,917,254円	110,256,822円
マネックス資産設計ファンド < 育成型 >	1,510,569,975円	1,361,858,828円

マネックス資産設計ファン ド エボリューション	19,742,481円	20,684,103円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	43,570円	7,922,191円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	69,532円	11,558,016円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	97,297円	26,921,544円
投資のソムリエ	2,916,326円	861,016円
クルーズコントロール	4,551,628円	21,759,643円
投資のソムリエ<DC年金>	-円	6,003円
D I A M 8資産バランス ファンドN<DC年金>	-円	580,728円
D I A Mワールドバランス2 5VA(適格機関投資家限 定)	207,330,889円	155,568,450円
D I A Mグローバル・バラ ンスファンド25VA(適格機 関投資家限定)	9,496,505,123円	4,947,648,314円
D I A Mグローバル・バラ ンスファンド50VA(適格機 関投資家限定)	1,693,923,553円	973,191,683円
D I A M国際分散バランス ファンド30VA(適格機関 投資家限定)	196,321,988円	125,037,964円
D I A M国際分散バランス ファンド50VA(適格機関 投資家限定)	754,060,647円	416,187,512円
D I A M国内重視バランス ファンド30VA(適格機関 投資家限定)	191,888,966円	113,263,150円
D I A M国内重視バランス ファンド50VA(適格機関 投資家限定)	275,573,071円	181,178,060円
D I A M世界バランスファン ド40VA(適格機関投資家 限定)	18,703,199,503円	14,962,758,798円
D I A M世界バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	6,212,388,614円	4,961,742,383円
D I A Mバランスファンド2 5VA(適格機関投資家限 定)	4,577,251,839円	3,579,689,253円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家 限定)	3,045,090,590円	2,417,341,842円
D I A Mバランスファンド5 0VA(適格機関投資家限 定)	7,124,455,334円	5,825,090,065円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関 投資家限定)	1,052,805,601円	683,866,893円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	2,286,348,172円	1,731,144,268円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	2,289,200,859円	1,592,474,926円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	12,951,946,542円	8,290,795,352円
D I A Mグローバル 私募ファンド (適格機関投資家向け)	183,644,962円	87,280,606円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	4,193,380,732円	3,068,189,985円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	8,789,640,440円	7,304,589,475円
D I A Mグローバル分散ファンドV A (適格機関投資家限定)	420,403,174円	280,027,182円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	37,330,815,031円	28,348,518,353円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	2,325,133,781円	1,440,903,785円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	4,462,368,016円	3,357,274,221円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	23,002,160,828円	17,491,462,759円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	199,299,465円	15,078,480円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	71,957,769円	84,011,222円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	158,048円	85,761,418円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	20,058,437,698円	15,548,866,566円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	257,282,523円	193,148,918円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	79,882,612円	58,278,796円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	188,563,237円	122,920,930円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	91,104円	224,247円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	141,970円	126,520円

	D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(121 2)(適格機関投資家限定)	1,292,493,310円		935,035,848円
	D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(130 3)(適格機関投資家限定)	405,984,054円		2,351,917,037円
	D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(130 6)(適格機関投資家限定)	-円		3,056,002,530円
	D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(130 9)(適格機関投資家限定)	-円		124,499,158円
	計	228,887,294,836円		188,590,646,846円
2.	受益権の総数	228,887,294,836口		188,590,646,846口
3.	2 差入代用有価証券	株式 2,047,500,000円	株式	2,950,000,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日	自 平成25年2月8日 至 平成26年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年2月7日現在	平成26年2月7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	62,100,064,005	53,867,282,563
合計	62,100,064,005	53,867,282,563

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成25年2月7日 現在				平成26年2月7日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	2,025,344,000	-	2,149,225,000	123,881,000	11,634,354,000	-	11,390,740,000	243,614,000
合計	2,025,344,000	-	2,149,225,000	123,881,000	11,634,354,000	-	11,390,740,000	243,614,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年2月7日現在	平成26年2月7日現在
1口当たり純資産額	1.3243円	1.6556円
（1万口当たり純資産額）	(13,243円)	(16,556円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年2月7日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	81,000	267	21,627,000	
日本水産	246,700	220	54,274,000	
マルハニチロホールディングス	386,000	175	67,550,000	
ハウスイ	15,000	138	2,070,000	
サカタのタネ	29,700	1,262	37,481,400	
ホクト	22,400	1,925	43,120,000	
ショーボンドHD	17,800	4,840	86,152,000	
ミライト・ホールディングス	56,800	902	51,233,600	
タマホーム	8,500	879	7,471,500	
住石ホールディングス	56,800	126	7,156,800	
日鉄鉱業	51,000	456	23,256,000	
三井松島	132,000	154	20,328,000	
国際石油開発帝石	972,300	1,236	1,201,762,800	
日本海洋掘削	5,000	4,930	24,650,000	
石油資源開発	28,500	3,765	107,302,500	
K&Oエナジーグループ	10,500	1,325	13,912,500	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,661	2,823,700	
安藤・間	130,500	352	45,936,000	
東急建設	71,200	445	31,684,000	
コムシスホールディングス	97,200	1,456	141,523,200	
ミサワホーム	21,500	1,411	30,336,500	
高松コンストラクションGP	15,200	1,787	27,162,400	
東建コーポレーション	7,460	4,545	33,905,700	
ヤマウラ	10,100	268	2,706,800	
大成建設	1,011,000	428	432,708,000	
大林組	600,000	569	341,400,000	
清水建設	612,000	508	310,896,000	
飛島建設	123,300	156	19,234,800	
長谷工コーポレーション	266,900	729	194,570,100	
松井建設	2,000	382	764,000	
銭高組	22,000	278	6,116,000	
鹿島建設	879,000	355	312,045,000	
不動テトラ	142,400	163	23,211,200	
大末建設	77,000	117	9,009,000	
鉄建建設	122,000	279	34,038,000	
日鉄住金テックスエンジ	33,000	365	12,045,000	
西松建設	262,000	350	91,700,000	
三井住友建設	538,100	111	59,729,100	
大豊建設	57,000	380	21,660,000	
前田建設	123,000	707	86,961,000	
佐田建設	69,000	126	8,694,000	
ナカノフドー建設	15,900	227	3,609,300	
奥村組	177,000	449	79,473,000	

大和小田急建設	11,500	238	2,737,000
東鉄工業	24,100	1,992	48,007,200
イチケン	23,000	169	3,887,000
浅沼組	61,000	153	9,333,000
戸田建設	233,000	329	76,657,000
熊谷組	191,000	257	49,087,000
青木あすなる建設	12,400	546	6,770,400
北野建設	43,000	270	11,610,000
植木組	25,000	191	4,775,000
三井ホーム	26,000	463	12,038,000
矢作建設	27,300	964	26,317,200
ピーエス三菱	15,500	463	7,176,500
大東建託	75,900	9,391	712,776,900
新日本建設	24,100	297	7,157,700
N I P P O	46,000	1,526	70,196,000
東亜道路	38,000	499	18,962,000
前田道路	63,000	1,668	105,084,000
日本道路	54,000	523	28,242,000
東亜建設	175,000	225	39,375,000
若築建設	109,000	124	13,516,000
東洋建設	62,300	379	23,611,700
五洋建設	238,000	365	86,870,000
大林道路	24,000	589	14,136,000
世紀東急	104,000	127	13,208,000
福田組	30,000	427	12,810,000
住友林業	137,700	1,043	143,621,100
日本基礎技術	22,400	319	7,145,600
日成ビルド工業	52,000	247	12,844,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	91,000	118	10,738,000
巴コーポレーション	25,300	424	10,727,200
パナホーム	75,000	705	52,875,000
大和ハウス	549,000	1,835	1,007,415,000
ライト工業	41,900	790	33,101,000
積水ハウス	525,200	1,353	710,595,600
日特建設	24,600	410	10,086,000
北陸電気工事	10,000	418	4,180,000
ユアテック	32,000	328	10,496,000
西部電気工業	17,000	443	7,531,000
四電工	6,000	351	2,106,000
中電工	29,000	1,724	49,996,000
関電工	91,000	515	46,865,000
きんでん	133,000	1,035	137,655,000
東京エネシス	21,000	463	9,723,000
トーエネック	29,000	610	17,690,000
住友電設	13,900	1,401	19,473,900
日本電設工業	33,000	1,269	41,877,000
協和エクシオ	78,400	1,251	98,078,400
新日本空調	17,300	608	10,518,400
日本工営	63,000	466	29,358,000
N D S	31,000	284	8,804,000

九電工	37,000	794	29,378,000
三機工業	43,000	611	26,273,000
日 揮	201,000	3,651	733,851,000
中外炉工業	60,000	233	13,980,000
ヤマト	16,000	329	5,264,000
太平電業	29,000	622	18,038,000
高砂熱学	57,200	861	49,249,200
三晃金属	23,000	263	6,049,000
NEC ネットエスアイ	19,400	2,313	44,872,200
朝日工業社	24,000	366	8,784,000
明星工業	29,000	446	12,934,000
アタカ大機	12,000	374	4,488,000
大 氣 社	26,600	2,144	57,030,400
ダイダン	25,000	524	13,100,000
日比谷総合設備	24,600	1,157	28,462,200
東芝プラントシステム	32,000	1,388	44,416,000
日本製粉	123,000	493	60,639,000
日清製粉G本社	199,500	1,016	202,692,000
日東富士製粉	8,000	310	2,480,000
昭和産業	83,000	328	27,224,000
鳥越製粉	16,800	658	11,054,400
協同飼料	73,000	106	7,738,000
中部飼料	19,700	581	11,445,700
日本配合飼料	65,000	115	7,475,000
東洋精糖	34,000	99	3,366,000
日本甜菜糖	105,000	190	19,950,000
三井製糖	79,000	423	33,417,000
ネクスト	15,700	1,027	16,123,900
日本M & Aセンター	9,600	8,470	81,312,000
ノバレーゼ	5,000	867	4,335,000
アコーディア・ゴルフ	76,000	1,378	104,728,000
タケエイ	12,900	1,104	14,241,600
パソナグループ	18,600	647	12,034,200
リンクアンドモチベーション	243	20,830	5,061,690
GCAサヴィアン	11,100	853	9,468,300
エス・エム・エス	10,500	1,910	20,055,000
テンプホールディングス	40,800	2,883	117,626,400
リニカル	3,600	910	3,276,000
クックパッド	9,200	2,848	26,201,600
エスクリ	6,500	956	6,214,000
アイ・ケイ・ケイ	4,400	819	3,603,600
森永製菓	197,000	221	43,537,000
中 村 屋	48,000	399	19,152,000
江崎グリコ	72,000	1,410	101,520,000
名糖産業	9,300	1,007	9,365,100
不 二 家	116,000	184	21,344,000
山崎製パン	147,000	1,110	163,170,000
第一屋製パン	29,000	138	4,002,000
モロゾフ	33,000	308	10,164,000
亀田製菓	11,200	2,786	31,203,200

カルビー	73,300	2,377	174,234,100
森永乳業	170,000	303	51,510,000
六甲バター	9,600	758	7,276,800
ヤクルト	117,000	4,910	574,470,000
明治ホールディングス	59,200	6,220	368,224,000
雪印メグミルク	43,200	1,253	54,129,600
プリマハム	101,000	185	18,685,000
日本ハム	139,000	1,694	235,466,000
伊藤ハム	110,000	458	50,380,000
林兼産業	67,000	78	5,226,000
丸大食品	97,000	305	29,585,000
米 久	7,000	867	6,069,000
S Foods	13,000	1,020	13,260,000
学情	6,100	793	4,837,300
スタジオアリス	7,700	1,305	10,048,500
シミックホールディングス	7,100	1,323	9,393,300
システナ	17,200	751	12,917,200
NECフィールドディング	15,100	1,575	23,782,500
デジタルアーツ	4,800	765	3,672,000
新日鉄住金SOL	14,700	2,572	37,808,400
総合警備保障	67,900	1,800	122,220,000
日本駐車場開発	193,500	111	21,478,500
コア	6,700	730	4,891,000
カカクコム	113,100	1,677	189,668,700
アイロムホールディングス	4,200	852	3,578,400
ルネサンス	8,600	803	6,905,800
SBSホールディングス	3,800	1,601	6,083,800
オプト	7,600	783	5,950,800
新日本科学	13,600	1,421	19,325,600
ツクイ	20,200	959	19,371,800
総合臨床HLDGS	5,600	476	2,665,600
キャリアデザインセンター	39	96,600	3,767,400
エムスリー	617	297,300	183,434,100
ベストブライダル	11,000	599	6,589,000
アウトソーシング	5,900	1,118	6,596,200
ディー・エヌ・エー	100,300	1,832	183,749,600
博報堂DYHLDGS	258,400	774	200,001,600
ぐるなび	13,000	3,165	41,145,000
一休	133	134,200	17,848,600
ジャパンベストレスキューS	118	46,800	5,522,400
ジェイコムホールディングス	3,500	733	2,565,500
PGMホールディングス	26,400	916	24,182,400
バリューコマース	11,500	1,164	13,386,000
サッポロホールディングス	328,000	386	126,608,000
アサヒグループホールディン	402,100	2,721	1,094,114,100
キリンHD	856,000	1,391	1,190,696,000
宝ホールディングス	157,000	811	127,327,000
オエノンホールディングス	49,000	220	10,780,000
養 命 酒	3,000	820	2,460,000
コカ・コーラウエスト	61,700	1,755	108,283,500

コカ・コーラーストジャパン	41,400	2,277	94,267,800
サントリー食品インター	102,700	3,300	338,910,000
ダイトードリンク	9,300	4,045	37,618,500
伊藤園	54,500	2,160	117,720,000
キーコーヒー	19,200	1,553	29,817,600
ユニカフェ	6,100	623	3,800,300
ジャパンフーズ	2,800	1,231	3,446,800
日清オイリオグループ	87,000	328	28,536,000
不二製油	48,700	1,451	70,663,700
J-オイルミルズ	85,000	267	22,695,000
ローソン	72,200	7,320	528,504,000
サンエー	13,300	2,925	38,902,500
キリン堂	6,600	668	4,408,800
ダイユーエイト	3,600	681	2,451,600
カワチ薬品	12,300	1,858	22,853,400
エービーシー・マート	25,000	4,285	107,125,000
ハードオフコーポレーション	8,600	858	7,378,800
高千穂交易	7,600	971	7,379,600
アスクル	18,200	3,685	67,067,000
ゲオホールディングス	30,100	916	27,571,600
アダストリアホールディング	13,500	2,499	33,736,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	23,000	223	5,129,000
伊藤忠食品	4,500	3,385	15,232,500
くらコーポレーション	10,400	1,661	17,274,400
キャンドウ	8,500	1,490	12,665,000
エレマテック	8,300	1,707	14,168,100
パル	10,300	1,835	18,900,500
JALUX	5,400	1,149	6,204,600
エディオン	80,700	562	45,353,400
あらた	39,000	318	12,402,000
サーラコーポレーション	15,400	495	7,623,000
トーメンデバイス	2,800	1,778	4,978,400
J Pホールディングス	31,500	443	13,954,500
あみやき亭	3,100	3,265	10,121,500
東京エレクトロンデバイス	3,700	1,566	5,794,200
ひらまつ	18,400	721	13,266,400
双日	1,181,600	179	211,506,400
ゲンキー	1,600	2,200	3,520,000
アルフレッサホールディングス	52,100	5,490	286,029,000
大黒天物産	3,600	2,753	9,910,800
ハニーズ	13,930	866	12,063,380
キッコーマン	163,000	1,829	298,127,000
味の素	477,000	1,399	667,323,000
キューピー	101,800	1,422	144,759,600
ハウス食品G本社	70,500	1,523	107,371,500
カゴメ	77,500	1,682	130,355,000
焼津水産化工	10,000	915	9,150,000
アリアケジャパン	18,300	2,508	45,896,400
ニチレイ	213,000	436	92,868,000
横浜冷凍	44,000	793	34,892,000

東洋水産	98,000	3,160	309,680,000
日清食品HD	78,200	4,575	357,765,000
永谷園	7,000	940	6,580,000
フジッコ	20,000	1,164	23,280,000
ロックフィールド	10,700	1,747	18,692,900
日本たばこ産業	1,108,300	3,186	3,531,043,800
ケンコーマヨネーズ	7,200	909	6,544,800
わらべや日洋	11,900	1,974	23,490,600
なとり	9,900	1,089	10,781,100
片倉工業	21,500	1,127	24,230,500
グンゼ	152,000	261	39,672,000
ヒューリック	297,000	1,343	398,871,000
神栄	25,000	207	5,175,000
山下医科器械	1,500	1,609	2,413,500
ラサ商事	8,900	461	4,102,900
アルペン	13,400	1,906	25,540,400
クオール	12,900	597	7,701,300
アルコニックス	5,400	2,267	12,241,800
神戸物産	1,800	2,407	4,332,600
ジェイアイエヌ	9,000	2,400	21,600,000
ビックカメラ	668	59,300	39,612,400
DCMホールディングス	86,800	676	58,676,800
MonotaRO	27,300	1,964	53,617,200
あいホールディングス	28,200	1,350	38,070,000
J.フロントリテイリング	416,000	660	274,560,000
ドトール・日レスHD	30,900	1,697	52,437,300
マツモトキヨシHLDGS	36,300	3,585	130,135,500
ブロンコビリー	2,900	1,794	5,202,600
スタートトゥデイ	54,900	2,193	120,395,700
物語コーポレーション	2,600	3,105	8,073,000
ココカラファイン	18,300	2,405	44,011,500
三越伊勢丹HD	350,100	1,224	428,522,400
東洋紡	790,000	178	140,620,000
ユニチカ	516,000	62	31,992,000
富士紡ホールディングス	98,000	212	20,776,000
日清紡ホールディングス	119,000	865	102,935,000
倉敷紡績	193,000	177	34,161,000
ダイワボウHD	160,000	194	31,040,000
シキボウ	109,000	123	13,407,000
日東紡績	137,000	428	58,636,000
トヨタ紡織	62,500	1,048	65,500,000
ウエルシアHD	6,400	5,610	35,904,000
クリエイトSDH	7,400	3,265	24,161,000
バイタルKSKHD	33,100	670	22,177,000
八洲電機	14,200	441	6,262,200
UKCホールディングス	11,300	1,580	17,854,000
丸善CHIHHD	15,400	297	4,573,800
TOKAIホールディングス	86,100	326	28,068,600
エー・ピーカンパニー	1,600	1,802	2,883,200
三洋貿易	6,300	895	5,638,500

日本毛織	59,000	717	42,303,000
大東紡織	30,000	73	2,190,000
トーア紡コーポレーション	82,000	74	6,068,000
ダイドーリミテッド	21,300	643	13,695,900
東京建物不動産販	9,500	410	3,895,000
三栄建築設計	5,400	831	4,487,400
野村不動産HLDGS	116,300	2,242	260,744,600
プレサンスコーポレーション	3,200	2,840	9,088,000
常和ホールディングス	6,200	3,240	20,088,000
フージャースHD	26,300	665	17,489,500
オープンハウス	7,000	1,715	12,005,000
東急不動産HD	390,600	866	338,259,600
飯田GHD	77,200	1,804	139,268,800
帝国繊維	19,600	1,283	25,146,800
ブックオフコーポレーション	9,700	714	6,925,800
日本コークス工業	151,900	138	20,962,200
ミタチ産業	3,800	493	1,873,400
あさひ	10,200	1,355	13,821,000
日本調剤	2,260	2,737	6,185,620
コスモス薬品	10,000	12,510	125,100,000
シップヘルスケアHD	25,200	3,635	91,602,000
トーエル	9,300	545	5,068,500
一六堂	2,800	455	1,274,000
ソフトクリエイトHD	5,800	963	5,585,400
セブン&アイ・HLDGS	736,800	3,845	2,832,996,000
クリエイト・レストランツ・ホール	2,200	2,907	6,395,400
ツルハホールディングス	17,300	9,170	158,641,000
サンマルクホールディングス	5,700	4,655	26,533,500
フェリシモ	5,000	987	4,935,000
トリドール	15,200	948	14,409,600
クスリのアオキ	2,600	5,320	13,832,000
帝人	765,000	237	181,305,000
東レ	1,356,000	698	946,488,000
クラレ	297,100	1,086	322,650,600
旭化成	1,166,000	722	841,852,000
サカイオーベックス	50,000	186	9,300,000
稲葉製作所	8,000	1,193	9,544,000
宮地エンジニアリングG	62,000	280	17,360,000
トーカロ	11,400	1,775	20,235,000
アルファCO	6,600	1,000	6,600,000
SUMCO	114,300	771	88,125,300
川田テクノロジーズ	3,900	2,554	9,960,600
住江織物	52,000	289	15,028,000
日本フェルト	11,000	456	5,016,000
イチカワ	13,000	284	3,692,000
日本バイリーン	20,000	618	12,360,000
エコナックホールディングス	56,000	49	2,744,000
日東製網	23,000	160	3,680,000
芦森工業	42,000	128	5,376,000

アツギ	160,000	115	18,400,000
ダイニック	36,000	175	6,300,000
共和レザー	12,800	497	6,361,600
セーレン	50,300	777	39,083,100
東海染工	28,000	121	3,388,000
小松精練	32,000	473	15,136,000
ワコールホールディングス	112,000	1,043	116,816,000
ホギメディカル	11,800	5,330	62,894,000
レナウン	46,600	121	5,638,600
クラウディア	2,400	1,140	2,736,000
T S Iホールディングス	90,000	600	54,000,000
I Tホールディングス	63,200	1,656	104,659,200
ネオス	3,500	1,012	3,542,000
電算システム	4,200	1,110	4,662,000
グリー	104,700	969	101,454,300
コーエーテクモHD	34,800	1,157	40,263,600
三菱総合研究所	6,800	2,029	13,797,200
ボルテージ	2,600	1,588	4,128,800
電算	1,300	1,842	2,394,600
ヒト・コミュニケーションズ	1,900	1,733	3,292,700
ブレインパッド	1,400	1,263	1,768,200
K L a b	11,800	729	8,602,200
ポルトウウィン・ピットクル	10,800	1,584	17,107,200
イーブックイニシアティブ	2,500	1,745	4,362,500
ネクソン	146,000	836	122,056,000
アイスタイル	5,000	518	2,590,000
エムアップ	3,200	721	2,307,200
エイチーム	1,600	6,540	10,464,000
e n i s h	2,500	2,209	5,522,500
モバイルクリエイト	1,400	3,860	5,404,000
ブロードリーフ	17,400	1,652	28,744,800
ハーツユナイテッドグループ	4,000	2,504	10,016,000
特種東海製紙	108,000	208	22,464,000
ドワンゴ	15,900	2,619	41,642,100
ベリサーブ	1,100	1,630	1,793,000
ティーガイア	17,500	1,136	19,880,000
豆蔵ホールディングス	10,400	386	4,014,400
テクマトリックス	5,800	588	3,410,400
GMOペイメントゲートウェイ	6,700	5,050	33,835,000
ザッパラス	9,900	720	7,128,000
インターネットイニシアティブ	25,900	1,970	51,023,000
ビットアイル	13,300	682	9,070,600
S R Aホールディングス	8,500	1,368	11,628,000
朝日ネット	16,300	505	8,231,500
王子ホールディングス	826,000	477	394,002,000
日本製紙	96,600	1,964	189,722,400
三菱製紙	266,000	96	25,536,000
北越紀州製紙	127,500	438	55,845,000
中越パルプ	71,000	203	14,413,000
巴川製紙	29,000	187	5,423,000

大王製紙	64,000	885	56,640,000
レンゴー	150,000	570	85,500,000
トーモク	59,000	316	18,644,000
ザ・バック	13,300	1,837	24,432,100
コープケミカル	29,000	131	3,799,000
昭和電工	1,245,000	137	170,565,000
住友化学	1,376,000	421	579,296,000
日本化成	37,000	136	5,032,000
住友精化	39,000	882	34,398,000
日産化学	128,200	1,541	197,556,200
ラサ工業	71,000	159	11,289,000
クレハ	131,000	489	64,059,000
多木化学	8,000	605	4,840,000
テイカ	32,000	294	9,408,000
石原産業	337,000	116	39,092,000
片倉チツカリン	13,000	263	3,419,000
日本曹達	120,000	558	66,960,000
東ソー	500,000	421	210,500,000
トクヤマ	291,000	391	113,781,000
セントラル硝子	179,000	327	58,533,000
東亜合成	220,000	412	90,640,000
ダイソー	75,000	351	26,325,000
関東電化	45,000	237	10,665,000
電気化学	374,000	375	140,250,000
イビデン	108,700	1,942	211,095,400
信越化学	335,200	5,703	1,911,645,600
日本カーバイド	55,000	252	13,860,000
堺化学	76,000	299	22,724,000
エア・ウォーター	154,000	1,512	232,848,000
大陽日酸	240,000	741	177,840,000
日本化学工業	70,000	130	9,100,000
日本パーカラライジング	44,000	2,145	94,380,000
高压ガス	28,000	551	15,428,000
チタン工業	22,000	231	5,082,000
四国化成	27,000	753	20,331,000
戸田工業	34,000	261	8,874,000
ステラ ケミファ	9,600	1,355	13,008,000
保土谷化学	57,000	183	10,431,000
日本触媒	158,000	1,141	180,278,000
大日精化	72,000	438	31,536,000
カネカ	233,000	649	151,217,000
協和発酵キリン	224,000	1,038	232,512,000
三菱瓦斯化学	295,000	672	198,240,000
三井化学	850,000	260	221,000,000
J S R	171,500	1,786	306,299,000
東京応化工業	36,200	2,142	77,540,400
大阪有機化学	12,700	462	5,867,400
三菱ケミカルH L D G S	1,168,500	446	521,151,000
日本合成化学	38,000	808	30,704,000
ダイセル	243,000	874	212,382,000

住友ベークライト	146,000	379	55,334,000
積水化学	384,000	1,141	438,144,000
日本ゼオン	148,000	987	146,076,000
アイカ工業	52,600	1,990	104,674,000
宇部興産	942,000	191	179,922,000
積水樹脂	26,400	1,405	37,092,000
タキロン	44,000	427	18,788,000
旭有機材	66,000	221	14,586,000
日立化成	80,800	1,390	112,312,000
ニチバン	19,000	353	6,707,000
リケンテクノス	30,000	577	17,310,000
大倉工業	45,000	313	14,085,000
積水化成品	53,000	264	13,992,000
群栄化学	50,000	397	19,850,000
タイガース ポリマー	9,400	452	4,248,800
ミライアル	4,700	1,406	6,608,200
日本化薬	132,000	1,365	180,180,000
カーリットホールディングス	15,100	461	6,961,100
イーピーエス	200	104,000	20,800,000
パナソニック インフォシス	3,600	2,748	9,892,800
プレステージ・インター	12,600	827	10,420,200
フェイス	5,300	1,075	5,697,500
アミューズ	5,200	1,986	10,327,200
野村総合研究所	99,700	3,300	329,010,000
ドリームインキュベータ	49	155,300	7,609,700
サイバネットシステム	15,100	380	5,738,000
T A C	11,600	359	4,164,400
ケネディクス	220,100	408	89,800,800
電通	175,800	3,860	678,588,000
インテージホールディングス	9,600	1,355	13,008,000
テイクアンドギヴニーズ	8,000	2,270	18,160,000
ぴあ	5,600	1,846	10,337,600
イオンファンタジー	6,100	1,424	8,686,400
ソースネクスト	9,000	665	5,985,000
ネクシィーズ	6,800	1,047	7,119,600
メディカルシステムネットワーク	14,500	497	7,206,500
日本精化	15,800	629	9,938,200
A D E K A	80,600	1,173	94,543,800
日油	155,000	702	108,810,000
ミヨシ油脂	71,000	143	10,153,000
新日本理化	22,800	232	5,289,600
ハリマ化成グループ	16,200	458	7,419,600
花 王	486,100	3,145	1,528,784,500
第一工業製薬	35,000	305	10,675,000
三洋化成	59,000	694	40,946,000
武田薬品	700,200	4,665	3,266,433,000
アステラス製薬	430,500	6,178	2,659,629,000
大日本住友製薬	132,400	1,676	221,902,400
塩野義製薬	291,900	2,012	587,302,800
田辺三菱製薬	155,600	1,435	223,286,000

わかもと製薬	7,000	270	1,890,000
あすか製薬	22,000	742	16,324,000
日本新薬	43,000	1,936	83,248,000
ビオフェルミン製薬	3,100	2,623	8,131,300
中外製薬	186,100	2,263	421,144,300
科研製薬	68,000	1,549	105,332,000
エーザイ	230,100	3,765	866,326,500
ロート製薬	79,000	1,580	124,820,000
小野薬品	84,900	8,700	738,630,000
久光製薬	58,000	4,405	255,490,000
有機合成薬品	13,000	266	3,458,000
持田製薬	13,800	6,000	82,800,000
参天製薬	68,700	4,200	288,540,000
扶桑薬品	63,000	332	20,916,000
日本ケミファ	26,000	493	12,818,000
ツムラ	54,900	2,506	137,579,400
日医工	43,800	1,468	64,298,400
テルモ	136,800	4,535	620,388,000
みらかホールディングス	49,000	4,605	225,645,000
キッセイ薬品工業	34,700	2,507	86,992,900
生化学工業	39,100	1,404	54,896,400
栄研化学	14,600	1,772	25,871,200
日水製薬	7,900	1,052	8,310,800
鳥居薬品	12,800	2,989	38,259,200
JCRファーマ	10,800	2,077	22,431,600
東和薬品	9,500	3,960	37,620,000
富士製薬工業	5,400	1,857	10,027,800
沢井製薬	29,300	5,650	165,545,000
ゼリア新薬工業	29,500	2,426	71,567,000
第一三共	589,400	1,652	973,688,800
キョーリン製薬HD	49,900	2,164	107,983,600
大幸薬品	8,900	2,064	18,369,600
ダイト	6,200	1,484	9,200,800
大塚ホールディングス	370,900	3,030	1,123,827,000
大正製薬HD	45,000	7,120	320,400,000
大日本塗料	108,000	157	16,956,000
日本ペイント	162,000	1,508	244,296,000
関西ペイント	227,000	1,347	305,769,000
神東塗料	11,000	213	2,343,000
中国塗料	54,000	543	29,322,000
日本特殊塗料	14,700	616	9,055,200
藤倉化成	23,800	587	13,970,600
太陽ホールディングス	15,300	3,500	53,550,000
DIC	663,000	291	192,933,000
サカタインクス	38,300	924	35,389,200
東洋インキSCホールディング	168,000	488	81,984,000
T&K TOKA	6,800	2,065	14,042,000
アルプス技研	7,800	920	7,176,000
サニックス	27,200	862	23,446,400
ダイオーズ	3,600	847	3,049,200

日本空調サービス	4,700	1,214	5,705,800
オリエンタルランド	50,400	15,275	769,860,000
ダスキン	50,500	1,891	95,495,500
パーク24	92,000	2,035	187,220,000
明光ネットワークジャパン	18,600	1,112	20,683,200
ファルコSDホールディングス	9,600	1,221	11,721,600
クレスコ	4,200	917	3,851,400
フジ・メディア・HD	170,300	1,792	305,177,600
秀英予備校	4,000	317	1,268,000
田谷	3,700	737	2,726,900
ラウンドワン	53,000	894	47,382,000
リゾートトラスト	63,100	1,725	108,847,500
オービック	60,700	3,155	191,508,500
TDCソフトウェアエンジニア	4,100	802	3,288,200
ヤフー	1,275,000	566	721,650,000
ビー・エム・エル	12,200	3,305	40,321,000
ワタベウェディング	6,400	643	4,115,200
トレンドマイクロ	77,700	3,075	238,927,500
もしもしホットライン	34,700	1,021	35,428,700
リソー教育	21,000	551	11,571,000
日本オラクル	28,200	4,225	119,145,000
アルファシステムズ	5,800	1,357	7,870,600
フューチャーアーキテクト	21,300	628	13,376,400
シーエーシー	11,000	898	9,878,000
ソフトバンク・テクノ	4,200	1,337	5,615,400
トーセ	4,400	741	3,260,400
ユー・エス・エス	225,800	1,383	312,281,400
オービックビジネスC	8,900	3,370	29,993,000
伊藤忠テクノソリューションズ	19,900	4,385	87,261,500
アイティフォー	19,800	464	9,187,200
東京個別指導学院	9,700	314	3,045,800
東計電算	3,300	1,476	4,870,800
楽天	605,200	1,563	945,927,600
エクスネット	1,800	1,351	2,431,800
テー・オー・ダブリュー	6,600	670	4,422,000
大塚商会	15,800	12,500	197,500,000
総合メディカル	4,300	3,825	16,447,500
サイボウズ	26,500	356	9,434,000
ソフトブレーン	24,700	131	3,235,700
アグレックス	4,200	1,018	4,275,600
セントラルスポーツ	5,900	1,533	9,044,700
パラカ	4,600	735	3,381,000
電通国際情報S	10,900	1,120	12,208,000
イーエムシステムズ	2,400	2,179	5,229,600
ウェザーニューズ	4,600	2,640	12,144,000
C I J	16,800	406	6,820,800
WOWOW	5,400	3,180	17,172,000
フルキャストホールディングス	18,000	230	4,140,000
富士フイルムHLDGS	427,800	2,836	1,213,240,800
コニカミノルタ	471,500	1,002	472,443,000

資 生 堂	332,500	1,600	532,000,000
ライオン	216,000	513	110,808,000
高砂香料	67,000	547	36,649,000
マンダム	18,700	3,300	61,710,000
ミルボン	11,900	3,430	40,817,000
ファンケル	43,500	1,083	47,110,500
コーセー	30,200	3,120	94,224,000
ドクターシーラボ	12,700	2,978	37,820,600
シーボン	1,800	2,299	4,138,200
ポーラ・オルビスHD	19,100	3,450	65,895,000
ノエビアホールディングス	12,500	1,840	23,000,000
エステー	11,600	971	11,263,600
コ ニ シ	13,600	1,870	25,432,000
長谷川香料	23,800	1,466	34,890,800
星光PMC	8,200	770	6,314,000
小林製薬	30,600	5,290	161,874,000
荒川化学工業	15,800	859	13,572,200
メック	14,600	830	12,118,000
日本高純度化学	54	212,600	11,480,400
JCU	2,800	6,000	16,800,000
新田ゼラチン	11,300	901	10,181,300
アース製薬	13,500	3,330	44,955,000
イハラケミカル	29,000	728	21,112,000
北興化学	11,000	328	3,608,000
大成ラミック	4,900	2,590	12,691,000
クミアイ化学	39,000	578	22,542,000
日本農薬	43,000	1,429	61,447,000
昭和シエル石油	167,200	936	156,499,200
コスモ石油	516,000	184	94,944,000
富士興産	6,700	657	4,401,900
ニチレキ	23,000	1,112	25,576,000
東燃ゼネラル石油	282,000	864	243,648,000
ユシロ化学	10,200	979	9,985,800
ビーピー・カストロール	8,400	491	4,124,400
富士石油	47,700	310	14,787,000
MORESCO	4,500	1,648	7,416,000
出光興産	88,600	2,117	187,566,200
JXホールディングス	2,073,500	487	1,009,794,500
横浜ゴム	209,000	872	182,248,000
東洋ゴム	155,000	560	86,800,000
ブリヂストン	585,800	3,591	2,103,607,800
住友ゴム	145,900	1,380	201,342,000
藤倉ゴム	11,800	990	11,682,000
オカモト	65,000	333	21,645,000
アキレス	148,000	137	20,276,000
フ コ ク	8,100	997	8,075,700
ニッタ	18,500	2,207	40,829,500
クリエートメディック	6,100	914	5,575,400
東海ゴム工業	34,500	1,044	36,018,000
三ツ星ベルト	47,000	539	25,333,000

バンドー化学	68,000	386	26,248,000
鬼怒川ゴム	34,000	457	15,538,000
旭硝子	920,000	583	536,360,000
日本板硝子	902,000	132	119,064,000
石塚硝子	24,000	304	7,296,000
有沢製作所	31,200	597	18,626,400
日本山村硝子	74,000	172	12,728,000
日本電気硝子	386,000	459	177,174,000
オハラ	7,100	589	4,181,900
住友大阪セメント	355,000	382	135,610,000
太平洋セメント	1,098,000	377	413,946,000
デイ・シイ	19,300	610	11,773,000
リゾートソリューション	17,000	242	4,114,000
日本ヒューム	18,000	873	15,714,000
日本コンクリート	32,000	517	16,544,000
三谷セキサン	9,400	1,117	10,499,800
ジャパンパイル	15,300	994	15,208,200
東海カーボン	175,000	320	56,000,000
日本カーボン	99,000	182	18,018,000
東洋炭素	10,300	1,850	19,055,000
ノリタケ	106,000	253	26,818,000
TOTO	275,000	1,548	425,700,000
日本碍子	236,000	1,937	457,132,000
日本特殊陶業	161,000	2,254	362,894,000
ダントーホールディングス	26,000	121	3,146,000
MARUWA	4,800	3,700	17,760,000
品川リフラクトリーズ	47,000	217	10,199,000
黒崎播磨	40,000	238	9,520,000
ヨータイ	11,000	299	3,289,000
イソライト	7,400	181	1,339,400
東京窯業	23,000	212	4,876,000
ニッカトー	6,700	398	2,666,600
フジインコーポレーテッド	17,000	1,120	19,040,000
エーアンドエーマテリアル	39,000	137	5,343,000
ニチアス	90,000	707	63,630,000
新日鐵住金	7,899,000	304	2,401,296,000
神戸製鋼所	2,589,000	156	403,884,000
中山製鋼所	105,000	87	9,135,000
合同製鐵	95,000	168	15,960,000
JFEホールディングス	476,700	2,080	991,536,000
日新製鋼HD	79,100	1,058	83,687,800
東京製鐵	103,200	504	52,012,800
共英製鋼	17,400	2,166	37,688,400
大和工業	38,600	2,900	111,940,000
東京鐵鋼	39,000	387	15,093,000
大阪製鐵	9,400	1,750	16,450,000
淀川製鋼所	133,000	431	57,323,000
東洋鋼鈹	45,000	499	22,455,000
丸一鋼管	62,500	2,642	165,125,000
モリ工業	29,000	394	11,426,000

大同特殊鋼	313,000	482	150,866,000
日本高周波	74,000	99	7,326,000
日本冶金工	146,500	257	37,650,500
山陽特殊製鋼	102,000	425	43,350,000
愛知製鋼	99,000	406	40,194,000
日立金属	166,000	1,469	243,854,000
日本金属	49,000	130	6,370,000
大太平洋金属	130,000	351	45,630,000
日本電工	80,000	286	22,880,000
栗本鉄工所	97,000	229	22,213,000
虹 技	20,000	189	3,780,000
日本鑄鉄管	20,000	213	4,260,000
日本製鋼所	267,000	492	131,364,000
三菱製鋼	113,000	249	28,137,000
日亜鋼業	26,000	339	8,814,000
日本精線	14,000	416	5,824,000
大紀アルミニウム	29,000	245	7,105,000
日本軽金属HD	423,300	140	59,262,000
三井金属	476,000	276	131,376,000
東邦亜鉛	105,000	349	36,645,000
三菱マテリアル	1,166,000	332	387,112,000
住友鉱山	483,000	1,302	628,866,000
D O W Aホールディングス	206,000	899	185,194,000
古河機金	314,000	200	62,800,000
エス・サイエンス	66,300	52	3,447,600
大阪チタニウム	20,400	1,546	31,538,400
東邦チタニウム	31,600	631	19,939,600
U A C J	237,000	403	95,511,000
古河電工	587,000	249	146,163,000
住友電工	704,000	1,571	1,105,984,000
フジクラ	300,000	471	141,300,000
昭和電線H L D G S	240,000	108	25,920,000
東京特殊電線	27,000	152	4,104,000
タツタ電線	27,300	560	15,288,000
沖 電 線	20,000	180	3,600,000
カナレ電気	2,800	1,388	3,886,400
平河ヒューテック	4,200	825	3,465,000
リョービ	114,000	373	42,522,000
アサヒHD	28,100	1,753	49,259,300
東洋製罐グループHD	132,700	1,804	239,390,800
ホッカンホールディングス	45,000	316	14,220,000
コロナ	9,800	1,043	10,221,400
横河ブリッジH L D G S	35,000	1,345	47,075,000
日本橋梁	41,400	180	7,452,000
駒井ハルテック	36,000	308	11,088,000
高田機工	17,000	205	3,485,000
三和ホールディングス	157,000	706	110,842,000
文化シャッター	44,000	586	25,784,000
三協立山	24,500	2,192	53,704,000
東洋シャッター	5,400	592	3,196,800

L I X I Lグループ	260,200	2,691	700,198,200
日本フィルコン	12,500	408	5,100,000
ノーリツ	36,700	2,022	74,207,400
長府製作所	20,000	2,254	45,080,000
リンナイ	28,900	7,780	224,842,000
ユニプレス	28,900	1,821	52,626,900
ダイニチ工業	9,500	693	6,583,500
日東精工	26,000	315	8,190,000
三洋工業	24,000	172	4,128,000
岡 部	36,900	1,263	46,604,700
中国工業	3,000	763	2,289,000
東 プ レ	36,000	1,237	44,532,000
高周波熱錬	27,300	693	18,918,900
東京製綱	127,000	162	20,574,000
モリテックスチル	10,000	286	2,860,000
パイオラックス	8,700	3,725	32,407,500
日本発条	148,900	1,018	151,580,200
中央発條	24,000	299	7,176,000
アドバネクス	38,000	142	5,396,000
三浦工業	27,700	2,641	73,155,700
タ ク マ	58,000	873	50,634,000
リブセンス	9,300	1,976	18,376,800
E R Iホールディングス	3,700	1,155	4,273,500
ツ ガ ミ	58,000	586	33,988,000
オークマ	122,000	951	116,022,000
東芝機械	102,000	538	54,876,000
ア マ ダ	286,000	784	224,224,000
アイダエンジニア	43,900	1,106	48,553,400
滝澤鉄工所	47,000	154	7,238,000
富士機械製造	56,800	835	47,428,000
牧野フライス	93,000	863	80,259,000
オーエスジー	76,800	1,794	137,779,200
ダイジェット	22,000	147	3,234,000
旭ダイヤモンド	48,000	1,077	51,696,000
D M G森精機	98,500	1,730	170,405,000
ディスコ	20,700	6,850	141,795,000
日東工器	10,800	1,785	19,278,000
豊田自動織機	162,500	4,645	754,812,500
豊和工業	10,600	795	8,427,000
大阪機工	73,000	136	9,928,000
石川製作所	43,000	111	4,773,000
東洋機械金属	14,100	586	8,262,600
津田駒工業	45,000	165	7,425,000
エンシュウ	46,000	136	6,256,000
島精機製作所	24,300	1,653	40,167,900
日阪製作所	24,000	899	21,576,000
やまびこ	7,300	3,475	25,367,500
ペガサスミシン製造	17,200	354	6,088,800
ナプテスコ	85,300	2,272	193,801,600
三井海洋開発	15,500	2,697	41,803,500

レオン自動機	17,000	596	10,132,000
S M C	53,400	23,990	1,281,066,000
新川	15,700	553	8,682,100
ホソカワミクロン	31,000	621	19,251,000
ユニオンツール	8,100	2,422	19,618,200
オイレス工業	17,700	2,271	40,196,700
日精エーエスピー	5,100	2,380	12,138,000
サトーホールディングス	19,500	2,324	45,318,000
日本エアテック	5,800	476	2,760,800
日精樹脂工業	13,600	543	7,384,800
ワイエイシイ	7,800	515	4,017,000
小松製作所	871,600	2,052	1,788,523,200
住友重機械	511,000	467	238,637,000
日立建機	95,300	1,937	184,596,100
日 工	28,000	612	17,136,000
巴工業	6,400	1,590	10,176,000
井関農機	191,000	282	53,862,000
T O W A	15,300	467	7,145,100
丸山製作所	39,000	245	9,555,000
北川鉄工所	86,000	180	15,480,000
シンニッタン	17,700	382	6,761,400
クボタ	975,000	1,540	1,501,500,000
荏原実業	5,000	1,368	6,840,000
東洋エンジニア	107,000	444	47,508,000
三菱化工機	62,000	161	9,982,000
月島機械	30,000	987	29,610,000
帝国電機製作所	6,300	2,794	17,602,200
東京機械	66,000	98	6,468,000
新東工業	43,800	716	31,360,800
渋谷工業	11,700	2,115	24,745,500
アイチ コーポレーション	26,400	429	11,325,600
小森コーポレーション	45,400	1,437	65,239,800
鶴見製作所	14,000	1,285	17,990,000
住友精密	29,000	396	11,484,000
酒井重工業	36,000	357	12,852,000
荏原製作所	413,000	655	270,515,000
石井鉄工所	28,000	254	7,112,000
西島製作所	19,900	1,174	23,362,600
千代田化工建	159,000	1,495	237,705,000
ダイキン工業	243,700	5,759	1,403,468,300
オルガノ	29,000	451	13,079,000
トーヨーカネツ	100,000	275	27,500,000
栗田工業	112,200	2,125	238,425,000
椿本チエイン	95,000	793	75,335,000
大同工業	37,000	273	10,101,000
日本コンベヤ	59,000	129	7,611,000
日 機 装	58,000	1,236	71,688,000
木村化工機	17,200	486	8,359,200
新興プランテック	41,100	762	31,318,200
アネスト岩田	30,000	631	18,930,000

ダイフク	75,500	1,213	91,581,500
加藤製作所	42,000	591	24,822,000
油研工業	35,000	217	7,595,000
タダノ	79,000	1,298	102,542,000
フジテック	52,000	1,283	66,716,000
C K D	50,000	974	48,700,000
キトー	10,500	1,889	19,834,500
平和	38,600	1,801	69,518,600
理想科学工業	13,800	2,133	29,435,400
S A N K Y O	54,100	4,045	218,834,500
日本金銭機械	16,500	1,760	29,040,000
マースエンジニアリング	10,100	1,847	18,654,700
福島工業	9,800	1,350	13,230,000
オーイズミ	6,300	976	6,148,800
ダイコク電機	7,400	2,288	16,931,200
ア マ ノ	51,000	1,066	54,366,000
J U K I	115,000	199	22,885,000
サンデン	101,000	451	45,551,000
蛇の目ミシン	174,000	84	14,616,000
ブラザー工業	230,700	1,343	309,830,100
マックス	28,000	1,111	31,108,000
モリタホールディングス	31,000	813	25,203,000
グローリー	53,200	2,446	130,127,200
新晃工業	12,500	752	9,400,000
大和冷機工業	29,000	677	19,633,000
セガサミーホールディングス	191,800	2,384	457,251,200
日本ピストンリング	71,000	196	13,916,000
リ ケ ン	71,000	452	32,092,000
T P R	19,900	1,691	33,650,900
ホシザキ電機	39,000	3,595	140,205,000
大豊工業	12,900	994	12,822,600
日本精工	397,000	1,123	445,831,000
N T N	413,000	398	164,374,000
ジェイテクト	189,600	1,537	291,415,200
不 二 越	166,000	623	103,418,000
ミネベア	243,000	819	199,017,000
日本トムソン	57,000	489	27,873,000
T H K	111,300	2,206	245,527,800
ユーシン精機	7,900	2,298	18,154,200
前澤給装工業	7,000	1,259	8,813,000
イーグル工業	22,000	1,485	32,670,000
前澤工業	13,500	314	4,239,000
日本ピラー工業	19,000	660	12,540,000
キッツ	80,000	475	38,000,000
日 立	4,286,000	780	3,343,080,000
東 芝	3,522,000	418	1,472,196,000
三菱電機	1,785,000	1,188	2,120,580,000
富士電機	497,000	423	210,231,000
東洋電機製造	35,000	336	11,760,000
安川電機	196,000	1,406	275,576,000

シンフォニア テクノロジー	107,000	161	17,227,000
明電舎	164,000	399	65,436,000
オリジン電気	26,000	312	8,112,000
山洋電気	27,000	653	17,631,000
デンヨー	17,600	1,317	23,179,200
日立工機	47,600	705	33,558,000
三桜工業	23,200	679	15,752,800
マキタ	116,400	5,050	587,820,000
東芝テック	112,000	648	72,576,000
芝浦メカトロニクス	32,000	231	7,392,000
マブチモーター	25,200	5,640	142,128,000
日本電産	96,500	11,625	1,121,812,500
東光高岳HD	9,900	1,802	17,839,800
宮越ホールディングス	6,200	267	1,655,400
ダイヘン	105,000	419	43,995,000
ヤーマン	2,400	1,374	3,297,600
JVCケンウッド	123,300	216	26,632,800
第一精工	7,400	1,141	8,443,400
日新電機	36,000	523	18,828,000
大崎電気	28,000	572	16,016,000
オムロン	201,400	3,900	785,460,000
日東工業	26,200	1,963	51,430,600
I D E C	23,300	876	20,410,800
ジーエス・ユアサ コーポ	344,000	541	186,104,000
サクサホールディングス	45,000	153	6,885,000
メルコホールディングス	8,600	1,646	14,155,600
テクノメディカ	4,100	2,114	8,667,400
日本電気	2,453,000	302	740,806,000
富士通	1,721,000	598	1,029,158,000
沖電気	689,000	253	174,317,000
岩崎通信機	85,000	96	8,160,000
電気興業	51,000	646	32,946,000
サンケン電気	97,000	660	64,020,000
ナカヨ通信機	17,000	329	5,593,000
アイホン	10,400	1,553	16,151,200
ルネサスエレクトロニクス	92,400	540	49,896,000
セイコーエプソン	121,800	2,957	360,162,600
ワコム	140,500	622	87,391,000
アルバック	30,100	1,688	50,808,800
アクセル	9,000	1,629	14,661,000
ピクセラ	7,400	145	1,073,000
E I Z O	16,400	2,713	44,493,200
日本信号	45,000	880	39,600,000
京三製作所	42,000	335	14,070,000
能美防災	24,000	983	23,592,000
ホーチキ	13,000	558	7,254,000
エレコム	6,400	1,404	8,985,600
日本無線	46,000	332	15,272,000
パナソニック	2,039,100	1,192	2,430,607,200
シャープ	1,287,000	315	405,405,000

アンリツ	103,800	1,055	109,509,000
富士通ゼネラル	42,000	1,099	46,158,000
日立国際電気	35,000	1,192	41,720,000
ソ ニ ー	978,500	1,691	1,654,643,500
T D K	107,700	4,260	458,802,000
帝国通信工業	44,000	169	7,436,000
ミツミ電機	68,000	759	51,612,000
タムラ製作所	69,000	281	19,389,000
アルプス電気	130,900	1,378	180,380,200
池上通信機	57,000	112	6,384,000
パイオニア	247,800	220	54,516,000
日本電波工業	16,100	855	13,765,500
日本トリム	3,900	7,160	27,924,000
ローランド ディー . ジー .	7,900	3,290	25,991,000
日本コロムビア	8,800	699	6,151,200
フオスター電機	18,300	1,668	30,524,400
クラリオン	110,000	147	16,170,000
S M K	53,000	491	26,023,000
ヨコオ	15,300	517	7,910,100
東 光	84,000	324	27,216,000
ティアック	97,000	80	7,760,000
ホシデン	52,400	509	26,671,600
ヒロセ電機	31,000	14,170	439,270,000
日本航空電子	46,000	1,617	74,382,000
T O A	19,200	1,027	19,718,400
古野電気	17,300	669	11,573,700
ユニデン	56,000	301	16,856,000
アルパイン	38,700	1,461	56,540,700
スミダコーポレーション	14,800	508	7,518,400
アイコム	9,900	2,339	23,156,100
リオン	5,100	1,550	7,905,000
船井電機	18,000	1,101	19,818,000
横河電機	193,600	1,501	290,593,600
新電元工業	57,000	590	33,630,000
アズビル	54,100	2,430	131,463,000
日本光電工業	38,100	3,955	150,685,500
チ ノ ー	33,000	217	7,161,000
共和電業	21,000	436	9,156,000
日本電子材料	8,300	432	3,585,600
堀場製作所	33,000	3,650	120,450,000
アドバンテスト	121,700	1,052	128,028,400
小野測器	19,000	440	8,360,000
エスベック	18,500	806	14,911,000
パナソニックデバイス	15,900	453	7,202,700
キーエンス	40,400	40,880	1,651,552,000
日置電機	9,400	1,377	12,943,800
シスメックス	74,700	5,840	436,248,000
メガチップス	16,000	1,250	20,000,000
O B A R A G R O U P	11,600	3,190	37,004,000
日本電産コバル電子	18,600	734	13,652,400

澤藤電機	11,000	213	2,343,000
デンソー	441,000	5,180	2,284,380,000
コーセル	26,000	1,127	29,302,000
新日本無線	13,000	355	4,615,000
オブテックス	11,400	1,555	17,727,000
千代田インテグレ	7,900	1,735	13,706,500
レーザーテック	12,800	993	12,710,400
スタンレー電気	128,600	2,208	283,948,800
岩崎電気	65,000	232	15,080,000
ウシオ電機	108,300	1,262	136,674,600
岡谷電機	10,100	375	3,787,500
ヘリオステクノH	15,300	346	5,293,800
日本セラミック	10,300	1,505	15,501,500
遠藤照明	7,400	1,999	14,792,600
日本デジタル研究所	13,200	1,479	19,522,800
古河電池	13,000	679	8,827,000
双信電機	9,000	376	3,384,000
山一電機	19,900	518	10,308,200
図 研	11,700	816	9,547,200
日本電子	62,000	449	27,838,000
カ シ オ	185,600	1,094	203,046,400
ファナック	199,100	16,360	3,257,276,000
日本シイエムケイ	42,000	249	10,458,000
エンプラス	6,700	6,470	43,349,000
大真空	25,000	427	10,675,000
ロ ー ム	94,300	5,010	472,443,000
浜松ホトニクス	69,600	4,195	291,972,000
三井ハイテック	23,600	680	16,048,000
新光電気工業	60,000	758	45,480,000
京 セ ラ	318,000	4,452	1,415,736,000
協栄産業	22,000	174	3,828,000
太陽誘電	86,900	1,157	100,543,300
村田製作所	187,200	8,900	1,666,080,000
ユーシン	25,100	677	16,992,700
双葉電子工業	33,100	1,288	42,632,800
日東電工	154,100	4,401	678,194,100
北陸電気工業	72,000	143	10,296,000
東海理化電機	47,200	1,819	85,856,800
ニチコン	56,200	825	46,365,000
日本ケミコン	113,000	332	37,516,000
K O A	22,500	1,078	24,255,000
三井造船	691,000	200	138,200,000
日立造船	132,400	571	75,600,400
佐世保重工業	126,000	137	17,262,000
三菱重工業	3,178,000	638	2,027,564,000
川崎重工業	1,390,000	424	589,360,000
I H I	1,220,000	467	569,740,000
名村造船所	26,200	1,095	28,689,000
サノヤスホールディングス	16,400	204	3,345,600
日本車輛	65,000	497	32,305,000

ニチユ三菱フォークリフト	21,000	683	14,343,000	
近畿車輛	31,000	349	10,819,000	
F P G	11,600	878	10,184,800	
島根銀行	4,100	1,297	5,317,700	
じもとホールディングス	126,200	193	24,356,600	
全国保証	21,000	4,215	88,515,000	
足利ホールディングス	69,200	512	35,430,400	
日産自動車	2,505,100	884	2,214,508,400	
いすゞ自動車	1,035,000	609	630,315,000	
トヨタ自動車	2,484,000	5,900	14,655,600,000	*
日野自動車	223,000	1,456	324,688,000	
三菱自動車工業	559,000	1,116	623,844,000	
エフテック	6,300	1,372	8,643,600	
G M B	1,900	1,306	2,481,400	
武蔵精密工業	19,100	1,966	37,550,600	
日産車体	87,000	1,241	107,967,000	
新明和工業	72,000	839	60,408,000	
極東開発工業	30,800	1,341	41,302,800	
日信工業	36,400	2,021	73,564,400	
トピー工業	147,000	183	26,901,000	
ティラド	70,000	262	18,340,000	
曙ブレーキ	83,200	454	37,772,800	
タチエス	26,400	1,359	35,877,600	
N O K	86,400	1,676	144,806,400	
フタバ産業	54,600	417	22,768,200	
カヤバ工業	152,000	469	71,288,000	
シロキ工業	41,000	222	9,102,000	
市光工業	44,000	139	6,116,000	
大同メタル工業	25,000	1,102	27,550,000	
プレス工業	70,000	409	28,630,000	
カルソニックカンセイ	121,000	483	58,443,000	
太平洋工業	36,600	656	24,009,600	
ケーヒン	41,200	1,578	65,013,600	
河西工業	24,000	771	18,504,000	
アイシン精機	163,300	3,515	573,999,500	
富士機工	21,000	363	7,623,000	
マ ッ ダ	2,660,000	491	1,306,060,000	
ダイハツ	189,400	1,622	307,206,800	
今仙電機製作所	13,300	1,411	18,766,300	
本田技研	1,606,200	3,680	5,910,816,000	
スズキ	373,100	2,623	978,641,300	
富士重工業	607,500	2,701	1,640,857,500	
ヤマハ発動機	271,500	1,319	358,108,500	
ショーワ	42,300	1,331	56,301,300	
小糸製作所	98,000	1,932	189,336,000	
T B K	20,000	558	11,160,000	
エクセディ	21,600	3,085	66,636,000	
ミツバ	32,900	1,738	57,180,200	
豊田合成	57,800	2,266	130,974,800	
愛三工業	22,000	859	18,898,000	

ヨロズ	13,200	2,008	26,505,600
エフ・シー・シー	29,300	1,866	54,673,800
新家工業	42,000	143	6,006,000
シマノ	77,100	8,220	633,762,000
タカタ	32,300	3,050	98,515,000
テイ・エス テック	37,800	3,370	127,386,000
小野建	15,400	1,271	19,573,400
はるやま商事	7,400	732	5,416,800
佐島電機	13,200	592	7,814,400
カッパ・クリエイティブHD	12,950	1,931	25,006,450
エコートレーディング	4,700	692	3,252,400
伯東	10,800	961	10,378,800
コンドーテック	14,700	678	9,966,600
中山福	10,200	821	8,374,200
ライトオン	13,100	689	9,025,900
ナガイレーベン	23,500	1,699	39,926,500
ジーンズメイト	5,900	223	1,315,700
三菱食品	19,400	2,171	42,117,400
良品計画	18,700	9,210	172,227,000
三城ホールディングス	21,700	454	9,851,800
松田産業	13,200	1,303	17,199,600
メディバルHD	176,200	1,466	258,309,200
アドヴァン	9,100	1,081	9,837,100
S P K	4,400	1,804	7,937,600
アズワン	11,500	2,595	29,842,500
スズデン	6,500	533	3,464,500
尾家産業	6,400	796	5,094,400
シモジマ	12,100	925	11,192,500
ドウシシャ	19,100	1,362	26,014,200
コナカ	22,500	799	17,977,500
高速	10,500	873	9,166,500
ハウス ローゼ	2,300	1,377	3,167,100
G - 7ホールディングス	5,300	756	4,006,800
イオン北海道	11,200	663	7,425,600
コジマ	25,800	264	6,811,200
ヒマラヤ	4,200	1,034	4,342,800
コーナン商事	22,900	1,036	23,724,400
黒田電気	25,400	1,558	39,573,200
ネットワンシステムズ	69,000	649	44,781,000
エコス	6,300	643	4,050,900
ワタミ	20,700	1,386	28,690,200
マルシェ	4,800	827	3,969,600
ドンキホーテホールディング	60,700	5,840	354,488,000
丸文	15,700	574	9,011,800
西松屋チェーン	34,700	772	26,788,400
ゼンショーホールディングス	67,000	1,168	78,256,000
ハビネット	10,700	888	9,501,600
幸楽苑	10,900	1,369	14,922,100
トーメンエレクトロニクス	9,100	1,642	14,942,200
ハークスレイ	5,100	765	3,901,500

サイゼリヤ	26,000	1,191	30,966,000
エクセル	8,200	1,179	9,667,800
マルカキカイ	5,700	1,180	6,726,000
アルゴグラフィックス	6,600	1,736	11,457,600
ガリバーインターナショナル	59,700	707	42,207,900
日本エム・ディ・エム	15,000	292	4,380,000
ポブラ	4,900	528	2,587,200
ユナイテッドアローズ	23,100	3,035	70,108,500
進和	10,400	1,167	12,136,800
エスケイジャパン	5,100	287	1,463,700
ダイトエレクトロン	8,400	406	3,410,400
ハイデイ日高	9,300	2,355	21,901,500
シークス	11,200	1,389	15,556,800
京都きもの友禅	11,800	1,047	12,354,600
コロワイド	58,500	1,077	63,004,500
田中商事	6,000	609	3,654,000
オーハシテクニカ	9,500	902	8,569,000
壱番屋	7,100	3,605	25,595,500
マクニカ	9,100	2,949	26,835,900
白銅	5,800	930	5,394,000
トップカルチャー	6,600	451	2,976,600
P L A N T	3,500	930	3,255,000
スギホールディングス	31,600	3,925	124,030,000
島津製作所	230,000	910	209,300,000
J M S	33,000	288	9,504,000
クボテック	4,600	250	1,150,000
ショットモリテックス	4,000	287	1,148,000
長野計器	11,500	635	7,302,500
ブイ・テクノロジー	37	247,600	9,161,200
スター精密	33,900	1,139	38,612,100
東京計器	62,000	281	17,422,000
愛知時計	24,000	289	6,936,000
東京精密	32,100	1,925	61,792,500
マニー	5,400	3,680	19,872,000
ニコン	333,200	1,765	588,098,000
トプコン	48,000	1,429	68,592,000
オリンパス	265,900	3,110	826,949,000
理研計器	15,900	851	13,530,900
大日本スクリーン	169,000	525	88,725,000
キャノン電子	16,400	1,859	30,487,600
タムロン	13,700	2,515	34,455,500
H O Y A	433,900	2,834	1,229,672,600
ノーリツ鋼機	16,200	640	10,368,000
エー・アンド・デイ	16,300	576	9,388,800
キャノン	1,034,600	2,981	3,084,142,600
リ コ ー	537,000	1,192	640,104,000
シチズンホールディングス	219,800	811	178,257,800
リズム時計	81,000	133	10,773,000
大研医器	6,200	1,743	10,806,600
パラマウントベッドHD	17,100	3,035	51,898,500

SHOBI	5,600	400	2,240,000
前田工織	13,100	1,348	17,658,800
永大産業	24,000	596	14,304,000
アートネイチャー	5,700	2,574	14,671,800
ダンロップスポーツ	9,900	1,248	12,355,200
バンダイナムコHLDGS	196,800	2,056	404,620,800
共立印刷	33,000	272	8,976,000
フランスベッドHLDGS	112,000	188	21,056,000
マーベラスAQL	26,800	600	16,080,000
パイロットコーポレーション	15,600	2,880	44,928,000
エイベックス・グループHD	32,500	2,099	68,217,500
トッパン・フォームズ	31,900	862	27,497,800
フジシールインターナショナル	21,700	3,350	72,695,000
タカラトミー	58,600	455	26,663,000
廣済堂	16,700	518	8,650,600
アーク	53,100	267	14,177,700
レック	6,000	1,153	6,918,000
タカノ	8,000	506	4,048,000
プロネクサス	18,300	669	12,242,700
ホクシン	13,500	142	1,917,000
ウッドワン	30,000	300	9,000,000
大建工業	73,000	252	18,396,000
きもと	13,700	730	10,001,000
凸版印刷	504,000	732	368,928,000
大日本印刷	543,000	975	529,425,000
図書印刷	29,000	376	10,904,000
共同印刷	55,000	273	15,015,000
日本写真印刷	30,000	1,460	43,800,000
光村印刷	3,000	262	786,000
藤森工業	16,000	2,301	36,816,000
宝印刷	10,300	721	7,426,300
前澤化成工業	13,300	1,018	13,539,400
アシックス	177,300	1,813	321,444,900
ツツミ	8,900	2,300	20,470,000
ジェイエスピー	12,200	1,482	18,080,400
ニチハ	22,800	1,342	30,597,600
ローランド	17,200	1,368	23,529,600
エフピコ	9,200	6,030	55,476,000
小松ウオール工業	6,100	2,015	12,291,500
ヤマハ	131,200	1,319	173,052,800
河合楽器	62,000	175	10,850,000
クリナップ	18,400	876	16,118,400
ビジョン	29,200	4,335	126,582,000
天馬	14,900	1,376	20,502,400
兼松日産農林	28,000	154	4,312,000
キングジム	15,000	647	9,705,000
リンテック	42,400	1,859	78,821,600
TASAKI	3,800	534	2,029,200
信越ポリマー	37,000	365	13,505,000
東リ	49,000	199	9,751,000

イトーキ	37,600	578	21,732,800
任天堂	109,900	11,490	1,262,751,000
三菱鉛筆	14,700	2,273	33,413,100
松風	9,000	846	7,614,000
タカラスタンダード	74,000	687	50,838,000
コクヨ	92,700	717	66,465,900
ナカバヤシ	38,000	198	7,524,000
ニフコ	41,700	2,813	117,302,100
グローブライド	94,000	138	12,972,000
岡村製作所	69,000	812	56,028,000
日本バルカー	78,000	273	21,294,000
MUTOHホールディングス	24,000	461	11,064,000
伊藤忠	1,405,500	1,265	1,777,957,500
丸紅	1,541,000	711	1,095,651,000
スクロール	22,900	304	6,961,600
高島	33,000	235	7,755,000
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,586	21,411,000
三陽商会	100,000	261	26,100,000
長瀬産業	99,700	1,167	116,349,900
ナイガイ	70,000	86	6,020,000
蝶理	11,400	1,130	12,882,000
豊田通商	196,300	2,354	462,090,200
オンワードホールディングス	125,000	714	89,250,000
三共生興	30,900	359	11,093,100
兼松	376,000	177	66,552,000
美津濃	88,000	568	49,984,000
ツカモトコーポレーション	32,000	147	4,704,000
ファミリーマート	59,500	4,470	265,965,000
ルック	34,000	268	9,112,000
三井物産	1,621,900	1,489	2,415,009,100
日本紙パルプ	91,000	312	28,392,000
東京エレクトロン	160,200	5,343	855,948,600
日立ハイテクノロジーズ	53,400	2,284	121,965,600
カメイ	22,900	748	17,129,200
東都水産	32,000	205	6,560,000
OUGホールディングス	28,000	192	5,376,000
スターゼン	65,000	262	17,030,000
セイコーHD	115,000	502	57,730,000
山善	68,100	592	40,315,200
椿本興業	20,000	292	5,840,000
住友商事	1,039,700	1,283	1,333,935,100
日本ユニシス	42,600	1,057	45,028,200
内田洋行	41,000	273	11,193,000
三菱商事	1,374,500	1,955	2,687,147,500
第一実業	41,000	439	17,999,000
キャノンマーケティングJPN	50,200	1,307	65,611,400
西華産業	61,000	235	14,335,000
佐藤商事	15,800	707	11,170,600
菱洋エレクトロ	20,900	1,051	21,965,900
東京産業	17,700	382	6,761,400

ユアサ商事	182,000	210	38,220,000
神鋼商事	46,000	210	9,660,000
小林産業	11,900	284	3,379,600
阪和興業	176,000	497	87,472,000
カナデン	2,000	653	1,306,000
菱電商事	26,000	714	18,564,000
ニプロ	95,100	880	83,688,000
フルサト工業	9,700	1,140	11,058,000
岩谷産業	196,000	606	118,776,000
すてきナイスグループ	75,000	216	16,200,000
昭光通商	60,000	147	8,820,000
ニチモウ	29,000	186	5,394,000
極東貿易	22,000	208	4,576,000
イワキ	28,000	197	5,516,000
兼松エレクトロニクス	11,200	1,323	14,817,600
三愛石油	41,000	468	19,188,000
稲畑産業	43,600	1,050	45,780,000
G S Iクレオス	48,000	151	7,248,000
明和産業	16,900	339	5,729,100
ゴールドウイン	43,000	454	19,522,000
ユニ・チャーム	114,700	5,644	647,366,800
デサント	43,000	634	27,262,000
キング	10,000	425	4,250,000
ワキタ	26,000	1,076	27,976,000
ヤマトインターナショナル	12,400	430	5,332,000
東邦ホールディングス	56,400	1,883	106,201,200
サンゲツ	31,200	2,419	75,472,800
ミツウロコグループ	28,400	550	15,620,000
シナネン	38,000	401	15,238,000
伊藤忠エネクス	39,000	567	22,113,000
サンリオ	44,400	3,970	176,268,000
サンワテクノス	8,800	878	7,726,400
リョーサン	26,200	2,044	53,552,800
新光商事	19,400	841	16,315,400
トーホー	38,000	353	13,414,000
三信電気	22,000	691	15,202,000
東陽テクニカ	24,200	1,005	24,321,000
モスフードサービス	23,100	2,094	48,371,400
加賀電子	16,000	1,226	19,616,000
三益半導体	15,900	860	13,674,000
ソーダニツカ	2,000	429	858,000
立花エレテック	10,700	1,297	13,877,900
木曽路	21,600	1,869	40,370,400
サトレストランシステムズ	16,600	737	12,234,200
千趣会	31,900	772	24,626,800
タカキュー	14,000	284	3,976,000
ケーヨー	29,600	466	13,793,600
アデランス	22,300	1,035	23,080,500
上新電機	38,000	755	28,690,000
日本瓦斯	26,300	1,059	27,851,700

ベスト電器	56,600	141	7,980,600
マルエツ	36,000	356	12,816,000
ロイヤルホールディングス	29,500	1,426	42,067,000
東天紅	13,000	192	2,496,000
いなげや	19,600	967	18,953,200
島忠	39,900	2,150	85,785,000
チヨダ	20,700	2,030	42,021,000
ライフコーポレーション	13,300	1,396	18,566,800
カスミ	36,200	668	24,181,600
リンガーハット	17,200	1,500	25,800,000
さが美	15,000	100	1,500,000
MR MAX	17,400	327	5,689,800
テンアライド	13,800	309	4,264,200
AOKIホールディングス	30,400	1,615	49,096,000
オークワ	27,000	827	22,329,000
コメリ	27,100	2,436	66,015,600
青山商事	44,200	2,549	112,665,800
しまむら	20,400	8,500	173,400,000
CFSコーポレーション	11,800	428	5,050,400
はせがわ	6,300	726	4,573,800
高島屋	238,000	933	222,054,000
松屋	35,400	941	33,311,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	103,000	706	72,718,000
近鉄百貨店	68,000	334	22,712,000
丸栄	29,000	184	5,336,000
ニッセンHD	35,200	406	14,291,200
パルコ	16,900	910	15,379,000
丸井グループ	229,600	893	205,032,800
クレディセゾン	143,900	2,500	359,750,000
アクシアルリテイリング	9,700	1,523	14,773,100
井筒屋	97,000	78	7,566,000
ダイエー	109,000	301	32,809,000
イズミヤ	66,000	446	29,436,000
イオン	703,400	1,244	875,029,600
ユニグループ・HD	168,500	616	103,796,000
イズミ	39,300	3,005	118,096,500
東武ストア	24,000	255	6,120,000
平和堂	35,700	1,386	49,480,200
フジ	19,500	1,680	32,760,000
ヤオコー	8,900	4,340	38,626,000
ゼビオ	21,200	2,003	42,463,600
ケースホールディングス	37,200	2,827	105,164,400
Paltac	24,600	1,324	32,570,400
OLYMPICグループ	10,400	777	8,080,800
日産東京販売HD	26,000	407	10,582,000
新生銀行	1,525,000	206	314,150,000
あおぞら銀行	916,000	292	267,472,000
三菱UFJフィナンシャルG	13,343,300	602	8,032,666,600
りそなホールディングス	1,674,400	555	929,292,000
三井住友トラストHD	3,461,000	485	1,678,585,000

三井住友フィナンシャルG	1,332,100	4,764	6,346,124,400
第四銀行	224,000	349	78,176,000
北越銀行	192,000	197	37,824,000
西日本シティ銀行	618,000	247	152,646,000
千葉銀行	679,000	621	421,659,000
横浜銀行	1,162,000	505	586,810,000
常陽銀行	656,000	474	310,944,000
群馬銀行	395,000	527	208,165,000
武蔵野銀行	28,100	3,090	86,829,000
千葉興業銀行	36,500	690	25,185,000
筑波銀行	73,300	353	25,874,900
東京都民銀行	31,100	976	30,353,600
七十七銀行	276,000	462	127,512,000
青森銀行	129,000	267	34,443,000
秋田銀行	121,000	260	31,460,000
山形銀行	107,000	384	41,088,000
岩手銀行	11,500	4,565	52,497,500
東邦銀行	157,000	300	47,100,000
東北銀行	92,000	144	13,248,000
みちのく銀行	95,000	201	19,095,000
ふくおかフィナンシャルG	715,000	412	294,580,000
静岡銀行	516,000	980	505,680,000
十六銀行	221,000	333	73,593,000
スルガ銀行	172,000	1,688	290,336,000
八十二銀行	325,000	547	177,775,000
山梨中央銀行	112,000	405	45,360,000
大垣共立銀行	220,000	277	60,940,000
福井銀行	151,000	222	33,522,000
北國銀行	198,000	325	64,350,000
清水銀行	6,000	2,433	14,598,000
滋賀銀行	165,000	486	80,190,000
南都銀行	172,000	348	59,856,000
百五銀行	158,000	397	62,726,000
京都銀行	336,000	779	261,744,000
紀陽銀行	69,100	1,299	89,760,900
三重銀行	73,000	213	15,549,000
ほくほくフィナンシャルG	1,199,000	194	232,606,000
広島銀行	519,000	393	203,967,000
山陰合同銀行	109,000	687	74,883,000
中国銀行	130,900	1,249	163,494,100
鳥取銀行	57,000	180	10,260,000
伊予銀行	188,400	937	176,530,800
百十四銀行	193,000	321	61,953,000
四国銀行	126,000	215	27,090,000
阿波銀行	144,000	483	69,552,000
鹿児島銀行	122,000	587	71,614,000
大分銀行	111,000	387	42,957,000
宮崎銀行	118,000	274	32,332,000
肥後銀行	144,000	509	73,296,000
佐賀銀行	107,000	209	22,363,000

十八銀行	109,000	211	22,999,000
沖縄銀行	13,100	3,715	48,666,500
琉球銀行	34,200	1,217	41,621,400
八千代銀行	8,400	2,607	21,898,800
セブン銀行	660,100	377	248,857,700
みずほフィナンシャルG	22,803,700	214	4,879,991,800
高知銀行	69,000	149	10,281,000
山口フィナンシャルG	176,000	888	156,288,000
アクリーティブ	12,400	199	2,467,600
芙蓉総合リース	18,500	3,365	62,252,500
興銀リース	30,700	2,560	78,592,000
東京センチュリーリース	41,400	2,845	117,783,000
S B Iホールディングス	211,600	1,342	283,967,200
日本証券金融	77,400	675	52,245,000
アイフル	320,600	344	110,286,400
日本アジア投資	120,000	110	13,200,000
ポケットカード	17,700	666	11,788,200
長野銀行	59,000	179	10,561,000
名古屋銀行	159,000	315	50,085,000
北洋銀行	265,400	384	101,913,600
愛知銀行	6,400	4,620	29,568,000
第三銀行	100,000	169	16,900,000
中京銀行	73,000	171	12,483,000
東日本銀行	77,000	254	19,558,000
大光銀行	63,000	202	12,726,000
愛媛銀行	103,000	211	21,733,000
トマト銀行	69,000	164	11,316,000
みなと銀行	160,000	166	26,560,000
京葉銀行	145,000	433	62,785,000
関西アーバン銀行	245,000	117	28,665,000
栃木銀行	89,000	366	32,574,000
北日本銀行	5,500	2,425	13,337,500
東和銀行	209,000	95	19,855,000
福島銀行	219,000	89	19,491,000
大東銀行	114,000	107	12,198,000
リコーリース	12,100	2,638	31,919,800
イオンフィナンシャルサービス	102,100	2,462	251,370,200
アコム	353,700	309	109,293,300
ジャックス	107,000	442	47,294,000
オリコ	393,300	214	84,166,200
日立キャピタル	34,600	2,697	93,316,200
アプラスフィナンシャル	63,100	124	7,824,400
オリックス	1,088,500	1,522	1,656,697,000
三菱UFJリース	446,800	556	248,420,800
ジャフコ	24,100	5,250	126,525,000
トモニホールディングス	135,000	408	55,080,000
大和証券G本社	1,745,000	944	1,647,280,000
野村ホールディングス	3,600,900	693	2,495,423,700
岡三証券グループ	138,000	908	125,304,000
丸三証券	52,300	887	46,390,100

東洋証券	71,000	368	26,128,000
東海東京HD	186,600	881	164,394,600
光世証券	42,000	253	10,626,000
水戸証券	52,000	443	23,036,000
いちよし証券	34,500	1,534	52,923,000
松井証券	89,500	1,121	100,329,500
NKS Jホールディングス	391,300	2,634	1,030,684,200
だいこう証券ビジ	8,600	755	6,493,000
日本取引所グループ	258,700	2,490	644,163,000
マネックスG	191,400	417	79,813,800
カブドットコム証券	68,200	543	37,032,600
極東証券	21,900	1,848	40,471,200
岩井コスモホールディング	16,700	1,284	21,442,800
フィデアホール	101,200	194	19,632,800
池田泉州HD	131,800	457	60,232,600
MS & AD	526,400	2,420	1,273,888,000
SONY FH	168,700	1,673	282,235,100
マネーパートナーズGP	13,600	244	3,318,400
小林洋行	5,200	268	1,393,600
第一生命	886,600	1,533	1,359,157,800
東京海上HD	682,300	2,997	2,044,853,100
イー・ギャランティ	5,100	2,137	10,898,700
アサックス	3,100	1,338	4,147,800
NECキャピタルソリューション	6,000	2,424	14,544,000
T & Dホールディングス	604,200	1,261	761,896,200
三井不動産	830,000	3,230	2,680,900,000
三菱地所	1,233,000	2,570	3,168,810,000
平和不動産	35,600	1,558	55,464,800
東京建物	360,000	917	330,120,000
ダイビル	51,800	1,098	56,876,400
京阪神ビルディング	29,300	520	15,236,000
住友不動産	422,000	4,459	1,881,698,000
太平洋興発	66,000	107	7,062,000
大京	296,000	234	69,264,000
テーオーシー	60,700	707	42,914,900
東京楽天地	27,000	459	12,393,000
レオパレス21	202,500	520	105,300,000
フジ住宅	22,600	688	15,548,800
空港施設	21,500	767	16,490,500
明和地所	8,700	473	4,115,100
住友不動産販売	12,700	2,981	37,858,700
ゴールドクレスト	13,900	2,219	30,844,100
リロ・ホールディング	7,000	4,895	34,265,000
日本エスリード	6,900	1,102	7,603,800
日神不動産	23,600	376	8,873,600
タカラレーベン	58,700	315	18,490,500
サンヨーハウジ 名古屋	9,200	1,042	9,586,400
イオンモール	113,600	2,881	327,281,600
ファースト住建	5,000	1,333	6,665,000
ランド	40,500	14	567,000

トーセイ	24,200	714	17,278,800
穴吹興産	12,000	297	3,564,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	109,400	964	105,461,600
サンフロンティア不動産	16,600	1,456	24,169,600
エフ・ジェー・ネクスト	7,300	513	3,744,900
ランドビジネス	11,900	400	4,760,000
グランディハウス	10,600	340	3,604,000
東武鉄道	1,013,000	469	475,097,000
相鉄ホールディングス	305,000	364	111,020,000
東京急行	1,050,000	625	656,250,000
京浜急行	458,000	835	382,430,000
小田急電鉄	572,000	891	509,652,000
京王電鉄	499,000	667	332,833,000
京成電鉄	268,000	893	239,324,000
富士急行	49,000	885	43,365,000
新京成電鉄	24,000	366	8,784,000
東日本旅客鉄道	328,300	7,583	2,489,498,900
西日本旅客鉄道	161,100	4,137	666,470,700
東海旅客鉄道	159,800	10,905	1,742,619,000
鴻池運輸	9,500	1,426	13,547,000
西日本鉄道	231,000	399	92,169,000
ハマキョウレックス	5,100	2,968	15,136,800
サカイ引越センター	2,900	3,355	9,729,500
近畿日本鉄道	1,795,000	348	624,660,000
阪急阪神HLDGS	1,197,000	517	618,849,000
南海電鉄	372,000	363	135,036,000
京阪電鉄	376,000	387	145,512,000
神戸電鉄	44,000	319	14,036,000
名糖運輸	7,600	657	4,993,200
名古屋鉄道	623,000	305	190,015,000
山陽電鉄	66,000	397	26,202,000
トランコム	5,200	3,530	18,356,000
日本通運	706,000	467	329,702,000
ヤマトホールディングス	332,300	2,114	702,482,200
山九	217,000	404	87,668,000
日新	68,000	279	18,972,000
丸運	11,200	231	2,587,200
丸全昭和運輸	60,000	317	19,020,000
センコー	72,000	503	36,216,000
トナミホールディングス	37,000	196	7,252,000
日本梱包運輸	54,500	1,737	94,666,500
日石輸送	21,000	224	4,704,000
福山通運	108,000	555	59,940,000
セイノーホールディングス	127,000	939	119,253,000
神奈川中央交通	22,000	503	11,066,000
日立物流	37,100	1,516	56,243,600
日本郵船	1,508,000	322	485,576,000
商船三井	1,003,000	407	408,221,000
川崎汽船	781,000	234	182,754,000
NSユナイテッド海運	77,000	257	19,789,000

乾 汽 船	21,700	336	7,291,200
明治海運	16,100	412	6,633,200
飯野海運	74,000	538	39,812,000
共栄タンカー	15,000	213	3,195,000
第一中央汽船	132,000	95	12,540,000
日本航空	150,800	4,965	748,722,000
ANAホールディングス	3,508,000	216	757,728,000
スカイマーク	38,200	347	13,255,400
パスコ	17,000	497	8,449,000
三菱倉庫	117,000	1,420	166,140,000
三井倉庫	90,000	426	38,340,000
住友倉庫	119,000	505	60,095,000
渋沢倉庫	42,000	348	14,616,000
ヤマタネ	89,000	165	14,685,000
東陽倉庫	31,000	235	7,285,000
日本トランスシティ	37,000	314	11,618,000
ケイヒン	33,000	154	5,082,000
中央倉庫	10,500	826	8,673,000
安田倉庫	14,000	990	13,860,000
東洋埠頭	52,000	212	11,024,000
宇徳	14,600	364	5,314,400
上 組	213,000	894	190,422,000
サンリツ	1,700	557	946,900
キムラユニティー	4,200	938	3,939,600
キューソー流通システム	5,800	1,008	5,846,400
郵船ロジスティクス	16,400	1,239	20,319,600
近鉄エクスプレス	16,000	4,135	66,160,000
東海運	9,900	255	2,524,500
エーアイティー	6,600	746	4,923,600
東京放送HD	94,900	1,106	104,959,400
日本テレビHLDS	175,400	1,660	291,164,000
テレビ朝日	44,600	1,977	88,174,200
スカパーJ S A T H D	133,700	517	69,122,900
テレビ東京HD	14,400	1,552	22,348,800
コネクシオ	15,700	821	12,889,700
日本電信電話	692,100	5,494	3,802,397,400
K D D I	546,800	5,681	3,106,370,800
光通信	16,400	8,150	133,660,000
N T T ドコモ	1,451,300	1,606	2,330,787,800
G M O インターネット	58,800	1,105	64,974,000
学研ホールディングス	59,000	288	16,992,000
ゼンリン	23,300	995	23,183,500
昭文社	10,700	672	7,190,400
K A D O K A W A	17,000	3,395	57,715,000
インプレスホールディングス	13,000	147	1,911,000
東京電力	1,514,000	489	740,346,000
中部電力	588,000	1,193	701,484,000
関西電力	728,300	1,096	798,216,800
中国電力	246,700	1,361	335,758,700
北陸電力	174,800	1,268	221,646,400

東北電力	445,900	1,110	494,949,000
四国電力	160,700	1,463	235,104,100
九州電力	394,100	1,236	487,107,600
北海道電力	167,000	968	161,656,000
沖縄電力	11,700	3,265	38,200,500
電源開発	110,800	2,970	329,076,000
東京瓦斯	2,093,000	481	1,006,733,000
大阪瓦斯	1,847,000	395	729,565,000
東邦瓦斯	454,000	480	217,920,000
北海道瓦斯	36,000	276	9,936,000
西部瓦斯	201,000	230	46,230,000
静岡瓦斯	46,600	563	26,235,800
アイネット	7,600	778	5,912,800
松竹	116,000	912	105,792,000
東宝	125,700	2,039	256,302,300
エイチ・アイ・エス	15,200	5,380	81,776,000
東映	74,000	608	44,992,000
AOI Pro.	7,500	645	4,837,500
NTTデータ	124,300	3,905	485,391,500
共立メンテナンス	9,300	3,605	33,526,500
イチネンホールディングス	19,600	750	14,700,000
建設技術研究所	11,100	1,041	11,555,100
スペース	9,200	836	7,691,200
インファーマシーズ	9,700	4,720	45,784,000
燦ホールディングス	3,900	1,361	5,307,900
スバル興業	3,000	341	1,023,000
東京テアトル	72,000	149	10,728,000
よみうりランド	37,000	587	21,719,000
東京都競馬	144,000	331	47,664,000
常磐興産	60,000	148	8,880,000
カナモト	24,000	2,595	62,280,000
東京ドーム	138,000	604	83,352,000
D T S	16,800	1,867	31,365,600
スクウェア・エニックス・HD	64,100	2,397	153,647,700
シーイーシー	10,700	654	6,997,800
カプコン	45,000	1,911	85,995,000
西尾レントオール	10,100	2,699	27,259,900
アゴーラ・ホスピタリティーG	78,000	48	3,744,000
日本空港ビルデング	60,900	2,131	129,777,900
トランス・コスモス	24,400	2,188	53,387,200
乃村工藝社	36,700	799	29,323,300
ジャステック	11,500	758	8,717,000
S C S K	41,900	2,875	120,462,500
藤田観光	48,000	335	16,080,000
K N T - C Tホールディングス	60,000	205	12,300,000
日本管財	8,000	1,936	15,488,000
トーカイ	8,300	2,836	23,538,800
白洋舎	5,000	222	1,110,000
セコム	193,900	5,489	1,064,317,100
日本システムウエア	6,800	458	3,114,400

セントラル警備保障	8,500	975	8,287,500
アイネス	24,000	731	17,544,000
丹青社	23,400	493	11,536,200
メイテック	25,600	2,532	64,819,200
T K C	14,800	1,819	26,921,200
アサツー ディ・ケイ	32,700	2,258	73,836,600
富士ソフト	22,400	2,378	53,267,200
応用地質	17,800	1,458	25,952,400
船井総合研究所	19,500	792	15,444,000
N S D	37,500	1,314	49,275,000
進学会	8,100	406	3,288,600
丸紅建材リース	16,000	206	3,296,000
コナミ	79,500	2,336	185,712,000
ベネッセホールディングス	62,400	3,840	239,616,000
イオンディライト	18,000	2,058	37,044,000
ナック	9,400	1,668	15,679,200
福井コンピュータH L D S	2,600	910	2,366,000
ニチイ学館	40,500	849	34,384,500
ダイセキ	27,600	1,771	48,879,600
ステップ	5,800	773	4,483,400
日鉄住金物産	116,000	399	46,284,000
元気寿司	5,500	1,537	8,453,500
トラスコ中山	20,200	2,313	46,722,600
ヤマダ電機	696,100	358	249,203,800
オートバックスセブン	61,800	1,558	96,284,400
アークランドサカモト	11,500	1,663	19,124,500
ニトリホールディングス	34,850	9,280	323,408,000
グルメ杵屋	13,000	736	9,568,000
愛眼	14,400	265	3,816,000
ケーユーホールディングス	3,700	1,316	4,869,200
吉野家ホールディングス	47,700	1,495	71,311,500
加藤産業	25,500	1,744	44,472,000
イノテック	16,400	465	7,626,000
イエローハット	15,200	1,910	29,032,000
富士エレクトロニクス	9,200	1,349	12,410,800
松屋フーズ	8,500	1,835	15,597,500
J B C Cホールディングス	14,800	780	11,544,000
J Kホールディングス	15,300	568	8,690,400
サガミチェーン	22,000	921	20,262,000
日伝	7,900	2,219	17,530,100
関西スーパーマーケット	13,300	801	10,653,300
ミロク情報サービス	12,000	391	4,692,000
北沢産業	11,000	188	2,068,000
杉本商事	9,500	993	9,433,500
因幡電機産業	24,100	3,180	76,638,000
王将フードサービス	8,700	3,265	28,405,500
プレナス	19,700	2,322	45,743,400
ミニストップ	13,100	1,595	20,894,500
アークス	30,000	1,910	57,300,000
パロ-	37,900	1,370	51,923,000

バイテック	6,200	795	4,929,000	
ミスミグループ本社	70,500	2,874	202,617,000	
江守商事	5,700	2,016	11,491,200	
アルテック	8,900	216	1,922,400	
ベルク	8,800	1,786	15,716,800	
大庄	8,300	1,259	10,449,700	
タキヒヨー	29,000	403	11,687,000	
ファーストリテイリング	41,100	36,260	1,490,286,000	
ソフトバンク	865,000	7,375	6,379,375,000	
スズケン	72,900	3,565	259,888,500	
サンドラッグ	37,200	4,175	155,310,000	
東京デリカ	8,900	1,385	12,326,500	
ジェコス	12,300	910	11,193,000	
ヤマザワ	4,200	1,524	6,400,800	
やまや	3,600	2,264	8,150,400	
ペルーナ	44,000	502	22,088,000	
合計	287,157,008		301,374,444,140	

*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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年2月28日現在

資産総額	63,994,423,448円
負債総額	233,930,738円
純資産総額（ - ）	63,760,492,710円
発行済数量	36,920,283,382口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7270円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年2月28日現在

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

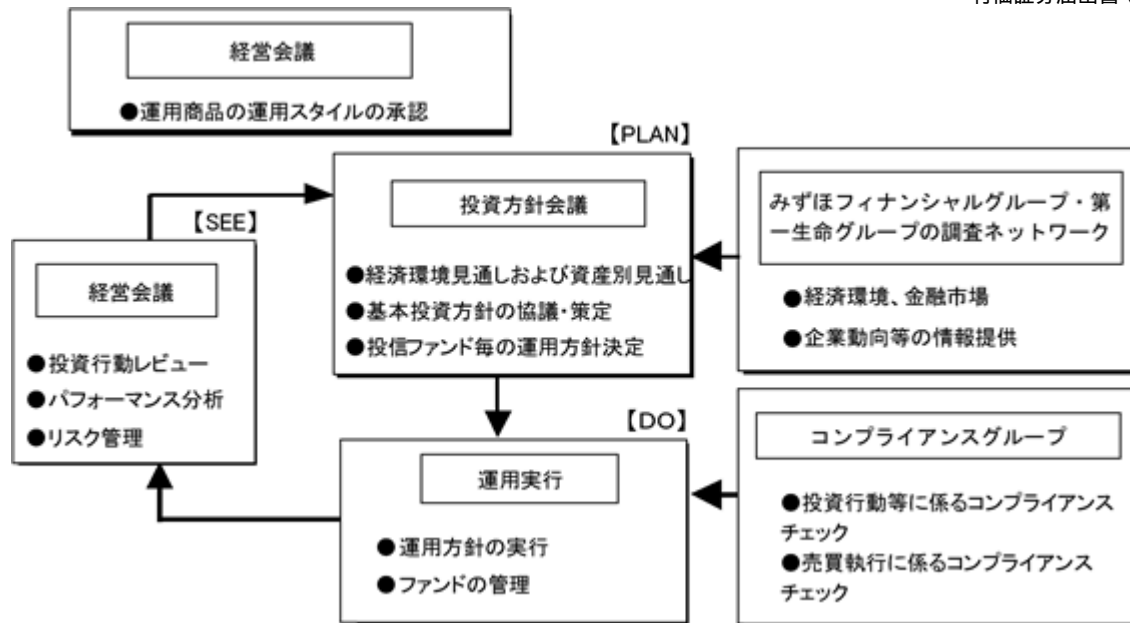
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は315本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	8	21,903,771,605
追加型株式投資信託	297	4,966,954,572,956
単位型公社債投資信託	9	89,877,531,429
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	102,533,373
合計	315	5,078,838,409,363

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	132,805	571,153
未払金	1,460,128	1,547,527
未払収益分配金	670	48
未払償還金	86,391	84,932
未払手数料	1,088,348	1,195,452
その他未払金	284,718	267,093
未払費用	2 1,105,512	2 1,306,837
未払法人税等	1,195,056	1,299,068
未払消費税等	92,354	116,872
賞与引当金	574,646	724,974
その他	-	100,000
流動負債計	4,560,503	5,666,434
固定負債		
退職給付引当金	680,768	802,603
役員退職慰労引当金	56,690	98,510
固定負債計	737,458	901,113
負債合計	5,297,962	6,567,548
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	19,716,594	20,898,697
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,463,300	3,945,403
株主資本計	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	136,143	103,768
評価・換算差額等計	136,143	103,768
純資産合計	24,281,215	25,430,943
負債・純資産合計	29,579,177	31,998,491

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

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

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

（単位：千円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期	第28期
	(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	13,430,000	15,630,000
当期変動額	2,200,000	700,000
当期末残高	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
当期首残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	4,459,380	3,463,300
当期変動額		
剰余金の配当	2,208,000	2,712,000
別途積立金の積立	2,200,000	700,000
当期純利益	3,411,920	3,894,102
当期末残高	3,463,300	3,945,403
利益剰余金合計		
当期首残高	18,512,674	19,716,594
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	19,716,594	20,898,697
株主資本合計		
当期首残高	22,941,152	24,145,072
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	24,145,072	25,327,175

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

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

（3）当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第27期(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(リース取引関係)

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

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

未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

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

減価償却費相当額の算定方法

該当事項はありません。

利息相当額の算定方法

該当事項はありません。

2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第27期（平成24年3月31日現在）

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

第28期（平成25年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期(平成24年3月31日現在)

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

第28期(平成25年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

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

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

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第27期（平成24年3月31日現在）

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

第28期（平成25年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

(千円)

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

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

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

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	915,630
未払金	1,777,659
未払収益分配金	48
未払償還金	51,109
未払手数料	1,403,573
その他未払金	322,928
未払費用	1,320,067
未払法人税等	1,362,916
未払消費税等	149,912
賞与引当金	592,328
	流動負債計
	6,118,515
固定負債	
退職給付引当金	870,468
役員退職慰労引当金	121,100
	固定負債計
	991,568
負債合計	7,110,084
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	20,051,026
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	19,927,733
別途積立金	17,130,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,297,733
	株主資本計
	24,479,504
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	109,475
	評価・換算差額等計
	109,475
純資産合計	24,588,979
負債・純資産合計	31,699,064

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

重要な会計方針

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

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

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

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式

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

3．その他有価証券

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

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

（金銭の信託関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

1．満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2．その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a . 名称

みずほ信託銀行株式会社

b . 資本金の額

平成25年3月末日現在 247,369百万円

c . 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 [*] (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	(1) 1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	210,200	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

* 平成25年3月末日現在

(1) 平成25年7月1日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

第一生命保険株式会社は、委託会社の株式を12,000株（持株比率50.00%）所有しています。

この他に、委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成25年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年3月19日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成25年2月8日から平成26年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成26年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

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