

【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27年5月8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 西 恵正
【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<DC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27年5月9日から平成28年5月6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。

(1 0) 【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）

(1 1) 【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

(1 2) 【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。

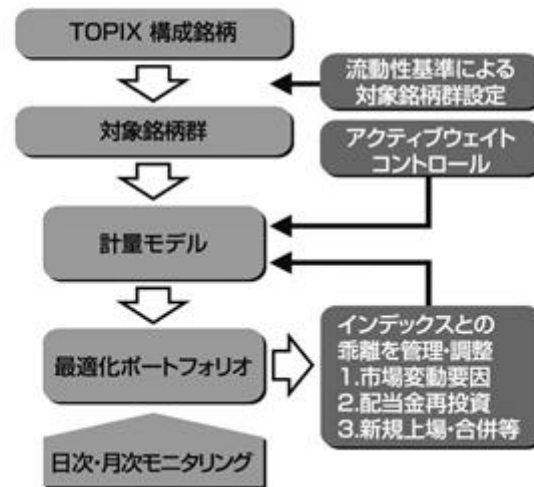
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

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	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		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

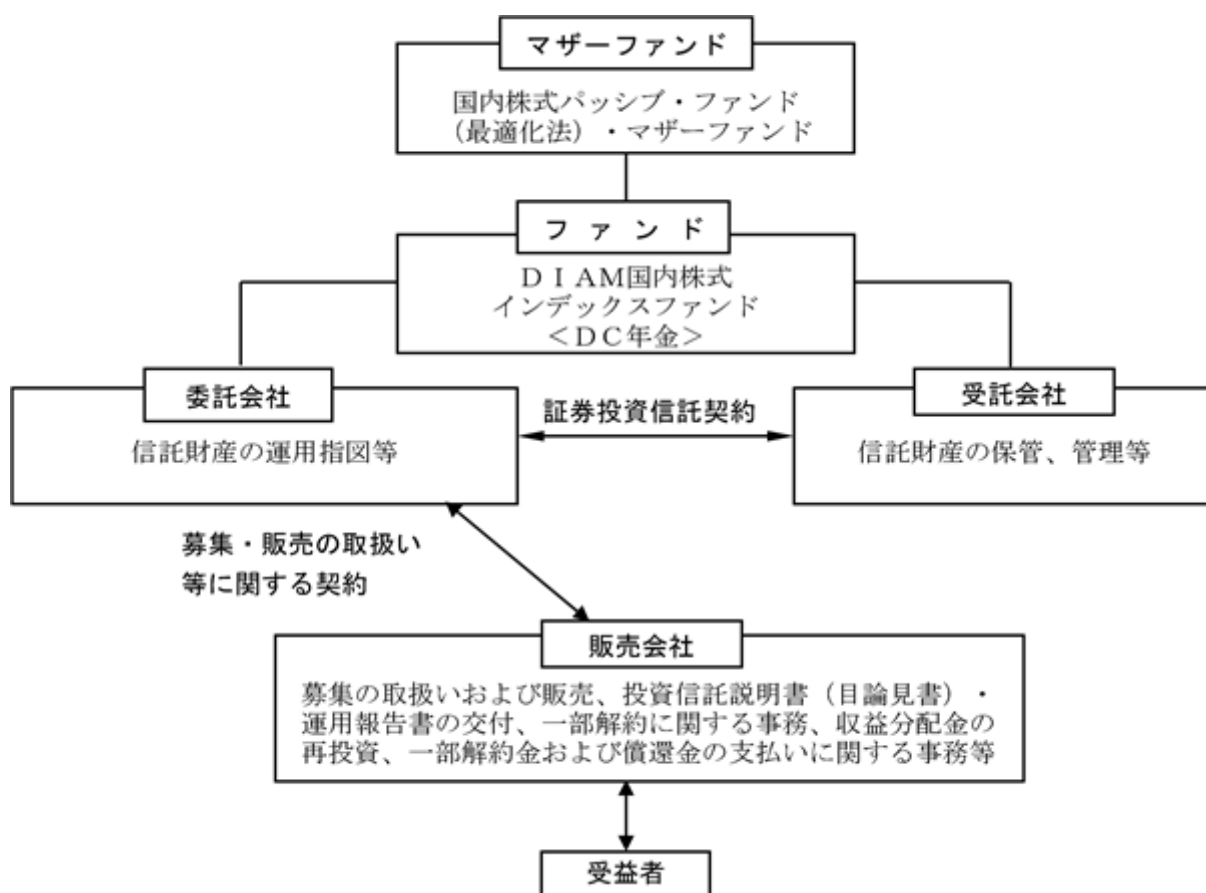
「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

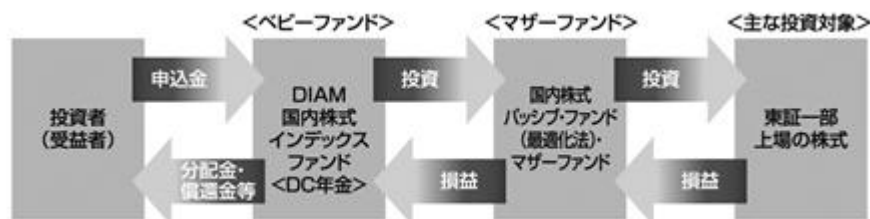
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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27年2月27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27年2月27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。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色> をご参照ください。

(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す。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を主として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す。）

- 14) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
 - 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す。)
 - 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

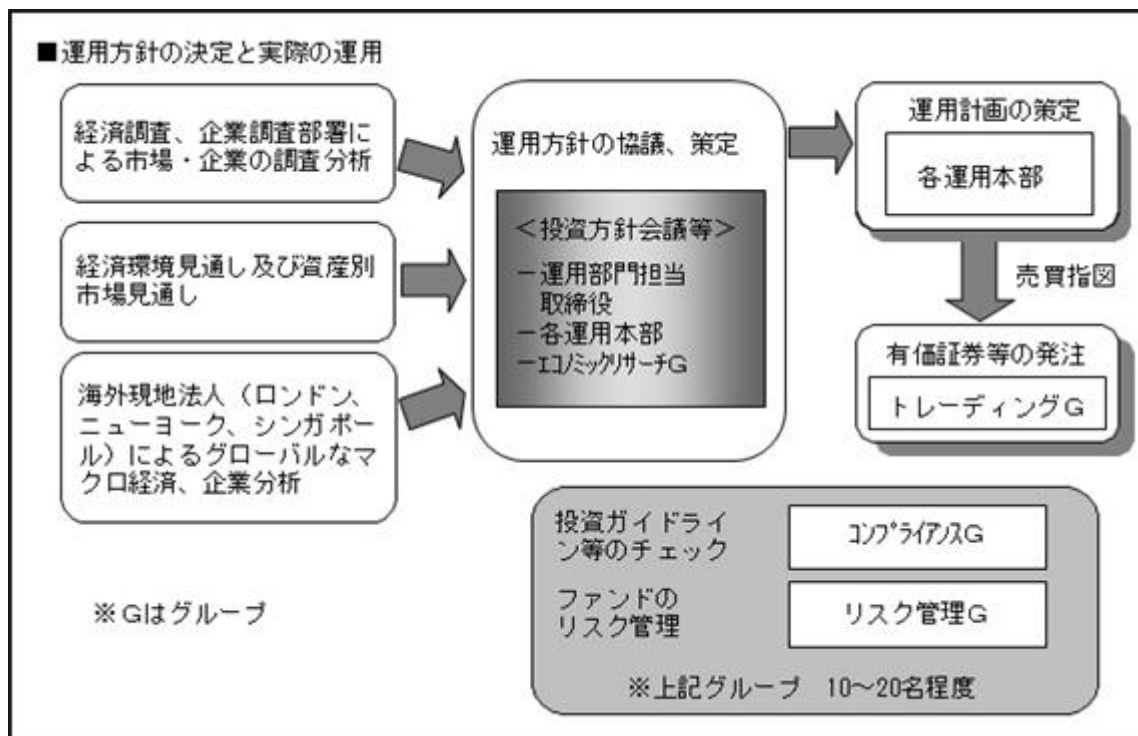
4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

（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】



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から得られた情報も参考にされます。

国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。それ以外の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。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年4月13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、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に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てします。）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てします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、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ます。

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

口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号八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) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第21条の2)

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

9) 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。

10) 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。

11) 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。

12) 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。

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

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

3 【投資リスク】

(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、資金出入り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。

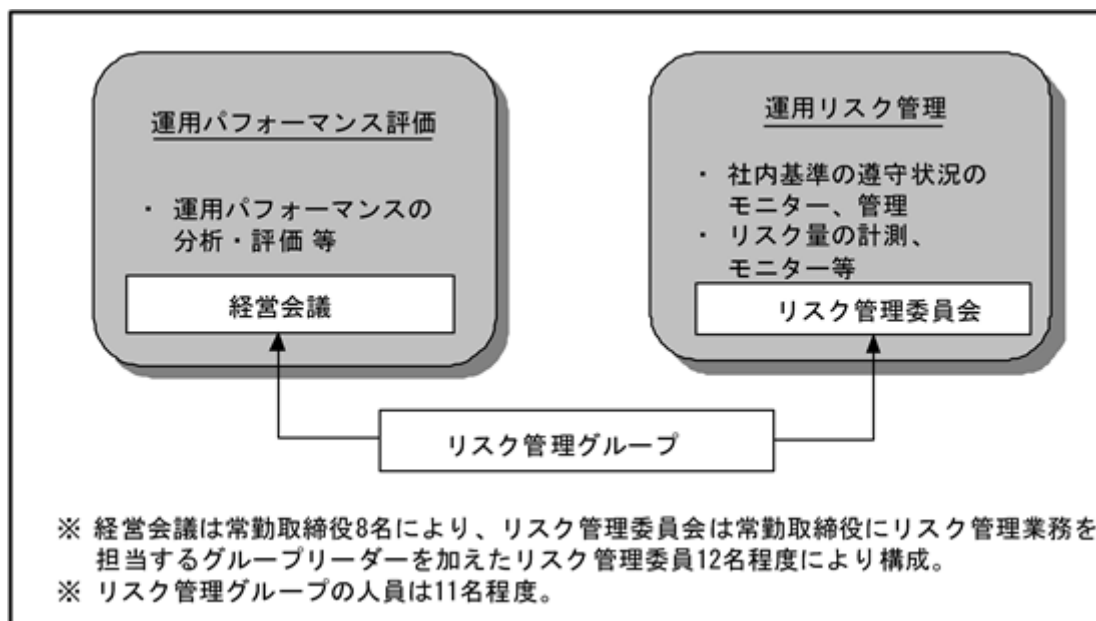
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、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ます、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< 運用評価・運用リスク管理体制 >

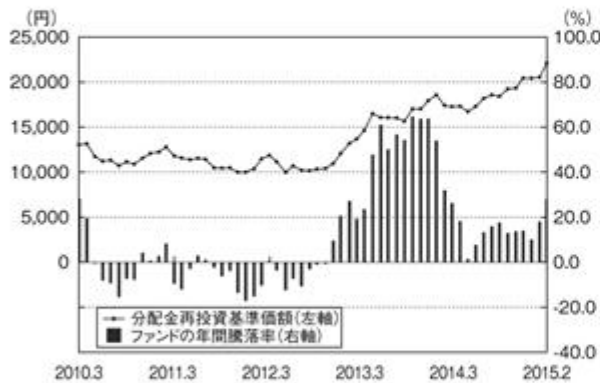
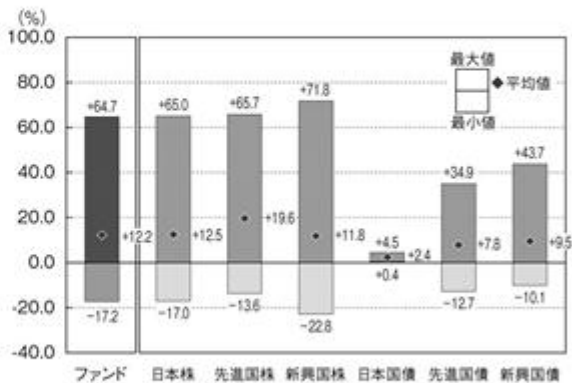


運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

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27年2月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

2010年3月～2015年2月

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

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

* 各資産クラスの指数

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

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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なく、株東京証券取引所は、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、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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）		主な役務
委託会社	年率0.08%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.11%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎年8月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

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等がファンドから支払われます。

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。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎年8月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、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に関する費用は、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27年2月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等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27年2月27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	77,418,651,420	100.01
内 日本	77,418,651,420	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,010,232	0.01
純資産総額	77,409,641,188	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27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	327,265,422,840	97.22
内 日本	327,265,422,840	97.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,359,214,639	2.78
純資産総額	336,624,637,479	100.00

その他資産の投資状況

平成27年2月27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）	8,542,800,000	2.54
内 日本	8,542,800,000	2.54

（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27年2月27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	35,759,192,342	2.0241 72,380,931,748	2.1650 77,418,651,420	- -	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27年2月27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27年2月27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	2,027,300	7,700.00 15,610,210,000	8,063.00 16,346,119,900	- -	4.86%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	11,635,900	679.90 7,911,248,410	777.70 9,049,239,430	- -	2.69%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	766,900	7,136.00 5,472,598,400	7,367.00 5,649,752,300	- -	1.68%
4	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,322,200	3,820.50 5,051,465,100	3,949.50 5,222,028,900	- -	1.55%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,096,700	4,177.00 4,580,915,900	4,759.50 5,219,743,650	- -	1.55%
6	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	20,077,700	199.90 4,013,532,230	220.50 4,427,132,850	- -	1.32%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	567,500	7,212.00 4,092,810,000	7,420.00 4,210,850,000	- -	1.25%
8	KDDI 日本	株式 情報・通信業	491,100	7,786.00 3,823,704,600	8,290.00 4,071,219,000	- -	1.21%
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	576,600	5,922.00 3,414,625,200	6,123.00 3,530,521,800	- -	1.05%
10	ファナック 日本	株式 電気機器	153,000	20,035.00 3,065,355,000	22,945.00 3,510,585,000	- -	1.04%
11	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	912,600	3,443.50 3,142,538,100	3,772.00 3,442,327,200	- -	1.02%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,752,900	1,830.00 3,207,807,000	1,901.00 3,332,262,900	- -	0.99%
13	キヤノン 日本	株式 電気機器	851,900	3,732.50 3,179,716,750	3,889.00 3,313,039,100	- -	0.98%
14	ソニー 日本	株式 電気機器	960,300	3,066.79 2,945,042,950	3,414.50 3,278,944,350	- -	0.97%
15	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,078,000	2,514.00 2,710,092,000	2,793.50 3,011,393,000	- -	0.89%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	131,600	19,475.00 2,562,910,000	22,250.00 2,928,100,000	- -	0.87%
17	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,528,000	798.70 2,817,813,600	818.00 2,885,904,000	- -	0.86%
18	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	606,600	4,386.00 2,660,547,600	4,573.50 2,774,285,100	- -	0.82%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	269,300	9,140.00 2,461,402,000	10,035.00 2,702,425,500	- -	0.80%
20	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,790,700	1,318.50 2,361,037,950	1,495.00 2,677,096,500	- -	0.80%

21	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,111,500	2,223.00 2,470,864,500	2,390.50 2,657,040,750	- -	0.79%
22	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,062,400	1,064.00 2,194,393,600	1,264.00 2,606,873,600	- -	0.77%
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	596,900	4,076.50 2,433,262,850	4,350.50 2,596,813,450	- -	0.77%
24	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,195,000	1,996.50 2,385,817,500	2,124.50 2,538,777,500	- -	0.75%
25	三井不動産 日本	株式 不動産業	769,000	3,126.00 2,403,894,000	3,286.50 2,527,318,500	- -	0.75%
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	154,200	12,780.00 1,970,676,000	14,745.00 2,273,679,000	- -	0.68%
27	信越化学工業 日本	株式 化学	276,000	7,955.00 2,195,580,000	8,203.00 2,264,028,000	- -	0.67%
28	花王 日本	株式 化学	413,900	5,014.00 2,075,294,600	5,350.00 2,214,365,000	- -	0.66%
29	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	482,300	4,559.00 2,198,805,700	4,584.00 2,210,863,200	- -	0.66%
30	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	2,964,000	643.40 1,907,037,600	735.00 2,178,540,000	- -	0.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
株式	97.22%
合計	97.22%

(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27年2月27日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.44%
輸送用機器		11.46%
銀行業		9.08%
情報・通信業		6.65%
化学		5.98%
機械		4.85%
医薬品		4.65%
陸運業		4.16%
小売業		4.12%
卸売業		3.98%
食料品		3.96%
サービス業		2.98%
不動産業		2.88%
建設業		2.49%
保険業		2.40%
電気・ガス業		1.92%
鉄鋼		1.55%
精密機器		1.42%
証券、商品先物取引業		1.35%
その他製品		1.28%
その他金融業		1.22%
ゴム製品		0.90%
ガラス・土石製品		0.90%
非鉄金属		0.89%
繊維製品		0.74%
金属製品		0.65%
空運業		0.59%
石油・石炭製品		0.46%
鉱業		0.42%
海運業		0.32%
パルプ・紙	0.23%	
倉庫・運輸関連業	0.22%	
水産・農林業	0.08%	
合計	97.22%	

(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27年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2703月	買建	560	8,277,509,440	8,542,800,000	2.54%

（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27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
第12計算期間末 (平成27年2月9日)	73,449	73,449	2.0668	2.0668
平成26年2月末日	63,760	-	1.7270	-
3月末日	63,583	-	1.7307	-
4月末日	61,723	-	1.6719	-
5月末日	63,948	-	1.7290	-
6月末日	66,337	-	1.8180	-
7月末日	67,719	-	1.8566	-
8月末日	67,101	-	1.8402	-
9月末日	69,453	-	1.9227	-
10月末日	71,543	-	1.9333	-
11月末日	72,100	-	2.0444	-
12月末日	72,629	-	2.0419	-
平成27年1月末日	73,699	-	2.0527	-
2月末日	77,409	-	2.2109	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第12計算期間	21.9

(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
第12計算期間	12,348,095,889	13,334,064,929

(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:2015年2月27日

基準価額・純資産の推移

(2005年2月28日～2015年2月27日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定業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
第12期	(2015.02.09)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

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	国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.01%

■国内株式バッシブ・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	97.22
内 日本	97.22
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.78
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)	2.54

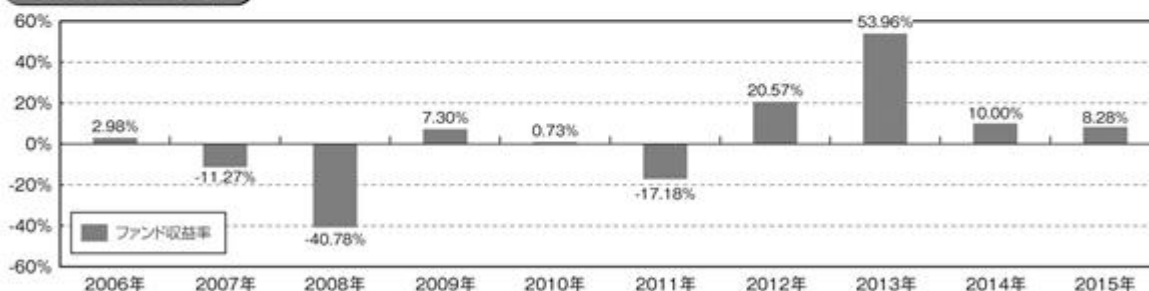
組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.44%
2	輸送用機器	11.46%
3	銀行業	9.08%
4	情報・通信業	6.65%
5	化学	5.98%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.86%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.69%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.68%
4	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.55%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.55%
6	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.32%
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.25%
8	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.21%
9	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.05%
10	ファナック	株式	日本	電気機器	1.04%

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、2015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（自動けいぞく）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ます。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

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には、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

委託会社は、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。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

(URL <http://www.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12期計算期間（平成26年2月8日から平成27年2月9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11期 平成26年2月7日現在	第12期 平成27年2月9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	576,694,677	460,251,293
親投資信託受益証券	61,897,534,059	73,447,613,884
流動資産合計	62,474,228,736	73,907,865,177
資産合計	62,474,228,736	73,907,865,177
負債の部		
流動負債		
未払解約金	501,156,820	371,968,222
未払受託者報酬	10,014,200	11,517,161
未払委託者報酬	63,423,515	72,942,305
その他未払費用	1,585,485	1,823,471
流動負債合計	576,180,020	458,251,159
負債合計	576,180,020	458,251,159
純資産の部		
元本等		
元本	1 36,523,179,565	1 35,537,210,525
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,374,869,151	37,912,403,493
（分配準備積立金）	9,085,776,686	17,682,687,284
元本等合計	61,898,048,716	73,449,614,018
純資産合計	61,898,048,716	73,449,614,018
負債純資産合計	62,474,228,736	73,907,865,177

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第11期 自 平成25年2月8日 至 平成26年2月7日	第12期 自 平成26年2月8日 至 平成27年2月9日
営業収益		
受取利息	184,490	150,641
有価証券売買等損益	12,405,662,162	13,882,178,825
営業収益合計	12,405,846,652	13,882,329,466
営業費用		
受託者報酬	19,009,572	21,690,338
委託者報酬	120,394,377	137,372,643
その他費用	3,009,659	3,434,131
営業費用合計	142,413,608	162,497,112
営業利益又は営業損失（ ）	12,263,433,044	13,719,832,354
経常利益又は経常損失（ ）	12,263,433,044	13,719,832,354
当期純利益又は当期純損失（ ）	12,263,433,044	13,719,832,354
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,963,013,024	2,321,028,891
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	13,064,476,476	25,374,869,151
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,768,822,392	10,599,081,822
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,768,822,392	10,599,081,822
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,758,849,737	9,460,350,943
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,758,849,737	9,460,350,943
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,374,869,151	37,912,403,493

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月7日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成27年2月9日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成26年2月7日現在	第12期 平成27年2月9日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	36,423,666,137円 16,783,744,888円 16,684,231,460円	36,523,179,565円 12,348,095,889円 13,334,064,929円
2 . 受益権の総数	36,523,179,565口	35,537,210,525口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 自 平成25年2月8日 至 平成26年2月7日	第12期 自 平成26年2月8日 至 平成27年2月9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（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）であります が、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（133,593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（11,398,669,870円）、信託約款に規定される収益調整金（20,229,716,209円）及び分配準備積立金（6,283,883,821円）より分配対象収益は37,912,403,493円（1万口当たり10,668.37円）であります が、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第11期 自 平成25年2月8日 至 平成26年2月7日	第12期 自 平成26年2月8日 至 平成27年2月9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11期 平成26年2月7日現在	第12期 平成27年2月9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11期 平成26年2月7日現在	第12期 平成27年2月9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	11,044,532,374	12,745,683,024
合計	11,044,532,374	12,745,683,024

（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11期 平成26年2月7日現在	第12期 平成27年2月9日現在
1口当たり純資産額	1.6948円	2.0668円
（1万口当たり純資産額）	（16,948円）	（20,668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27年2月9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	36,293,726,286	73,447,613,884	
親投資信託受益証券	合計	36,293,726,286	73,447,613,884	
合計		36,293,726,286	73,447,613,884	

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26年2月7日現在	平成27年2月9日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,341,076,428	3,344,502,623
株式	2	301,374,444,140	321,463,694,880
派生商品評価勘定		109,030,070	70,858,808
未収入金		22,086,600	-
未収配当金		284,826,643	374,039,516
前払金		507,595,000	-
流動資産合計		312,639,058,881	325,253,095,827
資産合計		312,639,058,881	325,253,095,827
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		353,025,920	1,921,820
前受金		-	58,750,000
未払金		-	128,128
未払解約金		60,211,000	515,027,000
流動負債合計		413,236,920	575,826,948
負債合計		413,236,920	575,826,948
純資産の部			
元本等			
元本	1	188,590,646,846	160,436,237,384
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		123,635,175,115	164,241,031,495
元本等合計		312,225,821,961	324,677,268,879
純資産合計		312,225,821,961	324,677,268,879
負債純資産合計		312,639,058,881	325,253,095,827

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26年2月7日現在	平成27年2月9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	228,887,294,836円	188,590,646,846円
同期中追加設定元本額	37,989,184,033円	23,150,658,982円
同期中一部解約元本額	78,285,832,023円	51,305,068,444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	3,970,207,848円	4,081,292,693円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,370,448,970円	1,411,014,973円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	37,386,768,579円	36,293,726,286円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	748,709,896円	771,217,140円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,859,610,081円	2,879,243,203円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,039,958,422円	3,084,803,902円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	386,095,927円	389,293,307円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,267,213,606円	1,303,303,457円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,088,127,674円	1,133,820,689円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	110,256,822円	79,128,019円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,361,858,828円	1,246,903,286円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	20,684,103円	28,697,422円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	7,922,191円	16,781,334円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	11,558,016円	32,790,530円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	26,921,544円	80,501,452円
投資のソムリエ	861,016円	99,708,872円
クルーズコントロール	21,759,643円	423,199,350円
投資のソムリエ<DC年金>	6,003円	1,478,970円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	580,728円	34,666,087円
D I A M D C バランス・F (成長型)	-円	6,788,927円
クルーズコントロール<DC年 金>	-円	134,378円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	155,568,450円	132,183,740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)	4,947,648,314円	2,171,589,003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)	973,191,683円	615,671,008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)	125,037,964円	69,684,107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)	416,187,512円	289,944,425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)	113,263,150円	60,949,241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)	181,178,060円	114,903,360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)	14,962,758,798円	10,168,712,919円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	4,961,742,383円	3,567,914,239円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,579,689,253円	2,920,763,500円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	2,417,341,842円	2,002,140,257円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	5,825,090,065円	5,051,496,869円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	683,866,893円	427,540,847円
D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	1,731,144,268円	1,150,626,711円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,592,474,926円	1,249,278,441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)	8,290,795,352円	5,566,969,150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)	87,280,606円	92,409,818円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	3,068,189,985円	1,941,802,505円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35V A (適格機 関投資家限定)	7,304,589,475円	6,507,891,316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)	280,027,182円	211,433,281円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	28,348,518,353円	24,147,001,270円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投 資家限定)	1,440,903,785円	1,005,779,315円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	3,357,274,221円	2,763,446,288円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	17,491,462,759円	15,142,706,177円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	15,078,480円	38,223円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	84,011,222円	10,776,546円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	85,761,418円	47,737,260円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	15,548,866,566円	13,528,621,725円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	193,148,918円	129,163,527円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	58,278,796円	45,522,958円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	122,920,930円	1,718,173円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	224,247円	104,752,546円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	126,520円	120,223円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	935,035,848円	818,354,088円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	2,351,917,037円	2,114,709,804円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	3,056,002,530円	2,751,007,520円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	124,499,158円	112,382,727円
	計	188,590,646,846円	160,436,237,384円
2 .	受益権の総数	188,590,646,846口	160,436,237,384口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 2,950,000,000円	株式 3,850,000,000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25年2月8日 至 平成26年2月7日	自 平成26年2月8日 至 平成27年2月9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26年2月7日現在	平成27年2月9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ぬ。	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つた場合、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26年2月7日現在	平成27年2月9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	53,867,282,563	52,346,025,733
合計	53,867,282,563	52,346,025,733

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成26年2月7日 現在				平成27年2月9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	11,634,354,000	-	11,390,740,000	243,614,000	2,965,179,000	-	3,034,185,000	69,006,000
合計	11,634,354,000	-	11,390,740,000	243,614,000	2,965,179,000	-	3,034,185,000	69,006,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

- 2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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26年2月7日現在	平成27年2月9日現在
1口当たり純資産額	1.6556円	2.0237円
（1万口当たり純資産額）	（16,556円）	（20,237円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年2月9日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	75,000	280.00	21,000,000	
日本水産	212,700	342.00	72,743,400	
マルハニチロ	33,500	1,792.00	60,032,000	
ハウスイ	14,000	126.00	1,764,000	
サカタのタネ	25,600	1,920.00	49,152,000	
ホクト	19,400	2,284.00	44,309,600	
ショーボンドホールディングス	15,400	5,000.00	77,000,000	
ミライト・ホールディングス	53,300	1,283.00	68,383,900	
タマホーム	11,600	553.00	6,414,800	
サンヨーホームズ	1,900	635.00	1,206,500	
住石ホールディングス	48,300	116.00	5,602,800	
日鉄鉱業	48,000	423.00	20,304,000	
三井松島産業	114,000	127.00	14,478,000	
国際石油開発帝石	911,600	1,352.00	1,232,483,200	
日本海洋掘削	5,200	4,265.00	22,178,000	
石油資源開発	24,700	3,800.00	93,860,000	
K & Oエナジーグループ	11,700	1,575.00	18,427,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,000	1,742.00	3,484,000	
安藤・間	115,500	739.00	85,354,500	
東急建設	61,500	594.00	36,531,000	
コムシスホールディングス	77,100	1,477.00	113,876,700	
ミサワホーム	20,500	1,077.00	22,078,500	
高松コンストラクショングループ	13,100	2,492.00	32,645,200	
東建コーポレーション	6,500	5,000.00	32,500,000	
ヤマウラ	8,400	400.00	3,360,000	
大成建設	875,000	671.00	587,125,000	
大林組	519,000	728.00	377,832,000	
清水建設	529,000	806.00	426,374,000	
飛鳥建設	112,700	252.00	28,400,400	
長谷工コーポレーション	216,300	938.00	202,889,400	
松井建設	2,000	710.00	1,420,000	
銭高組	25,000	379.00	9,475,000	
鹿島建設	761,000	455.00	346,255,000	
不動テトラ	131,100	240.00	31,464,000	
大末建設	6,700	888.00	5,949,600	
鉄建建設	105,000	432.00	45,360,000	
日鉄住金テックスエンジ	33,000	533.00	17,589,000	
西松建設	187,000	472.00	88,264,000	
三井住友建設	698,000	158.00	110,284,000	
大豊建設	47,000	516.00	24,252,000	
前田建設工業	115,000	881.00	101,315,000	
佐田建設	60,000	144.00	8,640,000	
ナカノフドー建設	13,400	383.00	5,132,200	

奥村組	164,000	550.00	90,200,000
大和小田急建設	9,400	769.00	7,228,600
東鉄工業	20,800	2,842.00	59,113,600
イチケン	19,000	308.00	5,852,000
浅沼組	56,000	150.00	8,400,000
戸田建設	217,000	426.00	92,442,000
熊谷組	217,000	364.00	78,988,000
青木あすなる建設	10,600	839.00	8,893,400
北野建設	36,000	349.00	12,564,000
植木組	22,000	259.00	5,698,000
三井ホーム	23,000	502.00	11,546,000
矢作建設工業	21,500	836.00	17,974,000
ピーエス三菱	18,300	430.00	7,869,000
東日本ハウス	21,800	532.00	11,597,600
大東建託	65,700	13,220.00	868,554,000
新日本建設	20,700	444.00	9,190,800
N I P P O	40,000	1,613.00	64,520,000
東亜道路工業	33,000	427.00	14,091,000
前田道路	54,000	1,809.00	97,686,000
日本道路	52,000	557.00	28,964,000
東亜建設工業	130,000	201.00	26,130,000
若築建設	100,000	199.00	19,900,000
東洋建設	46,200	605.00	27,951,000
五洋建設	192,200	453.00	87,066,600
大林道路	20,000	659.00	13,180,000
世紀東急工業	25,300	568.00	14,370,400
福田組	26,000	911.00	23,686,000
日本ドライケミカル	2,300	2,271.00	5,223,300
住友林業	127,700	1,154.00	147,365,800
日本基礎技術	20,800	376.00	7,820,800
日成ビルド工業	48,000	285.00	13,680,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	94.00	7,520,000
巴コーポレーション	21,800	440.00	9,592,000
パナホーム	65,000	743.00	48,295,000
大和ハウス工業	506,700	2,200.00	1,114,740,000
ライト工業	27,800	1,061.00	29,495,800
積水ハウス	532,300	1,514.00	805,902,200
日特建設	23,200	516.00	11,971,200
北陸電気工事	9,000	795.00	7,155,000
ユアテック	27,000	772.00	20,844,000
西部電気工業	15,000	462.00	6,930,000
四電工	6,000	445.00	2,670,000
中電工	25,000	1,823.00	45,575,000
関電工	79,000	661.00	52,219,000
きんでん	115,000	1,361.00	156,515,000
東京エネシス	19,000	838.00	15,922,000
トーエネック	25,000	588.00	14,700,000
住友電設	13,700	1,234.00	16,905,800
日本電設工業	28,300	1,732.00	49,015,600
協和エクシオ	73,600	1,172.00	86,259,200

新日本空調	14,700	960.00	14,112,000	
日本工営	54,000	491.00	26,514,000	
N D S	30,000	298.00	8,940,000	
九電工	32,000	1,412.00	45,184,000	
三機工業	35,400	724.00	25,629,600	
日揮	174,000	2,516.00	437,784,000	
中外炉工業	53,000	275.00	14,575,000	
ヤマト	16,000	433.00	6,928,000	
太平電業	23,000	883.00	20,309,000	
高砂熱学工業	48,300	1,456.00	70,324,800	
三晃金属工業	18,000	257.00	4,626,000	
N E C ネットズエスアイ	19,200	2,201.00	42,259,200	
朝日工業社	20,000	405.00	8,100,000	
明星工業	31,000	665.00	20,615,000	
大気社	24,800	2,770.00	68,696,000	
ダイダン	23,000	670.00	15,410,000	
日比谷総合設備	22,400	1,592.00	35,660,800	
東芝プラントシステム	28,100	1,742.00	48,950,200	
日本製粉	107,000	559.00	59,813,000	
日清製粉グループ本社	190,000	1,410.00	267,900,000	
日東富士製粉	8,000	321.00	2,568,000	
昭和産業	72,000	494.00	35,568,000	
鳥越製粉	14,500	711.00	10,309,500	
中部飼料	17,100	647.00	11,063,700	
フィード・ワンホールディングス	106,800	112.00	11,961,600	
東洋精糖	29,000	100.00	2,900,000	
日本甜菜製糖	90,000	203.00	18,270,000	
三井製糖	68,000	394.00	26,792,000	
塩水港精糖	18,700	272.00	5,086,400	
ネクスト	18,900	861.00	16,272,900	
日本M & A センター	24,900	3,910.00	97,359,000	
ノバレーゼ	4,200	842.00	3,536,400	
アコーディア・ゴルフ	60,700	1,186.00	71,990,200	
タケエイ	15,700	1,011.00	15,872,700	
トラスト・テック	2,800	1,723.00	4,824,400	
パソナグループ	12,000	679.00	8,148,000	
C D S	3,700	951.00	3,518,700	
リンクアンドモチベーション	21,800	162.00	3,531,600	
G C A サヴィアン	12,600	1,189.00	14,981,400	
エス・エム・エス	18,000	1,349.00	24,282,000	
テンブホールディングス	31,700	3,815.00	120,935,500	
リニカル	4,200	921.00	3,868,200	
クックパッド	10,200	4,910.00	50,082,000	
エスクリ	5,700	1,197.00	6,822,900	
アイ・ケイ・ケイ	4,400	1,046.00	4,602,400	
森永製菓	156,000	335.00	52,260,000	
中村屋	41,000	484.00	19,844,000	
江崎グリコ	40,000	4,345.00	173,800,000	
名糖産業	8,000	1,170.00	9,360,000	
不二家	100,000	194.00	19,400,000	

山崎製パン	127,000	1,661.00	210,947,000	
第一屋製パン	25,000	129.00	3,225,000	
モロゾフ	28,000	367.00	10,276,000	
亀田製菓	9,700	4,350.00	42,195,000	
寿スピリッツ	4,200	2,565.00	10,773,000	
カルビー	64,100	4,180.00	267,938,000	
森永乳業	156,000	471.00	73,476,000	
六甲バター	7,900	1,140.00	9,006,000	
ヤクルト本社	92,800	6,860.00	636,608,000	
明治ホールディングス	51,300	12,890.00	661,257,000	
雪印メグミルク	41,000	1,593.00	65,313,000	
プリマハム	97,000	271.00	26,287,000	
日本ハム	127,000	2,687.00	341,249,000	
伊藤ハム	95,000	601.00	57,095,000	
林兼産業	58,000	93.00	5,394,000	
丸大食品	90,000	411.00	36,990,000	
米久	5,500	1,830.00	10,065,000	
S Foods	10,900	2,021.00	22,028,900	
学情	6,000	1,005.00	6,030,000	
スタジオアリス	7,400	1,797.00	13,297,800	
シミックホールディングス	6,100	1,945.00	11,864,500	
システナ	15,000	872.00	13,080,000	
デジタルアーツ	8,200	1,063.00	8,716,600	
新日鉄住金ソリューションズ	12,700	3,240.00	41,148,000	
総合警備保障	53,800	3,170.00	170,546,000	
キューブシステム	6,700	616.00	4,127,200	
日本駐車場開発	166,200	130.00	21,606,000	
コア	6,500	892.00	5,798,000	
カカクコム	107,300	1,851.00	198,612,300	
アイロムホールディングス	3,900	1,746.00	6,809,400	
ルネサンス	8,200	1,243.00	10,192,600	
ディップ	3,600	5,000.00	18,000,000	
SBSホールディングス	11,400	871.00	9,929,400	
オプト	7,300	649.00	4,737,700	
新日本科学	15,200	829.00	12,600,800	
ツクイ	19,100	885.00	16,903,500	
総合臨床ホールディングス	7,500	463.00	3,472,500	
キャリアデザインセンター	4,800	916.00	4,396,800	
エムスリー	139,600	2,375.00	331,550,000	
ツカダ・グローバルホールディング	11,700	723.00	8,459,100	
アウトソーシング	6,100	1,911.00	11,657,100	
ウェルネット	4,200	2,278.00	9,567,600	
ディー・エヌ・エー	79,500	1,405.00	111,697,500	
博報堂DYホールディングス	223,600	1,156.00	258,481,600	
ぐるなび	19,900	1,791.00	35,640,900	
エスアールジータカミヤ	12,900	880.00	11,352,000	
一休	12,700	1,644.00	20,878,800	
ジャパンベストレスキューシステム	13,400	258.00	3,457,200	
ファンコミュニケーションズ	27,800	1,371.00	38,113,800	
ジェイコムホールディングス	3,500	788.00	2,758,000	

P G Mホールディングス	22,900	1,243.00	28,464,700
W D Bホールディングス	5,800	840.00	4,872,000
ティア	4,100	572.00	2,345,200
バリューコマース	13,200	523.00	6,903,600
サッポロホールディングス	283,000	493.00	139,519,000
アサヒグループホールディングス	347,900	3,678.50	1,279,750,150
麒麟ホールディングス	740,500	1,603.50	1,187,391,750
宝ホールディングス	135,800	787.00	106,874,600
オエノンホールディングス	46,000	216.00	9,936,000
養命酒製造	3,000	924.00	2,772,000
コカ・コーラウエスト	58,700	1,649.00	96,796,300
コカ・コーライーストジャパン	52,600	2,019.00	106,199,400
サントリー食品インターナショナル	103,800	4,135.00	429,213,000
ダイドードリンコ	8,800	4,600.00	40,480,000
伊藤園	51,300	2,328.00	119,426,400
キーコーヒー	15,600	1,733.00	27,034,800
ユニカフェ	5,400	801.00	4,325,400
ジャパンフーズ	2,600	1,127.00	2,930,200
日清オイリオグループ	84,000	417.00	35,028,000
不二製油	46,200	1,638.00	75,675,600
J - オイルミルズ	73,000	427.00	31,171,000
ローソン	57,700	7,850.00	452,945,000
サンエー	11,500	3,775.00	43,412,500
ダイユーエイト	3,200	882.00	2,822,400
カワチ薬品	11,800	1,893.00	22,337,400
エービーシー・マート	21,600	6,170.00	133,272,000
ハードオフコーポレーション	7,500	1,092.00	8,190,000
高千穂交易	6,100	1,055.00	6,435,500
アスクル	15,800	1,952.00	30,841,600
ゲオホールディングス	28,700	1,210.00	34,727,000
アダストリアホールディングス	12,800	2,755.00	35,264,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	19,000	126.00	2,394,000
伊藤忠食品	3,900	3,930.00	15,327,000
くらコーポレーション	8,900	3,595.00	31,995,500
キャンドウ	7,300	1,548.00	11,300,400
エレマテック	7,100	2,709.00	19,233,900
パル	8,900	3,095.00	27,545,500
J A L U X	4,500	1,930.00	8,685,000
エディオン	69,800	860.00	60,028,000
あらた	34,000	323.00	10,982,000
サーラコーポレーション	13,200	589.00	7,774,800
ワッツ	6,100	852.00	5,197,200
トーメンデバイス	2,400	1,837.00	4,408,800
J Pホールディングス	40,100	388.00	15,558,800
あみやき亭	2,600	3,840.00	9,984,000
東京エレクトロン デバイス	3,000	1,530.00	4,590,000
ひらまつ	21,100	632.00	13,335,200
双日	1,023,000	170.00	173,910,000
ゲンキー	1,500	9,990.00	14,985,000
アルフレッサ ホールディングス	180,300	1,541.00	277,842,300

大黒天物産	3,600	3,995.00	14,382,000	
ハニーズ	12,100	994.00	12,027,400	
キッコーマン	141,000	3,140.00	442,740,000	
味の素	399,000	2,220.00	885,780,000	
キューピー	88,100	2,629.00	231,614,900	
ハウス食品グループ本社	64,100	2,315.00	148,391,500	
カゴメ	67,100	1,859.00	124,738,900	
焼津水産化学工業	8,700	1,005.00	8,743,500	
アリアケジャパン	15,800	3,110.00	49,138,000	
ニチレイ	185,000	579.00	107,115,000	
横浜冷凍	38,100	807.00	30,746,700	
東洋水産	90,400	4,045.00	365,668,000	
イトアンド	2,000	1,800.00	3,600,000	
日清食品ホールディングス	73,300	5,690.00	417,077,000	
永谷園	7,000	1,102.00	7,714,000	
フジッコ	17,000	1,892.00	32,164,000	
ロック・フィールド	9,300	2,101.00	19,539,300	
日本たばこ産業	959,100	3,443.50	3,302,660,850	
ケンコーマヨネーズ	5,700	1,616.00	9,211,200	
わらべや日洋	10,300	1,984.00	20,435,200	
なとり	8,400	1,469.00	12,339,600	
ユーグレナ	37,400	1,735.00	64,889,000	
片倉工業	20,300	1,154.00	23,426,200	
ゲンゼ	131,000	306.00	40,086,000	
ヒューリック	257,200	1,196.00	307,611,200	
神栄	23,000	198.00	4,554,000	
山下医科器械	1,300	1,656.00	2,152,800	
ラサ商事	8,100	552.00	4,471,200	
アルペン	13,600	1,707.00	23,215,200	
クオール	15,500	899.00	13,934,500	
アルコニックス	8,600	1,835.00	15,781,000	
神戸物産	5,000	4,455.00	22,275,000	
ジェイアイエヌ	10,300	3,340.00	34,402,000	
ビックカメラ	66,100	1,276.00	84,343,600	
D C Mホールディングス	73,700	820.00	60,434,000	
Monotaro	29,700	3,370.00	100,089,000	
あいホールディングス	24,400	1,970.00	48,068,000	
ディーブイエックス	4,500	1,041.00	4,684,500	
きちり	3,000	700.00	2,100,000	
アークランドサービス	1,800	4,000.00	7,200,000	
J.フロントリテイリング	192,800	1,558.00	300,382,400	
ドトール・日レスホールディングス	26,700	1,718.00	45,870,600	
マツモトキヨシホールディングス	34,100	3,865.00	131,796,500	
ブロンコビリー	2,700	3,885.00	10,489,500	
スタートトゥデイ	47,400	2,619.00	124,140,600	
物語コーポレーション	3,700	3,860.00	14,282,000	
ココカラファイン	15,900	3,160.00	50,244,000	
三越伊勢丹ホールディングス	303,000	1,665.00	504,495,000	
東洋紡	640,000	165.00	105,600,000	
ユニチカ	470,000	54.00	25,380,000	

富士紡ホールディングス	79,000	310.00	24,490,000	
日清紡ホールディングス	103,000	1,234.00	127,102,000	
倉敷紡績	167,000	197.00	32,899,000	
ダイワボウホールディングス	139,000	189.00	26,271,000	
シキボウ	93,000	118.00	10,974,000	
日東紡績	119,000	466.00	55,454,000	
トヨタ紡織	54,000	1,462.00	78,948,000	
ウエルシアホールディングス	13,700	4,170.00	57,129,000	
クリエイイトSDホールディングス	6,400	4,065.00	26,016,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,700	941.00	27,006,700	
八洲電機	12,000	565.00	6,780,000	
UKCホールディングス	9,800	1,798.00	17,620,400	
丸善CHIホールディングス	17,800	359.00	6,390,200	
TOKAIホールディングス	74,500	548.00	40,826,000	
エー・ピーカンパニー	2,100	2,019.00	4,239,900	
三洋貿易	9,200	1,313.00	12,079,600	
チムニー	2,800	2,245.00	6,286,000	
ウイン・パートナーズ	4,900	1,434.00	7,026,600	
ネクステージ	1,500	636.00	954,000	
ジョイフル本田	8,300	4,205.00	34,901,500	
麒麟堂ホールディングス	5,200	844.00	4,388,800	
すかいらく	55,800	1,222.00	68,187,600	
日本毛織	51,000	785.00	40,035,000	
大東紡織	27,000	73.00	1,971,000	
トーア紡コーポレーション	73,000	74.00	5,402,000	
ダイドーリミテッド	18,300	512.00	9,369,600	
東京建物不動産販売	8,200	396.00	3,247,200	
三栄建築設計	6,300	892.00	5,619,600	
野村不動産ホールディングス	91,600	1,997.00	182,925,200	
日本商業開発	4,700	2,154.00	10,123,800	
プレサンスコーポレーション	5,200	3,645.00	18,954,000	
常和ホールディングス	6,300	3,720.00	23,436,000	
日本管理センター	7,200	1,244.00	8,956,800	
エストラスト	1,600	654.00	1,046,400	
フージャースホールディングス	22,700	497.00	11,281,900	
オープンハウス	9,600	1,970.00	18,912,000	
東急不動産ホールディングス	399,400	768.00	306,739,200	
飯田グループホールディングス	98,800	1,576.00	155,708,800	
帝国繊維	16,900	2,358.00	39,850,200	
ブックオフコーポレーション	8,800	866.00	7,620,800	
日本コークス工業	145,800	111.00	16,183,800	
ミタチ産業	3,600	694.00	2,498,400	
あさひ	10,000	1,146.00	11,460,000	
日本調剤	1,900	3,980.00	7,562,000	
コスモス薬品	7,700	18,900.00	145,530,000	
シップヘルスケアホールディングス	27,800	2,864.00	79,619,200	
トーエル	8,200	666.00	5,461,200	
一六堂	3,600	433.00	1,558,800	
ソフトクリエイイトホールディングス	5,100	932.00	4,753,200	

セブン&アイ・ホールディングス	637,600	4,386.00	2,796,513,600	
薬王堂	2,100	2,298.00	4,825,800	
クリエイイト・レストランツ・ホールディング	10,600	1,563.00	16,567,800	
ツルハホールディングス	32,500	7,460.00	242,450,000	
スターティア	1,300	1,513.00	1,966,900	
サンマルクホールディングス	5,500	7,430.00	40,865,000	
フェリシモ	3,900	995.00	3,880,500	
トリドール	15,600	1,581.00	24,663,600	
クスリのアオキ	6,800	7,680.00	52,224,000	
帝人	661,000	382.00	252,502,000	
東レ	1,252,000	988.30	1,237,351,600	
クラレ	275,500	1,523.00	419,586,500	
旭化成	1,009,000	1,170.50	1,181,034,500	
サカイオーベックス	42,000	177.00	7,434,000	
稲葉製作所	6,900	1,327.00	9,156,300	
宮地エンジニアリンググループ	47,000	196.00	9,212,000	
トーカロ	10,600	2,133.00	22,609,800	
アルファ	5,600	1,177.00	6,591,200	
SUMCO	111,200	2,045.00	227,404,000	
川田テクノロジーズ	3,100	4,050.00	12,555,000	
住江織物	44,000	293.00	12,892,000	
日本フェルト	9,500	542.00	5,149,000	
イチカワ	11,000	272.00	2,992,000	
日本バイリーン	23,000	595.00	13,685,000	
エコナックホールディングス	54,000	54.00	2,916,000	
日東製網	19,000	159.00	3,021,000	
芦森工業	35,000	170.00	5,950,000	
アツギ	136,000	114.00	15,504,000	
ダイニック	31,000	174.00	5,394,000	
共和レザー	10,700	751.00	8,035,700	
セーレン	40,500	1,010.00	40,905,000	
東海染工	24,000	122.00	2,928,000	
小松精練	26,900	539.00	14,499,100	
ワコールホールディングス	96,000	1,168.00	112,128,000	
ホギメディカル	10,200	5,830.00	59,466,000	
レナウン	39,100	111.00	4,340,100	
クラウディア	2,000	1,354.00	2,708,000	
T S Iホールディングス	72,100	737.00	53,137,700	
I Tホールディングス	50,500	2,052.00	103,626,000	
ネオス	4,100	631.00	2,587,100	
電算システム	5,300	1,492.00	7,907,600	
グリー	92,200	673.00	62,050,600	
コーエーテクモホールディングス	34,400	1,619.00	55,693,600	
三菱総合研究所	5,900	2,925.00	17,257,500	
ボルテージ	2,700	1,132.00	3,056,400	
電算	1,600	2,258.00	3,612,800	
A G S	2,700	1,082.00	2,921,400	
ファインデックス	2,200	6,200.00	13,640,000	
ヒト・コミュニケーションズ	2,200	1,740.00	3,828,000	

ブレインパッド	1,600	1,230.00	1,968,000	
K L a b	16,100	1,198.00	19,287,800	
ポールトゥウィン・ピットクルー ホールディングス	10,000	787.00	7,870,000	
イーブックイニシアティブジャパン	3,400	1,052.00	3,576,800	
ネクソン	144,400	1,194.00	172,413,600	
アイスタイル	5,000	706.00	3,530,000	
エムアップ	4,000	710.00	2,840,000	
エイチーム	1,900	4,905.00	9,319,500	
e n i s h	4,000	1,519.00	6,076,000	
コロブラ	26,600	2,621.00	69,718,600	
モバイルクリエイト	6,500	746.00	4,849,000	
オルトプラス	2,800	1,024.00	2,867,200	
ブロードリーフ	12,600	1,895.00	23,877,000	
ハーツユニテッドグループ	4,600	1,727.00	7,944,200	
特種東海製紙	94,000	288.00	27,072,000	
ベリサーブ	1,800	1,062.00	1,911,600	
ティーガイア	15,200	1,292.00	19,638,400	
豆蔵ホールディングス	11,900	601.00	7,151,900	
テクマトリックス	6,600	598.00	3,946,800	
GMOペイメントゲートウェイ	13,200	2,339.00	30,874,800	
ザッパラス	8,700	646.00	5,620,200	
インターネットイニシアティブ	24,600	2,513.00	61,819,800	
GMOクラウド	2,600	880.00	2,288,000	
ビットアイル	17,100	512.00	8,755,200	
S R Aホールディングス	8,100	1,548.00	12,538,800	
システムインテグレータ	1,800	468.00	842,400	
パイブドピッツ	1,400	2,045.00	2,863,000	
朝日ネット	16,000	508.00	8,128,000	
コムチュア	2,600	1,924.00	5,002,400	
王子ホールディングス	663,000	479.00	317,577,000	
日本製紙	78,000	1,917.00	149,526,000	
三菱製紙	247,000	87.00	21,489,000	
北越紀州製紙	100,300	553.00	55,465,900	
中越パルプ工業	62,000	267.00	16,554,000	
巴川製紙所	25,000	198.00	4,950,000	
大王製紙	72,000	992.00	71,424,000	
g u m i	11,500	2,420.00	27,830,000	
レンゴー	143,000	524.00	74,932,000	
トーモク	51,000	285.00	14,535,000	
ザ・バック	11,500	2,332.00	26,818,000	
コープケミカル	25,000	109.00	2,725,000	
昭和電工	1,077,000	153.00	164,781,000	
住友化学	1,191,000	513.00	610,983,000	
日本化成	31,000	143.00	4,433,000	
住友精化	34,000	804.00	27,336,000	
日産化学工業	108,100	2,171.00	234,685,100	
ラサ工業	61,000	132.00	8,052,000	
クレハ	114,000	531.00	60,534,000	
多木化学	8,000	731.00	5,848,000	

テイカ	27,000	440.00	11,880,000	
石原産業	271,000	108.00	29,268,000	
片倉チッカリン	12,000	272.00	3,264,000	
日本曹達	104,000	684.00	71,136,000	
東ソー	404,000	555.00	224,220,000	
トクヤマ	252,000	287.00	72,324,000	
セントラル硝子	165,000	487.00	80,355,000	
東亜合成	203,000	499.00	101,297,000	
ダイソー	65,000	433.00	28,145,000	
関東電化工業	39,000	555.00	21,645,000	
電気化学工業	335,000	460.00	154,100,000	
イビデン	101,300	1,851.00	187,506,300	
信越化学工業	290,100	7,955.00	2,307,745,500	
日本カーバイド工業	55,000	227.00	12,485,000	
堺化学工業	66,000	389.00	25,674,000	
エア・ウォーター	143,000	2,076.00	296,868,000	
大陽日酸	208,000	1,439.00	299,312,000	
日本化学工業	60,000	298.00	17,880,000	
日本パーカライジング	38,200	2,755.00	105,241,000	
高压ガス工業	25,000	599.00	14,975,000	
チタン工業	19,000	232.00	4,408,000	
四国化成工業	24,000	964.00	23,136,000	
戸田工業	32,000	517.00	16,544,000	
ステラ ケミファ	8,300	1,300.00	10,790,000	
保土谷化学工業	49,000	195.00	9,555,000	
日本触媒	127,000	1,559.00	197,993,000	
大日精化工業	67,000	631.00	42,277,000	
カネカ	218,000	735.00	160,230,000	
協和発酵キリン	194,000	1,374.00	266,556,000	
三菱瓦斯化学	278,000	567.00	157,626,000	
三井化学	735,000	339.00	249,165,000	
J S R	159,800	2,084.00	333,023,200	
東京応化工業	33,500	3,780.00	126,630,000	
大阪有機化学工業	11,900	487.00	5,795,300	
三菱ケミカルホールディングス	1,011,400	611.60	618,572,240	
日本合成化学工業	38,000	689.00	26,182,000	
ダイセル	228,000	1,458.00	332,424,000	
住友ベークライト	152,000	497.00	75,544,000	
積水化学工業	374,000	1,402.00	524,348,000	
日本ゼオン	139,000	1,123.00	156,097,000	
アイカ工業	48,700	2,555.00	124,428,500	
宇部興産	815,000	191.00	155,665,000	
積水樹脂	25,100	1,551.00	38,930,100	
タキロン	34,000	503.00	17,102,000	
旭有機材工業	57,000	287.00	16,359,000	
日立化成	79,900	2,469.00	197,273,100	
ニチバン	16,000	499.00	7,984,000	
リケンテクノス	26,200	435.00	11,397,000	
大倉工業	39,000	345.00	13,455,000	
積水化成成品工業	46,000	429.00	19,734,000	

群栄化学工業	43,000	340.00	14,620,000	
タイガースポリマー	8,000	856.00	6,848,000	
ミライアル	5,900	1,540.00	9,086,000	
ダイキョーニシカワ	3,900	3,680.00	14,352,000	
日本化薬	105,000	1,510.00	158,550,000	
カーリットホールディングス	13,100	668.00	8,750,800	
E P Sホールディングス	19,100	1,485.00	28,363,500	
パナソニック インフォメーション システムズ	3,300	3,280.00	10,824,000	
プレステージ・インターナショナル	12,300	1,014.00	12,472,200	
フェイス	4,700	1,293.00	6,077,100	
アミューズ	4,900	2,896.00	14,190,400	
野村総合研究所	86,300	4,100.00	353,830,000	
ドリームインキュベータ	5,200	2,261.00	11,757,200	
サイバネットシステム	12,500	450.00	5,625,000	
クイック	5,500	758.00	4,169,000	
T A C	8,100	214.00	1,733,400	
ケネディクス	229,200	515.00	118,038,000	
電通	179,800	4,590.00	825,282,000	
インテージホールディングス	8,700	1,682.00	14,633,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,200	970.00	6,014,000	
東邦システムサイエンス	4,500	616.00	2,772,000	
びあ	4,800	2,212.00	10,617,600	
イオンファンタジー	5,300	1,605.00	8,506,500	
ソースネクスト	7,600	763.00	5,798,800	
ネクシィーズ	5,800	638.00	3,700,400	
メディカルシステムネットワーク	13,800	392.00	5,409,600	
ティー・ワイ・オー	15,300	172.00	2,631,600	
日本精化	13,600	847.00	11,519,200	
A D E K A	74,700	1,383.00	103,310,100	
日油	135,000	774.00	104,490,000	
ミヨシ油脂	61,000	133.00	8,113,000	
新日本理化	26,000	211.00	5,486,000	
ハリマ化成グループ	14,000	462.00	6,468,000	
花王	434,900	5,014.00	2,180,588,600	
第一工業製薬	30,000	382.00	11,460,000	
三洋化成工業	51,000	886.00	45,186,000	
武田薬品工業	606,000	5,922.00	3,588,732,000	
アステラス製薬	1,842,300	1,830.00	3,371,409,000	
大日本住友製薬	114,500	1,259.00	144,155,500	
塩野義製薬	252,600	3,280.00	828,528,000	
田辺三菱製薬	188,500	1,975.00	372,287,500	
わかもと製薬	7,000	278.00	1,946,000	
あすか製薬	19,100	1,131.00	21,602,100	
日本新薬	37,000	3,925.00	145,225,000	
ビオフェルミン製薬	2,700	2,927.00	7,902,900	
中外製薬	161,000	3,505.00	564,305,000	
科研製薬	56,000	3,160.00	176,960,000	
エーザイ	213,400	6,200.00	1,323,080,000	
理研ビタミン	5,100	4,055.00	20,680,500	

ロート製薬	73,600	1,492.00	109,811,200
小野薬品工業	73,500	11,460.00	842,310,000
久光製薬	45,600	4,180.00	190,608,000
有機合成薬品工業	11,000	266.00	2,926,000
持田製薬	11,600	6,730.00	78,068,000
参天製薬	59,400	7,420.00	440,748,000
扶桑薬品工業	55,000	305.00	16,775,000
日本ケミファ	21,000	546.00	11,466,000
ツムラ	50,900	2,914.00	148,322,600
日医工	37,900	2,200.00	83,380,000
テルモ	236,700	3,125.00	739,687,500
みらかホールディングス	42,500	5,330.00	226,525,000
キッセイ薬品工業	30,000	3,205.00	96,150,000
生化学工業	30,900	2,268.00	70,081,200
栄研化学	13,600	1,747.00	23,759,200
日水製薬	6,700	1,288.00	8,629,600
鳥居薬品	11,100	3,145.00	34,909,500
J C Rファーマ	12,500	2,247.00	28,087,500
東和薬品	8,200	5,480.00	44,936,000
富士製薬工業	4,700	2,074.00	9,747,800
沢井製薬	25,600	7,320.00	187,392,000
ゼリア新薬工業	33,100	1,896.00	62,757,600
第一三共	544,000	1,796.50	977,296,000
キョーリン製薬ホールディングス	43,200	2,488.00	107,481,600
大幸薬品	7,100	1,869.00	13,269,900
ダイト	6,100	2,437.00	14,865,700
大塚ホールディングス	321,000	3,731.00	1,197,651,000
大正製薬ホールディングス	38,900	7,650.00	297,585,000
大日本塗料	93,000	151.00	14,043,000
日本ペイントホールディングス	140,000	3,610.00	505,400,000
関西ペイント	196,000	1,979.00	387,884,000
神東塗料	11,000	214.00	2,354,000
中国塗料	46,000	950.00	43,700,000
日本特殊塗料	12,600	772.00	9,727,200
藤倉化成	22,300	573.00	12,777,900
太陽ホールディングス	13,200	4,320.00	57,024,000
D I C	648,000	295.00	191,160,000
サカタインクス	33,100	1,203.00	39,819,300
東洋インキS Cホールディングス	160,000	549.00	87,840,000
T & K T O K A	5,500	2,203.00	12,116,500
アルプス技研	6,500	1,461.00	9,496,500
サニックス	18,700	407.00	7,610,900
ダイオーズ	3,600	915.00	3,294,000
日本空調サービス	8,000	837.00	6,696,000
オリエンタルランド	43,600	27,430.00	1,195,948,000
ダスキン	45,700	1,956.00	89,389,200
パーク24	76,600	2,087.00	159,864,200
明光ネットワークジャパン	16,100	1,207.00	19,432,700
ファルコホールディングス	7,800	1,291.00	10,069,800
クレスコ	3,500	1,742.00	6,097,000

フジ・メディア・ホールディングス	158,700	1,481.00	235,034,700	
秀英予備校	3,500	301.00	1,053,500	
田谷	3,200	807.00	2,582,400	
ラウンドワン	45,700	712.00	32,538,400	
リゾートトラスト	59,500	2,691.00	160,114,500	
オービック	52,500	4,210.00	221,025,000	
ジャストシステム	20,800	678.00	14,102,400	
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,500	1,019.00	3,566,500	
ヤフー	1,092,300	423.00	462,042,900	
ビー・エム・エル	9,500	3,165.00	30,067,500	
ワタベウェディング	5,400	510.00	2,754,000	
トレンドマイクロ	80,700	3,415.00	275,590,500	
もしもしホットライン	30,000	1,296.00	38,880,000	
インフォメーション・ディベロプメント	3,000	915.00	2,745,000	
リソー教育	24,800	256.00	6,348,800	
日本オラクル	24,400	5,010.00	122,244,000	
早稲田アカデミー	2,900	804.00	2,331,600	
アルファシステムズ	5,000	1,586.00	7,930,000	
フューチャーアーキテクト	16,200	693.00	11,226,600	
CAC Holdings	10,400	1,161.00	12,074,400	
ソフトバンク・テクノロジー	4,100	1,184.00	4,854,400	
トーセ	3,900	751.00	2,928,900	
ユー・エス・エス	195,300	1,922.00	375,366,600	
オービックビジネスコンサルタント	9,700	3,770.00	36,569,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	17,300	4,665.00	80,704,500	
アイティフォー	18,500	460.00	8,510,000	
東京個別指導学院	7,900	357.00	2,820,300	
東計電算	2,800	1,680.00	4,704,000	
サイバーエージェント	29,600	5,490.00	162,504,000	
楽天	700,400	1,667.00	1,167,566,800	
エクスネット	1,600	1,469.00	2,350,400	
テー・オー・ダブリュー	5,400	876.00	4,730,400	
大塚商会	41,000	4,655.00	190,855,000	
総合メディカル	3,700	5,760.00	21,312,000	
サイボウズ	20,400	354.00	7,221,600	
ソフトブレーン	20,700	188.00	3,891,600	
セントラルスポーツ	5,600	2,008.00	11,244,800	
バラカ	5,700	1,149.00	6,549,300	
電通国際情報サービス	9,400	1,141.00	10,725,400	
イーエムシステムズ	1,800	1,644.00	2,959,200	
ウェザーニューズ	4,600	3,100.00	14,260,000	
C I J	13,200	457.00	6,032,400	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,600	1,352.00	2,163,200	
日本エンタープライズ	9,700	383.00	3,715,100	
WOWOW	3,600	5,610.00	20,196,000	
フルキャストホールディングス	16,600	463.00	7,685,800	
富士フイルムホールディングス	370,200	4,016.50	1,486,908,300	
コニカミノルタ	368,000	1,180.00	434,240,000	

資生堂	287,700	1,915.50	551,089,350	
ライオン	187,000	623.00	116,501,000	
高砂香料工業	53,000	582.00	30,846,000	
マンダム	16,200	3,845.00	62,289,000	
ミルボン	9,600	3,325.00	31,920,000	
ファンケル	37,500	1,697.00	63,637,500	
コーセー	26,100	5,310.00	138,591,000	
コタ	4,700	1,881.00	8,840,700	
ドクターシーラボ	11,000	3,850.00	42,350,000	
シーボン	1,600	2,682.00	4,291,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	19,200	5,040.00	96,768,000	
ノエビアホールディングス	10,800	2,169.00	23,425,200	
アジュバンコスメジャパン	3,100	945.00	2,929,500	
エステー	11,300	1,016.00	11,480,800	
アグロ カネショウ	4,400	1,165.00	5,126,000	
コニシ	12,700	1,970.00	25,019,000	
長谷川香料	20,600	1,687.00	34,752,200	
星光PMC	8,900	916.00	8,152,400	
小林製薬	26,500	7,940.00	210,410,000	
荒川化学工業	13,700	1,335.00	18,289,500	
メック	12,600	884.00	11,138,400	
日本高純度化学	4,700	2,428.00	11,411,600	
JCU	4,400	5,420.00	23,848,000	
新田ゼラチン	9,900	704.00	6,969,600	
アース製薬	11,600	4,100.00	47,560,000	
イハラケミカル工業	24,900	1,323.00	32,942,700	
北興化学工業	18,000	408.00	7,344,000	
大成ラミック	4,600	2,849.00	13,105,400	
クミアイ化学工業	34,000	883.00	30,022,000	
日本農薬	37,000	1,381.00	51,097,000	
昭和シェル石油	144,500	1,174.00	169,643,000	
コスモ石油	447,000	169.00	75,543,000	
富士興産	6,200	601.00	3,726,200	
ニチレキ	20,000	927.00	18,540,000	
東燃ゼネラル石油	244,000	1,081.00	263,764,000	
ユシロ化学工業	9,500	1,556.00	14,782,000	
ビービー・カストロール	6,600	1,288.00	8,500,800	
富士石油	37,500	363.00	13,612,500	
MORESCO	4,200	2,147.00	9,017,400	
出光興産	76,700	2,081.00	159,612,700	
JXホールディングス	1,794,900	468.80	841,449,120	
横浜ゴム	181,000	1,105.00	200,005,000	
東洋ゴム工業	73,200	2,349.00	171,946,800	
ブリヂストン	506,900	4,559.00	2,310,957,100	
住友ゴム工業	126,100	1,792.00	225,971,200	
藤倉ゴム工業	13,500	805.00	10,867,500	
オカモト	55,000	459.00	25,245,000	
アキレス	138,000	152.00	20,976,000	
フコク	6,800	1,156.00	7,860,800	
ニッタ	16,000	2,846.00	45,536,000	

クリエートメディック	5,300	1,010.00	5,353,000	
住友理工	29,900	975.00	29,152,500	
三ツ星ベルト	41,000	972.00	39,852,000	
バンドー化学	59,000	431.00	25,429,000	
鬼怒川ゴム工業	36,000	483.00	17,388,000	
旭硝子	797,000	695.00	553,915,000	
日本板硝子	780,000	111.00	86,580,000	
石塚硝子	21,000	227.00	4,767,000	
有沢製作所	27,100	931.00	25,230,100	
日本山村硝子	65,000	169.00	10,985,000	
日本電気硝子	310,000	546.00	169,260,000	
オハラ	6,400	573.00	3,667,200	
住友大阪セメント	300,000	355.00	106,500,000	
太平洋セメント	1,009,000	360.00	363,240,000	
デイ・シイ	16,600	493.00	8,183,800	
リゾートソリューション	17,000	254.00	4,318,000	
日本ヒューム	16,900	857.00	14,483,300	
日本コンクリート工業	27,700	562.00	15,567,400	
三谷セキサン	8,100	2,050.00	16,605,000	
ジャパンパイル	21,600	729.00	15,746,400	
東海カーボン	140,000	360.00	50,400,000	
日本カーボン	85,000	252.00	21,420,000	
東洋炭素	9,000	1,943.00	17,487,000	
ノリタケカンパニーリミテド	91,000	291.00	26,481,000	
TOTO	238,000	1,492.00	355,096,000	
日本碍子	204,000	2,139.00	436,356,000	
日本特殊陶業	139,400	3,390.00	472,566,000	
ダントーホールディングス	22,000	151.00	3,322,000	
MARUWA	4,700	2,576.00	12,107,200	
品川リフラクトリーズ	41,000	267.00	10,947,000	
黒崎播磨	35,000	243.00	8,505,000	
ヨータイ	9,000	373.00	3,357,000	
イソライト工業	7,400	217.00	1,605,800	
東京窯業	20,000	221.00	4,420,000	
ニッカトー	6,200	410.00	2,542,000	
フジミインコーポレーテッド	16,200	1,774.00	28,738,800	
エーアンドエーマテリアル	34,000	112.00	3,808,000	
ニチアス	72,000	658.00	47,376,000	
新日鐵住金	6,835,000	296.50	2,026,577,500	
神戸製鋼所	2,795,000	213.00	595,335,000	
中山製鋼所	121,000	83.00	10,043,000	
合同製鐵	82,000	187.00	15,334,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	412,500	2,683.00	1,106,737,500	
日新製鋼	68,500	1,467.00	100,489,500	
東京製鐵	81,800	885.00	72,393,000	
共英製鋼	17,200	2,088.00	35,913,600	
大和工業	36,800	2,973.00	109,406,400	
東京鐵鋼	31,000	543.00	16,833,000	
大阪製鐵	10,200	2,069.00	21,103,800	

淀川製鋼所	115,000	453.00	52,095,000	
東洋鋼鈑	39,000	567.00	22,113,000	
丸一鋼管	49,600	2,776.00	137,689,600	
モリ工業	26,000	421.00	10,946,000	
大同特殊鋼	271,000	536.00	145,256,000	
日本高周波鋼業	63,000	113.00	7,119,000	
日本冶金工業	126,100	244.00	30,768,400	
山陽特殊製鋼	96,000	454.00	43,584,000	
愛知製鋼	95,000	550.00	52,250,000	
日立金属	165,000	1,850.00	305,250,000	
日本金属	42,000	146.00	6,132,000	
大平洋金属	103,000	361.00	37,183,000	
新日本電工	98,500	301.00	29,648,500	
栗本鐵工所	84,000	213.00	17,892,000	
虹 技	23,000	212.00	4,876,000	
日本鑄鉄管	16,000	235.00	3,760,000	
日本製鋼所	231,000	500.00	115,500,000	
三菱製鋼	105,000	244.00	25,620,000	
日亜鋼業	22,000	336.00	7,392,000	
日本精線	12,000	658.00	7,896,000	
大紀アルミニウム工業所	27,000	328.00	8,856,000	
日本軽金属ホールディングス	392,200	175.00	68,635,000	
三井金属鉱業	440,000	258.00	113,520,000	
東邦亜鉛	91,000	395.00	35,945,000	
三菱マテリアル	1,009,000	402.00	405,618,000	
住友金属鉱山	446,000	1,787.50	797,225,000	
DOWAホールディングス	193,000	986.00	190,298,000	
古河機械金属	252,000	204.00	51,408,000	
エス・サイエンス	78,300	48.00	3,758,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,900	2,502.00	39,781,800	
東邦チタニウム	27,300	780.00	21,294,000	
U A C J	185,000	322.00	59,570,000	
古河電気工業	474,000	206.00	97,644,000	
住友電気工業	609,200	1,441.00	877,857,200	
フジクラ	225,000	488.00	109,800,000	
昭和電線ホールディングス	178,000	99.00	17,622,000	
東京特殊電線	2,300	1,410.00	3,243,000	
タツタ電線	30,300	489.00	14,816,700	
沖電線	17,000	334.00	5,678,000	
カナレ電気	2,600	2,224.00	5,782,400	
平河ヒューテック	3,800	1,252.00	4,757,600	
リョービ	91,000	316.00	28,756,000	
アーレスティ	14,100	621.00	8,756,100	
アサヒホールディングス	24,400	1,892.00	46,164,800	
東洋製罐グループホールディングス	114,800	1,475.00	169,330,000	
ホッカンホールディングス	39,000	279.00	10,881,000	
コロナ	8,500	1,128.00	9,588,000	
横河ブリッジホールディングス	30,600	1,273.00	38,953,800	
OSJBホールディングス	23,500	277.00	6,509,500	
駒井ハルテック	29,000	275.00	7,975,000	

高田機工	14,000	240.00	3,360,000
三和ホールディングス	155,900	790.00	123,161,000
文化シャッター	45,000	923.00	41,535,000
三協立山	19,700	1,908.00	37,587,600
アルインコ	6,800	1,080.00	7,344,000
東洋シャッター	4,100	815.00	3,341,500
L I X I Lグループ	240,200	2,600.00	624,520,000
日本フィルコン	11,900	463.00	5,509,700
ノーリツ	31,700	1,974.00	62,575,800
長府製作所	17,300	3,020.00	52,246,000
リンナイ	30,100	8,380.00	252,238,000
ユニプレス	29,700	2,043.00	60,677,100
ダイニチ工業	8,300	770.00	6,391,000
日東精工	23,000	376.00	8,648,000
三洋工業	21,000	210.00	4,410,000
岡部	31,900	1,043.00	33,271,700
ジーテクト	11,100	1,049.00	11,643,900
中国工業	2,700	820.00	2,214,000
東プレ	31,100	1,676.00	52,123,600
高周波熱錬	27,900	862.00	24,049,800
東京製綱	109,000	216.00	23,544,000
モリテックスチール	8,500	316.00	2,686,000
パイオラックス	8,200	5,360.00	43,952,000
日本発条	140,400	1,198.00	168,199,200
中央発條	21,000	337.00	7,077,000
アドバネクス	30,000	178.00	5,340,000
三浦工業	72,100	1,275.00	91,927,500
タクマ	55,000	869.00	47,795,000
テクノプロ・ホールディング	17,200	2,280.00	39,216,000
リブセンス	9,400	764.00	7,181,600
ジャパンマテリアル	6,500	1,680.00	10,920,000
ウチヤマホールディングス	7,100	586.00	4,160,600
サクセスホールディングス	1,300	1,245.00	1,618,500
アサンテ	4,000	1,250.00	5,000,000
E R Iホールディングス	3,900	980.00	3,822,000
リクルートホールディングス	183,000	3,500.00	640,500,000
ツガミ	47,000	694.00	32,618,000
オークマ	105,000	1,130.00	118,650,000
東芝機械	88,000	453.00	39,864,000
アマダ	240,900	1,094.00	263,544,600
アイダエンジニアリング	35,300	1,213.00	42,818,900
滝澤鉄工所	50,000	209.00	10,450,000
富士機械製造	52,800	1,114.00	58,819,200
牧野フライス製作所	80,000	1,001.00	80,080,000
オーエスジー	73,600	2,233.00	164,348,800
ダイジェット工業	19,000	220.00	4,180,000
旭ダイヤモンド工業	44,300	1,299.00	57,545,700
D M G森精機	102,000	1,612.00	164,424,000
ディスコ	18,000	10,320.00	185,760,000
日東工器	9,400	2,191.00	20,595,400

パンチ工業	3,600	1,473.00	5,302,800
豊田自動織機	140,600	6,240.00	877,344,000
豊和工業	9,100	748.00	6,806,800
大阪機工	62,000	157.00	9,734,000
石川製作所	40,000	102.00	4,080,000
東洋機械金属	11,000	453.00	4,983,000
津田駒工業	39,000	155.00	6,045,000
エンシュウ	40,000	114.00	4,560,000
島精機製作所	22,800	1,908.00	43,502,400
日阪製作所	20,400	962.00	19,624,800
やまびこ	6,300	4,990.00	31,437,000
ペガサスミシン製造	14,100	557.00	7,853,700
ナプテスコ	98,400	3,065.00	301,596,000
三井海洋開発	16,200	2,039.00	33,031,800
レオン自動機	12,000	492.00	5,904,000
S M C	48,400	31,500.00	1,524,600,000
新川	13,500	698.00	9,423,000
ホソカワミクロン	27,000	721.00	19,467,000
ユニオンツール	8,000	3,285.00	26,280,000
オイレス工業	20,200	2,029.00	40,985,800
日精エー・エス・ビー機械	5,100	2,847.00	14,519,700
サトーホールディングス	20,100	2,485.00	49,948,500
日本エアテック	4,700	676.00	3,177,200
日精樹脂工業	11,700	1,362.00	15,935,400
ワイエイシイ	6,600	630.00	4,158,000
小松製作所	801,500	2,436.00	1,952,454,000
住友重機械工業	442,000	689.00	304,538,000
日立建機	72,200	2,206.00	159,273,200
日工	22,000	396.00	8,712,000
巴工業	6,100	1,708.00	10,418,800
井関農機	165,000	221.00	36,465,000
T O W A	13,200	736.00	9,715,200
丸山製作所	36,000	223.00	8,028,000
北川鉄工所	74,000	239.00	17,686,000
シンニッタン	16,700	530.00	8,851,000
クボタ	779,000	1,789.00	1,393,631,000
荏原実業	4,900	1,404.00	6,879,600
東洋エンジニアリング	83,000	364.00	30,212,000
三菱化工機	53,000	440.00	23,320,000
月島機械	28,500	1,297.00	36,964,500
帝国電機製作所	10,800	1,172.00	12,657,600
東京機械製作所	61,000	72.00	4,392,000
新東工業	38,000	801.00	30,438,000
澁谷工業	13,500	2,237.00	30,199,500
アイチコーポレーション	23,000	590.00	13,570,000
小森コーポレーション	39,300	1,210.00	47,553,000
鶴見製作所	12,000	1,997.00	23,964,000
住友精密工業	26,000	481.00	12,506,000
酒井重工業	31,000	303.00	9,393,000
荏原製作所	335,000	493.00	165,155,000

石井鐵工所	24,000	220.00	5,280,000
西島製作所	15,800	905.00	14,299,000
北越工業	11,900	1,088.00	12,947,200
千代田化工建設	125,000	985.00	123,125,000
ダイキン工業	224,900	8,126.00	1,827,537,400
オルガノ	31,000	481.00	14,911,000
トーヨーカネツ	93,000	243.00	22,599,000
栗田工業	91,400	2,729.00	249,430,600
椿本チエイン	83,000	961.00	79,763,000
大同工業	32,000	257.00	8,224,000
日本コンベヤ	50,000	225.00	11,250,000
日機装	50,000	952.00	47,600,000
木村化工機	14,900	486.00	7,241,400
新興ブランテック	35,600	886.00	31,541,600
アネスト岩田	24,200	801.00	19,384,200
ダイフク	76,300	1,385.00	105,675,500
サムコ	2,100	1,085.00	2,278,500
加藤製作所	34,000	917.00	31,178,000
油研工業	31,000	246.00	7,626,000
タダノ	75,000	1,436.00	107,700,000
フジテック	45,000	1,212.00	54,540,000
C K D	43,300	1,087.00	47,067,100
キトー	16,900	1,164.00	19,671,600
平和	33,500	2,387.00	79,964,500
理想科学工業	18,800	1,841.00	34,610,800
S A N K Y O	46,800	4,420.00	206,856,000
日本金銭機械	14,200	1,697.00	24,097,400
マースエンジニアリング	8,800	2,160.00	19,008,000
福島工業	8,500	1,797.00	15,274,500
オーイズミ	5,400	841.00	4,541,400
ダイコク電機	6,400	1,876.00	12,006,400
アマノ	51,500	1,324.00	68,186,000
J U K I	115,000	382.00	43,930,000
サンデン	94,000	604.00	56,776,000
蛇の目ミシン工業	150,000	146.00	21,900,000
ブラザー工業	199,600	1,893.00	377,842,800
マックス	24,000	1,318.00	31,632,000
モリタホールディングス	27,000	1,259.00	33,993,000
グローリー	49,400	2,982.00	147,310,800
新晃工業	10,800	1,300.00	14,040,000
大和冷機工業	22,400	717.00	16,060,800
セガサミーホールディングス	165,900	1,639.00	271,910,100
日本ビストンリング	60,000	248.00	14,880,000
リケン	67,000	466.00	31,222,000
T P R	17,200	2,825.00	48,590,000
ホシザキ電機	33,800	6,170.00	208,546,000
大豊工業	12,500	1,287.00	16,087,500
日本精工	317,000	1,472.00	466,624,000
N T N	357,000	545.00	194,565,000
ジェイテクト	164,600	1,743.00	286,897,800

不二越	143,000	646.00	92,378,000	
ミネベア	230,000	1,765.00	405,950,000	
日本トムソン	53,000	583.00	30,899,000	
T H K	102,700	2,698.00	277,084,600	
ユーシン精機	6,800	2,321.00	15,782,800	
前澤給装工業	6,100	1,421.00	8,668,100	
イーグル工業	21,500	2,211.00	47,536,500	
前澤工業	11,500	322.00	3,703,000	
日本ピラー工業	16,800	903.00	15,170,400	
キッツ	69,200	590.00	40,828,000	
日立製作所	3,708,000	798.70	2,961,579,600	
東芝	3,251,000	479.10	1,557,554,100	
三菱電機	1,544,000	1,304.50	2,014,148,000	
富士電機	430,000	516.00	221,880,000	
東洋電機製造	33,000	422.00	13,926,000	
安川電機	181,500	1,508.00	273,702,000	
シンフォニア テクノロジー	107,000	191.00	20,437,000	
明電舎	142,000	368.00	52,256,000	
オリジン電気	22,000	494.00	10,868,000	
山洋電気	34,000	814.00	27,676,000	
デンヨー	14,000	1,940.00	27,160,000	
日立工機	41,300	867.00	35,807,100	
三櫻工業	19,900	768.00	15,283,200	
マキタ	100,700	5,380.00	541,766,000	
東芝テック	111,000	721.00	80,031,000	
芝浦メカトロニクス	25,000	285.00	7,125,000	
マブチモーター	47,200	5,000.00	236,000,000	
日本電産	167,000	8,218.00	1,372,406,000	
東光高岳	7,800	1,763.00	13,751,400	
宮越ホールディングス	5,200	466.00	2,423,200	
ダイヘン	84,000	557.00	46,788,000	
ヤーマン	2,100	1,551.00	3,257,100	
J V Cケンウッド	113,300	360.00	40,788,000	
第一精工	5,600	1,997.00	11,183,200	
日新電機	36,000	709.00	25,524,000	
大崎電気工業	24,000	776.00	18,624,000	
オムロン	166,700	4,825.00	804,327,500	
日東工業	24,700	2,134.00	52,709,800	
I D E C	18,400	988.00	18,179,200	
不二電機工業	1,500	1,544.00	2,316,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	298,000	520.00	154,960,000	
サクサホールディングス	39,000	208.00	8,112,000	
メルコホールディングス	8,500	1,899.00	16,141,500	
テクノメディカ	3,500	2,445.00	8,557,500	
日本電気	1,998,000	331.00	661,338,000	
富士通	1,489,000	732.90	1,091,288,100	
沖電気工業	534,000	250.00	133,500,000	
岩崎通信機	68,000	97.00	6,596,000	
電気興業	44,000	532.00	23,408,000	

サンケン電気	78,000	958.00	74,724,000	
ナカヨ	15,000	380.00	5,700,000	
アイホン	9,000	1,863.00	16,767,000	
ルネサスエレクトロニクス	79,900	917.00	73,268,300	
セイコーエプソン	105,400	4,255.00	448,477,000	
ワコム	121,500	609.00	73,993,500	
アルバック	28,400	1,649.00	46,831,600	
アクセル	7,200	1,683.00	12,117,600	
E I Z O	14,200	2,565.00	36,423,000	
ジャパンディスプレイ	237,800	428.00	101,778,400	
日本信号	42,600	1,209.00	51,503,400	
京三製作所	36,000	368.00	13,248,000	
能美防災	20,400	1,460.00	29,784,000	
ホーチキ	11,000	889.00	9,779,000	
エレコム	4,800	2,336.00	11,212,800	
日本無線	33,000	354.00	11,682,000	
パナソニック	1,882,100	1,318.50	2,481,548,850	
シャープ	1,305,000	238.00	310,590,000	
アンリツ	96,500	809.00	78,068,500	
富士通ゼネラル	47,000	1,154.00	54,238,000	
日立国際電気	40,000	1,501.00	60,040,000	
ソニー	999,000	3,064.00	3,060,936,000	
T D K	93,200	7,680.00	715,776,000	
帝国通信工業	37,000	228.00	8,436,000	
ミツミ電機	54,500	846.00	46,107,000	
タムラ製作所	60,000	395.00	23,700,000	
アルプス電気	121,900	2,399.00	292,438,100	
池上通信機	53,000	169.00	8,957,000	
パイオニア	232,000	236.00	54,752,000	
日本電波工業	14,000	940.00	13,160,000	
鈴木	1,900	897.00	1,704,300	
日本トリム	3,700	3,050.00	11,285,000	
ローランド ディー . ジー .	6,200	3,275.00	20,305,000	
日本コロムビア	5,300	402.00	2,130,600	
フォスター電機	15,800	2,254.00	35,613,200	
クラリオン	81,000	357.00	28,917,000	
S M K	45,000	474.00	21,330,000	
ヨコオ	12,100	648.00	7,840,800	
東光	36,000	329.00	11,844,000	
ティアック	83,000	57.00	4,731,000	
ホシデン	48,800	624.00	30,451,200	
ヒロセ電機	24,900	13,740.00	342,126,000	
日本航空電子工業	44,000	2,649.00	116,556,000	
T O A	16,600	1,163.00	19,305,800	
日立マクセル	23,000	1,943.00	44,689,000	
古野電気	18,400	1,131.00	20,810,400	
ユニデン	42,000	223.00	9,366,000	
アルパイン	36,800	1,826.00	67,196,800	
スミダコーポレーション	13,800	779.00	10,750,200	
アイコム	8,600	2,649.00	22,781,400	

リオン	4,400	1,469.00	6,463,600	
船井電機	15,600	1,346.00	20,997,600	
横河電機	154,600	1,300.00	200,980,000	
新電元工業	59,000	645.00	38,055,000	
アズビル	50,400	3,005.00	151,452,000	
東亜ディーケーケー	6,500	612.00	3,978,000	
日本光電工業	32,900	5,560.00	182,924,000	
チノー	5,500	1,186.00	6,523,000	
共和電業	18,900	453.00	8,561,700	
日本電子材料	6,600	657.00	4,336,200	
堀場製作所	28,500	3,825.00	109,012,500	
アドバンテスト	105,300	1,526.00	160,687,800	
小野測器	7,800	912.00	7,113,600	
エスベック	17,100	1,058.00	18,091,800	
パナソニック デバイスSUNX	13,500	854.00	11,529,000	
キーエンス	35,000	57,200.00	2,002,000,000	
日置電機	8,100	1,799.00	14,571,900	
シスメックス	119,500	5,490.00	656,055,000	
メガチップス	16,200	1,470.00	23,814,000	
OBARA GROUP	10,000	5,670.00	56,700,000	
イマジカ・ロボット ホールディング クス	8,000	507.00	4,056,000	
澤藤電機	10,000	225.00	2,250,000	
デンソー	381,600	5,451.00	2,080,101,600	
コーセル	22,500	1,271.00	28,597,500	
新日本無線	11,000	473.00	5,203,000	
オプテックス	10,600	1,887.00	20,002,200	
千代田インテグレ	6,800	2,105.00	14,314,000	
レーザーテック	15,800	1,373.00	21,693,400	
スタンレー電気	111,200	2,822.00	313,806,400	
岩崎電気	53,000	226.00	11,978,000	
ウシオ電機	93,700	1,496.00	140,175,200	
岡谷電機産業	8,700	445.00	3,871,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	14,200	434.00	6,162,800	
日本セラミック	8,900	1,604.00	14,275,600	
遠藤照明	7,100	1,341.00	9,521,100	
日本デジタル研究所	13,100	1,481.00	19,401,100	
古河電池	11,000	957.00	10,527,000	
双信電機	7,700	403.00	3,103,100	
山一電機	17,900	813.00	14,552,700	
図研	11,200	1,145.00	12,824,000	
日本電子	66,000	529.00	34,914,000	
カシオ計算機	154,800	1,856.00	287,308,800	
ファナック	160,800	20,035.00	3,221,628,000	
日本シイエムケイ	39,400	312.00	12,292,800	
エンプラス	7,000	4,460.00	31,220,000	
大真空	28,000	338.00	9,464,000	
ローム	76,100	7,140.00	543,354,000	
浜松ホトニクス	64,300	5,680.00	365,224,000	
三井ハイテック	20,400	807.00	16,462,800	

新光電気工業	58,300	881.00	51,362,300	
京セラ	253,500	5,485.00	1,390,447,500	
協栄産業	19,000	201.00	3,819,000	
太陽誘電	80,900	1,283.00	103,794,700	
村田製作所	162,000	12,780.00	2,070,360,000	
ユーシン	21,600	715.00	15,444,000	
双葉電子工業	26,400	1,923.00	50,767,200	
日東電工	125,000	7,349.00	918,625,000	
北陸電気工業	67,000	182.00	12,194,000	
東海理化電機製作所	40,700	2,438.00	99,226,600	
ニチコン	48,600	975.00	47,385,000	
日本ケミコン	125,000	368.00	46,000,000	
K O A	21,300	1,119.00	23,834,700	
三井造船	598,000	199.00	119,002,000	
日立造船	120,700	669.00	80,748,300	
三菱重工業	2,588,000	623.60	1,613,876,800	
川崎重工業	1,122,000	558.00	626,076,000	
I H I	1,113,000	548.00	609,924,000	
名村造船所	43,000	1,072.00	46,096,000	
サノヤスホールディングス	18,800	287.00	5,395,600	
日本車輛製造	56,000	363.00	20,328,000	
ニチユ三菱フォークリフト	17,800	680.00	12,104,000	
近畿車輛	23,000	334.00	7,682,000	
F P G	13,100	2,482.00	32,514,200	
島根銀行	3,500	1,430.00	5,005,000	
じもとホールディングス	109,400	220.00	24,068,000	
全国保証	39,600	3,885.00	153,846,000	
足利ホールディングス	95,800	484.00	46,367,200	
東京T Yフィナンシャルグループ	19,600	3,475.00	68,110,000	
日産自動車	2,167,900	1,064.00	2,306,645,600	
いすゞ自動車	488,300	1,600.00	781,280,000	
トヨタ自動車	2,130,800	7,700.00	16,407,160,000	*
日野自動車	220,500	1,668.00	367,794,000	
三菱自動車工業	566,100	1,010.00	571,761,000	
エフテック	8,900	1,170.00	10,413,000	
レシップホールディングス	5,100	862.00	4,396,200	
G M B	2,400	1,294.00	3,105,600	
武蔵精密工業	16,500	2,527.00	41,695,500	
日産車体	67,900	1,363.00	92,547,700	
新明和工業	62,000	1,195.00	74,090,000	
極東開発工業	28,700	1,290.00	37,023,000	
日信工業	28,300	1,853.00	52,439,900	
トピー工業	127,000	295.00	37,465,000	
ティラド	60,000	245.00	14,700,000	
曙ブレーキ工業	65,500	422.00	27,641,000	
タチエス	24,500	1,664.00	40,768,000	
N O K	74,700	3,265.00	243,895,500	
フタバ産業	47,200	562.00	26,526,400	
カヤバ工業	173,000	442.00	76,466,000	
シロキ工業	35,000	319.00	11,165,000	

市光工業	37,000	239.00	8,843,000	
大同メタル工業	22,000	1,097.00	24,134,000	
プレス工業	77,000	419.00	32,263,000	
カルソニックカンセイ	118,000	652.00	76,936,000	
太平洋工業	31,600	993.00	31,378,800	
ケーヒン	35,500	1,844.00	65,462,000	
河西工業	19,000	969.00	18,411,000	
アイシン精機	141,300	4,235.00	598,405,500	
富士機工	18,000	490.00	8,820,000	
マツダ	460,300	2,416.50	1,112,314,950	
ダイハツ工業	184,400	1,660.00	306,104,000	
今仙電機製作所	13,100	1,512.00	19,807,200	
本田技研工業	1,389,800	3,820.50	5,309,730,900	
スズキ	322,900	3,474.00	1,121,754,600	
富士重工業	525,600	3,983.00	2,093,464,800	
安永	5,300	614.00	3,254,200	
ヤマハ発動機	234,900	2,397.00	563,055,300	
ショーワ	36,500	1,191.00	43,471,500	
小糸製作所	92,500	3,565.00	329,762,500	
T B K	19,900	621.00	12,357,900	
エクセディ	21,000	2,627.00	55,167,000	
ミツバ	28,400	2,092.00	59,412,800	
豊田合成	49,900	2,528.00	126,147,200	
愛三工業	24,000	1,060.00	25,440,000	
盟和産業	13,000	151.00	1,963,000	
ヨロズ	14,400	2,286.00	32,918,400	
エフ・シー・シー	22,800	1,920.00	43,776,000	
新家工業	32,000	184.00	5,888,000	
シマノ	66,700	15,590.00	1,039,853,000	
タカタ	27,900	1,408.00	39,283,200	
テイ・エス テック	32,600	3,455.00	112,633,000	
小野建	13,200	987.00	13,028,400	
はるやま商事	6,400	738.00	4,723,200	
佐島電機	12,200	761.00	9,284,200	
カップ・クリエイトホールディングス	24,700	1,164.00	28,750,800	
エコートレーディング	4,000	666.00	2,664,000	
伯東	10,500	1,289.00	13,534,500	
コンドーテック	11,300	774.00	8,746,200	
中山福	8,900	888.00	7,903,200	
ライトオン	11,400	746.00	8,504,400	
ナガイレーベン	22,000	2,013.00	44,286,000	
ジーンズメイト	5,000	229.00	1,145,000	
三菱食品	16,800	2,536.00	42,604,800	
良品計画	18,800	13,000.00	244,400,000	
三城ホールディングス	19,100	475.00	9,072,500	
松田産業	11,400	1,356.00	15,458,400	
メディパルホールディングス	152,400	1,387.00	211,378,800	
アドヴァン	8,000	1,338.00	10,704,000	
S P K	3,400	2,051.00	6,973,400	

萩原電気	4,200	1,808.00	7,593,600	
アズワン	10,900	3,235.00	35,261,500	
スズデン	5,200	706.00	3,671,200	
尾家産業	5,600	842.00	4,715,200	
シモジマ	9,400	1,060.00	9,964,000	
ドウシシャ	19,900	1,992.00	39,640,800	
小津産業	3,100	1,998.00	6,193,800	
コナカ	17,900	656.00	11,742,400	
高速	9,200	899.00	8,270,800	
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,417.00	2,692,300	
G - 7ホールディングス	3,300	1,030.00	3,399,000	
たけびし	5,300	1,122.00	5,946,600	
イオン北海道	9,700	692.00	6,712,400	
コジマ	22,600	317.00	7,164,200	
ヒマラヤ	3,600	1,001.00	3,603,600	
コーナン商事	23,300	1,348.00	31,408,400	
黒田電気	25,700	1,712.00	43,998,400	
ネットワンシステムズ	61,900	783.00	48,467,700	
エコス	5,400	946.00	5,108,400	
ワタミ	18,000	1,209.00	21,762,000	
マルシェ	4,100	895.00	3,669,500	
ドンキホーテホールディングス	49,000	8,110.00	397,390,000	
丸文	13,500	784.00	10,584,000	
西松屋チェーン	30,000	957.00	28,710,000	
ゼンショーホールディングス	78,400	1,066.00	83,574,400	
ハピネット	9,200	1,410.00	12,972,000	
幸楽苑	9,600	1,580.00	15,168,000	
ハークスレイ	4,400	1,024.00	4,505,600	
橋本総業	2,800	1,413.00	3,956,400	
サイゼリヤ	22,500	2,098.00	47,205,000	
エクセル	7,000	1,304.00	9,128,000	
マルカキカイ	5,000	1,719.00	8,595,000	
アルゴグラフィックス	6,300	1,754.00	11,050,200	
ガリバーインターナショナル	46,200	926.00	42,781,200	
日本エム・ディ・エム	12,700	627.00	7,962,900	
ポプラ	4,200	558.00	2,343,600	
ユナイテッドアローズ	19,900	3,615.00	71,938,500	
進和	9,000	1,365.00	12,285,000	
エスケイジャパン	3,900	236.00	920,400	
ダイトエレクトロン	7,000	648.00	4,536,000	
ハイデイ日高	9,600	3,680.00	35,328,000	
シークス	9,700	2,452.00	23,784,400	
京都きもの友禅	9,800	1,006.00	9,858,800	
コロワイド	50,600	1,625.00	82,225,000	
田中商事	5,000	687.00	3,435,000	
オーハシテクニカ	9,400	1,577.00	14,823,800	
壺番屋	6,100	4,880.00	29,768,000	
マクニカ	7,800	3,490.00	27,222,000	
白銅	5,000	1,151.00	5,755,000	
トップカルチャー	6,200	496.00	3,075,200	

PLANT	3,900	1,279.00	4,988,100	
スギホールディングス	27,300	5,610.00	153,153,000	
島津製作所	185,000	1,211.00	224,035,000	
JMS	29,000	287.00	8,323,000	
クボテック	3,300	313.00	1,032,900	
ショットモリテックス	3,600	235.00	846,000	
長野計器	9,900	697.00	6,900,300	
ブイ・テクノロジー	3,000	2,271.00	6,813,000	
スター精密	29,300	1,490.00	43,657,000	
東京計器	53,000	285.00	15,105,000	
愛知時計電機	21,000	324.00	6,804,000	
オーバル	11,300	334.00	3,774,200	
東京精密	27,700	2,320.00	64,264,000	
マニー	4,300	7,070.00	30,401,000	
ニコン	288,300	1,415.00	407,944,500	
トプコン	46,600	2,293.00	106,853,800	
オリンパス	230,000	4,000.00	920,000,000	
理研計器	13,700	1,209.00	16,563,300	
SCREENホールディングス	146,000	698.00	101,908,000	
キャノン電子	14,200	2,171.00	30,828,200	
タムロン	11,900	2,341.00	27,857,900	
HOYA	367,500	4,491.00	1,650,442,500	
ノーリツ鋼機	14,000	669.00	9,366,000	
エー・アンド・デイ	14,000	471.00	6,594,000	
キャノン	895,400	3,732.50	3,342,080,500	
リコー	464,400	1,112.00	516,412,800	
シチズンホールディングス	190,100	952.00	180,975,200	
リズム時計工業	68,000	158.00	10,744,000	
大研医器	10,700	1,114.00	11,919,800	
パラマウントベッドホールディングス	16,300	3,180.00	51,834,000	
SHOBI	5,700	403.00	2,297,100	
前田工織	15,300	1,045.00	15,988,500	
永大産業	22,000	436.00	9,592,000	
アートネイチャー	11,200	1,090.00	12,208,000	
ダンロップスポーツ	9,800	1,336.00	13,092,800	
パンダイナムコホールディングス	170,300	2,415.00	411,274,500	
共立印刷	28,400	291.00	8,264,400	
フランスベッドホールディングス	108,000	183.00	19,764,000	
マーベラス	25,700	1,742.00	44,769,400	
パイロットコーポレーション	13,500	6,680.00	90,180,000	
萩原工業	3,300	1,941.00	6,405,300	
エイベックス・グループ・ホールディングス	30,200	1,837.00	55,477,400	
トッパン・フォームズ	27,600	1,251.00	34,527,600	
フジシールインターナショナル	18,700	3,565.00	66,665,500	
タカラトミー	55,500	641.00	35,575,500	
廣濟堂	14,500	473.00	6,858,500	
アーク	48,700	136.00	6,623,200	
レック	5,500	1,338.00	7,359,000	

タカノ	6,900	589.00	4,064,100	
プロネクサス	15,800	747.00	11,802,600	
ホクシン	13,100	129.00	1,689,900	
ウッドワン	27,000	273.00	7,371,000	
大建工業	63,000	278.00	17,514,000	
きもと	28,900	276.00	7,976,400	
凸版印刷	436,000	804.00	350,544,000	
大日本印刷	470,000	1,082.00	508,540,000	
図書印刷	25,000	330.00	8,250,000	
共同印刷	48,000	395.00	18,960,000	
日本写真印刷	25,900	1,906.00	49,365,400	
光村印刷	3,000	264.00	792,000	
藤森工業	13,900	3,530.00	49,067,000	
宝印刷	8,900	898.00	7,992,200	
前澤化成工業	11,500	1,284.00	14,766,000	
アシックス	153,400	2,866.00	439,644,400	
ツツミ	7,700	2,505.00	19,288,500	
J S P	12,100	2,408.00	29,136,800	
ニチハ	21,500	1,309.00	28,143,500	
エフピコ	14,300	3,920.00	56,056,000	
小松ウオール工業	4,700	2,487.00	11,688,900	
ヤマハ	113,500	1,767.00	200,554,500	
河合楽器製作所	5,400	2,370.00	12,798,000	
クリナップ	15,900	893.00	14,198,700	
ビジョン	29,200	7,580.00	221,336,000	
天馬	12,900	1,669.00	21,530,100	
兼松日産農林	24,000	154.00	3,696,000	
キングジム	13,100	770.00	10,087,000	
リンテック	36,700	2,557.00	93,841,900	
T A S A K I	2,900	1,850.00	5,365,000	
信越ポリマー	31,800	545.00	17,331,000	
東リ	43,000	249.00	10,707,000	
イトーキ	32,500	579.00	18,817,500	
任天堂	95,100	11,740.00	1,116,474,000	
三菱鉛筆	12,700	3,645.00	46,291,500	
松風	7,500	1,399.00	10,492,500	
タカラスタンダード	64,000	916.00	58,624,000	
コクヨ	80,300	904.00	72,591,200	
ナカバヤシ	34,000	220.00	7,480,000	
ニフコ	36,100	3,975.00	143,497,500	
グローブライド	75,000	180.00	13,500,000	
岡村製作所	59,300	863.00	51,175,900	
日本バルカー工業	67,000	312.00	20,904,000	
M U T O Hホールディングス	21,000	454.00	9,534,000	
伊藤忠商事	1,276,200	1,260.00	1,608,012,000	
丸紅	1,334,100	698.00	931,201,800	
スクロール	19,800	280.00	5,544,000	
高島	29,000	246.00	7,134,000	
ヨンドシーホールディングス	11,600	1,884.00	21,854,400	
三陽商会	85,000	277.00	23,545,000	

長瀬産業	93,000	1,494.00	138,942,000
ナイガイ	58,000	60.00	3,480,000
蝶理	9,800	1,907.00	18,688,600
豊田通商	169,900	2,964.00	503,583,600
オンワードホールディングス	116,000	786.00	91,176,000
三共生興	26,000	480.00	12,480,000
兼松	306,000	171.00	52,326,000
美津濃	83,000	582.00	48,306,000
ツカモトコーポレーション	28,000	136.00	3,808,000
ファミリーマート	51,500	5,310.00	273,465,000
ルック	28,000	223.00	6,244,000
三井物産	1,292,500	1,588.50	2,053,136,250
日本紙パルプ商事	79,000	334.00	26,386,000
東京エレクトロン	129,900	8,540.00	1,109,346,000
日立ハイテクノロジーズ	52,800	3,595.00	189,816,000
カメイ	20,000	778.00	15,560,000
東都水産	26,000	198.00	5,148,000
OUGホールディングス	26,000	230.00	5,980,000
スターゼン	59,000	407.00	24,013,000
セイコーホールディングス	109,000	614.00	66,926,000
山善	58,800	832.00	48,921,600
椿本興業	18,000	302.00	5,436,000
住友商事	899,900	1,225.00	1,102,377,500
日本ユニシス	42,100	1,134.00	47,741,400
内田洋行	37,000	361.00	13,357,000
三菱商事	1,168,400	2,223.00	2,597,353,200
第一実業	38,000	602.00	22,876,000
キヤノンマーケティングジャパン	43,500	2,108.00	91,698,000
西華産業	50,000	290.00	14,500,000
佐藤商事	13,800	755.00	10,419,000
菱洋エレクトロ	17,600	1,230.00	21,648,000
東京産業	15,300	474.00	7,252,200
ユアサ商事	13,400	2,390.00	32,026,000
神鋼商事	40,000	261.00	10,440,000
小林産業	11,400	250.00	2,850,000
阪和興業	153,000	452.00	69,156,000
カナデン	2,000	804.00	1,608,000
菱電商事	24,000	805.00	19,320,000
ニプロ	98,600	1,036.00	102,149,600
フルサト工業	8,400	1,612.00	13,540,800
岩谷産業	169,000	779.00	131,651,000
すてきなイスグループ	66,000	191.00	12,606,000
昭光通商	55,000	165.00	9,075,000
ニチモウ	25,000	198.00	4,950,000
極東貿易	18,000	223.00	4,014,000
イワキ	24,000	220.00	5,280,000
兼松エレクトロニクス	9,700	1,783.00	17,295,100
三愛石油	39,000	815.00	31,785,000
稲畑産業	36,900	1,084.00	39,999,600
G S Iクレオス	40,000	127.00	5,080,000

明和産業	12,300	445.00	5,473,500	
キムラタン	716,000	9.00	6,444,000	
ゴールドウイン	37,000	722.00	26,714,000	
ユニ・チャーム	327,400	3,116.50	1,020,342,100	
デサント	37,000	1,367.00	50,579,000	
キング	8,300	430.00	3,569,000	
ワキタ	32,500	1,107.00	35,977,500	
ヤマトインターナショナル	10,800	419.00	4,525,200	
東邦ホールディングス	52,500	1,879.00	98,647,500	
サンゲツ	28,900	3,145.00	90,890,500	
ミツウロコグループホールディングス	24,700	577.00	14,251,900	
シナネン	33,000	474.00	15,642,000	
伊藤忠エネクス	33,700	932.00	31,408,400	
サンリオ	42,700	3,115.00	133,010,500	
サンワ テクノス	9,700	1,235.00	11,979,500	
リョーサン	25,700	2,544.00	65,380,800	
新光商事	17,900	1,127.00	20,173,300	
トーヨー	36,000	439.00	15,804,000	
三信電気	21,100	846.00	17,850,600	
東陽テクニカ	22,300	1,153.00	25,711,900	
モスフードサービス	20,000	2,411.00	48,220,000	
加賀電子	13,800	1,331.00	18,367,800	
三益半導体工業	13,700	1,307.00	17,905,900	
ソーダニッカ	2,000	510.00	1,020,000	
立花エレテック	9,400	1,621.00	15,237,400	
木曽路	18,700	2,017.00	37,717,900	
サトレストランシステムズ	14,300	1,143.00	16,344,900	
千趣会	27,500	816.00	22,440,000	
タカキュー	10,700	220.00	2,354,000	
ケーヨー	28,800	575.00	16,560,000	
アデランス	17,900	1,026.00	18,365,400	
上新電機	33,000	965.00	31,845,000	
日本瓦斯	24,400	2,998.00	73,151,200	
ベスト電器	49,400	147.00	7,261,800	
マルエツ	37,000	500.00	18,500,000	
ロイヤルホールディングス	25,500	1,705.00	43,477,500	
東天紅	12,000	192.00	2,304,000	
いなげや	17,100	1,425.00	24,367,500	
島忠	36,900	3,010.00	111,069,000	
チヨダ	18,000	2,525.00	45,450,000	
ライフコーポレーション	9,600	1,696.00	16,281,600	
カスミ	31,300	973.00	30,454,900	
リンガーハット	14,900	2,230.00	33,227,000	
さが美	13,000	94.00	1,222,000	
MR MAX	15,500	280.00	4,340,000	
テンアライド	13,100	386.00	5,056,600	
AOKIホールディングス	35,000	1,437.00	50,295,000	
オークワ	24,000	970.00	23,280,000	
コメリ	26,100	2,520.00	65,772,000	

青山商事	38,300	4,020.00	153,966,000
しまむら	17,700	10,510.00	186,027,000
C F Sコーポレーション	10,200	839.00	8,557,800
はせがわ	5,500	540.00	2,970,000
高島屋	222,000	1,057.00	234,654,000
松屋	30,700	1,775.00	54,492,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	72,000	2,149.00	154,728,000
近鉄百貨店	58,000	338.00	19,604,000
丸栄	25,000	134.00	3,350,000
ニッセンホールディングス	32,100	318.00	10,207,800
パルコ	14,700	1,026.00	15,082,200
丸井グループ	183,300	1,179.00	216,110,700
クレディセゾン	124,500	2,090.00	260,205,000
アクシアル リテイリング	11,800	2,858.00	33,724,400
井筒屋	83,000	62.00	5,146,000
イオン	628,500	1,283.00	806,365,500
ユニーグループ・ホールディングス	146,200	693.00	101,316,600
イズミ	34,000	4,040.00	137,360,000
東武ストア	21,000	282.00	5,922,000
フォーバル	3,000	1,282.00	3,846,000
平和堂	30,900	2,483.00	76,724,700
フジ	17,000	2,165.00	36,805,000
ヤオコー	8,600	8,100.00	69,660,000
ゼビオ	20,700	1,952.00	40,406,400
ケーズホールディングス	35,100	3,345.00	117,409,500
P a l t a c	24,400	1,536.00	37,478,400
O l y m p i cグループ	9,100	834.00	7,589,400
日産東京販売ホールディングス	25,700	266.00	6,836,200
新生銀行	1,451,000	212.00	307,612,000
あおぞら銀行	1,029,000	408.00	419,832,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,229,600	679.90	8,314,905,040
りそなホールディングス	1,783,300	632.70	1,128,293,910
三井住友トラスト・ホールディングス	3,369,000	440.00	1,482,360,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,152,700	4,177.00	4,814,827,900
第四銀行	193,000	410.00	79,130,000
北越銀行	165,000	220.00	36,300,000
西日本シティ銀行	535,000	370.00	197,950,000
千葉銀行	588,000	817.00	480,396,000
横浜銀行	1,053,000	674.20	709,932,600
常陽銀行	553,000	610.00	337,330,000
群馬銀行	361,000	784.00	283,024,000
武蔵野銀行	24,300	3,995.00	97,078,500
千葉興業銀行	31,600	789.00	24,932,400
筑波銀行	63,400	364.00	23,077,600
七十七銀行	257,000	658.00	169,106,000
青森銀行	119,000	350.00	41,650,000
秋田銀行	101,000	336.00	33,936,000
山形銀行	92,000	506.00	46,552,000

岩手銀行	10,600	4,925.00	52,205,000
東邦銀行	136,000	430.00	58,480,000
東北銀行	83,000	159.00	13,197,000
みちのく銀行	76,000	212.00	16,112,000
ふくおかフィナンシャルグループ	618,000	581.00	359,058,000
静岡銀行	446,000	1,132.00	504,872,000
十六銀行	191,000	406.00	77,546,000
スルガ銀行	160,900	2,310.00	371,679,000
八十二銀行	276,000	794.00	219,144,000
山梨中央銀行	97,000	478.00	46,366,000
大垣共立銀行	191,000	386.00	73,726,000
福井銀行	131,000	270.00	35,370,000
北國銀行	170,000	395.00	67,150,000
清水銀行	5,200	2,879.00	14,970,800
滋賀銀行	153,000	682.00	104,346,000
南都銀行	147,000	403.00	59,241,000
百五銀行	146,000	510.00	74,460,000
京都銀行	291,000	1,025.00	298,275,000
紀陽銀行	59,800	1,519.00	90,836,200
三重銀行	68,000	267.00	18,156,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,036,000	252.00	261,072,000
広島銀行	450,000	593.00	266,850,000
山陰合同銀行	93,000	987.00	91,791,000
中国銀行	109,600	1,746.00	191,361,600
鳥取銀行	49,000	227.00	11,123,000
伊予銀行	163,000	1,372.00	223,636,000
百十四銀行	167,000	400.00	66,800,000
四国銀行	118,000	249.00	29,382,000
阿波銀行	125,000	649.00	81,125,000
鹿児島銀行	106,000	764.00	80,984,000
大分銀行	93,000	430.00	39,990,000
宮崎銀行	101,000	426.00	43,026,000
肥後銀行	124,000	667.00	82,708,000
佐賀銀行	93,000	268.00	24,924,000
十八銀行	94,000	331.00	31,114,000
沖縄銀行	12,100	4,925.00	59,592,500
琉球銀行	31,400	1,783.00	55,986,200
セブン銀行	513,900	546.00	280,589,400
みずほフィナンシャルグループ	21,068,300	199.90	4,211,553,170
高知銀行	59,000	150.00	8,850,000
山口フィナンシャルグループ	152,000	1,259.00	191,368,000
アクリーティブ	10,700	222.00	2,375,400
芙蓉総合リース	16,000	4,180.00	66,880,000
興銀リース	28,600	2,380.00	68,068,000
東京センチュリーリース	35,800	2,832.00	101,385,600
S B Iホールディングス	183,000	1,302.00	238,266,000
日本証券金融	72,100	607.00	43,764,700
アイフル	254,900	437.00	111,391,300
日本アジア投資	104,000	71.00	7,384,000
ポケットカード	11,400	541.00	6,167,400

長野銀行	51,000	203.00	10,353,000	
名古屋銀行	138,000	431.00	59,478,000	
北洋銀行	229,500	456.00	104,652,000	
愛知銀行	5,500	5,700.00	31,350,000	
第三銀行	86,000	193.00	16,598,000	
中京銀行	63,000	201.00	12,663,000	
東日本銀行	66,000	350.00	23,100,000	
大光銀行	54,000	225.00	12,150,000	
愛媛銀行	90,000	253.00	22,770,000	
トマト銀行	60,000	178.00	10,680,000	
みなと銀行	138,000	233.00	32,154,000	
京葉銀行	125,000	648.00	81,000,000	
関西アーバン銀行	21,200	1,220.00	25,864,000	
栃木銀行	77,000	579.00	44,583,000	
北日本銀行	4,800	2,937.00	14,097,600	
東和銀行	208,000	98.00	20,384,000	
福島銀行	188,000	88.00	16,544,000	
大東銀行	98,000	145.00	14,210,000	
リコーリース	12,000	3,195.00	38,340,000	
イオンフィナンシャルサービス	99,900	2,250.00	224,775,000	
アコム	306,100	368.00	112,644,800	
ジャックス	84,000	542.00	45,528,000	
オリエントコーポレーション	352,000	195.00	68,640,000	
日立キャピタル	29,900	2,475.00	74,002,500	
アプラスフィナンシャル	73,000	135.00	9,855,000	
オリックス	1,078,900	1,467.00	1,582,746,300	
三菱UFJリース	386,600	538.00	207,990,800	
ジャフコ	20,800	4,470.00	92,976,000	
トモニホールディングス	117,000	509.00	59,553,000	
大和証券グループ本社	1,426,000	851.90	1,214,809,400	
野村ホールディングス	3,116,000	643.40	2,004,834,400	
岡三証券グループ	130,000	840.00	109,200,000	
丸三証券	48,500	829.00	40,206,500	
東洋証券	61,000	351.00	21,411,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	174,900	755.00	132,049,500	
光世証券	36,000	220.00	7,920,000	
水戸証券	47,300	412.00	19,487,600	
いちよし証券	32,000	1,259.00	40,288,000	
松井証券	77,500	1,011.00	78,352,500	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	338,600	3,267.00	1,106,206,200	
だいこう証券ビジネス	7,400	770.00	5,698,000	
日本取引所グループ	223,800	2,890.00	646,782,000	
マネックスグループ	179,100	256.00	45,849,600	
カブドットコム証券	67,500	678.00	45,765,000	
極東証券	20,500	1,762.00	36,121,000	
岩井コスモホールディングス	15,600	1,377.00	21,481,200	
フィデアホールディングス	87,600	211.00	18,483,600	
池田泉州ホールディングス	125,800	536.00	67,428,800	

アニコム ホールディングス	6,300	1,729.00	10,892,700	
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	485,800	2,931.00	1,423,879,800	
マネースクウェアHD	4,700	1,308.00	6,147,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	146,000	1,738.00	253,748,000	
マネーパートナーズグループ	15,500	390.00	6,045,000	
小林洋行	5,200	317.00	1,648,400	
第一生命保険	976,500	1,720.00	1,679,580,000	
東京海上ホールディングス	627,300	4,076.50	2,557,188,450	
イー・ギャランティ	4,500	1,825.00	8,212,500	
アサックス	2,700	1,568.00	4,233,600	
NECキャピタルソリューション	6,200	1,786.00	11,073,200	
T & Dホールディングス	555,600	1,438.00	798,952,800	
三井不動産	808,000	3,126.00	2,525,808,000	
三菱地所	1,133,000	2,514.00	2,848,362,000	
平和不動産	28,800	1,672.00	48,153,600	
東京建物	332,000	849.00	281,868,000	
ダイビル	39,300	1,009.00	39,653,700	
京阪神ビルディング	25,600	677.00	17,331,200	
住友不動産	365,000	3,921.50	1,431,347,500	
太平洋興発	61,000	97.00	5,917,000	
大京	243,000	168.00	40,824,000	
テーオーシー	52,600	718.00	37,766,800	
東京楽天地	26,000	496.00	12,896,000	
レオパレス21	166,700	710.00	118,357,000	
スターツコーポレーション	17,500	1,664.00	29,120,000	
フジ住宅	19,700	671.00	13,218,700	
空港施設	18,500	690.00	12,765,000	
明和地所	8,900	477.00	4,245,300	
住友不動産販売	11,000	2,796.00	30,756,000	
ゴールドクレスト	13,700	1,814.00	24,851,800	
リロ・ホールディング	5,500	8,610.00	47,355,000	
日本エスリード	6,000	1,194.00	7,164,000	
日神不動産	20,400	476.00	9,710,400	
タカラレーベン	68,500	597.00	40,894,500	
サンヨーハウジング名古屋	8,700	1,272.00	11,066,400	
イオンモール	98,300	2,020.00	198,566,000	
ファースト住建	5,800	1,267.00	7,348,600	
ランド	59,000	22.00	1,298,000	
東祥	3,500	2,960.00	10,360,000	
トーセイ	20,800	724.00	15,059,200	
穴吹興産	14,000	249.00	3,486,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	94,700	1,149.00	108,810,300	
サンフロンティア不動産	16,400	915.00	15,006,000	
エフ・ジェー・ネクスト	11,700	544.00	6,364,800	
ランドビジネス	7,800	400.00	3,120,000	
グランディハウス	13,600	299.00	4,066,400	
東武鉄道	825,000	556.00	458,700,000	
相鉄ホールディングス	265,000	543.00	143,895,000	

東京急行電鉄	839,000	780.00	654,420,000	
京浜急行電鉄	423,000	886.00	374,778,000	
小田急電鉄	495,000	1,123.00	555,885,000	
京王電鉄	431,000	950.00	409,450,000	
京成電鉄	231,000	1,393.00	321,783,000	
富士急行	42,000	1,196.00	50,232,000	
新京成電鉄	21,000	403.00	8,463,000	
東日本旅客鉄道	283,000	9,140.00	2,586,620,000	
西日本旅客鉄道	148,600	6,267.00	931,276,200	
東海旅客鉄道	138,300	19,475.00	2,693,392,500	
西武ホールディングス	123,000	2,787.00	342,801,000	
鴻池運輸	9,500	2,359.00	22,410,500	
西日本鉄道	200,000	503.00	100,600,000	
ハマキョウレックス	4,800	4,205.00	20,184,000	
サカイ引越センター	2,600	3,725.00	9,685,000	
近畿日本鉄道	1,554,000	412.00	640,248,000	
阪急阪神ホールディングス	1,036,000	679.00	703,444,000	
南海電気鉄道	346,000	475.00	164,350,000	
京阪電気鉄道	346,000	696.00	240,816,000	
神戸電鉄	38,000	367.00	13,946,000	
名糖運輸	6,700	723.00	4,844,100	
名古屋鉄道	555,000	458.00	254,190,000	
山陽電気鉄道	57,000	470.00	26,790,000	
トランコム	4,500	5,040.00	22,680,000	
日本通運	611,000	646.00	394,706,000	
ヤマトホールディングス	271,500	2,692.00	730,878,000	
山九	188,000	461.00	86,668,000	
日新	59,000	301.00	17,759,000	
丸運	9,100	256.00	2,329,600	
丸全昭和運輸	52,000	390.00	20,280,000	
センコー	62,000	666.00	41,292,000	
トナミホールディングス	32,000	420.00	13,440,000	
日本梱包運輸倉庫	50,500	1,810.00	91,405,000	
日本石油輸送	19,000	235.00	4,465,000	
福山通運	94,000	628.00	59,032,000	
セイノーホールディングス	119,000	1,205.00	143,395,000	
神奈川中央交通	18,000	591.00	10,638,000	
日立物流	32,100	1,639.00	52,611,900	
日本郵船	1,304,000	334.00	435,536,000	
商船三井	809,000	408.00	330,072,000	
川崎汽船	675,000	327.00	220,725,000	
NSユナイテッド海運	66,000	291.00	19,206,000	
明治海運	13,900	414.00	5,754,600	
飯野海運	79,900	621.00	49,617,900	
共栄タンカー	13,000	235.00	3,055,000	
第一中央汽船	113,000	44.00	4,972,000	
日本航空	295,600	3,630.00	1,073,028,000	
A N Aホールディングス	3,035,000	313.30	950,865,500	
バスコ	14,000	348.00	4,872,000	
三菱倉庫	101,000	1,770.00	178,770,000	

三井倉庫ホールディングス	89,000	402.00	35,778,000	
住友倉庫	113,000	636.00	71,868,000	
澁澤倉庫	40,000	340.00	13,600,000	
ヤマタネ	77,000	179.00	13,783,000	
東陽倉庫	27,000	301.00	8,127,000	
乾汽船	10,400	964.00	10,025,600	
日本トランスシティ	35,000	379.00	13,265,000	
ケイヒン	28,000	194.00	5,432,000	
中央倉庫	9,000	935.00	8,415,000	
安田倉庫	12,100	1,028.00	12,438,800	
東洋埠頭	48,000	195.00	9,360,000	
宇徳	12,500	626.00	7,825,000	
上組	184,000	1,158.00	213,072,000	
サンリツ	1,700	544.00	924,800	
キムラユニティー	4,200	1,007.00	4,229,400	
キューソー流通システム	4,300	1,427.00	6,136,100	
郵船ロジスティクス	14,200	1,496.00	21,243,200	
近鉄エクスプレス	13,800	5,000.00	69,000,000	
東海運	8,800	284.00	2,499,200	
エーアイテイナー	7,200	1,210.00	8,712,000	
東京放送ホールディングス	91,300	1,246.00	113,759,800	
日本テレビホールディングス	139,200	1,789.00	249,028,800	
朝日放送	15,100	925.00	13,967,500	
テレビ朝日ホールディングス	41,600	1,656.00	68,889,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	115,800	711.00	82,333,800	
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,259.00	28,011,600	
コネクシオ	10,800	989.00	10,681,200	
クロップス	1,400	533.00	746,200	
日本電信電話	596,500	7,212.00	4,301,958,000	
K D D I	516,200	7,786.00	4,019,133,200	
光通信	13,700	6,820.00	93,434,000	
N T T ドコモ	1,256,000	1,996.50	2,507,604,000	
GMOインターネット	50,800	1,172.00	59,537,600	
K A D O K A W A ・ D W A N G O	39,700	1,863.00	73,961,100	
学研ホールディングス	51,000	252.00	12,852,000	
ゼンリン	20,200	1,449.00	29,269,800	
昭文社	9,300	832.00	7,737,600	
インプレスホールディングス	11,500	127.00	1,460,500	
東京電力	1,309,900	475.00	622,202,500	
中部電力	472,500	1,447.00	683,707,500	
関西電力	630,200	1,067.00	672,423,400	
中国電力	213,500	1,663.00	355,050,500	
北陸電力	151,300	1,641.00	248,283,300	
東北電力	385,800	1,443.00	556,709,400	
四国電力	139,000	1,523.00	211,697,000	
九州電力	341,000	1,071.00	365,211,000	
北海道電力	144,500	929.00	134,240,500	
沖縄電力	10,100	3,845.00	38,834,500	
電源開発	103,800	4,350.00	451,530,000	
東京瓦斯	1,877,000	712.80	1,337,925,600	

大阪瓦斯	1,599,000	477.20	763,042,800	
東邦瓦斯	393,000	631.00	247,983,000	
北海道瓦斯	31,000	284.00	8,804,000	
西部瓦斯	174,000	258.00	44,892,000	
静岡瓦斯	43,900	809.00	35,515,100	
メタウォーター	7,200	2,310.00	16,632,000	
アイネット	7,800	899.00	7,012,200	
松竹	100,000	1,110.00	111,000,000	
東宝	108,800	2,666.00	290,060,800	
エイチ・アイ・エス	26,300	3,650.00	95,995,000	
東映	57,000	635.00	36,195,000	
AOI Pro.	7,200	768.00	5,529,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	94,200	4,670.00	439,914,000	
共立メンテナンス	8,000	5,760.00	46,080,000	
イチネンホールディングス	17,000	1,032.00	17,544,000	
建設技術研究所	9,500	1,481.00	14,069,500	
スペース	8,900	1,182.00	10,519,800	
インファーマシーズ	16,800	4,120.00	69,216,000	
燦ホールディングス	3,300	1,766.00	5,827,800	
スバル興業	3,000	437.00	1,311,000	
東京テアトル	62,000	140.00	8,680,000	
よみうりランド	32,000	462.00	14,784,000	
東京都競馬	110,000	299.00	32,890,000	
常磐興産	60,000	156.00	9,360,000	
カナモト	22,500	3,000.00	67,500,000	
東京ドーム	110,000	539.00	59,290,000	
D T S	15,700	2,487.00	39,045,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,400	2,494.00	138,167,600	
シーイーシー	9,900	994.00	9,840,600	
カプコン	39,000	2,001.00	78,039,000	
西尾レントオール	13,000	3,090.00	40,170,000	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	66,000	52.00	3,432,000	
日本空港ビルデング	52,700	5,020.00	264,554,000	
トランス・コスモス	21,100	2,229.00	47,031,900	
乃村工藝社	31,600	1,097.00	34,665,200	
ジャステック	8,900	915.00	8,143,500	
S C S K	36,200	2,970.00	107,514,000	
藤田観光	59,000	434.00	25,606,000	
K N T - C Tホールディングス	78,000	156.00	12,168,000	
日本管財	7,900	2,610.00	20,619,000	
トーカイ	7,100	3,690.00	26,199,000	
白洋舎	5,000	246.00	1,230,000	
セコム	156,600	6,994.00	1,095,260,400	
日本システムウエア	5,800	975.00	5,655,000	
セントラル警備保障	7,200	1,229.00	8,848,800	
アイネス	20,800	884.00	18,387,200	
丹青社	18,600	779.00	14,489,400	
メイテック	21,800	3,290.00	71,722,000	

TKC	12,800	2,068.00	26,470,400	
アサツー ディ・ケイ	30,300	2,916.00	88,354,800	
富士ソフト	21,000	2,438.00	51,198,000	
応用地質	16,900	1,596.00	26,972,400	
船井総研ホールディングス	18,200	941.00	17,126,200	
NSD	32,400	1,773.00	57,445,200	
進学会	7,000	472.00	3,304,000	
丸紅建材リース	13,000	280.00	3,640,000	
コナミ	61,900	2,361.00	146,145,900	
ベネッセホールディングス	59,000	3,435.00	202,665,000	
イオンディライト	15,600	2,672.00	41,683,200	
ナック	10,800	1,078.00	11,642,400	
福井コンピュータホールディングス	4,200	860.00	3,612,000	
ニチイ学館	31,600	1,135.00	35,866,000	
ダイセキ	26,000	2,060.00	53,560,000	
ステップ	5,700	833.00	4,748,100	
日鉄住金物産	100,000	415.00	41,500,000	
元気寿司	4,700	2,830.00	13,301,000	
トラスコ中山	19,000	3,055.00	58,045,000	
ヤマダ電機	602,300	443.00	266,818,900	
オートバックスセブン	56,100	1,788.00	100,306,800	
アークランドサカモト	10,900	2,264.00	24,677,600	
ニトリホールディングス	65,800	6,820.00	448,756,000	
グルメ杵屋	11,000	945.00	10,395,000	
愛眼	12,800	252.00	3,225,600	
ケーユーホールディングス	8,200	665.00	5,453,000	
吉野家ホールディングス	42,900	1,358.00	58,258,200	
加藤産業	22,000	2,165.00	47,630,000	
イノテック	14,000	488.00	6,832,000	
イエローハット	14,400	2,333.00	33,595,200	
富士エレクトロニクス	7,900	1,440.00	11,376,000	
松屋フーズ	7,400	2,451.00	18,137,400	
JBCホールディングス	12,900	767.00	9,894,300	
JKホールディングス	15,800	563.00	8,895,400	
サガミチェーン	19,000	1,157.00	21,983,000	
日伝	6,300	2,465.00	15,529,500	
関西スーパーマーケット	11,600	803.00	9,314,800	
ミロク情報サービス	10,100	668.00	6,746,800	
北沢産業	11,000	178.00	1,958,000	
杉本商事	8,300	1,285.00	10,665,500	
因幡電機産業	22,500	3,955.00	88,987,500	
王将フードサービス	11,200	4,460.00	49,952,000	
ブレナス	17,000	2,274.00	38,658,000	
ミニストップ	11,400	1,613.00	18,388,200	
アークス	26,500	2,465.00	65,322,500	
パロー	32,800	2,219.00	72,783,200	
パイテック	5,200	976.00	5,075,200	
ミスミグループ本社	56,900	4,240.00	241,256,000	
江守グループホールディングス	6,500	861.00	5,596,500	
アルテック	11,200	207.00	2,318,400	

ベルク	6,800	3,230.00	21,964,000	
大 庄	8,200	1,545.00	12,669,000	
タキヒヨー	26,000	416.00	10,816,000	
ファーストリテイリング	30,500	43,935.00	1,340,017,500	
ソフトバンク	806,100	7,136.00	5,752,329,600	
スズケン	63,100	3,625.00	228,737,500	
サンドラッグ	32,200	5,190.00	167,118,000	
サックスパー ホールディングス	11,400	1,657.00	18,889,800	
ジェコス	10,500	1,335.00	14,017,500	
ヤマザワ	3,300	1,725.00	5,692,500	
やまや	2,600	1,524.00	3,962,400	
ルネサスイーストン	6,900	712.00	4,912,800	
ベルーナ	38,100	516.00	19,659,600	
合計	256,480,300		321,463,694,880	

*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27年2月27日現在

資産総額	77,954,260,422円
負債総額	544,619,234円
純資産総額（ - ）	77,409,641,188円
発行済数量	35,012,842,390口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2109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27年2月27日現在

資産総額	337,860,260,429円
負債総額	1,235,622,950円
純資産総額（ - ）	336,624,637,479円
発行済数量	155,484,453,261口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1650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。

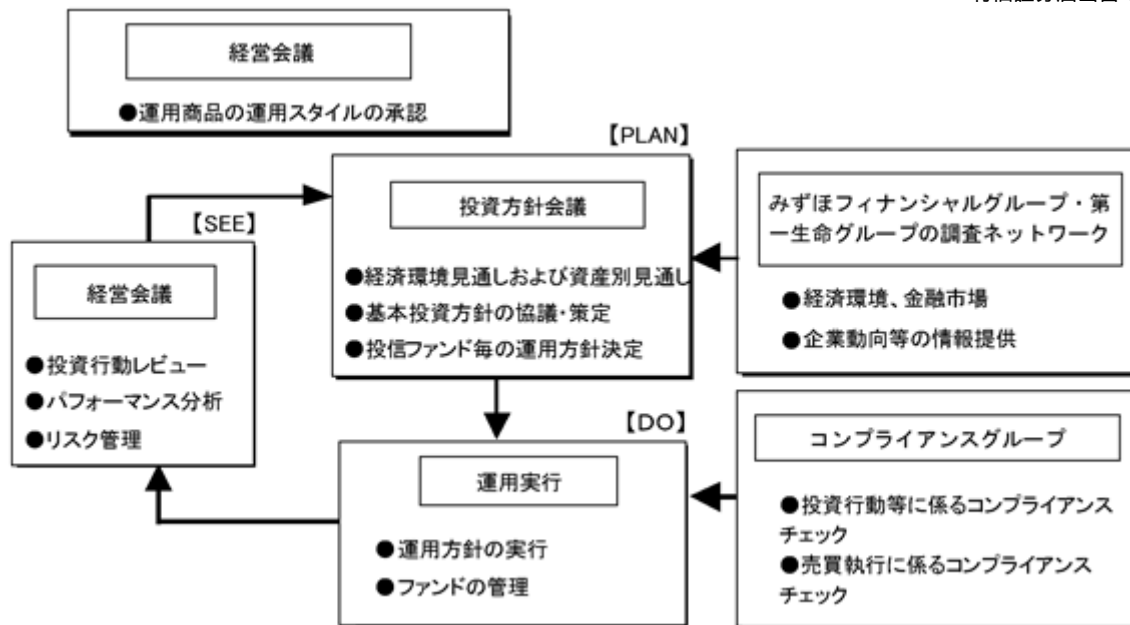
投資運用の意思決定機構

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27年2月27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27年2月27日現在、委託会社の運用する投資信託は353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	7	20,669,998,430
追加型株式投資信託	323	5,754,565,009,705
単位型公社債投資信託	23	201,073,975,137
追加型公社債投資信託	0	0
合計	353	5,976,308,983,272

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29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26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30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	-
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	2 1,306,837	2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（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	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
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	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第28期 （ 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 ）		第29期 （ 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期		第29期	
	（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）		（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		-	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	-		213,744	
雑損失	-		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	1	1,752	1	22
固定資産売却損	2	115	2	1,448
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		134,463		13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の 配当							2,712,000	2,712,000	2,712,000
別途積立金 の積立				700,000			700,000	-	-
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	700,000	-	-	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の 配当		2,712,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	32,375	32,375
当期変動額 合計	32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の 配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金 の積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の 配当		3,096,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	139,391	139,391
当期変動額 合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

重要な会計方針

項目	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当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。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 2em;">数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理</p> <p style="padding-left: 2em;">過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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第25号 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

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27年3月期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

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、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28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウェア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	-	22
ソフトウェア	1,752	0

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	115	1,448

(株主資本等変動計算書関係)

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

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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

(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26年6月30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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィス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	-

第29期（平成26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	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

(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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26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
差入保証金	731,564	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。

(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	-	-	-

第29期(平成26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	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

(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28期及び第29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。

第29期（平成26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	522,887	146,101	376,785
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
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）	9,474	10,000	526
小計	9,474	10,000	526
合計	536,913	159,101	377,811

（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

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

第29期（平成26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	10,952,459	1,628,835

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）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

	（千円）
（1）退職給付債務	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	133,522
退職給付引当金	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

(1) 勤務費用	102,125
(2) 利息費用	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	41,923
(5) その他	314
退職給付費用	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

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）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	112,660
未認識過去勤務費用	19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759
退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期	第29期
	(平成25年3月31日現在)	(平成26年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	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	109	-
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	54,172
繰延税金負債合計	-	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

（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。

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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	627,855	未払 費用	224,758
	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	251,110	未払 費用	97,587

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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 (旧株式 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)	1,629,874 775,579	未払 手数料 現金・ 預金	224,525 10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	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)	432,201 203,876	-	-
	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	287,136 11,810	未払 費用 未払金	155,413 2,646
	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 7,933	金銭の 信託	10,952,459

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せん。

（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。

（注7）株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行（株式会社みずほ銀行に商号変更）に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行（旧株式会社みずほコーポレート銀行）に引き継いでおります。

（1株当たり情報）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
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30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,723,059
金銭の信託		12,434,692
前払費用		41,958
未収委託者報酬		4,115,165
未収運用受託報酬		2,110,505
未収投資助言報酬		291,921
未収収益		276,092
繰延税金資産		381,830
その他		19,665
	流動資産計	29,394,891
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	112,415
車両運搬具	1	1,278
器具備品	1	155,618
無形固定資産		
商標権	1	148
ソフトウェア	1	1,293,646
ソフトウェア仮勘定		671,614
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	210
投資その他の資産		
投資有価証券		569,502
関係会社株式		1,916,596
繰延税金資産		632,938
差入保証金		731,858
その他		98,609
	固定資産計	6,191,588
資産合計		35,586,479

（単位：千円）

	第30期中間会計期間末 （平成26年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	1,166,764
未払金	1,957,162
未払償還金	51,109
未払手数料	1,643,563
その他未払金	262,489
未払費用	1,591,500
未払法人税等	1,472,835
未払消費税等	371,933
賞与引当金	654,870
その他	20,000
	流動負債計
	7,235,067
固定負債	
退職給付引当金	812,666
役員退職慰労引当金	83,180
	固定負債計
	895,847
負債合計	8,130,914
（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	22,814,599
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	19,480,000
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	2,711,306
	株主資本計
	27,243,077
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	212,487
	評価・換算差額等計
	212,487
純資産合計	27,455,565
負債・純資産合計	35,586,479

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日至平成26年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	13,286,051	
運用受託報酬	3,381,064	
投資助言報酬	490,761	
その他営業収益	421,279	
	営業収益計	17,579,156
営業費用		
支払手数料	5,909,864	
広告宣伝費	92,826	
公告費	159	
調査費	2,887,318	
調査費	2,043,582	
委託調査費	843,735	
委託計算費	190,750	
営業雑経費	236,536	
通信費	17,081	
印刷費	205,572	
協会費	12,088	
諸会費	15	
支払販売手数料	1,778	
	営業費用計	9,317,455
一般管理費		
給料	2,293,163	
役員報酬	121,968	
給料・手当	2,171,195	
交際費	15,267	
寄付金	2,697	
旅費交通費	108,306	
租税公課	63,009	
不動産賃借料	344,346	
退職給付費用	109,300	
固定資産減価償却費	1 271,644	
福利厚生費	11,154	
修繕費	4,020	
賞与引当金繰入額	654,870	
役員退職慰労引当金繰入額	23,042	
役員退職慰労金	25,501	
機器リース料	23	
事務委託費	102,506	
事務用消耗品費	33,911	
器具備品費	1,141	
諸経費	73,631	
	一般管理費計	4,137,538
営業利益		4,124,161

（単位：千円）

	第30期中間会計期間 （自平成26年4月1日至平成26年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,686	
受取利息	1,115	
雑収入	1,165	
営業外収益計		8,967
営業外費用		
為替差損	896	
金銭の信託運用損	2,943	
営業外費用計		3,839
経常利益		4,129,289
特別損失		
関係会社株式評価損	202,477	
特別損失計		202,477
税引前中間純利益		3,926,811
法人税、住民税及び事業税		1,450,315
法人税等調整額		46,321
法人税等合計		1,403,993
中間純利益		2,522,818

(3) 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変更による累積的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の積立				2,350,000			2,350,000	-	-
中間純利益							2,522,818	2,522,818	2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	2,155,181	194,818	194,818
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	2,711,306	22,814,599	27,243,077

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変更による累積的影響額		131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	243,159	27,291,419
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の積立		-
中間純利益		2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	30,671	30,671
当中間期変動額合計	30,671	164,146
当中間期末残高	212,487	27,455,565

重要な会計方針

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26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、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の際会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)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。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
<p>「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。以下「退職給付会計基準」という。）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第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ4,584千円増加しております。なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。</p>	

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
	1. 固定資産の減価償却累計額	建物
	車両運搬具	3,645千円
	器具備品	690,539千円
	商標権	789千円
	ソフトウェア	1,737,240千円
	電信電話専用施設利用権	1,386千円

(中間損益計算書関係)

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産
	無形固定資産	235,019千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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26年6月30日 定時株主総会	普通株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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	9,723,059	9,723,059	-
(2) 金銭の信託	12,434,692	12,434,692	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	489,256	489,256	-
資産計	22,647,008	22,647,008	-
(1) 未払法人税等	1,472,835	1,472,835	-
負債計	1,472,835	1,472,835	-

（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	1,916,596
差入保証金	731,858

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

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

なお、当中間会計期間において、関係会社株式について202,477千円減損処理を行っております。

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

(有価証券関係)

第30期中間会計期間末（平成26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1,916,596千円）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	474,395	146,101	328,293
債券	-	-	-
その他（投資信託）	14,861	13,000	1,861
小計	489,256	159,101	330,154
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	489,256	159,101	330,154

（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30期中間会計期間末（平成26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30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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	13,286,051	3,871,825	421,279	17,579,156

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益 （千円）
第一生命グループ	1,799,530

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,143,981円	89銭
1株当たり中間純利益金額	105,117円	43銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

（注1）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30期中間会計期間 （自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）
中間純利益	2,522,818千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,522,818千円
期中平均株式数	24,000株

（注2）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額が5,582円81銭増加し、1株当たり中間純利益金額が122円93銭増加しております。

（重要な後発事象）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または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26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	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西日本シティ銀行	85,745	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。
損保ジャパン日本興亜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。

(注) 資本金の額は平成26年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 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26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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年3月18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	佐々木 貴司 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26年2月8日から平成27年2月9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27年2月9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26年12月5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	山野 浩 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。