

**【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28年5月6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 惠正
【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< D C年金 >  
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）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28年5月7日から平成29年5月2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經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

**( 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。

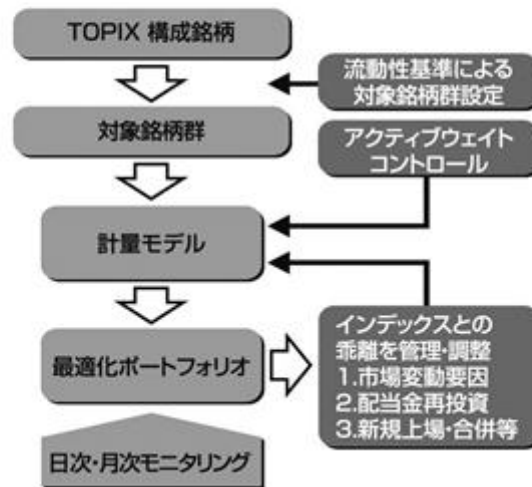
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

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	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

## 単位型投信・追加型投信

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

## 投資対象地域

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

## 投資対象資産

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

## 補足分類

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



## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

## 投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（株式））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

(注) 商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（株式））に分類されます。

## 決算頻度

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

## 投資対象地域

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

## 投資形態

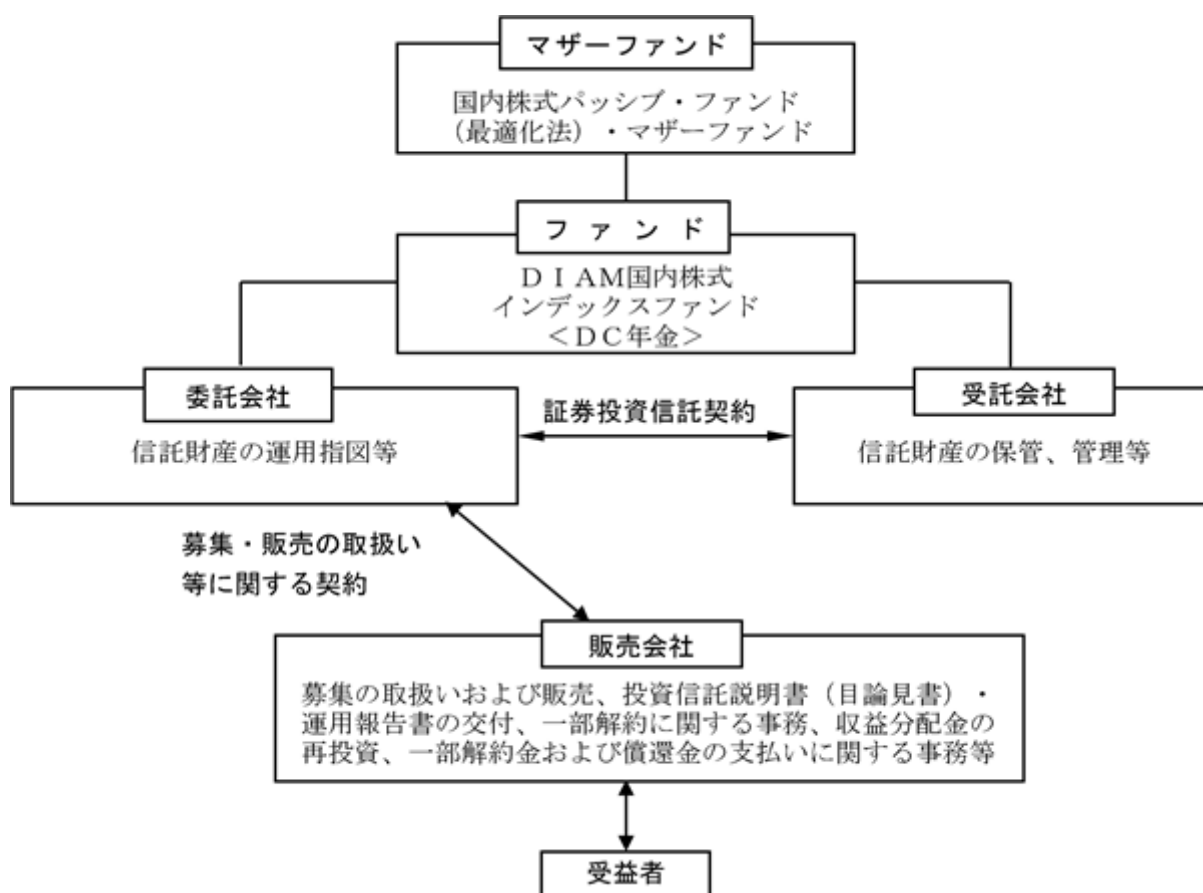
「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

## （２）【ファンドの沿革】

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

## （３）【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

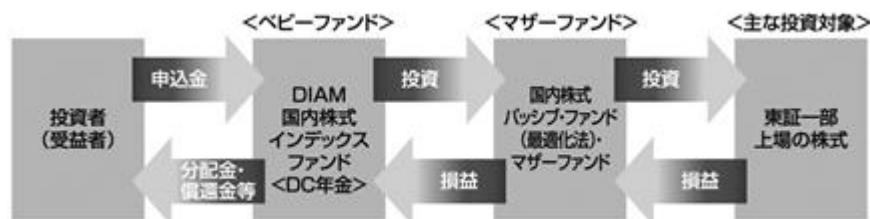
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成28年2月29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28年2月29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】

## &lt;基本方針&gt;

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。

## &lt;投資対象&gt;

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。

## &lt;投資態度&gt;

- 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

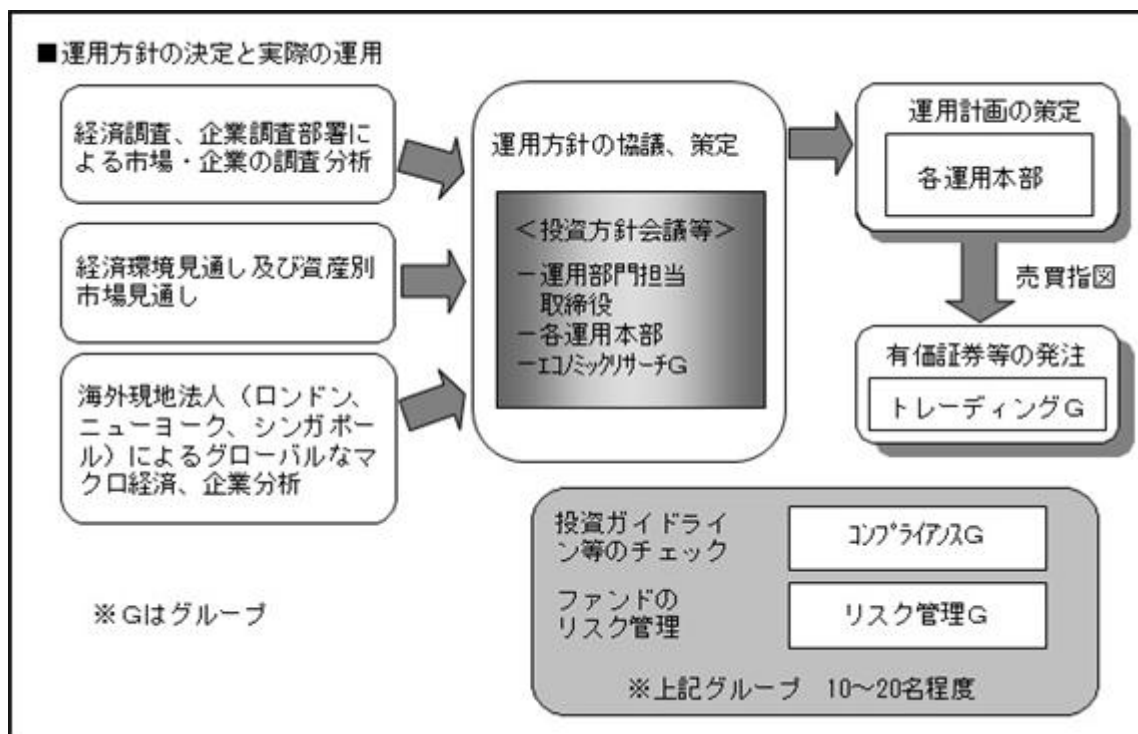
### 4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

## （参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
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28年2月29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) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (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とで、受益者毎に異なります。

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

#### (3)その他の留意点

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

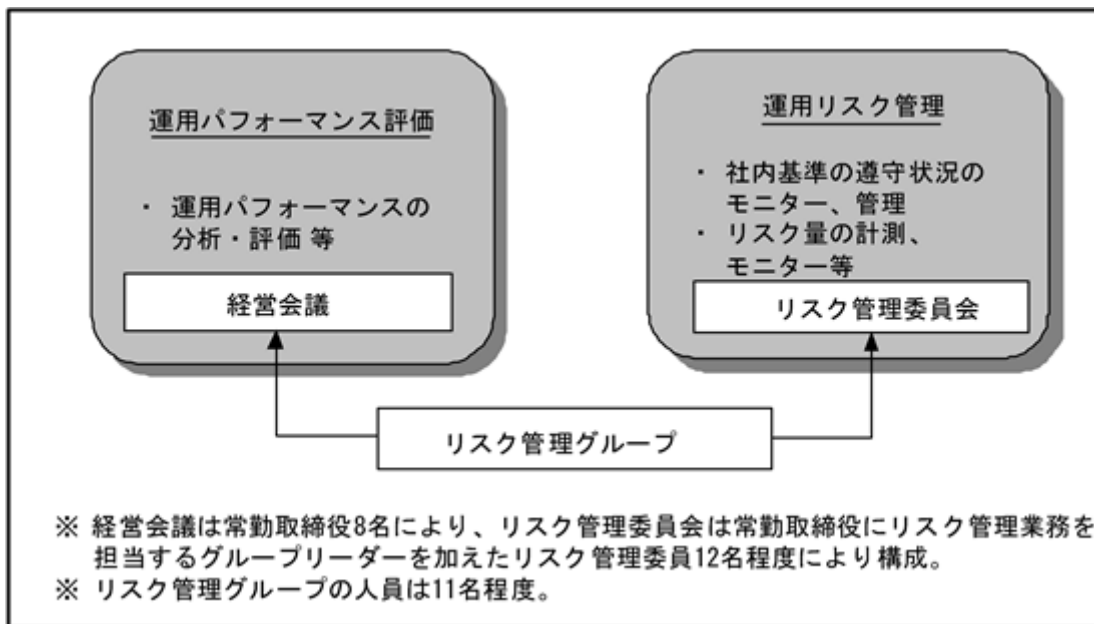
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回るようになった場合、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。

## &lt; 運用評価・運用リスク管理体制 &gt;



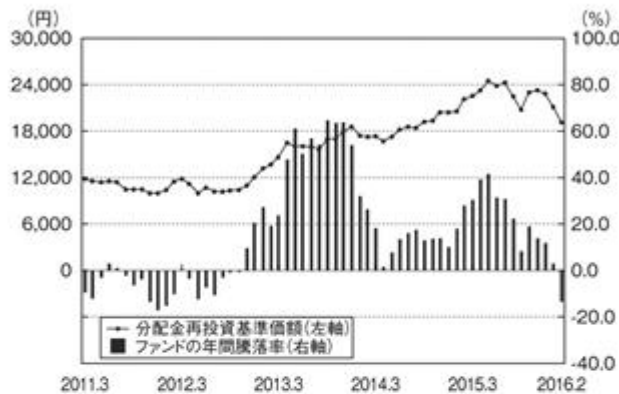
運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

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。

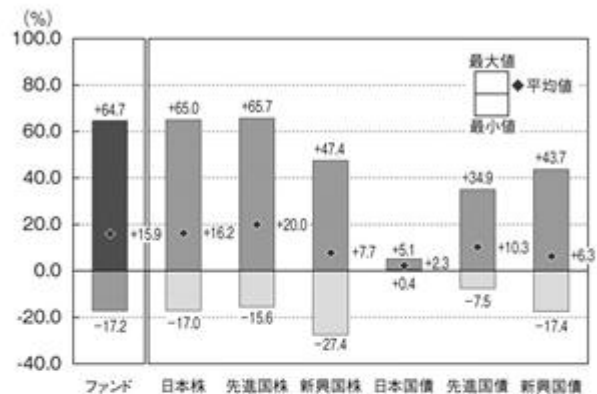
上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## （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



2011年3月～2016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・ディバースファイド(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・ディバースファイド」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%）

支払先	内訳（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、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎年8月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、信託財産から支払われます。

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。



## （５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

### 個人の受益者に対する課税

#### 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ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等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。

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28年4月1日現在のものです。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28年2月29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	71,846,573,011	100.01
内 日本	71,846,573,011	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,851,636	0.01
純資産総額	71,836,721,375	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28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	264,888,128,380	96.63
内 日本	264,888,128,380	96.63
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,238,968,872	3.37
純資産総額	274,127,097,252	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年2月29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）	9,621,360,000	3.51
内 日本	9,621,360,000	3.51

（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28年2月29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	38,240,671,179	1.9967 76,357,690,686	1.8788 71,846,573,011	- -	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28年2月29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28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,716,900	6,555.00 11,254,279,500	5,897.00 10,124,559,300	- -	3.69%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	10,931,600	538.20 5,883,387,120	486.60 5,319,316,560	- -	1.94%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,053,100	5,308.00 5,589,854,800	4,806.00 5,061,198,600	- -	1.85%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	772,000	5,104.00 3,940,288,000	5,574.00 4,303,128,000	- -	1.57%
5	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	914,400	4,643.00 4,245,559,200	4,490.00 4,105,656,000	- -	1.50%
6	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,384,100	3,200.00 4,429,120,000	2,878.00 3,983,439,800	- -	1.45%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,242,300	3,129.00 3,887,156,700	2,887.00 3,586,520,100	- -	1.31%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,091,000	3,412.00 3,722,492,000	3,164.00 3,451,924,000	- -	1.26%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	19,203,100	181.59 3,487,176,169	166.10 3,189,634,910	- -	1.16%

10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	575,800	5,845.00 3,365,551,000	5,371.00 3,092,621,800	- -	1.13%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,050,800	2,839.00 2,983,221,200	2,641.50 2,775,688,200	- -	1.01%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,619,100	1,662.50 2,691,753,750	1,624.00 2,629,418,400	- -	0.96%
13	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	569,900	5,165.00 2,943,533,500	4,495.00 2,561,700,500	- -	0.93%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	252,400	10,875.00 2,744,850,000	9,916.00 2,502,798,400	- -	0.91%
15	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	123,600	22,480.00 2,778,528,000	20,215.00 2,498,574,000	- -	0.91%
16	キヤノン 日本	株式 電気機器	743,200	3,371.00 2,505,327,200	3,163.00 2,350,741,600	- -	0.86%
17	ファナック 日本	株式 電気機器	141,200	16,380.00 2,312,856,000	16,600.00 2,343,920,000	- -	0.86%
18	ソニー 日本	株式 電気機器	974,000	2,569.00 2,502,206,000	2,387.00 2,324,938,000	- -	0.85%
19	花王 日本	株式 化学	388,900	6,209.00 2,414,680,100	5,699.00 2,216,341,100	- -	0.81%
20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	552,000	3,941.00 2,175,432,000	3,936.00 2,172,672,000	- -	0.79%
21	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,013,000	2,253.00 2,282,289,000	2,093.50 2,120,715,500	- -	0.77%
22	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,937,700	1,081.50 2,095,622,550	1,024.50 1,985,173,650	- -	0.72%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	144,800	13,965.00 2,022,132,000	13,565.00 1,964,212,000	- -	0.72%
24	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	487,900	4,139.00 2,019,418,100	3,953.00 1,928,668,700	- -	0.70%
25	三井不動産 日本	株式 不動産業	722,000	2,664.50 1,923,769,000	2,623.00 1,893,806,000	- -	0.69%
26	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,022,300	1,869.50 1,911,189,850	1,807.00 1,847,296,100	- -	0.67%
27	キーエンス 日本	株式 電気機器	31,300	58,010.00 1,815,713,000	58,410.00 1,828,233,000	- -	0.67%
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,473,000	1,143.00 1,683,639,000	1,144.00 1,685,112,000	- -	0.61%
29	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,522,000	495.30 1,744,446,600	477.90 1,683,163,800	- -	0.61%
30	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	436,200	4,188.00 1,826,805,600	3,696.00 1,612,195,200	- -	0.59%

(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28年2月29日現在

種類	投資比率
株式	96.63%
合計	96.63%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成28年2月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	10.99%
輸送用機器		9.51%
情報・通信業		8.08%
銀行業		7.11%
化学		5.79%
医薬品		5.64%
食料品		4.94%
陸運業		4.69%
小売業		4.69%
機械		4.39%
卸売業		4.08%
サービス業		3.67%
建設業		3.03%
不動産業		2.74%
保険業		2.37%
電気・ガス業		2.16%
精密機器		1.57%
その他製品		1.52%
その他金融業		1.32%
鉄鋼		1.11%
証券、商品先物取引業		1.04%
ゴム製品		0.95%
非鉄金属		0.83%
ガラス・土石製品		0.82%
繊維製品		0.71%
空運業		0.69%
金属製品		0.63%
石油・石炭製品		0.48%
鋳業		0.28%
パルプ・紙		0.25%
海運業	0.21%	
倉庫・運輸関連業	0.21%	
水産・農林業	0.10%	
合計	96.63%	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 【投資不動産物件】

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28年2月29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 2803月	買建	747	9,898,951,172	9,621,360,000	3.51%

（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28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
第13計算期間末 (平成28年2月8日)	76,274	76,274	2.0357	2.0357
平成27年2月末日	77,409	-	2.2109	-
3月末日	79,123	-	2.2557	-
4月末日	81,276	-	2.3284	-
5月末日	85,467	-	2.4475	-
6月末日	82,952	-	2.3858	-
7月末日	85,684	-	2.4280	-
8月末日	79,562	-	2.2488	-
9月末日	75,502	-	2.0800	-
10月末日	83,612	-	2.2966	-
11月末日	83,793	-	2.3289	-
12月末日	83,535	-	2.2826	-
平成28年1月末日	78,570	-	2.1125	-
2月末日	71,836	-	1.9139	-



## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第13計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第13計算期間	1.5

(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】

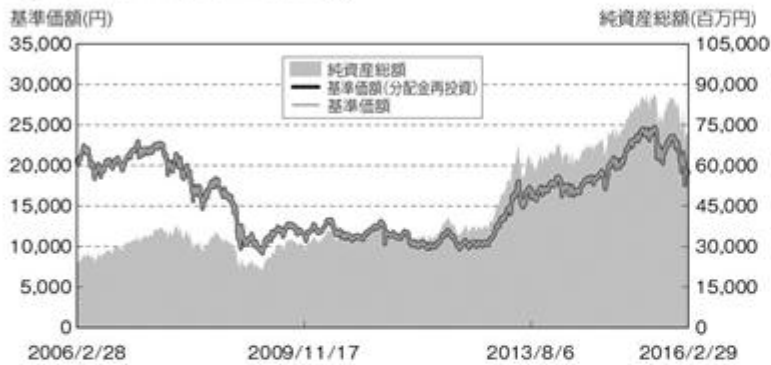
	設定口数	解約口数
第4計算期間	7,400,148,798	4,214,916,172
第5計算期間	8,779,618,539	5,384,513,066
第6計算期間	8,569,368,552	4,148,881,796
第7計算期間	8,901,159,838	4,615,887,504
第8計算期間	7,387,878,523	3,984,381,861
第9計算期間	8,287,509,892	4,947,169,536
第10計算期間	9,700,581,703	6,785,126,872
第11計算期間	16,783,744,888	16,684,231,460
第12計算期間	12,348,095,889	13,334,064,929
第13計算期間	15,836,928,730	13,906,095,221

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2016年2月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2006年2月28日～2016年2月29日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したもとして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
第13期	(2016.02.08)	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

■組入銘柄一覧 (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。

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	96.63
内 日本	96.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.37
純資産総額	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.51

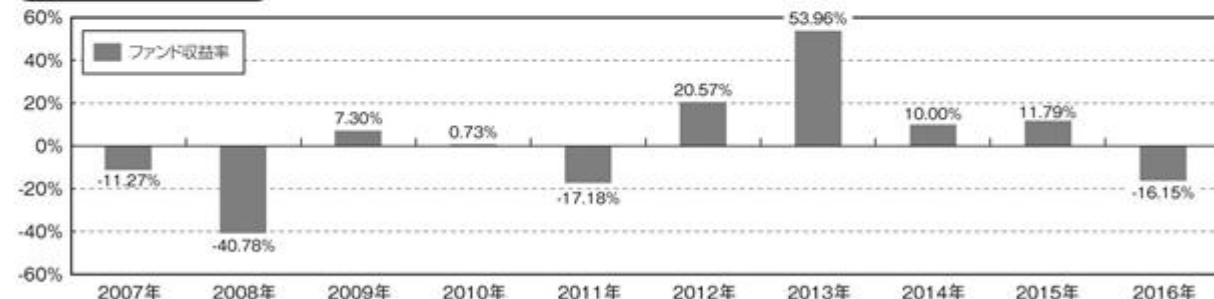
## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	10.99%
2	輸送用機器	9.51%
3	情報・通信業	8.08%
4	銀行業	7.11%
5	化学	5.79%

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.69%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.94%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.85%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.57%
5	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.50%
6	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.45%
7	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.31%
8	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.26%
9	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.16%
10	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.13%

## 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として算出しております。

※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、2016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、各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

#### 解約のお申込み方法

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

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

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

信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

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

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

#### 解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

### 解約代金の受渡日

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

## 3【資産管理等の概要】

### (1)【資産の評価】

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

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
国内株式	原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。

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「口.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「口.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対し異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a. ~ e. の規定にしたがいます。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、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。

#### ハ．関係法人との契約の更改

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

#### 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。

### 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てします。）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13期計算期間（平成27年2月10日から平成28年2月8日まで）の財務諸表について、P w C 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&lt;DC年金&gt;

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成27年2月9日現在	第13期 平成28年2月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	460,251,293	298,233,769
親投資信託受益証券	73,447,613,884	76,272,395,045
流動資産合計	73,907,865,177	76,570,628,814
資産合計	73,907,865,177	76,570,628,814
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	371,968,222	196,968,807
未払受託者報酬	11,517,161	13,211,830
未払委託者報酬	72,942,305	83,675,190
その他未払費用	1,823,471	2,091,784
流動負債合計	458,251,159	295,947,611
負債合計	458,251,159	295,947,611
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 35,537,210,525	1 37,468,044,034
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	37,912,403,493	38,806,637,169
（分配準備積立金）	17,682,687,284	11,931,069,673
元本等合計	73,449,614,018	76,274,681,203
純資産合計	73,449,614,018	76,274,681,203
負債純資産合計	73,907,865,177	76,570,628,814

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第12期		第13期	
	自	平成26年2月8日 至 平成27年2月9日	自	平成27年2月10日 至 平成28年2月8日
<b>営業収益</b>				
受取利息		150,641		194,086
有価証券売買等損益		13,882,178,825		1,124,847,839
営業収益合計		13,882,329,466		1,124,653,753
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		21,690,338		26,172,218
委託者報酬		137,372,643		165,757,955
その他費用		3,434,131		4,143,759
営業費用合計		162,497,112		196,073,932
営業利益又は営業損失（ ）		13,719,832,354		1,320,727,685
経常利益又は経常損失（ ）		13,719,832,354		1,320,727,685
当期純利益又は当期純損失（ ）		13,719,832,354		1,320,727,685
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（ ）		2,321,028,891		2,461,053,579
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		25,374,869,151		37,912,403,493
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,599,081,822		20,062,207,144
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,599,081,822		20,062,207,144
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,460,350,943		15,386,192,204
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,460,350,943		15,386,192,204
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		37,912,403,493		38,806,637,169

## ( 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、前計算期間末日を平成27年2月9日、当計算期間末日を平成28年2月8日としております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第12期 平成27年2月9日現在	第13期 平成28年2月8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	36,523,179,565円 12,348,095,889円 13,334,064,929円	35,537,210,525円 15,836,928,730円 13,906,095,221円
2 . 受益権の総数	35,537,210,525口	37,468,044,034口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第12期 自 平成26年2月8日 至 平成27年2月9日	第13期 自 平成27年2月10日 至 平成28年2月8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（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。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（27,848,920,821円）及び分配準備積立金（11,931,069,673円）より分配対象収益は39,779,990,494円（1万口当たり10,617.04円）であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期 自 平成26年2月8日 至 平成27年2月9日	第13期 自 平成27年2月10日 至 平成28年2月8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12期 平成27年2月9日現在	第13期 平成28年2月8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12期 平成27年2月9日現在	第13期 平成28年2月8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	12,745,683,024	2,080,479,791
合計	12,745,683,024	2,080,479,791

（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12期 平成27年2月9日現在	第13期 平成28年2月8日現在
1口当たり純資産額	2.0668円	2.0357円
（1万口当たり純資産額）	(20,668円)	(20,357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28年2月8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	38,172,461,361	76,272,395,045	
親投資信託受益証券	合計	38,172,461,361	76,272,395,045	
合計		38,172,461,361	76,272,395,045	

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27年2月9日現在	平成28年2月8日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,344,502,623	5,429,529,564
株式	2	321,463,694,880	281,831,760,820
派生商品評価勘定		70,858,808	-
未収入金		-	33,300,100
未収配当金		374,039,516	387,169,296
前払金		-	146,427,000
流動資産合計		325,253,095,827	287,828,186,780
資産合計		325,253,095,827	287,828,186,780
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,921,820	84,351,696
前受金		58,750,000	-
未払金		128,128	1,567,776
未払解約金		515,027,000	844,877,000
流動負債合計		575,826,948	930,796,472
負債合計		575,826,948	930,796,472
純資産の部			
元本等			
元本	1	160,436,237,384	143,582,065,487
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		164,241,031,495	143,315,324,821
元本等合計		324,677,268,879	286,897,390,308
純資産合計		324,677,268,879	286,897,390,308
負債純資産合計		325,253,095,827	287,828,186,750

## 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27年2月9日現在	平成28年2月8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	188,590,646,846円	160,436,237,384円
同期中追加設定元本額	23,150,658,982円	38,536,719,607円
同期中一部解約元本額	51,305,068,444円	55,390,891,504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	4,081,292,693円	5,617,682,100円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,411,014,973円	1,820,166,879円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	6,660,487円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	13,299,631円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	31,387,977円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	15,547,145円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	11,093,364円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	11,755,011円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	36,293,726,286円	38,172,461,361円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	771,217,140円	786,499,443円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,879,243,203円	2,836,468,246円

D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 3成長型	3,084,803,902円	2,892,104,565円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	389,293,307円	368,856,638円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,303,303,457円	1,224,436,857円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,133,820,689円	1,092,740,778円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	79,128,019円	60,704,664円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,246,903,286円	1,226,882,342円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	28,697,422円	27,113,958円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	16,781,334円	24,706,633円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	32,790,530円	49,577,626円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	80,501,452円	106,323,778円
投資のソムリエ	99,708,872円	1,057,072,049円
クルーズコントロール	423,199,350円	708,256,115円
投資のソムリエ< DC年金>	1,478,970円	18,989,955円
D I A M 8資産バランスファンドN< DC年金>	34,666,087円	76,867,727円
D I A M DC バランス・F(成長型)	6,788,927円	55,564,467円
クルーズコントロール< DC年金>	134,378円	182,825円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	- 円	12,186,127円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	- 円	30,724,957円
投資のソムリエ< DC年金>リスク抑制型	- 円	660,417円
D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	266,833,209円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	132,183,740円	113,636,589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)	2,171,589,003円	536,918,730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)	615,671,008円	478,804,153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)	69,684,107円	41,760,119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)	289,944,425円	166,681,120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)	60,949,241円	41,989,158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)	114,903,360円	58,181,496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)	10,168,712,919円	5,375,516,838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)	3,567,914,239円	2,050,277,399円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	2,920,763,500円	2,019,290,758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)	2,002,140,257円	1,613,319,467円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	5,051,496,869円	4,174,989,311円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	427,540,847円	322,112,731円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	1,150,626,711円	853,964,228円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,249,278,441円	1,010,419,845円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	5,566,969,150円	4,107,539,986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)	92,409,818円	46,003,219円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	1,941,802,505円	1,335,804,233円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	6,507,891,316円	5,542,900,861円
D I A Mグローバル分散ファン ドVA(適格機関投資家限定)	211,433,281円	- 円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	24,147,001,270円	21,045,587,384円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	1,005,779,315円	799,834,907円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	2,763,446,288円	2,401,484,718円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	15,142,706,177円	13,407,676,777円

	D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	38,223円	4,455,809円
	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	10,776,546円	7,115,578円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	47,737,260円	5,949,384円
	D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	13,528,621,725円	12,049,845,453円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	129,163,527円	113,139,882円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	45,522,958円	42,673,735円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	1,718,173円	39,006,138円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	104,752,546円	12,245,363円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	120,223円	120,493円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	818,354,088円	670,998,289円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,114,709,804円	1,887,540,594円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,751,007,520円	2,485,634,300円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	112,382,727円	94,839,111円
	計	160,436,237,384円	143,582,065,487円
2 .	受益権の総数	160,436,237,384口	143,582,065,487口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,850,000,000円	株式 3,277,500,000円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年2月8日 至 平成27年2月9日	自 平成27年2月10日 至 平成28年2月8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27年2月9日現在	平成28年2月8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27年2月9日現在	平成28年2月8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	52,346,025,733	9,657,161,479
合計	52,346,025,733	9,657,161,479

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	平成27年2月9日 現在				平成28年2月8日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	2,965,179,000	-	3,034,185,000	69,006,000	4,960,587,000	-	4,876,350,000	84,237,000
合計	2,965,179,000	-	3,034,185,000	69,006,000	4,960,587,000	-	4,876,350,000	84,237,000

## （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27年2月9日現在	平成28年2月8日現在
1口当たり純資産額	2.0237円	1.9981円
（1万口当たり純資産額）	(20,237円)	(19,981円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成28年2月8日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	67,000	264.00	17,688,000	
日本水産	178,200	600.00	106,920,000	
マルハニチロ	31,600	2,279.00	72,016,400	
ハウスイ	12,000	122.00	1,464,000	
サカタのタネ	22,800	3,000.00	68,400,000	
ホクト	15,800	2,238.00	35,360,400	
ショーボンドホールディングス	16,300	4,175.00	68,052,500	
ミライト・ホールディングス	47,600	857.00	40,793,200	
タマホーム	12,000	411.00	4,932,000	
サンヨーホームズ	3,400	475.00	1,615,000	
住石ホールディングス	45,900	100.00	4,590,000	
日鉄鉱業	43,000	451.00	19,393,000	
三井松島産業	102,000	129.00	13,158,000	
国際石油開発帝石	814,800	1,031.00	840,058,800	
日本海洋掘削	4,600	2,211.00	10,170,600	
石油資源開発	24,500	2,890.00	70,805,000	
K&Oエナジーグループ	10,400	1,564.00	16,265,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,161.00	4,179,600	
安藤・間	103,200	591.00	60,991,200	
東急建設	50,300	772.00	38,831,600	
コムシスホールディングス	66,500	1,655.00	110,057,500	
ミサワホーム	18,300	705.00	12,901,500	
高松コンストラクショングループ	11,700	2,245.00	26,266,500	
東建コーポレーション	6,400	9,180.00	58,752,000	
ヤマウラ	7,200	457.00	3,290,400	
大成建設	803,000	749.00	601,447,000	
大林組	463,900	1,078.00	500,084,200	
清水建設	473,000	926.00	437,998,000	
飛鳥建設	117,300	173.00	20,292,900	
長谷工コーポレーション	180,500	1,177.00	212,448,500	
松井建設	17,100	645.00	11,029,500	
銭高組	22,000	478.00	10,516,000	
鹿島建設	725,000	690.00	500,250,000	
不動テトラ	109,600	141.00	15,453,600	
大末建設	5,800	827.00	4,796,600	
鉄建建設	94,000	287.00	26,978,000	
西松建設	179,000	430.00	76,970,000	
三井住友建設	592,500	97.00	57,472,500	
大豊建設	60,000	544.00	32,640,000	
前田建設工業	95,000	723.00	68,685,000	
佐田建設	10,700	427.00	4,568,900	
ナカノフドー建設	11,800	659.00	7,776,200	
奥村組	147,000	616.00	90,552,000	

東鉄工業	18,600	3,295.00	61,287,000
イチケン	17,000	363.00	6,171,000
浅沼組	50,000	282.00	14,100,000
戸田建設	180,000	566.00	101,880,000
熊谷組	226,000	350.00	79,100,000
青木あすなる建設	10,300	689.00	7,096,700
北野建設	33,000	303.00	9,999,000
植木組	19,000	240.00	4,560,000
三井ホーム	20,000	521.00	10,420,000
矢作建設工業	21,100	787.00	16,605,700
ピーエス三菱	18,600	400.00	7,440,000
日本ハウスホールディングス	31,600	431.00	13,619,600
大東建託	57,800	15,190.00	877,982,000
新日本建設	18,400	543.00	9,991,200
N I P P O	36,000	1,832.00	65,952,000
東亜道路工業	29,000	411.00	11,919,000
前田道路	48,000	1,886.00	90,528,000
日本道路	46,000	566.00	26,036,000
東亜建設工業	135,000	297.00	40,095,000
若築建設	90,000	128.00	11,520,000
東洋建設	48,700	548.00	26,687,600
五洋建設	171,700	500.00	85,850,000
大林道路	18,000	782.00	14,076,000
世紀東急工業	24,400	546.00	13,322,400
福田組	25,000	989.00	24,725,000
日本ドライケミカル	1,900	2,153.00	4,090,700
住友林業	106,500	1,385.00	147,502,500
日本基礎技術	17,200	458.00	7,877,600
日成ビルド工業	43,000	366.00	15,738,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	72.00	5,760,000
巴コーポレーション	19,700	331.00	6,520,700
パナホーム	58,000	894.00	51,852,000
大和ハウス工業	456,900	3,355.00	1,532,899,500
ライト工業	29,800	1,122.00	33,435,600
積水ハウス	517,100	1,895.50	980,163,050
日特建設	17,200	457.00	7,860,400
北陸電気工事	5,700	884.00	5,038,800
ユアテック	24,000	913.00	21,912,000
西部電気工業	12,000	416.00	4,992,000
四電工	6,000	396.00	2,376,000
中電工	22,400	2,594.00	58,105,600
関電工	62,000	777.00	48,174,000
きんでん	93,600	1,526.00	142,833,600
東京エネシス	18,000	957.00	17,226,000
トーエネック	22,000	726.00	15,972,000
住友電設	12,300	1,466.00	18,031,800
日本電設工業	25,200	2,243.00	56,523,600
協和エクシオ	60,700	1,216.00	73,811,200
新日本空調	13,200	1,016.00	13,411,200
日本工営	48,000	413.00	19,824,000

N D S	25,000	311.00	7,775,000
九電工	28,000	2,404.00	67,312,000
三機工業	34,400	993.00	34,159,200
日揮	155,000	1,782.00	276,210,000
中外炉工業	47,000	223.00	10,481,000
ヤマト	14,100	483.00	6,810,300
太平電業	23,000	1,230.00	28,290,000
高砂熱学工業	46,200	1,615.00	74,613,000
三晃金属工業	16,000	271.00	4,336,000
N E C ネットエスアイ	17,200	1,853.00	31,871,600
朝日工業社	16,000	452.00	7,232,000
明星工業	28,300	444.00	12,565,200
大気社	19,000	2,544.00	48,336,000
ダイダン	20,000	763.00	15,260,000
日比谷総合設備	18,700	1,707.00	31,920,900
東芝プラントシステム	25,100	1,365.00	34,261,500
日本製粉	102,000	896.00	91,392,000
日清製粉グループ本社	169,600	1,995.00	338,352,000
日東富士製粉	8,000	369.00	2,952,000
昭和産業	64,000	487.00	31,168,000
鳥越製粉	12,600	678.00	8,542,800
中部飼料	14,400	845.00	12,168,000
フィード・ワン	93,700	124.00	11,618,800
東洋精糖	25,000	103.00	2,575,000
日本甜菜製糖	80,000	201.00	16,080,000
三井製糖	61,000	543.00	33,123,000
塩水港精糖	17,200	247.00	4,248,400
日新製糖	2,200	4,500.00	9,900,000
ネクスト	40,700	1,130.00	45,991,000
ジェイエシーリクルートメント	6,600	1,098.00	7,246,800
日本M&Aセンター	22,300	5,270.00	117,521,000
ノバレーゼ	3,800	859.00	3,264,200
アコーディア・ゴルフ	40,000	1,121.00	44,840,000
中広	1,400	708.00	991,200
タケエイ	12,400	794.00	9,845,600
トラスト・テック	2,900	2,428.00	7,041,200
パソナグループ	12,500	656.00	8,200,000
C D S	3,300	870.00	2,871,000
リンクアンドモチベーション	29,200	113.00	3,299,600
G C A サヴィアン	12,700	1,022.00	12,979,400
エス・エム・エス	17,900	1,874.00	33,544,600
テンプホールディングス	101,000	1,669.00	168,569,000
リニカル	8,500	1,837.00	15,614,500
クックパッド	32,000	1,740.00	55,680,000
エスクリ	6,100	1,014.00	6,185,400
アイ・ケイ・ケイ	7,800	663.00	5,171,400
森永製菓	139,000	661.00	91,879,000
中村屋	35,000	483.00	16,905,000
江崎グリコ	35,700	6,180.00	220,626,000
名糖産業	7,100	1,364.00	9,684,400

不二家	90,000	190.00	17,100,000
山崎製パン	113,000	2,705.00	305,665,000
第一屋製パン	26,000	104.00	2,704,000
モロゾフ	24,000	437.00	10,488,000
亀田製菓	8,600	4,950.00	42,570,000
寿スピリッツ	3,700	5,370.00	19,869,000
カルビー	57,300	4,965.00	284,494,500
森永乳業	139,000	592.00	82,288,000
六甲バター	6,900	1,720.00	11,868,000
ヤクルト本社	83,000	5,570.00	462,310,000
明治ホールディングス	91,600	9,880.00	905,008,000
雪印メグミルク	36,400	2,989.00	108,799,600
プリマハム	98,000	304.00	29,792,000
日本ハム	114,000	2,610.00	297,540,000
伊藤ハム	74,000	758.00	56,092,000
林兼産業	50,000	98.00	4,900,000
丸大食品	80,000	453.00	36,240,000
米久	5,000	2,750.00	13,750,000
S Foods	9,700	2,383.00	23,115,100
学情	5,300	1,160.00	6,148,000
スタジオアリス	6,700	2,082.00	13,949,400
シミックホールディングス	6,500	1,635.00	10,627,500
システナ	13,300	1,688.00	22,450,400
N J S	3,000	1,294.00	3,882,000
デジタルアーツ	6,600	2,067.00	13,642,200
新日鉄住金ソリューションズ	22,700	2,076.00	47,125,200
総合警備保障	48,100	5,980.00	287,638,000
キューブシステム	6,100	533.00	3,251,300
いちごグループホールディングス	112,900	377.00	42,563,300
日本駐車場開発	148,700	122.00	18,141,400
コア	5,800	1,307.00	7,580,600
カカクコム	104,500	2,183.00	228,123,500
アイロムグループ	4,100	851.00	3,489,100
ルネサンス	7,400	1,241.00	9,183,400
ディップ	15,900	2,464.00	39,177,600
S B Sホールディングス	13,600	821.00	11,165,600
オプトホールディング	9,000	596.00	5,364,000
新日本科学	13,600	368.00	5,004,800
ツクイ	17,100	1,405.00	24,025,500
キャリアデザインセンター	3,900	899.00	3,506,100
エムスリー	124,800	2,727.00	340,329,600
ツカダ・グローバルホールディング	10,600	699.00	7,409,400
アウトソーシング	6,700	3,165.00	21,205,500
ウェルネット	5,400	3,270.00	17,658,000
ディー・エヌ・エー	64,600	1,880.00	121,448,000
博報堂DYホールディングス	199,900	1,353.00	270,464,700
ぐるなび	16,700	2,540.00	42,418,000
エスアールジータカミヤ	11,700	393.00	4,598,100
ジャパンベストレスキューシステム	16,700	235.00	3,924,500
ファンコミュニケーションズ	33,200	765.00	25,398,000

ジェイコムホールディングス	3,300	2,079.00	6,860,700
WDBホールディングス	5,200	1,000.00	5,200,000
ティア	6,100	615.00	3,751,500
バリューコマース	13,300	390.00	5,187,000
インフォマート	20,800	1,204.00	25,043,200
サッポロホールディングス	237,000	531.00	125,847,000
アサヒグループホールディングス	290,200	3,736.00	1,084,187,200
麒麟ホールディングス	626,900	1,663.50	1,042,848,150
宝ホールディングス	112,100	801.00	89,792,100
オエノンホールディングス	44,000	206.00	9,064,000
養命酒製造	4,900	1,949.00	9,550,100
コカ・コーラウエスト	52,400	2,730.00	143,052,000
コカ・コーライーストジャパン	54,800	1,950.00	106,860,000
サントリー食品インターナショナル	106,000	5,370.00	569,220,000
ダイドードリンコ	7,900	5,290.00	41,791,000
伊藤園	45,900	3,170.00	145,503,000
キーコーヒー	13,700	1,913.00	26,208,100
ユニカフェ	4,500	956.00	4,302,000
ジャパンフーズ	2,600	1,155.00	3,003,000
日清オイリオグループ	82,000	501.00	41,082,000
不二製油グループ本社	41,300	2,045.00	84,458,500
J・オイルミルズ	65,000	344.00	22,360,000
ローソン	51,600	9,940.00	512,904,000
サンエー	9,300	5,140.00	47,802,000
ダイユーエイト	3,700	787.00	2,911,900
カワチ薬品	10,600	2,012.00	21,327,200
エービーシー・マート	17,400	6,350.00	110,490,000
ハードオフコーポレーション	6,600	1,742.00	11,497,200
高千穂交易	5,400	929.00	5,016,600
アスクル	16,600	3,675.00	61,005,000
ゲオホールディングス	25,800	1,907.00	49,200,600
アダストリア	12,500	6,780.00	84,750,000
ジーフット	8,100	908.00	7,354,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	20,000	90.00	1,800,000
伊藤忠食品	3,300	4,350.00	14,355,000
くらコーポレーション	8,000	5,240.00	41,920,000
キャンドウ	7,300	1,524.00	11,125,200
エレマテック	6,300	2,330.00	14,679,000
パル	7,900	2,491.00	19,678,900
JALUX	4,400	2,173.00	9,561,200
エディオン	57,600	930.00	53,568,000
あらた	6,100	2,366.00	14,432,600
サーラコーポレーション	11,700	630.00	7,371,000
ワッツ	5,400	808.00	4,363,200
トーメンデバイス	1,900	1,853.00	3,520,700
ハローズ	4,100	2,801.00	11,484,100
JPHホールディングス	35,800	276.00	9,880,800
あみやき亭	2,600	4,830.00	12,558,000
東京エレクトロン デバイス	5,000	1,575.00	7,875,000
ひらまつ	18,800	674.00	12,671,200

フィールズ	8,900	1,782.00	15,859,800
双日	857,900	233.00	199,890,700
ゲンキー	2,700	2,834.00	7,651,800
アルフレッサ ホールディングス	171,300	2,181.00	373,605,300
サッポロドラッグストアー	1,300	2,381.00	3,095,300
大黒天物産	3,300	4,620.00	15,246,000
ハニーズ	11,900	1,258.00	14,970,200
ファーマライズホールディングス	2,900	509.00	1,476,100
キッコーマン	117,000	4,070.00	476,190,000
味の素	331,000	2,975.50	984,890,500
キュービー	78,700	2,702.00	212,647,400
ハウス食品グループ本社	52,900	2,371.00	125,425,900
カゴメ	55,600	2,096.00	116,537,600
焼津水産化学工業	7,800	1,028.00	8,018,400
アリアケジャパン	12,700	6,530.00	82,931,000
ピエトロ	1,400	1,820.00	2,548,000
エバラ食品工業	3,900	2,005.00	7,819,500
ニチレイ	165,000	989.00	163,185,000
横浜冷凍	33,900	1,074.00	36,408,600
東洋水産	76,100	4,260.00	324,186,000
イトアアンド	1,700	2,290.00	3,893,000
日清食品ホールディングス	65,500	5,540.00	362,870,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,087.00	7,609,000
一正蒲鉾	5,500	879.00	4,834,500
フジッコ	15,000	2,398.00	35,970,000
ロック・フィールド	8,100	3,175.00	25,717,500
日本たばこ産業	914,400	4,643.00	4,245,559,200
ケンコーマヨネーズ	5,100	2,441.00	12,449,100
わらべや日洋	8,300	2,454.00	20,368,200
なとり	7,800	1,731.00	13,501,800
北の達人コーポレーション	2,100	543.00	1,140,300
ユーグレナ	52,200	1,634.00	85,294,800
片倉工業	18,200	1,129.00	20,547,800
ゲンゼ	117,000	308.00	36,036,000
ヒューリック	284,000	1,048.00	297,632,000
神栄	19,000	116.00	2,204,000
山下医科器械	1,200	1,667.00	2,000,400
ラサ商事	6,700	618.00	4,140,600
アルペン	12,200	1,905.00	23,241,000
クオール	13,800	1,517.00	20,934,600
アルコニックス	7,700	1,350.00	10,395,000
神戸物産	8,800	2,758.00	24,270,400
ジェイアイエヌ	9,200	4,765.00	43,838,000
ビックカメラ	70,400	1,037.00	73,004,800
D C Mホールディングス	66,900	876.00	58,604,400
MonotaRO	48,000	2,546.00	122,208,000
東京一番フーズ	2,100	550.00	1,155,000
ダイヤモンドダイニング	2,100	1,115.00	2,341,500
あい ホールディングス	24,300	2,824.00	68,623,200
ディービーエックス	3,700	1,118.00	4,136,600



きちり	3,700	685.00	2,534,500
アークランドサービス	4,300	2,636.00	11,334,800
J.フロント リテイリング	172,400	1,566.00	269,978,400
ドトール・日レスホールディングス	23,900	1,859.00	44,430,100
マツモトキヨシホールディングス	28,100	5,380.00	151,178,000
ブロンコビリー	5,300	2,785.00	14,760,500
スタートトゥデイ	41,400	3,620.00	149,868,000
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,288.00	4,894,400
物語コーポレーション	3,700	4,865.00	18,000,500
ココカラファイン	14,200	4,865.00	69,083,000
三越伊勢丹ホールディングス	270,900	1,431.00	387,657,900
東洋紡	573,000	160.00	91,680,000
ユニチカ	420,000	51.00	21,420,000
富士紡ホールディングス	70,000	213.00	14,910,000
日清紡ホールディングス	76,600	1,193.00	91,383,800
倉敷紡績	148,000	195.00	28,860,000
ダイワボウホールディングス	124,000	211.00	26,164,000
シキボウ	89,000	109.00	9,701,000
日東紡績	96,000	353.00	33,888,000
トヨタ紡織	48,200	1,914.00	92,254,800
マクニカ・富士エレホールディングス	24,500	1,453.00	35,598,500
ウエルシアホールディングス	11,800	6,060.00	71,508,000
クリエイトSDホールディングス	20,000	2,561.00	51,220,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,800	944.00	22,467,200
八洲電機	10,700	566.00	6,056,200
U K Cホールディングス	8,700	2,358.00	20,514,600
丸善C H Iホールディングス	16,000	334.00	5,344,000
O C H Iホールディングス	3,300	1,018.00	3,359,400
T O K A Iホールディングス	60,000	592.00	35,520,000
ミサワ	1,800	560.00	1,008,000
エー・ピーカンパニー	2,300	1,202.00	2,764,600
三洋貿易	7,500	1,396.00	10,470,000
チムニー	3,300	2,875.00	9,487,500
シュッピン	3,800	1,065.00	4,047,000
ウイン・パートナーズ	4,900	1,533.00	7,511,700
ネクステージ	2,200	620.00	1,364,000
ジョイフル本田	22,100	2,359.00	52,133,900
キリン堂ホールディングス	4,400	989.00	4,351,600
ホットランド	3,500	1,363.00	4,770,500
すかいらーく	41,700	1,371.00	57,170,700
綿半ホールディングス	3,800	1,496.00	5,684,800
日本毛織	44,000	857.00	37,708,000
大東紡織	22,000	60.00	1,320,000
トーア紡コーポレーション	6,300	522.00	3,288,600
ダイドーリミテッド	16,600	499.00	8,283,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,200	1,054.00	47,640,800
三栄建築設計	5,400	1,134.00	6,123,600
野村不動産ホールディングス	90,300	2,060.00	186,018,000

三重交通グループホールディングス	24,500	469.00	11,490,500
サムティ	7,200	1,041.00	7,495,200
ディア・ライフ	6,800	340.00	2,312,000
エー・ディー・ワークス	92,000	45.00	4,140,000
日本商業開発	4,500	1,652.00	7,434,000
プレサンスコーポレーション	4,600	3,605.00	16,583,000
ユニゾホールディングス	8,500	4,140.00	35,190,000
日本管理センター	8,900	1,335.00	11,881,500
サンセイランディック	3,100	773.00	2,396,300
エストラスト	2,400	622.00	1,492,800
フージャースホールディングス	18,900	503.00	9,506,700
オープンハウス	19,700	1,931.00	38,040,700
東急不動産ホールディングス	329,600	717.00	236,323,200
飯田グループホールディングス	126,200	2,141.00	270,194,200
帝国繊維	15,100	1,266.00	19,116,600
ブックオフコーポレーション	7,700	941.00	7,245,700
日本コークス工業	117,000	81.00	9,477,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,800	742.00	2,077,600
ミタチ産業	3,600	696.00	2,505,600
あさひ	10,100	1,374.00	13,877,400
日本調剤	3,400	4,100.00	13,940,000
コスモス薬品	6,900	17,240.00	118,956,000
シップヘルスケアホールディングス	27,700	2,761.00	76,479,700
トーエル	7,200	702.00	5,054,400
一六堂	3,600	372.00	1,339,200
ソフトクリエイトホールディングス	5,000	864.00	4,320,000
セブン&アイ・ホールディングス	569,900	5,165.00	2,943,533,500
薬王堂	1,900	2,936.00	5,578,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,200	2,982.00	36,380,400
明治電機工業	4,300	1,140.00	4,902,000
ツルハホールディングス	31,300	10,080.00	315,504,000
デリカフーズ	3,100	964.00	2,988,400
スターティア	2,600	595.00	1,547,000
サンマルクホールディングス	10,700	2,956.00	31,629,200
フェリシモ	3,900	1,007.00	3,927,300
トリドール	16,700	2,473.00	41,299,100
クスリのアオキ	12,100	5,210.00	63,041,000
帝人	591,000	397.00	234,627,000
東レ	1,049,000	984.20	1,032,425,800
クラレ	228,200	1,448.00	330,433,600
旭化成	902,000	760.00	685,520,000
サカイオーベックス	38,000	204.00	7,752,000
稲葉製作所	7,800	1,179.00	9,196,200
宮地エンジニアリンググループ	45,000	161.00	7,245,000
トーカロ	10,200	2,035.00	20,757,000
アルファ	4,900	1,215.00	5,953,500
SUMCO	113,100	727.00	82,223,700
川田テクノロジーズ	2,700	3,685.00	9,949,500
住江織物	36,000	316.00	11,376,000

日本フェルト	7,800	486.00	3,790,800
イチカワ	10,000	283.00	2,830,000
エコナックホールディングス	43,000	45.00	1,935,000
日東製網	18,000	137.00	2,466,000
芦森工業	31,000	169.00	5,239,000
アツギ	118,000	116.00	13,688,000
ダイニック	28,000	156.00	4,368,000
共和レザー	9,500	890.00	8,455,000
セーレン	36,000	1,248.00	44,928,000
東海染工	22,000	130.00	2,860,000
小松精練	22,100	618.00	13,657,800
ワコールホールディングス	86,000	1,399.00	120,314,000
ホギメディカル	9,100	5,860.00	53,326,000
レナウン	38,800	110.00	4,268,000
クラウドシア	3,600	520.00	1,872,000
T S Iホールディングス	64,500	802.00	51,729,000
I Tホールディングス	45,200	2,813.00	127,147,600
ネオス	4,000	458.00	1,832,000
電算システム	4,700	1,643.00	7,722,100
グリー	82,600	600.00	49,560,000
コーエーテクモホールディングス	32,300	1,793.00	57,913,900
三菱総合研究所	5,300	3,225.00	17,092,500
ボルテージ	2,600	1,211.00	3,148,600
電算	1,600	2,348.00	3,756,800
A G S	2,400	931.00	2,234,400
ファインデックス	8,900	904.00	8,045,600
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	1,719.00	5,328,900
ブレインパッド	2,000	682.00	1,364,000
K L a b	21,000	684.00	14,364,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,900	994.00	8,846,600
イーブクイニシアティブジャパン	3,000	580.00	1,740,000
ネクソン	130,200	1,843.00	239,958,600
アイスタイル	22,400	955.00	21,392,000
エムアップ	3,500	568.00	1,988,000
エイチーム	5,000	1,645.00	8,225,000
テクノスジャパン	1,500	2,968.00	4,452,000
e n i s h	4,000	568.00	2,272,000
コロプラ	37,600	2,092.00	78,659,200
モバイルクリエイト	8,900	390.00	3,471,000
オルトプラス	5,000	348.00	1,740,000
ブロードリーフ	14,100	1,131.00	15,947,100
ハーツユナイテッドグループ	4,100	2,096.00	8,593,600
ブイキューブ	6,600	975.00	6,435,000
サイバーリンクス	1,500	1,008.00	1,512,000
VOYAGE GROUP	3,000	1,200.00	3,600,000
オブティム	900	4,330.00	3,897,000
特種東海製紙	84,000	357.00	29,988,000
ベリサーブ	1,500	2,167.00	3,250,500
ティーガイア	13,500	1,320.00	17,820,000

日本アジアグループ	11,500	572.00	6,578,000	
豆蔵ホールディングス	10,600	659.00	6,985,400	
テクマトリックス	5,800	1,459.00	8,462,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	238,000	277.00	65,926,000	
GMOペイメントゲートウェイ	11,800	6,080.00	71,744,000	
ザッパラス	7,800	425.00	3,315,000	
インターネットイニシアティブ	22,000	2,208.00	48,576,000	
さくらインターネット	6,700	1,887.00	12,642,900	
GMOクラウド	3,000	690.00	2,070,000	
SRAホールディングス	7,800	2,492.00	19,437,600	
MINORIソリューションズ	2,000	923.00	1,846,000	
システムインテグレータ	1,800	762.00	1,371,600	
朝日ネット	12,600	507.00	6,388,200	
コムチュア	2,300	2,007.00	4,616,100	
王子ホールディングス	593,000	479.00	284,047,000	
日本製紙	74,700	1,948.00	145,515,600	
三菱製紙	221,000	83.00	18,343,000	
北越紀州製紙	89,700	716.00	64,225,200	
中越パルプ工業	57,000	192.00	10,944,000	
巴川製紙所	21,000	207.00	4,347,000	
大王製紙	64,000	1,037.00	66,368,000	
gumi	14,000	599.00	8,386,000	
パイプドHD	1,700	1,163.00	1,977,100	
レンゴー	128,000	616.00	78,848,000	
トモク	46,000	267.00	12,282,000	
ザ・バック	10,200	2,599.00	26,509,800	
昭和電工	963,000	129.00	124,227,000	
住友化学	1,064,000	554.00	589,456,000	
日本化成	28,000	117.00	3,276,000	
住友精化	30,000	649.00	19,470,000	
日産化学工業	86,900	2,784.00	241,929,600	
ラサ工業	55,000	115.00	6,325,000	
クレハ	109,000	392.00	42,728,000	
多木化学	8,000	703.00	5,624,000	
テイカ	24,000	560.00	13,440,000	
石原産業	260,000	82.00	21,320,000	
片倉コープアグリ	18,000	227.00	4,086,000	
日東エフシー	8,500	850.00	7,225,000	
日本曹達	93,000	565.00	52,545,000	
東ソー	390,000	470.00	183,300,000	
トクヤマ	240,000	147.00	35,280,000	
セントラル硝子	157,000	607.00	95,299,000	
東亜合成	90,600	946.00	85,707,600	
大阪ソーダ	62,000	446.00	27,652,000	
関東電化工業	34,000	846.00	28,764,000	
デンカ	300,000	449.00	134,700,000	
イビデン	84,500	1,383.00	116,863,500	
信越化学工業	259,300	5,982.00	1,551,132,600	
日本カーバイド工業	49,000	133.00	6,517,000	

堺化学工業	59,000	343.00	20,237,000
エア・ウォーター	119,000	1,898.00	225,862,000
大陽日酸	111,400	1,168.00	130,115,200
日本化学工業	54,000	230.00	12,420,000
日本パーカライジング	73,900	1,086.00	80,255,400
高圧ガス工業	20,000	613.00	12,260,000
チタン工業	18,000	182.00	3,276,000
四国化成工業	20,000	974.00	19,480,000
戸田工業	29,000	269.00	7,801,000
ステラ ケミファ	7,400	2,116.00	15,658,400
保土谷化学工業	43,000	188.00	8,084,000
日本触媒	21,000	7,340.00	154,140,000
大日精化工業	56,000	472.00	26,432,000
カネカ	195,000	1,092.00	212,940,000
協和発酵キリン	173,000	1,799.00	311,227,000
三菱瓦斯化学	249,000	604.00	150,396,000
三井化学	613,000	452.00	277,076,000
J S R	135,700	1,706.00	231,504,200
東京応化工業	29,000	3,100.00	89,900,000
大阪有機化学工業	10,400	649.00	6,749,600
三菱ケミカルホールディングス	968,500	655.20	634,561,200
日本合成化学工業	34,000	717.00	24,378,000
ダイセル	203,300	1,706.00	346,829,800
住友ベークライト	135,000	489.00	66,015,000
積水化学工業	328,200	1,425.00	467,685,000
日本ゼオン	124,000	776.00	96,224,000
アイカ工業	43,500	2,185.00	95,047,500
宇部興産	774,000	222.00	171,828,000
積水樹脂	22,400	1,423.00	31,875,200
タキロン	34,000	569.00	19,346,000
旭有機材工業	47,000	214.00	10,058,000
日立化成	71,400	2,018.00	144,085,200
ニチパン	14,000	618.00	8,652,000
リケンテクノス	23,500	354.00	8,319,000
大倉工業	35,000	304.00	10,640,000
積水化成品工業	37,000	384.00	14,208,000
群栄化学工業	39,000	283.00	11,037,000
タイガースポリマー	7,200	663.00	4,773,600
ミライアル	5,300	885.00	4,690,500
ダイキアクシス	2,700	851.00	2,297,700
ダイキョーニシカワ	18,600	1,773.00	32,977,800
日本化薬	94,000	1,296.00	121,824,000
カーリットホールディングス	13,600	517.00	7,031,200
E P Sホールディングス	16,100	1,356.00	21,831,600
レグス	2,100	639.00	1,341,900
プレステージ・インターナショナル	12,100	1,140.00	13,794,000
フェイス	3,600	1,208.00	4,348,800
アミューズ	4,000	4,865.00	19,460,000
野村総合研究所	95,500	4,230.00	403,965,000
ドリームインキュベータ	4,800	2,073.00	9,950,400

サイバネットシステム	11,100	698.00	7,747,800
クイック	7,400	743.00	5,498,200
T A C	8,200	205.00	1,681,000
C Eホールディングス	1,800	900.00	1,620,000
ケネディクス	193,400	438.00	84,709,200
電通	160,700	6,030.00	969,021,000
インテージホールディングス	7,100	1,424.00	10,110,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	536.00	3,644,800
東邦システムサイエンス	4,100	641.00	2,628,100
ぴあ	4,300	2,387.00	10,264,100
イオンファンタジー	5,100	2,033.00	10,368,300
ソースネクスト	6,800	514.00	3,495,200
シーティーエス	3,300	745.00	2,458,500
ネクシィーズ	5,000	740.00	3,700,000
メディカルシステムネットワーク	15,400	491.00	7,561,400
ティー・ワイ・オー	18,600	170.00	3,162,000
日本精化	12,000	742.00	8,904,000
扶桑化学工業	9,100	1,383.00	12,585,300
A D E K A	71,100	1,640.00	116,604,000
日油	110,000	894.00	98,340,000
ミヨシ油脂	54,000	119.00	6,426,000
新日本理化	22,400	143.00	3,203,200
ハリマ化成グループ	12,400	559.00	6,931,600
花王	388,900	6,209.00	2,414,680,100
第一工業製薬	32,000	345.00	11,040,000
三洋化成工業	45,000	877.00	39,465,000
武田薬品工業	575,800	5,845.00	3,365,551,000
アステラス製薬	1,619,100	1,662.50	2,691,753,750
大日本住友製薬	102,400	1,305.00	133,632,000
塩野義製薬	210,700	5,190.00	1,093,533,000
田辺三菱製薬	168,500	2,107.00	355,029,500
わかもと製薬	7,000	275.00	1,925,000
あすか製薬	18,400	1,285.00	23,644,000
日本新薬	33,100	4,220.00	139,682,000
ピオフェルミン製薬	2,300	3,510.00	8,073,000
中外製薬	144,000	3,625.00	522,000,000
科研製薬	24,900	8,030.00	199,947,000
エーザイ	178,000	7,886.00	1,403,708,000
理研ビタミン	4,600	3,860.00	17,756,000
ロート製薬	70,800	2,146.00	151,936,800
小野薬品工業	65,700	20,565.00	1,351,120,500
久光製薬	44,900	5,400.00	242,460,000
有機合成薬品工業	10,000	257.00	2,570,000
持田製薬	10,000	9,730.00	97,300,000
参天製薬	266,100	1,870.00	497,607,000
扶桑薬品工業	49,000	274.00	13,426,000
日本ケミファ	18,000	511.00	9,198,000
ツムラ	45,500	2,949.00	134,179,500
日医工	33,800	2,701.00	91,293,800
テルモ	211,600	4,080.00	863,328,000

みらかホールディングス	36,800	5,160.00	189,888,000
キッセイ薬品工業	25,600	2,936.00	75,161,600
生化学工業	27,700	1,426.00	39,500,200
栄研化学	12,100	2,277.00	27,551,700
日水製薬	5,900	1,310.00	7,729,000
鳥居薬品	9,900	2,596.00	25,700,400
J C Rファーマ	11,100	2,273.00	25,230,300
東和薬品	6,600	6,380.00	42,108,000
富士製薬工業	4,100	2,159.00	8,851,900
沢井製薬	24,500	8,210.00	201,145,000
ゼリア新薬工業	29,600	1,567.00	46,383,200
第一三共	486,300	2,420.50	1,177,089,150
キョーリン製薬ホールディングス	38,600	2,365.00	91,289,000
大幸薬品	7,100	1,333.00	9,464,300
ダイト	6,200	3,025.00	18,755,000
大塚ホールディングス	310,900	4,192.00	1,303,292,800
大正製薬ホールディングス	34,800	8,460.00	294,408,000
ペプチドリーム	17,800	3,830.00	68,174,000
大日本塗料	83,000	215.00	17,845,000
日本ペイントホールディングス	111,600	2,299.00	256,568,400
関西ペイント	163,600	1,765.00	288,754,000
神東塗料	11,000	193.00	2,123,000
中国塗料	41,000	767.00	31,447,000
日本特殊塗料	10,100	957.00	9,665,700
藤倉化成	19,800	544.00	10,771,200
太陽ホールディングス	10,600	4,205.00	44,573,000
D I C	579,000	290.00	167,910,000
サカタイクス	29,500	1,070.00	31,565,000
東洋インキS Cホールディングス	143,000	449.00	64,207,000
T & K T O K A	10,500	1,001.00	10,510,500
アルプス技研	5,300	2,147.00	11,379,100
サニックス	23,100	157.00	3,626,700
ダイオーズ	2,600	1,121.00	2,914,600
日本空調サービス	7,100	1,059.00	7,518,900
オリエンタルランド	155,900	7,809.00	1,217,423,100
ダスキン	40,800	2,236.00	91,228,800
パーク24	68,700	3,290.00	226,023,000
明光ネットワークジャパン	16,700	1,136.00	18,971,200
ファルコホールディングス	6,300	1,288.00	8,114,400
クレスコ	3,100	1,861.00	5,769,100
フジ・メディア・ホールディングス	141,900	1,394.00	197,808,600
秀英予備校	2,500	572.00	1,430,000
田谷	3,000	677.00	2,031,000
ラウンドワン	45,000	575.00	25,875,000
リゾートトラスト	60,500	3,000.00	181,500,000
オービック	47,000	5,620.00	264,140,000
ジャストシステム	24,800	910.00	22,568,000
T D Cソフトウェアエンジニアリング	3,000	1,267.00	3,801,000
ヤフー	976,400	465.00	454,026,000
ビー・エム・エル	8,500	3,685.00	31,322,500

ワタベウェディング	4,300	433.00	1,861,900
トレンドマイクロ	66,100	4,785.00	316,288,500
りらいあコミュニケーションズ	23,800	1,035.00	24,633,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,900	887.00	2,572,300
リソー教育	26,700	326.00	8,704,200
日本オラクル	21,800	5,230.00	114,014,000
早稲田アカデミー	2,400	906.00	2,174,400
アルファシステムズ	4,500	1,800.00	8,100,000
フューチャーアーキテクト	16,400	805.00	13,202,000
C A C Holdings	10,200	891.00	9,088,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	1,312.00	4,854,400
トーセ	3,600	692.00	2,491,200
ユー・エス・エス	174,500	1,752.00	305,724,000
オービックビジネスコンサルタント	6,900	4,805.00	33,154,500
伊藤忠テクノソリューションズ	30,800	2,123.00	65,388,400
アイティフォー	17,700	508.00	8,991,600
東京個別指導学院	6,900	725.00	5,002,500
東計電算	2,400	2,001.00	4,802,400
サイバーエージェント	35,200	5,430.00	191,136,000
楽天	674,400	1,214.00	818,721,600
エクスネット	1,600	1,556.00	2,489,600
テー・オー・ダブリュー	8,600	613.00	5,271,800
大塚商会	36,600	5,860.00	214,476,000
総合メディカル	6,600	3,900.00	25,740,000
サイボウズ	18,500	289.00	5,346,500
ソフトブレイン	19,900	158.00	3,144,200
セントラルスポーツ	5,000	2,325.00	11,625,000
パラカ	4,700	1,445.00	6,791,500
電通国際情報サービス	8,400	2,267.00	19,042,800
イーエムシステムズ	2,300	2,698.00	6,205,400
ウェザーニューズ	4,600	3,845.00	17,687,000
C I J	12,300	464.00	5,707,200
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,343.00	2,014,500
日本エンタープライズ	13,800	208.00	2,870,400
WOWOW	6,500	2,796.00	18,174,000
フュージョンパートナー	7,700	599.00	4,612,300
フルキャストホールディングス	13,100	649.00	8,501,900
富士フイルムホールディングス	330,900	4,624.00	1,530,081,600
コニカミノルタ	344,800	974.00	335,835,200
資生堂	274,300	2,330.00	639,119,000
ライオン	167,000	1,058.00	176,686,000
高砂香料工業	9,500	2,694.00	25,593,000
マンダム	13,500	4,645.00	62,707,500
ミルボン	8,500	4,255.00	36,167,500
ファンケル	33,600	1,540.00	51,744,000
コーセー	23,400	9,950.00	232,830,000
コタ	4,500	1,583.00	7,123,500
シーズ・ホールディングス	19,000	1,956.00	37,164,000
シーボン	1,600	2,488.00	3,980,800



ポーラ・オルビスホールディングス	14,700	7,950.00	116,865,000
ノエビアホールディングス	9,100	3,110.00	28,301,000
アジュバンコスメジャパン	2,900	991.00	2,873,900
エステー	10,000	1,151.00	11,510,000
アグロ カネショウ	5,700	952.00	5,426,400
コニシ	11,300	2,468.00	27,888,400
長谷川香料	18,300	1,527.00	27,944,100
星光P M C	7,900	1,071.00	8,460,900
小林製薬	21,900	9,980.00	218,562,000
荒川化学工業	12,400	1,052.00	13,044,800
メック	11,200	868.00	9,721,600
日本高純度化学	4,200	2,072.00	8,702,400
J C U	4,200	3,685.00	15,477,000
新田ゼラチン	9,700	710.00	6,887,000
O A Tアグリオ	1,300	1,376.00	1,788,800
デクセリアルズ	32,400	1,164.00	37,713,600
アース製薬	10,400	4,735.00	49,244,000
イハラケミカル工業	22,200	1,469.00	32,611,800
北興化学工業	16,000	343.00	5,488,000
大成ラミック	4,100	3,120.00	12,792,000
クミアイ化学工業	29,800	1,254.00	37,369,200
日本農薬	33,000	715.00	23,595,000
昭和シェル石油	145,400	973.00	141,474,200
富士興産	5,500	439.00	2,414,500
ニチレキ	17,800	932.00	16,589,600
東燃ゼネラル石油	218,000	1,008.00	219,744,000
ユシロ化学工業	7,800	1,317.00	10,272,600
ビービー・カストロール	5,900	1,243.00	7,333,700
富士石油	33,500	271.00	9,078,500
M O R E S C O	4,600	1,542.00	7,093,200
出光興産	75,500	1,878.00	141,789,000
J Xホールディングス	1,711,400	473.60	810,519,040
コスモエネルギーホールディングス	43,600	1,272.00	55,459,200
横浜ゴム	87,200	1,692.00	147,542,400
東洋ゴム工業	65,400	2,140.00	139,956,000
ブリヂストン	487,900	4,139.00	2,019,418,100
住友ゴム工業	135,300	1,453.00	196,590,900
藤倉ゴム工業	12,200	497.00	6,063,400
オカモト	45,000	1,015.00	45,675,000
アキレス	120,000	140.00	16,800,000
フコク	5,300	942.00	4,992,600
ニッタ	15,600	3,165.00	49,374,000
クリエートメディック	4,900	903.00	4,424,700
住友理工	31,200	1,047.00	32,666,400
三ツ星ベルト	35,000	856.00	29,960,000
パンドー化学	53,000	453.00	24,009,000
鬼怒川ゴム工業	32,000	552.00	17,664,000
旭硝子	763,000	624.00	476,112,000
日本板硝子	696,000	78.00	54,288,000
石塚硝子	20,000	216.00	4,320,000

有沢製作所	21,300	609.00	12,971,700
日本山村硝子	58,000	175.00	10,150,000
日本電気硝子	299,000	586.00	175,214,000
オハラ	5,800	538.00	3,120,400
住友大阪セメント	286,000	448.00	128,128,000
太平洋セメント	902,000	308.00	277,816,000
デイ・シイ	13,200	295.00	3,894,000
リゾートソリューション	14,000	311.00	4,354,000
日本ヒューム	14,000	621.00	8,694,000
日本コンクリート工業	29,800	299.00	8,910,200
三谷セキサン	7,300	1,515.00	11,059,500
アジアパイルホールディングス	17,800	399.00	7,102,200
東海カーボン	125,000	302.00	37,750,000
日本カーボン	71,000	214.00	15,194,000
東洋炭素	8,000	1,676.00	13,408,000
ノリタケカンパニーリミテド	82,000	256.00	20,992,000
T O T O	106,200	3,525.00	374,355,000
日本碍子	183,000	2,253.00	412,299,000
日本特殊陶業	124,600	2,596.00	323,461,600
ダントーホールディングス	17,000	183.00	3,111,000
M A R U W A	5,300	2,705.00	14,336,500
品川リフラクトリーズ	37,000	239.00	8,843,000
黒崎播磨	31,000	255.00	7,905,000
ヨータイ	8,000	312.00	2,496,000
イソライト工業	7,100	198.00	1,405,800
東京窯業	17,000	179.00	3,043,000
ニッカトー	5,500	389.00	2,139,500
フジインコーポレーテッド	12,700	1,217.00	15,455,900
エーアンドエーマテリアル	30,000	81.00	2,430,000
ニチアス	74,000	719.00	53,206,000
新日鐵住金	651,700	2,086.50	1,359,772,050
神戸製鋼所	2,655,000	95.00	252,225,000
中山製鋼所	162,000	68.00	11,016,000
合同製鐵	81,000	214.00	17,334,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	395,000	1,445.50	570,972,500
日新製鋼	65,900	1,286.00	84,747,400
東京製鐵	79,700	772.00	61,528,400
共英製鋼	15,400	1,891.00	29,121,400
大和工業	31,900	2,502.00	79,813,800
東京鐵鋼	30,000	442.00	13,260,000
大阪製鐵	9,100	1,961.00	17,845,100
淀川製鋼所	21,500	2,404.00	51,686,000
東洋鋼鈹	34,600	343.00	11,867,800
丸一鋼管	48,400	3,350.00	162,140,000
モリ工業	21,000	334.00	7,014,000
大同特殊鋼	242,000	465.00	112,530,000
日本高周波鋼業	56,000	78.00	4,368,000
日本冶金工業	106,200	117.00	12,425,400
山陽特殊製鋼	86,000	561.00	48,246,000

愛知製鋼	85,000	464.00	39,440,000
日立金属	165,400	1,216.00	201,126,400
日本金属	38,000	103.00	3,914,000
大平洋金属	101,000	291.00	29,391,000
新日本電工	81,900	173.00	14,168,700
栗本鐵工所	69,000	182.00	12,558,000
虹 技	21,000	172.00	3,612,000
日本鑄鉄管	16,000	150.00	2,400,000
日本製鋼所	239,000	366.00	87,474,000
三菱製鋼	101,000	200.00	20,200,000
日亜鋼業	18,800	270.00	5,076,000
日本精線	10,000	481.00	4,810,000
大紀アルミニウム工業所	23,000	283.00	6,509,000
日本軽金属ホールディングス	327,000	185.00	60,495,000
三井金属鉱業	368,000	184.00	67,712,000
東邦亜鉛	76,000	233.00	17,708,000
三菱マテリアル	902,000	356.00	321,112,000
住友金属鉱山	399,000	1,162.50	463,837,500
D O W Aホールディングス	186,000	637.00	118,482,000
古河機械金属	225,000	185.00	41,625,000
エス・サイエンス	65,100	37.00	2,408,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,200	1,711.00	24,296,200
東邦チタニウム	24,400	991.00	24,180,400
U A C J	202,000	221.00	44,642,000
古河電気工業	454,000	274.00	124,396,000
住友電気工業	578,500	1,508.00	872,378,000
フジクラ	201,000	539.00	108,339,000
昭和電線ホールディングス	174,000	60.00	10,440,000
東京特殊電線	1,900	869.00	1,651,100
タツタ電線	30,300	367.00	11,120,100
沖電線	17,000	217.00	3,689,000
カナレ電気	2,300	1,779.00	4,091,700
平河ヒューテック	6,800	993.00	6,752,400
リョービ	88,000	452.00	39,776,000
アーレスティ	16,700	663.00	11,072,100
アサヒホールディングス	21,800	1,589.00	34,640,200
東洋製罐グループホールディングス	102,700	2,202.00	226,145,400
ホッカンホールディングス	35,000	305.00	10,675,000
コロナ	7,700	1,012.00	7,792,400
横河ブリッジホールディングス	27,400	1,045.00	28,633,000
O S J Bホールディングス	31,800	216.00	6,868,800
駒井ハルテック	26,000	226.00	5,876,000
高田機工	12,000	196.00	2,352,000
三和ホールディングス	146,400	796.00	116,534,400
文化シャッター	40,300	984.00	39,655,200
三協立山	19,000	1,339.00	25,441,000
アルインコ	8,300	1,037.00	8,607,100
東洋シャッター	3,600	643.00	2,314,800
L I X I Lグループ	201,300	2,636.00	530,626,800
日本ファイルコン	10,700	447.00	4,782,900

ノーリツ	28,300	1,822.00	51,562,600
長府製作所	15,400	2,504.00	38,561,600
リンナイ	26,900	10,140.00	272,766,000
ユニプレス	28,600	2,291.00	65,522,600
ダイニチ工業	7,700	652.00	5,020,400
日東精工	20,000	284.00	5,680,000
三洋工業	19,000	164.00	3,116,000
岡部	30,100	883.00	26,578,300
ジーテクト	15,100	1,252.00	18,905,200
中国工業	2,500	670.00	1,675,000
東ブレ	27,800	2,328.00	64,718,400
高周波熱錬	26,900	845.00	22,730,500
東京製綱	98,000	147.00	14,406,000
サンコール	7,800	518.00	4,040,400
モリテックスチール	7,500	268.00	2,010,000
パイオラックス	7,300	5,910.00	43,143,000
日本発条	136,000	1,055.00	143,480,000
中央発條	17,000	281.00	4,777,000
アドバネクス	2,700	1,362.00	3,677,400
三浦工業	64,500	1,844.00	118,938,000
タクマ	53,000	909.00	48,177,000
テクノプロ・ホールディングス	23,400	3,150.00	73,710,000
インターワークス	1,900	696.00	1,322,400
リブセンス	9,300	302.00	2,808,600
ジャパンマテリアル	6,000	2,250.00	13,500,000
ベクトル	4,500	2,184.00	9,828,000
ウチヤマホールディングス	7,500	495.00	3,712,500
サクセスホールディングス	1,300	1,269.00	1,649,700
キャリアリンク	1,900	1,526.00	2,899,400
I B J	8,400	434.00	3,645,600
アサンテ	5,300	1,610.00	8,533,000
N・フィールド	5,100	972.00	4,957,200
M & Aキャピタルパートナーズ	1,200	1,860.00	2,232,000
ライドオン・エクスプレス	2,300	2,059.00	4,735,700
E R Iホールディングス	3,800	831.00	3,157,800
アビスト	1,500	2,181.00	3,271,500
ウィルグループ	3,300	885.00	2,920,500
日本ビューホテル	1,600	1,657.00	2,651,200
リクルートホールディングス	290,800	3,720.00	1,081,776,000
エラン	1,200	1,300.00	1,560,000
ツガミ	42,000	412.00	17,304,000
オークマ	94,000	786.00	73,884,000
東芝機械	79,000	380.00	30,020,000
アマダホールディングス	210,700	1,064.00	224,184,800
アイダエンジニアリング	37,900	1,008.00	38,203,200
滝澤鉄工所	45,000	128.00	5,760,000
富士機械製造	47,200	1,102.00	52,014,400
牧野フライス製作所	72,000	706.00	50,832,000
オーエスジー	65,800	1,925.00	126,665,000
ダイジェット工業	17,000	139.00	2,363,000

旭ダイヤモンド工業	39,600	1,219.00	48,272,400
D M G 森精機	79,700	1,057.00	84,242,900
ソディック	27,400	746.00	20,440,400
ディスコ	18,400	11,210.00	206,264,000
日東工器	8,400	2,248.00	18,883,200
パンチ工業	5,700	797.00	4,542,900
日本郵政	318,000	1,417.00	450,606,000
ベルシステム24ホールディングス	21,200	1,141.00	24,189,200
豊田自動織機	125,700	5,190.00	652,383,000
豊和工業	8,100	546.00	4,422,600
O K K	56,000	119.00	6,664,000
石川製作所	35,000	73.00	2,555,000
東洋機械金属	10,800	370.00	3,996,000
津田駒工業	36,000	108.00	3,888,000
エンシュウ	35,000	76.00	2,660,000
島精機製作所	20,400	1,868.00	38,107,200
フリーー	2,100	3,040.00	6,384,000
日阪製作所	18,300	835.00	15,280,500
やまびこ	26,500	817.00	21,650,500
ペガサスミシン製造	14,900	497.00	7,405,300
ナブテスコ	75,100	2,173.00	163,192,300
三井海洋開発	16,900	1,403.00	23,710,700
レオン自動機	12,200	615.00	7,503,000
S M C	43,300	25,085.00	1,086,180,500
新川	12,900	503.00	6,488,700
ホソカワミクロン	24,000	546.00	13,104,000
ユニオンツール	6,200	2,822.00	17,496,400
オイレス工業	18,700	1,880.00	35,156,000
日精エー・エス・ビー機械	5,300	2,155.00	11,421,500
サトーホールディングス	19,500	2,429.00	47,365,500
日本エアータック	5,000	666.00	3,330,000
日精樹脂工業	10,500	762.00	8,001,000
ワイエイシイ	5,700	757.00	4,314,900
小松製作所	708,300	1,791.50	1,268,919,450
住友重機械工業	421,000	471.00	198,291,000
日立建機	64,600	1,717.00	110,918,200
日工	19,000	350.00	6,650,000
巴工業	6,000	1,485.00	8,910,000
井関農機	148,000	159.00	23,532,000
T O W A	13,900	629.00	8,743,100
丸山製作所	31,000	181.00	5,611,000
北川鉄工所	66,000	209.00	13,794,000
シンニッタン	13,100	553.00	7,244,300
タカキタ	3,600	549.00	1,976,400
クボタ	693,700	1,601.00	1,110,613,700
荏原実業	4,400	1,286.00	5,658,400
東洋エンジニアリング	83,000	291.00	24,153,000
三菱化工機	47,000	237.00	11,139,000
月島機械	27,400	1,045.00	28,633,000
帝国電機製作所	10,500	731.00	7,675,500

東京機械製作所	54,000	39.00	2,106,000
新東工業	32,800	945.00	30,996,000
澁谷工業	12,100	1,455.00	17,605,500
アイチコーポレーション	20,500	781.00	16,010,500
小森コーポレーション	35,100	1,239.00	43,488,900
鶴見製作所	10,700	1,736.00	18,575,200
住友精密工業	23,000	363.00	8,349,000
酒井重工業	28,000	186.00	5,208,000
荏原製作所	319,000	503.00	160,457,000
石井鐵工所	21,000	170.00	3,570,000
西島製作所	15,400	906.00	13,952,400
北越工業	15,600	727.00	11,341,200
千代田化工建設	112,000	850.00	95,200,000
ダイキン工業	201,000	7,708.00	1,549,308,000
オルガノ	25,000	447.00	11,175,000
トヨーカネツ	77,000	222.00	17,094,000
栗田工業	86,800	2,639.00	229,065,200
椿本チエイン	82,000	680.00	55,760,000
大同工業	27,000	194.00	5,238,000
日本コンベヤ	48,000	134.00	6,432,000
日機装	51,600	852.00	43,963,200
木村化工機	12,400	372.00	4,612,800
新興プランテック	31,800	930.00	29,574,000
アネスト岩田	23,300	964.00	22,461,200
ダイフク	74,200	1,868.00	138,605,600
サムコ	2,300	839.00	1,929,700
加藤製作所	33,000	414.00	13,662,000
油研工業	27,000	222.00	5,994,000
タダノ	67,000	1,046.00	70,082,000
フジテック	40,200	1,152.00	46,310,400
C K D	38,400	1,013.00	38,899,200
キトー	17,400	895.00	15,573,000
平和	42,800	2,315.00	99,082,000
理想科学工業	15,300	1,729.00	26,453,700
S A N K Y O	38,400	4,470.00	171,648,000
日本金銭機械	12,700	993.00	12,611,100
マースエンジニアリング	7,900	1,946.00	15,373,400
福島工業	8,500	2,568.00	21,828,000
オーイズミ	5,800	587.00	3,404,600
ダイコク電機	5,700	1,486.00	8,470,200
竹内製作所	20,500	1,670.00	34,235,000
アマノ	42,700	1,642.00	70,113,400
J U K I	20,500	858.00	17,589,000
サンデンホールディングス	84,000	286.00	24,024,000
蛇の目ミシン工業	13,400	621.00	8,321,400
ブラザー工業	178,500	1,202.00	214,557,000
マックス	20,000	1,189.00	23,780,000
モリタホールディングス	24,200	1,275.00	30,855,000
グローリー	47,100	3,835.00	180,628,500
新晃工業	9,600	1,629.00	15,638,400

大和冷機工業	22,200	897.00	19,913,400
セガサミーホールディングス	148,300	1,224.00	181,519,200
日本ピストンリング	5,800	1,741.00	10,097,800
リケン	64,000	401.00	25,664,000
T P R	17,000	2,916.00	49,572,000
ツバキ・ナカシマ	12,800	1,504.00	19,251,200
ホシザキ電機	30,300	8,290.00	251,187,000
大豊工業	11,100	1,213.00	13,464,300
日本精工	283,500	1,082.00	306,747,000
N T N	342,000	388.00	132,696,000
ジェイテクト	147,100	1,614.00	237,419,400
不二越	128,000	396.00	50,688,000
ミネベア	222,000	822.00	182,484,000
日本トムソン	47,000	478.00	22,466,000
T H K	91,800	1,866.00	171,298,800
ユーシン精機	5,400	1,895.00	10,233,000
前澤給装工業	5,800	1,464.00	8,491,200
イーグル工業	17,100	1,630.00	27,873,000
前澤工業	9,900	288.00	2,851,200
日本ピラー工業	14,000	915.00	12,810,000
キッツ	67,200	509.00	34,204,800
日立製作所	3,522,000	495.30	1,744,446,600
東芝	2,906,000	178.60	519,011,600
三菱電機	1,473,000	1,143.00	1,683,639,000
富士電機	416,000	396.00	164,736,000
東洋電機製造	27,000	354.00	9,558,000
安川電機	171,400	1,290.00	221,106,000
シンフォニア テクノロジー	90,000	165.00	14,850,000
明電舎	127,000	505.00	64,135,000
オリジン電気	20,000	275.00	5,500,000
山洋電気	36,000	586.00	21,096,000
デンヨー	12,700	1,520.00	19,304,000
日立工機	37,000	794.00	29,378,000
三櫻工業	17,600	605.00	10,648,000
マキタ	90,000	6,570.00	591,300,000
東芝テック	99,000	353.00	34,947,000
芝浦メカトロニクス	22,000	206.00	4,532,000
マブチモーター	39,500	5,840.00	230,680,000
日本電産	166,100	7,666.00	1,273,322,600
東光高岳	7,700	1,466.00	11,288,200
ダブル・スコープ	4,100	4,245.00	17,404,500
宮越ホールディングス	4,600	317.00	1,458,200
ダイヘン	81,000	509.00	41,229,000
田淵電機	15,600	515.00	8,034,000
ヤーマン	1,800	2,019.00	3,634,200
J V Cケンウッド	101,200	300.00	30,360,000
ミマキエンジニアリング	9,300	421.00	3,915,300
第一精工	5,700	1,374.00	7,831,800
日新電機	32,300	1,025.00	33,107,500
大崎電気工業	25,000	737.00	18,425,000

オムロン	158,400	3,050.00	483,120,000
日東工業	22,100	1,950.00	43,095,000
I D E C	18,100	1,038.00	18,787,800
不二電機工業	1,500	1,357.00	2,035,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	266,000	468.00	124,488,000
サクサホールディングス	35,000	202.00	7,070,000
メルコホールディングス	7,600	2,265.00	17,214,000
テクノメディカ	3,000	2,402.00	7,206,000
日本電気	1,898,000	300.00	569,400,000
富士通	1,331,000	420.20	559,286,200
沖電気工業	598,000	143.00	85,514,000
岩崎通信機	66,000	71.00	4,686,000
電気興業	36,000	510.00	18,360,000
サンケン電気	75,000	325.00	24,375,000
ナカヨ	13,000	343.00	4,459,000
アイホン	7,800	1,964.00	15,319,200
ルネサスエレクトロニクス	71,500	761.00	54,411,500
セイコーエプソン	205,500	1,829.00	375,859,500
ワコム	108,700	499.00	54,241,300
アルバック	25,400	2,825.00	71,755,000
アクセル	6,500	1,032.00	6,708,000
E I Z O	13,700	3,085.00	42,264,500
ジャパンディスプレイ	257,700	256.00	65,971,200
日本信号	38,100	1,124.00	42,824,400
京三製作所	32,000	313.00	10,016,000
能美防災	15,700	1,443.00	22,655,100
ホーチキ	10,000	1,091.00	10,910,000
エレコム	11,900	1,596.00	18,992,400
日本無線	35,000	292.00	10,220,000
パナソニック	1,577,200	941.20	1,484,460,640
シャープ	1,167,000	177.00	206,559,000
アンリツ	82,900	643.00	53,304,700
富士通ゼネラル	42,000	1,526.00	64,092,000
日立国際電気	32,000	1,300.00	41,600,000
ソニー	974,000	2,569.00	2,502,206,000
T D K	83,300	6,100.00	508,130,000
帝国通信工業	33,000	183.00	6,039,000
ミツミ電機	52,500	516.00	27,090,000
タムラ製作所	53,000	293.00	15,529,000
アルプス電気	117,100	2,070.00	242,397,000
池上通信機	44,000	137.00	6,028,000
パイオニア	223,300	270.00	60,291,000
日本電波工業	12,600	726.00	9,147,600
鈴木	4,000	514.00	2,056,000
日本トリム	3,700	4,485.00	16,594,500
ローランド ディー・ジー・	6,800	2,385.00	16,218,000
日本コロムビア	4,800	453.00	2,174,400
フォスター電機	17,300	2,451.00	42,402,300
クラリオン	73,000	405.00	29,565,000
S M K	41,000	575.00	23,575,000



ヨコオ	9,700	546.00	5,296,200
東光	28,000	375.00	10,500,000
ティアック	99,000	49.00	4,851,000
ホシデン	41,800	605.00	25,289,000
ヒロセ電機	22,300	12,540.00	279,642,000
日本航空電子工業	40,000	1,122.00	44,880,000
T O A	16,300	1,080.00	17,604,000
日立マクセル	22,800	1,681.00	38,326,800
古野電気	16,500	769.00	12,688,500
ユニデンホールディングス	43,000	115.00	4,945,000
アルパイン	32,900	1,233.00	40,565,700
スミダコーポレーション	11,300	627.00	7,085,100
アイコム	7,700	2,090.00	16,093,000
リオン	5,300	1,638.00	8,681,400
船井電機	13,900	860.00	11,954,000
横河電機	138,200	1,316.00	181,871,200
新電元工業	49,000	384.00	18,816,000
アズビル	45,100	2,912.00	131,331,200
東亜ディーケーケー	5,800	523.00	3,033,400
日本光電工業	57,700	2,844.00	164,098,800
チノー	5,100	1,043.00	5,319,300
共和電業	17,000	387.00	6,579,000
日本電子材料	5,500	426.00	2,343,000
堀場製作所	25,500	4,020.00	102,510,000
アドバンテスト	94,100	1,103.00	103,792,300
小野測器	6,700	727.00	4,870,900
エスベック	14,300	1,392.00	19,905,600
パナソニック デバイス S U N X	12,100	591.00	7,151,100
キーエンス	31,300	58,010.00	1,815,713,000
日置電機	7,200	2,201.00	15,847,200
シスメックス	107,100	7,440.00	796,824,000
日本マイクロニクス	18,000	923.00	16,614,000
メガチップス	14,400	1,076.00	15,494,400
O B A R A G R O U P	8,900	4,100.00	36,490,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,400	417.00	4,753,800
澤藤電機	8,000	201.00	1,608,000
デンソー	341,000	4,506.00	1,536,546,000
コーセル	19,200	997.00	19,142,400
新日本無線	10,000	412.00	4,120,000
オブテックス	10,200	2,968.00	30,273,600
千代田インテグレ	7,300	2,894.00	21,126,200
レーザーテック	16,100	1,426.00	22,958,600
スタンレー電気	99,100	2,658.00	263,407,800
岩崎電気	47,000	201.00	9,447,000
ウシオ電機	83,800	1,681.00	140,867,800
岡谷電機産業	7,800	395.00	3,081,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	402.00	4,743,600
日本セラミック	7,900	1,730.00	13,667,000
遠藤照明	7,000	1,098.00	7,686,000

日本デジタル研究所	11,700	1,557.00	18,216,900	
古河電池	10,000	701.00	7,010,000	
双信電機	6,900	271.00	1,869,900	
山一電機	11,900	618.00	7,354,200	
図研	10,000	1,167.00	11,670,000	
日本電子	54,000	642.00	34,668,000	
カシオ計算機	138,400	2,117.00	292,992,800	
ファナック	141,200	16,380.00	2,312,856,000	
日本シイエムケイ	29,600	327.00	9,679,200	
エンプラス	7,000	4,010.00	28,070,000	
大真空	26,000	200.00	5,200,000	
ローム	68,000	4,950.00	336,600,000	
浜松ホトニクス	107,700	2,993.00	322,346,100	
三井ハイテック	20,000	584.00	11,680,000	
新光電気工業	52,100	715.00	37,251,500	
京セラ	226,600	4,695.00	1,063,887,000	
協栄産業	15,000	143.00	2,145,000	
太陽誘電	67,100	1,277.00	85,686,700	
村田製作所	144,800	13,965.00	2,022,132,000	
ユーシン	18,300	648.00	11,858,400	
双葉電子工業	23,600	1,530.00	36,108,000	
日東電工	111,700	6,207.00	693,321,900	
北陸電気工業	55,000	142.00	7,810,000	
東海理化電機製作所	40,400	2,745.00	110,898,000	
ニチコン	43,500	834.00	36,279,000	
日本ケミコン	112,000	154.00	17,248,000	
K O A	19,100	943.00	18,011,300	
三井造船	534,000	142.00	75,828,000	
日立造船	109,500	563.00	61,648,500	
三菱重工業	2,458,000	426.90	1,049,320,200	
川崎重工業	1,074,000	326.00	350,124,000	
I H I	1,061,000	192.00	203,712,000	
名村造船所	41,400	799.00	33,078,600	
サノヤスホールディングス	17,300	235.00	4,065,500	
日本車輛製造	57,000	241.00	13,737,000	
ニチユ三菱フォークリフト	16,100	490.00	7,889,000	
近畿車輛	20,000	338.00	6,760,000	
F P G	40,400	1,075.00	43,430,000	
島根銀行	3,100	1,246.00	3,862,600	
じもとホールディングス	97,900	167.00	16,349,300	
全国保証	35,400	3,610.00	127,794,000	
足利ホールディングス	99,900	359.00	35,864,100	
東京T Yフィナンシャルグループ	18,800	3,060.00	57,528,000	
九州フィナンシャルグループ	208,500	668.00	139,278,000	
かんぽ生命保険	41,600	2,375.00	98,800,000	
ゆうちょ銀行	261,900	1,327.00	347,541,300	
日産自動車	1,937,700	1,081.50	2,095,622,550	
いすゞ自動車	400,000	1,089.00	435,600,000	
トヨタ自動車	1,716,900	6,555.00	11,254,279,500	*
日野自動車	197,000	1,188.00	234,036,000	

三菱自動車工業	548,200	931.00	510,374,200
エフテック	7,300	1,120.00	8,176,000
レシップホールディングス	4,700	748.00	3,515,600
G M B	2,200	898.00	1,975,600
ファルテック	2,500	1,387.00	3,467,500
武蔵精密工業	14,700	2,409.00	35,412,300
日産車体	67,400	1,103.00	74,342,200
新明和工業	60,000	823.00	49,380,000
極東開発工業	27,500	1,144.00	31,460,000
日信工業	30,900	1,452.00	44,866,800
トビー工業	114,000	234.00	26,676,000
ティラド	54,000	180.00	9,720,000
曙ブレーキ工業	70,000	225.00	15,750,000
タチエス	21,900	1,728.00	37,843,200
N O K	66,800	1,885.00	125,918,000
フタバ産業	42,100	518.00	21,807,800
K Y B	155,000	303.00	46,965,000
シロキ工業	34,000	343.00	11,662,000
市光工業	33,000	201.00	6,633,000
大同メタル工業	19,300	922.00	17,794,600
プレス工業	73,300	462.00	33,864,600
ミクニ	13,200	363.00	4,791,600
カルソニックカンセイ	105,000	950.00	99,750,000
太平洋工業	30,700	1,092.00	33,524,400
ケーヒン	31,700	1,660.00	52,622,000
河西工業	16,900	1,359.00	22,967,100
アイシン精機	138,900	4,665.00	647,968,500
富士機工	16,000	459.00	7,344,000
マツダ	437,100	1,862.50	814,098,750
ダイハツ工業	164,700	1,741.00	286,742,700
今仙電機製作所	12,700	1,082.00	13,741,400
本田技研工業	1,242,300	3,129.00	3,887,156,700
スズキ	288,600	3,230.00	932,178,000
富士重工業	436,200	4,188.00	1,826,805,600
安永	4,300	535.00	2,300,500
ヤマハ発動機	195,000	2,136.00	416,520,000
ショーワ	35,800	952.00	34,081,600
小糸製作所	82,700	5,020.00	415,154,000
T B K	16,500	390.00	6,435,000
エクセディ	18,800	2,467.00	46,379,600
ミツバ	23,400	1,780.00	41,652,000
豊田合成	50,200	2,378.00	119,375,600
愛三工業	24,200	1,006.00	24,345,200
盟和産業	1,700	1,004.00	1,706,800
ヨロズ	12,900	2,369.00	30,560,100
エフ・シー・シー	22,600	2,061.00	46,578,600
新家工業	30,000	136.00	4,080,000
シマノ	55,600	18,900.00	1,050,840,000
タカタ	24,900	525.00	13,072,500
テイ・エス テック	32,100	2,727.00	87,536,700

ジャムコ	6,000	2,893.00	17,358,000
小野建	11,900	1,015.00	12,078,500
はるやま商事	5,700	791.00	4,508,700
佐鳥電機	10,800	703.00	7,592,400
カップ・クリエイト	19,100	1,197.00	22,862,700
エコートレーディング	3,400	617.00	2,097,800
伯東	10,400	1,076.00	11,190,400
コンドーテック	10,900	760.00	8,284,000
中山福	8,700	796.00	6,925,200
ライトオン	10,100	1,505.00	15,200,500
ナガイレベン	19,600	1,965.00	38,514,000
ジーンズメイト	4,600	194.00	892,400
三菱食品	15,000	3,070.00	46,050,000
良品計画	15,600	25,290.00	394,524,000
三城ホールディングス	17,300	466.00	8,061,800
松田産業	10,000	1,412.00	14,120,000
第一興商	24,100	4,770.00	114,957,000
メディカルホールディングス	136,300	1,847.00	251,746,100
アドヴァン	13,800	1,125.00	15,525,000
S P K	3,200	2,027.00	6,486,400
萩原電気	3,500	1,975.00	6,912,500
アルピス	3,600	1,975.00	7,110,000
アズワン	10,600	4,095.00	43,407,000
スズデン	4,400	1,119.00	4,923,600
尾家産業	4,800	876.00	4,204,800
シモジマ	9,500	1,078.00	10,241,000
ドウシシャ	16,000	2,460.00	39,360,000
小津産業	3,000	2,156.00	6,468,000
コナカ	16,000	607.00	9,712,000
高速	8,200	979.00	8,027,800
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,492.00	2,536,400
G - 7ホールディングス	4,000	1,384.00	5,536,000
たけびし	4,900	1,001.00	4,904,900
イオン北海道	9,400	541.00	5,085,400
コジマ	20,200	262.00	5,292,400
ヒマラヤ	4,300	1,031.00	4,433,300
コーナン商事	19,300	1,669.00	32,211,700
黒田電気	25,300	1,599.00	40,454,700
ネットワンシステムズ	58,900	607.00	35,752,300
エコス	5,000	1,329.00	6,645,000
ワタミ	16,200	869.00	14,077,800
マルシェ	3,700	845.00	3,126,500
ドンキホーテホールディングス	88,100	3,750.00	330,375,000
丸文	12,000	757.00	9,084,000
西松屋チェーン	26,900	1,039.00	27,949,100
ゼンショーホールディングス	70,100	1,456.00	102,065,600
ハビネット	12,400	1,030.00	12,772,000
幸楽苑ホールディングス	8,700	1,556.00	13,537,200
ハークスレイ	3,800	1,134.00	4,309,200
橋本総業	2,600	1,577.00	4,100,200

サイゼリヤ	22,400	2,445.00	54,768,000
エクセル	6,600	1,311.00	8,652,600
V Tホールディングス	46,000	708.00	32,568,000
マルカキカイ	4,400	1,409.00	6,199,600
アルゴグラフィックス	6,200	1,735.00	10,757,000
魚力	4,200	1,327.00	5,573,400
ガリバーインターナショナル	36,600	1,186.00	43,407,600
日本エム・ディ・エム	11,400	584.00	6,657,600
ポブラ	3,500	520.00	1,820,000
ユナイテッドアローズ	19,400	5,420.00	105,148,000
進和	8,000	1,464.00	11,712,000
エスケイジャパン	3,200	512.00	1,638,400
ダイトエレクトロン	6,100	710.00	4,331,000
ハイデイ日高	10,300	3,790.00	39,037,000
シークス	8,600	3,460.00	29,756,000
京都きもの友禅	9,400	904.00	8,497,600
コロワイド	45,200	1,730.00	78,196,000
ピーシーデポコーポレーション	11,200	986.00	11,043,200
田中商事	4,400	670.00	2,948,000
オーハシテクニカ	7,700	1,287.00	9,909,900
壱番屋	6,200	6,000.00	37,200,000
白銅	4,000	1,151.00	4,604,000
トップカルチャー	5,900	473.00	2,790,700
P L A N T	3,100	1,296.00	4,017,600
スギホールディングス	24,400	6,000.00	146,400,000
島津製作所	178,000	1,790.00	318,620,000
J M S	24,000	303.00	7,272,000
クボテック	3,000	488.00	1,464,000
モリテックス	3,000	289.00	867,000
長野計器	8,900	678.00	6,034,200
ブイ・テクノロジー	3,300	3,990.00	13,167,000
スター精密	26,200	1,339.00	35,081,800
東京計器	44,000	200.00	8,800,000
愛知時計電機	18,000	316.00	5,688,000
オーバル	13,700	236.00	3,233,200
東京精密	26,600	2,392.00	63,627,200
マニー	12,600	1,749.00	22,037,400
ニコン	257,800	1,786.00	460,430,800
トプコン	46,300	1,076.00	49,818,800
オリンパス	205,600	4,345.00	893,332,000
理研計器	11,200	1,186.00	13,283,200
S C R E E Nホールディングス	141,000	861.00	121,401,000
キヤノン電子	12,700	1,699.00	21,577,300
タムロン	11,100	1,789.00	19,857,900
H O Y A	321,200	4,210.00	1,352,252,000
ノーリツ鋼機	12,600	557.00	7,018,200
エー・アンド・デイ	12,600	407.00	5,128,200
キヤノン	743,200	3,371.00	2,505,327,200
リコー	447,100	1,199.00	536,072,900
シチズンホールディングス	170,000	709.00	120,530,000

リズム時計工業	61,000	141.00	8,601,000
大研医器	10,900	957.00	10,431,300
メニコン	6,900	3,930.00	27,117,000
スノーピーク	1,100	3,190.00	3,509,000
パラマウントベッドホールディングス	14,600	4,065.00	59,349,000
トランザクション	2,200	589.00	1,295,800
S H O B I	5,000	391.00	1,955,000
ニホンフラッシュ	4,000	1,010.00	4,040,000
前田工織	15,200	1,062.00	16,142,400
永大産業	19,000	410.00	7,790,000
アートネイチャー	11,100	989.00	10,977,900
ダンロップスポーツ	8,800	742.00	6,529,600
バンダイナムコホールディングス	142,700	2,670.00	381,009,000
アイフィスジャパン	2,400	422.00	1,012,800
共立印刷	23,300	297.00	6,920,100
S H O E I	6,600	2,149.00	14,183,400
フランスベッドホールディングス	19,400	995.00	19,303,000
マーベラス	22,900	833.00	19,075,700
パイロットコーポレーション	24,100	4,305.00	103,750,500
萩原工業	2,900	2,299.00	6,667,100
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,100	1,314.00	32,981,400
トッパン・フォームズ	24,700	1,440.00	35,568,000
フジシールインターナショナル	16,800	3,655.00	61,404,000
タカラトミー	45,400	732.00	33,232,800
廣済堂	12,900	341.00	4,398,900
アーケ	58,300	91.00	5,305,300
レック	4,600	1,338.00	6,154,800
タカノ	6,000	653.00	3,918,000
プロネクス	12,900	1,102.00	14,215,800
ホクシン	11,900	119.00	1,416,100
ウッドワン	23,000	250.00	5,750,000
大建工業	54,000	272.00	14,688,000
きもと	23,900	223.00	5,329,700
凸版印刷	390,000	1,028.00	400,920,000
大日本印刷	408,000	1,073.00	437,784,000
図書印刷	26,000	500.00	13,000,000
共同印刷	47,000	344.00	16,168,000
日本写真印刷	23,200	2,056.00	47,699,200
光村印刷	3,000	229.00	687,000
藤森工業	12,400	2,780.00	34,472,000
宝印刷	7,000	1,289.00	9,023,000
前澤化成工業	10,300	1,052.00	10,835,600
アシックス	128,600	2,055.00	264,273,000
ツツミ	6,900	2,607.00	17,988,300
J S P	9,400	2,480.00	23,312,000
ニチハ	19,200	1,777.00	34,118,400
エフピコ	12,800	4,970.00	63,616,000
小松ウオール工業	4,700	1,833.00	8,615,100
ヤマハ	101,500	3,070.00	311,605,000

河合楽器製作所	5,200	2,048.00	10,649,600
クリナップ	16,300	744.00	12,127,200
ピジョン	78,200	2,513.00	196,516,600
天馬	11,100	2,259.00	25,074,900
兼松日産農林	14,000	145.00	2,030,000
キングジム	11,600	736.00	8,537,600
リンテック	32,800	2,265.00	74,292,000
T A S A K I	2,600	1,462.00	3,801,200
信越ポリマー	28,400	638.00	18,119,200
東リ	36,000	309.00	11,124,000
イトーキ	29,100	873.00	25,404,300
任天堂	85,000	17,365.00	1,476,025,000
三菱鉛筆	10,300	5,360.00	55,208,000
松風	6,800	1,389.00	9,445,200
タカスタンダード	57,000	835.00	47,595,000
コクヨ	71,800	1,251.00	89,821,800
ナカバヤシ	28,000	262.00	7,336,000
ニフコ	27,600	5,330.00	147,108,000
立川ブラインド工業	6,100	716.00	4,367,600
グローブライド	6,700	1,487.00	9,962,900
岡村製作所	48,200	1,105.00	53,261,000
日本バルカー工業	57,000	290.00	16,530,000
M U T O Hホールディングス	17,000	242.00	4,114,000
伊藤忠商事	1,069,100	1,383.00	1,478,565,300
丸紅	1,340,800	571.80	766,669,440
スクロール	20,500	423.00	8,671,500
高島	26,000	188.00	4,888,000
ヨンドシーホールディングス	10,400	2,619.00	27,237,600
三陽商会	81,000	295.00	23,895,000
長瀬産業	82,000	1,296.00	106,272,000
ナイガイ	52,000	44.00	2,288,000
蝶理	8,700	1,490.00	12,963,000
豊田通商	151,800	2,460.00	373,428,000
オンワードホールディングス	96,000	724.00	69,504,000
三共生興	20,500	416.00	8,528,000
兼松	290,000	164.00	47,560,000
美津濃	74,000	514.00	38,036,000
ツカモトコーポレーション	25,000	116.00	2,900,000
ファミリーマート	41,900	6,120.00	256,428,000
ルック	26,000	150.00	3,900,000
三井物産	1,232,000	1,325.00	1,632,400,000
日本紙パルプ商事	71,000	323.00	22,933,000
東京エレクトロン	123,900	6,841.00	847,599,900
日立ハイテクノロジーズ	47,200	3,160.00	149,152,000
カメイ	17,700	1,053.00	18,638,100
東都水産	24,000	187.00	4,488,000
O U Gホールディングス	20,000	234.00	4,680,000
スターゼン	4,900	3,250.00	15,925,000
セイコーホールディングス	89,000	526.00	46,814,000
山善	52,300	957.00	50,051,100

楢本興業	15,000	314.00	4,710,000
住友商事	857,600	1,157.00	992,243,200
日本ユニシス	37,600	1,369.00	51,474,400
内田洋行	34,000	421.00	14,314,000
三菱商事	1,022,300	1,869.50	1,911,189,850
第一実業	31,000	485.00	15,035,000
キヤノンマーケティングジャパン	38,800	2,111.00	81,906,800
西華産業	45,000	246.00	11,070,000
佐藤商事	12,300	692.00	8,511,600
菱洋エレクトロ	15,700	1,103.00	17,317,100
東京産業	13,700	435.00	5,959,500
ユアサ商事	12,900	2,674.00	34,494,600
神鋼商事	31,000	212.00	6,572,000
小林産業	9,800	204.00	1,999,200
阪和興業	136,000	475.00	64,600,000
カナデン	13,100	865.00	11,331,500
菱電商事	22,000	680.00	14,960,000
ニプロ	102,900	1,133.00	116,585,700
フルサト工業	7,500	1,744.00	13,080,000
岩谷産業	162,000	586.00	94,932,000
すてきナイスグループ	59,000	151.00	8,909,000
昭光通商	50,000	78.00	3,900,000
ニチモウ	21,000	190.00	3,990,000
極東貿易	19,000	226.00	4,294,000
イワキ	21,000	197.00	4,137,000
兼松エレクトロニクス	8,600	2,030.00	17,458,000
三愛石油	35,000	965.00	33,775,000
稲畑産業	32,700	1,094.00	35,773,800
G S Iクレオス	36,000	131.00	4,716,000
明和産業	12,600	391.00	4,926,600
キムラタン	588,000	7.00	4,116,000
ゴールドウイン	6,100	5,020.00	30,622,000
ユニ・チャーム	292,700	2,288.00	669,697,600
デサント	32,900	1,718.00	56,522,200
キング	6,900	410.00	2,829,000
ワキタ	29,000	890.00	25,810,000
ヤマトインターナショナル	9,200	398.00	3,661,600
東邦ホールディングス	43,600	2,484.00	108,302,400
サンゲツ	49,200	2,060.00	101,352,000
ミツウロコグループホールディングス	22,000	564.00	12,408,000
シナネンホールディングス	28,000	461.00	12,908,000
伊藤忠エネクス	35,100	921.00	32,327,100
サンリオ	42,000	2,726.00	114,492,000
サンワテクノス	8,700	730.00	6,351,000
リョーサン	21,600	3,060.00	66,096,000
新光商事	16,000	1,139.00	18,224,000
トーヨー	6,200	2,218.00	13,751,600
三信電気	18,800	861.00	16,186,800
東陽テクニカ	20,000	1,105.00	22,100,000
モスフードサービス	17,800	3,375.00	60,075,000



加賀電子	12,300	1,407.00	17,306,100
三益半導体工業	10,700	1,013.00	10,839,100
ソーダニッカ	14,400	480.00	6,912,000
立花エレテック	10,100	1,158.00	11,695,800
木曽路	16,700	2,194.00	36,639,800
サトレストランシステムズ	16,100	848.00	13,652,800
千趣会	27,000	745.00	20,115,000
タカキュー	9,900	187.00	1,851,300
ケーヨー	23,300	507.00	11,813,100
アデランス	23,900	569.00	13,599,100
上新電機	32,000	994.00	31,808,000
日本瓦斯	15,600	2,444.00	38,126,400
ベスト電器	44,200	126.00	5,569,200
ロイヤルホールディングス	22,600	2,181.00	49,290,600
東天紅	10,000	156.00	1,560,000
いなげや	15,200	1,304.00	19,820,800
島忠	35,200	2,615.00	92,048,000
チヨダ	16,000	3,155.00	50,480,000
ライフコーポレーション	8,600	2,600.00	22,360,000
リンガーハット	12,300	2,420.00	29,766,000
さが美	10,000	95.00	950,000
MR MAX	11,600	310.00	3,596,000
テンアライド	13,000	388.00	5,044,000
AOKIホールディングス	31,100	1,295.00	40,274,500
オークワ	20,000	1,117.00	22,340,000
コメリ	21,000	2,312.00	48,552,000
青山商事	26,100	4,595.00	119,929,500
しまむら	15,800	12,830.00	202,714,000
はせがわ	4,800	431.00	2,068,800
高島屋	198,000	988.00	195,624,000
松屋	27,400	920.00	25,208,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,800	1,995.00	139,251,000
近鉄百貨店	53,000	318.00	16,854,000
丸栄	29,000	92.00	2,668,000
ニッセンホールディングス	20,400	161.00	3,284,400
パルコ	13,100	1,001.00	13,113,100
丸井グループ	167,200	1,656.00	276,883,200
クレディセゾン	103,300	2,058.00	212,591,400
アクシアル リテイリング	10,500	3,885.00	40,792,500
井筒屋	75,000	52.00	3,900,000
イオン	560,600	1,619.50	907,891,700
ユニーグループ・ホールディングス	130,500	824.00	107,532,000
イズミ	27,100	4,605.00	124,795,500
東武ストア	17,000	309.00	5,253,000
フォーバル	5,200	622.00	3,234,400
平和堂	27,600	2,402.00	66,295,200
フジ	15,200	2,235.00	33,972,000
ヤオコー	15,400	4,890.00	75,306,000
ゼビオホールディングス	18,500	2,003.00	37,055,500
ケーズホールディングス	28,800	3,955.00	113,904,000

PALTAC	21,800	2,079.00	45,322,200
三谷産業	14,500	338.00	4,901,000
Olympicグループ	7,200	612.00	4,406,400
日産東京販売ホールディングス	22,900	303.00	6,938,700
新生銀行	1,179,000	154.00	181,566,000
あおぞら銀行	862,000	368.00	317,216,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,931,600	538.20	5,883,387,120
りそなホールディングス	1,594,000	452.80	721,763,200
三井住友トラスト・ホールディングス	2,844,000	333.20	947,620,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,091,000	3,412.00	3,722,492,000
第四銀行	172,000	396.00	68,112,000
北越銀行	147,000	205.00	30,135,000
西日本シティ銀行	443,000	212.00	93,916,000
千葉銀行	525,000	584.00	306,600,000
横浜銀行	914,000	531.70	485,973,800
常陽銀行	492,000	436.00	214,512,000
群馬銀行	303,000	526.00	159,378,000
武蔵野銀行	21,700	3,200.00	69,440,000
千葉興業銀行	37,300	514.00	19,172,200
筑波銀行	56,600	332.00	18,791,200
七十七銀行	213,000	443.00	94,359,000
青森銀行	100,000	316.00	31,600,000
秋田銀行	89,000	314.00	27,946,000
山形銀行	77,000	414.00	31,878,000
岩手銀行	9,500	3,940.00	37,430,000
東邦銀行	122,000	358.00	43,676,000
東北銀行	70,000	149.00	10,430,000
みちのく銀行	69,000	184.00	12,696,000
ふくおかフィナンシャルグループ	589,000	403.00	237,367,000
静岡銀行	399,000	882.00	351,918,000
十六銀行	171,000	385.00	65,835,000
スルガ銀行	129,300	1,846.00	238,687,800
八十二銀行	246,000	557.00	137,022,000
山梨中央銀行	84,000	522.00	43,848,000
大垣共立銀行	182,000	378.00	68,796,000
福井銀行	117,000	199.00	23,283,000
北國銀行	152,000	307.00	46,664,000
清水銀行	4,700	2,413.00	11,341,100
富山銀行	2,600	3,035.00	7,891,000
滋賀銀行	128,000	485.00	62,080,000
南都銀行	132,000	335.00	44,220,000
百五銀行	123,000	456.00	56,088,000
京都銀行	260,000	803.00	208,780,000
紀陽銀行	53,500	1,309.00	70,031,500
三重銀行	61,000	213.00	12,993,000
ほくほくフィナンシャルグループ	926,000	184.00	170,384,000
広島銀行	402,000	493.00	198,186,000
山陰合同銀行	82,500	701.00	57,832,500
中国銀行	96,500	1,239.00	119,563,500
鳥取銀行	44,000	180.00	7,920,000

伊予銀行	145,600	838.00	122,012,800
百十四銀行	150,000	358.00	53,700,000
四国銀行	105,000	234.00	24,570,000
阿波銀行	112,000	566.00	63,392,000
大分銀行	78,000	371.00	28,938,000
宮崎銀行	91,000	306.00	27,846,000
佐賀銀行	83,000	215.00	17,845,000
十八銀行	84,000	282.00	23,688,000
沖縄銀行	10,800	3,460.00	37,368,000
琉球銀行	28,100	1,318.00	37,035,800
セブン銀行	510,400	483.00	246,523,200
みずほフィナンシャルグループ	19,193,300	181.60	3,485,503,280
高知銀行	53,000	112.00	5,936,000
山口フィナンシャルグループ	127,000	1,115.00	141,605,000
アクリーティブ	11,100	434.00	4,817,400
芙蓉総合リース	15,600	5,440.00	84,864,000
興銀リース	25,600	2,189.00	56,038,400
東京センチュリーリース	32,000	4,240.00	135,680,000
S B Iホールディングス	163,600	1,104.00	180,614,400
日本証券金融	60,100	504.00	30,290,400
アイフル	227,900	345.00	78,625,500
日本アジア投資	8,900	245.00	2,180,500
ポケットカード	13,700	497.00	6,808,900
長野銀行	46,000	182.00	8,372,000
名古屋銀行	114,000	383.00	43,662,000
北洋銀行	205,100	318.00	65,221,800
愛知銀行	4,600	5,160.00	23,736,000
第三銀行	78,000	144.00	11,232,000
中京銀行	56,000	202.00	11,312,000
東日本銀行	65,000	285.00	18,525,000
大光銀行	49,000	212.00	10,388,000
愛媛銀行	81,000	225.00	18,225,000
トマト銀行	54,000	157.00	8,478,000
みなと銀行	123,000	174.00	21,402,000
京葉銀行	112,000	463.00	51,856,000
関西アーバン銀行	19,000	1,143.00	21,717,000
栃木銀行	73,000	478.00	34,894,000
北日本銀行	4,300	2,826.00	12,151,800
東和銀行	191,000	86.00	16,426,000
福島銀行	168,000	82.00	13,776,000
大東銀行	82,000	185.00	15,170,000
リコーリース	10,700	3,535.00	37,824,500
イオンフィナンシャルサービス	89,400	2,465.00	220,371,000
アコム	273,600	534.00	146,102,400
ジャックス	75,000	408.00	30,600,000
オリエントコーポレーション	589,000	212.00	124,868,000
日立キャピタル	32,100	2,721.00	87,344,100
アプラスフィナンシャル	65,700	95.00	6,241,500
オリックス	964,700	1,628.00	1,570,531,600
三菱UFJリース	345,600	535.00	184,896,000

ジャフコ	22,800	3,330.00	75,924,000
トモニホールディングス	104,500	365.00	38,142,500
大和証券グループ本社	1,275,000	693.10	883,702,500
野村ホールディングス	2,621,500	560.80	1,470,137,200
岡三証券グループ	116,000	608.00	70,528,000
丸三証券	40,400	1,274.00	51,469,600
東洋証券	53,000	324.00	17,172,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,200	603.00	94,188,600
光世証券	33,000	154.00	5,082,000
水戸証券	42,300	370.00	15,651,000
いちよし証券	30,500	1,136.00	34,648,000
松井証券	69,300	1,011.00	70,062,300
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	302,700	3,110.00	941,397,000
だいこう証券ビジネス	6,600	856.00	5,649,600
日本取引所グループ	400,100	1,707.00	682,970,700
マネックスグループ	160,100	296.00	47,389,600
カブドットコム証券	120,700	340.00	41,038,000
極東証券	18,300	1,360.00	24,888,000
岩井コスモホールディングス	12,900	1,181.00	15,234,900
藍澤證券	19,100	643.00	12,281,300
フィデアホールディングス	82,900	205.00	16,994,500
池田泉州ホールディングス	144,300	414.00	59,740,200
アニコムホールディングス	9,200	2,807.00	25,824,400
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	407,200	2,974.50	1,211,216,400
マネースクウェアHD	4,700	1,107.00	5,202,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	130,600	1,565.00	204,389,000
マネーパートナーズグループ	12,600	352.00	4,435,200
小林洋行	4,700	254.00	1,193,800
第一生命保険	872,900	1,348.00	1,176,669,200
東京海上ホールディングス	552,000	3,941.00	2,175,432,000
イー・ギャランティ	4,400	2,571.00	11,312,400
アサックス	2,400	1,373.00	3,295,200
NECキャピタルソリューション	5,600	1,692.00	9,475,200
T & Dホールディングス	496,600	1,144.00	568,110,400
三井不動産	722,000	2,664.50	1,923,769,000
三菱地所	1,013,000	2,253.00	2,282,289,000
平和不動産	25,800	1,249.00	32,224,200
東京建物	148,800	1,167.00	173,649,600
ダイビル	35,100	906.00	31,800,600
京阪神ビルディング	22,800	637.00	14,523,600
住友不動産	326,000	3,105.00	1,012,230,000
太平洋興発	58,000	80.00	4,640,000
大京	253,000	187.00	47,311,000
テーオーシー	52,800	898.00	47,414,400
東京楽天地	23,000	476.00	10,948,000
レオパレス21	160,400	615.00	98,646,000

スターツコーポレーション	15,600	2,223.00	34,678,800
フジ住宅	17,500	678.00	11,865,000
空港施設	16,600	558.00	9,262,800
明和地所	7,400	555.00	4,107,000
住友不動産販売	9,800	2,486.00	24,362,800
ゴールドクレスト	10,700	1,786.00	19,110,200
リロ・ホールディング	5,400	14,030.00	75,762,000
日本エスリード	5,400	1,069.00	5,772,600
日神不動産	18,300	390.00	7,137,000
タカラレーベン	60,300	547.00	32,984,100
サンヨーハウジング名古屋	7,700	1,006.00	7,746,200
イオンモール	87,900	1,700.00	149,430,000
ファースト住建	5,100	1,347.00	6,869,700
ランド	64,400	12.00	772,800
東祥	4,300	3,875.00	16,662,500
トーセイ	20,700	684.00	14,158,800
穴吹興産	13,000	248.00	3,224,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	84,700	1,108.00	93,847,600
サンフロンティア不動産	16,400	1,036.00	16,990,400
エフ・ジェー・ネクスト	11,900	514.00	6,116,600
ランドビジネス	9,400	301.00	2,829,400
グランディハウス	11,900	367.00	4,367,300
東武鉄道	738,000	596.00	439,848,000
相鉄ホールディングス	237,000	711.00	168,507,000
東京急行電鉄	804,000	960.00	771,840,000
京浜急行電鉄	378,000	1,016.00	384,048,000
小田急電鉄	442,000	1,298.00	573,716,000
京王電鉄	386,000	1,093.00	421,898,000
京成電鉄	207,000	1,664.00	344,448,000
富士急行	38,000	1,264.00	48,032,000
新京成電鉄	18,000	422.00	7,596,000
東日本旅客鉄道	252,400	10,875.00	2,744,850,000
西日本旅客鉄道	132,900	7,602.00	1,010,305,800
東海旅客鉄道	123,600	22,480.00	2,778,528,000
西武ホールディングス	110,000	2,381.00	261,910,000
鴻池運輸	19,500	1,468.00	28,626,000
西日本鉄道	179,000	811.00	145,169,000
ハマキョウレックス	10,600	2,108.00	22,344,800
サカイ引越センター	5,400	2,791.00	15,071,400
近鉄グループホールディングス	1,390,000	508.00	706,120,000
阪急阪神ホールディングス	927,000	762.00	706,374,000
南海電気鉄道	310,000	687.00	212,970,000
京阪電気鉄道	309,000	784.00	242,256,000
神戸電鉄	33,000	360.00	11,880,000
名古屋鉄道	503,000	555.00	279,165,000
山陽電気鉄道	47,000	466.00	21,902,000
トランコム	4,000	6,730.00	26,920,000
日本通運	534,000	537.00	286,758,000
ヤマトホールディングス	255,100	2,529.50	645,275,450
山九	182,000	541.00	98,462,000

日新	57,000	321.00	18,297,000
丸運	8,600	256.00	2,201,600
丸全昭和運輸	45,000	427.00	19,215,000
センコー	62,000	777.00	48,174,000
トナミホールディングス	28,000	310.00	8,680,000
ニッコンホールディングス	45,200	2,144.00	96,908,800
日本石油輸送	17,000	243.00	4,131,000
福山通運	84,000	582.00	48,888,000
セイノーホールディングス	97,900	1,267.00	124,039,300
神奈川中央交通	16,000	716.00	11,456,000
日立物流	28,700	1,982.00	56,883,400
丸和運輸機関	3,100	2,209.00	6,847,900
C & F ロジホールディングス	13,200	948.00	12,513,600
日本郵船	1,239,000	239.00	296,121,000
商船三井	672,000	226.00	151,872,000
川崎汽船	604,000	194.00	117,176,000
N S ユナイテッド海運	62,000	173.00	10,726,000
明治海運	12,300	391.00	4,809,300
飯野海運	71,500	472.00	33,748,000
共栄タンカー	12,000	150.00	1,800,000
日本航空	264,300	4,141.00	1,094,466,300
A N Aホールディングス	2,563,000	320.90	822,466,700
パスコ	13,000	448.00	5,824,000
三菱倉庫	98,000	1,563.00	153,174,000
三井倉庫ホールディングス	80,000	297.00	23,760,000
住友倉庫	101,000	608.00	61,408,000
澁澤倉庫	36,000	296.00	10,656,000
ヤマタネ	64,000	170.00	10,880,000
東陽倉庫	24,000	249.00	5,976,000
乾汽船	10,900	888.00	9,679,200
日本トランスシティ	31,000	380.00	11,780,000
ケイヒン	26,000	155.00	4,030,000
中央倉庫	7,900	989.00	7,813,100
安田倉庫	10,800	785.00	8,478,000
東洋埠頭	40,000	158.00	6,320,000
宇徳	11,300	337.00	3,808,100
上組	165,000	1,066.00	175,890,000
サンリツ	1,700	503.00	855,100
キムラユニティー	3,500	1,202.00	4,207,000
キューソー流通システム	3,800	2,399.00	9,116,200
郵船ロジスティクス	12,700	1,475.00	18,732,500
近鉄エクスプレス	24,700	1,877.00	46,361,900
東海運	8,300	280.00	2,324,000
エーアイティー	6,400	1,069.00	6,841,600
内外トランスライン	3,400	1,000.00	3,400,000
東京放送ホールディングス	81,600	2,002.00	163,363,200
日本テレビホールディングス	124,400	2,288.00	284,627,200
朝日放送	13,500	701.00	9,463,500
テレビ朝日ホールディングス	37,200	2,377.00	88,424,400
スカパーJ S A Tホールディングス	103,400	724.00	74,861,600

テレビ東京ホールディングス	12,300	2,161.00	26,580,300
日本BS放送	2,300	1,161.00	2,670,300
U-NEXT	3,200	1,048.00	3,353,600
コネクシオ	12,100	1,065.00	12,886,500
日本通信	72,200	177.00	12,779,400
クロップス	1,400	532.00	744,800
日本電信電話	1,053,100	5,308.00	5,589,854,800
KDDI	1,384,100	3,200.00	4,429,120,000
光通信	16,400	7,650.00	125,460,000
NTTドコモ	1,050,800	2,839.00	2,983,221,200
エムティーアイ	17,400	639.00	11,118,600
GMOインターネット	50,400	1,406.00	70,862,400
カドカワ	42,500	1,764.00	74,970,000
学研ホールディングス	46,000	244.00	11,224,000
ゼンリン	18,000	1,989.00	35,802,000
昭文社	7,400	698.00	5,165,200
インプレスホールディングス	11,100	137.00	1,520,700
東京電力	1,170,900	609.00	713,078,100
中部電力	422,400	1,566.50	661,689,600
関西電力	563,300	1,331.00	749,752,300
中国電力	190,800	1,650.00	314,820,000
北陸電力	135,200	1,764.00	238,492,800
東北電力	344,900	1,552.00	535,284,800
四国電力	124,300	1,751.00	217,649,300
九州電力	304,800	1,230.00	374,904,000
北海道電力	129,200	1,116.00	144,187,200
沖縄電力	14,700	2,921.00	42,938,700
電源開発	117,700	4,025.00	473,742,500
イーレックス	2,600	1,816.00	4,721,600
東京瓦斯	1,541,000	567.80	874,979,800
大阪瓦斯	1,429,000	451.30	644,907,700
東邦瓦斯	348,000	805.00	280,140,000
北海道瓦斯	34,000	278.00	9,452,000
広島ガス	24,100	424.00	10,218,400
西部瓦斯	156,000	274.00	42,744,000
静岡ガス	39,300	781.00	30,693,300
メタウォーター	8,900	2,554.00	22,730,600
アイネット	7,600	1,132.00	8,603,200
松竹	90,000	1,087.00	97,830,000
東宝	97,200	3,015.00	293,058,000
エイチ・アイ・エス	23,500	3,460.00	81,310,000
東映	51,000	1,094.00	55,794,000
AOI Pro.	6,900	1,027.00	7,086,300
ラックランド	2,000	1,467.00	2,934,000
エヌ・ティ・ティ・データ	84,200	6,220.00	523,724,000
共立メンテナンス	10,800	8,830.00	95,364,000
イチネンホールディングス	15,200	1,015.00	15,428,000
建設技術研究所	8,500	1,065.00	9,052,500
スペース	7,800	1,289.00	10,054,200
アインホールディングス	16,400	5,250.00	86,100,000

燦ホールディングス	2,900	1,433.00	4,155,700
ピー・シー・エー	1,800	1,514.00	2,725,200
スバル興業	3,000	399.00	1,197,000
東京テアトル	57,000	125.00	7,125,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	982.00	1,669,400
ナガワ	2,600	3,215.00	8,359,000
よみうりランド	29,000	429.00	12,441,000
東京都競馬	99,000	245.00	24,255,000
常磐興産	54,000	152.00	8,208,000
カナモト	20,100	2,742.00	55,114,200
東京ドーム	115,000	549.00	63,135,000
D T S	15,100	2,205.00	33,295,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,600	3,030.00	174,528,000
シーイーシー	8,900	1,226.00	10,911,400
カブコン	34,800	2,422.00	84,285,600
西尾レントオール	11,600	3,015.00	34,974,000
アイ・エス・ビー	1,600	693.00	1,108,800
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	72,000	38.00	2,736,000
日本空港ビルデング	43,400	4,190.00	181,846,000
トランス・コスモス	16,700	2,674.00	44,655,800
乃村工藝社	30,800	1,548.00	47,678,400
ジャステック	8,600	932.00	8,015,200
S C S K	32,400	4,715.00	152,766,000
藤田観光	52,000	535.00	27,820,000
K N T - C Tホールディングス	70,000	199.00	13,930,000
日本管財	12,400	1,866.00	23,138,400
トーカイ	6,400	3,200.00	20,480,000
白洋舎	5,000	265.00	1,325,000
セコム	150,000	8,408.00	1,261,200,000
日本システムウエア	5,000	941.00	4,705,000
セントラル警備保障	6,400	1,984.00	12,697,600
アイネス	19,300	1,120.00	21,616,000
丹青社	26,900	775.00	20,847,500
メイテック	17,900	4,385.00	78,491,500
T K C	12,600	2,843.00	35,821,800
アサツー ディ・ケイ	25,300	2,704.00	68,411,200
富士ソフト	20,200	2,653.00	53,590,600
応用地質	15,100	1,224.00	18,482,400
船井総研ホールディングス	20,000	1,492.00	29,840,000
N S D	28,900	1,741.00	50,314,900
進学会	6,900	643.00	4,436,700
丸紅建材リース	12,000	202.00	2,424,000
オオバ	7,900	431.00	3,404,900
コナミホールディングス	61,500	2,811.00	172,876,500
学究社	2,100	1,286.00	2,700,600
ベネッセホールディングス	48,300	3,445.00	166,393,500
イオンディライト	13,900	3,930.00	54,627,000
ナック	8,900	896.00	7,974,400



福井コンピュータホールディングス	2,900	1,180.00	3,422,000
ニチイ学館	25,100	862.00	21,636,200
ダイセキ	27,100	1,852.00	50,189,200
ステップ	4,900	1,066.00	5,223,400
日鉄住金物産	90,000	354.00	31,860,000
元気寿司	3,800	2,229.00	8,470,200
トラスコ中山	15,600	4,105.00	64,038,000
ヤマダ電機	414,200	578.00	239,407,600
オートバックスセブン	52,200	2,004.00	104,608,800
アークランドサカモト	11,500	2,356.00	27,094,000
ニトリホールディングス	58,900	9,160.00	539,524,000
グルメ杵屋	9,000	1,007.00	9,063,000
愛眼	10,800	236.00	2,548,800
ケーユーホールディングス	7,100	773.00	5,488,300
吉野家ホールディングス	50,300	1,446.00	72,733,800
加藤産業	21,300	2,932.00	62,451,600
イノテック	12,400	499.00	6,187,600
イエローハット	12,900	1,962.00	25,309,800
松屋フーズ	6,600	2,892.00	19,087,200
J B C Cホールディングス	11,500	684.00	7,866,000
J Kホールディングス	13,900	481.00	6,685,900
サガミチェーン	18,200	1,272.00	23,150,400
日伝	5,500	2,719.00	14,954,500
関西スーパーマーケット	11,400	807.00	9,199,800
ミロク情報サービス	10,100	996.00	10,059,600
北沢産業	11,000	167.00	1,837,000
杉本商事	7,900	1,260.00	9,954,000
因幡電機産業	19,100	3,705.00	70,765,500
王将フードサービス	10,000	4,080.00	40,800,000
プレナス	15,200	1,928.00	29,305,600
ミニストップ	10,100	2,112.00	21,331,200
アークス	25,500	2,407.00	61,378,500
パローホールディングス	29,400	2,669.00	78,468,600
バイテックホールディングス	4,200	1,129.00	4,741,800
ミスミグループ本社	152,900	1,527.00	233,478,300
アルテック	11,700	159.00	1,860,300
ベルク	6,700	4,270.00	28,609,000
大 庄	6,500	1,491.00	9,691,500
タキヒヨー	22,000	470.00	10,340,000
ファーストリテイリング	27,300	35,070.00	957,411,000
ソフトバンクグループ	772,000	5,104.00	3,940,288,000
蔵王産業	2,400	1,316.00	3,158,400
スズケン	62,000	4,055.00	251,410,000
サンドラッグ	28,800	7,840.00	225,792,000
サックスパー ホールディングス	12,800	1,700.00	21,760,000
ジェコス	9,400	1,006.00	9,456,400
ヤマザワ	2,900	1,696.00	4,918,400
やまや	2,800	1,945.00	5,446,000
ルネサスイーストン	8,600	422.00	3,629,200
ベルーナ	34,000	593.00	20,162,000

合計	228,873,900		281,831,760,820	
----	-------------	--	-----------------	--

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成28年2月29日現在

資産総額	71,977,137,350円
負債総額	140,415,975円
純資産総額（ - ）	71,836,721,375円
発行済数量	37,533,902,099口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9139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28年2月29日現在

資産総額	274,500,874,645円
負債総額	373,777,393円
純資産総額（ - ）	274,127,097,252円
発行済数量	145,902,151,489口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8788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カ年の資本金の変動

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。

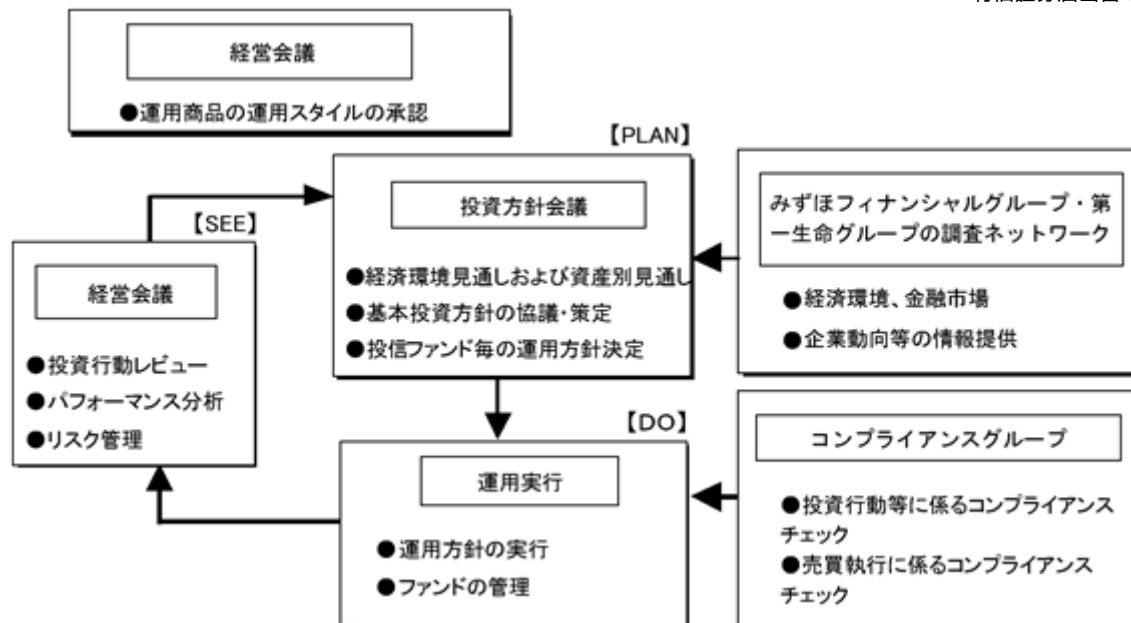
###### 投資運用の意思決定機構

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28年2月29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28年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は415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	5	23,629,020,732
追加型株式投資信託	370	5,576,357,548,539
単位型公社債投資信託	40	294,039,557,704
追加型公社債投資信託	0	0
合計	415	5,894,026,126,975

### 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30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27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31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27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29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	4,178,284	4,343,365
関係会社株式	617,159	613,137
繰延税金資産	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（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	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
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	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第29期 （ 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 ）		第30期 （ 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日 ）	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

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
会計方針の変 更による累積 的影響額									
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	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
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 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

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					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	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	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
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

## 重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27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、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。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、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 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</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。

## 会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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。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27年3月26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事業年度より適用し、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。

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、当事業年度の期首において、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、当事業年度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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千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。

## 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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

### 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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035



## （損益計算書関係）

## 1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

## 2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

## （株主資本等変動計算書関係）

## 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

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

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27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

## (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27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30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等でありませ

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、株価指数先物取引及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及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 その他有価証券	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	-

#### 第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

## (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29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27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	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

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、記載しておりません。

当事業年度において、関係会社株式について202,477千円の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	-	-	-

## 第30期（平成27年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

（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29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）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。

4. その他有価証券

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。

第30期（平成27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	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
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	532,891	159,101	373,789

（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

第30期（平成27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	14,169,657	2,544,066

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度(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)

	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
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	973,035

## (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)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

## (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

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり  
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29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

## 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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27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33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

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89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

## （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す。

## 2．関連情報

## 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。

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

（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

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険 株式会 社	東京都 千代田 区	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

## 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

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	658,756	未払費用	235,583
	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	383,980	未払費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-

## 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。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第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	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	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	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一ファイ ナンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	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	287,136	未払 費用	155,413
							業務委託料 の支払	11,810	未払金	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)	1,000,000	金銭の 信託	10,952,459
							信託報酬の 支払	7,933			

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	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	2,217,439  551,351  2,139	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	306,365  11,276,198  71
	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	-	兼務 1名	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	407,531  8,540	未払 費用  未払金	240,725  6,501
	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  8,254	金銭の 信託	14,169,657

## 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) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注4) 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5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## （1株当たり情報）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「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、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

## （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31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
資産合計		38,994,807



（単位：千円）

	第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	956,031
未払金	2,105,195
未払収益分配金	44
未払償還金	49,873
未払手数料	1,770,062
その他未払金	285,213
未払費用	1,927,420
未払法人税等	1,486,583
未払消費税等	289,515
賞与引当金	724,368
その他	20,000
流動負債計	7,509,114
固定負債	
退職給付引当金	920,913
役員退職慰労引当金	137,750
固定負債計	1,058,663
負債合計	8,567,778
（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	25,771,823
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	22,030,000
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	3,118,530
株主資本計	30,200,301
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	226,727
評価・換算差額等計	226,727
純資産合計	30,427,029
負債・純資産合計	38,994,807

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	15,465,477	
運用受託報酬	3,695,539	
投資助言報酬	510,549	
その他営業収益	383,893	
	営業収益計	20,055,459
営業費用		
支払手数料	6,672,717	
広告宣伝費	217,738	
公告費	129	
調査費	3,678,769	
調査費	2,272,268	
委託調査費	1,406,500	
委託計算費	207,057	
営業雑経費	280,193	
通信費	17,208	
印刷費	226,482	
協会費	11,849	
諸会費	17	
支払販売手数料	24,635	
	営業費用計	11,056,605
一般管理費		
給料	2,351,238	
役員報酬	121,094	
給料・手当	2,230,144	
交際費	19,774	
寄付金	2,156	
旅費交通費	119,653	
租税公課	94,838	
不動産賃借料	363,395	
退職給付費用	114,178	
固定資産減価償却費	1 362,235	
福利厚生費	10,385	
修繕費	30,844	
賞与引当金繰入額	724,368	
役員退職慰労引当金繰入額	27,285	
機器リース料	76	
事務委託費	137,814	
事務用消耗品費	33,473	
器具備品費	14,115	
諸経費	84,703	
	一般管理費計	4,490,538
営業利益		4,508,315

(単位:千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	8,323	
受取利息	1,015	
雑収入	5,491	
		営業外収益計 14,830
営業外費用		
為替差損	3,664	
金銭の信託運用損	166,406	
		営業外費用計 170,070
経常利益		4,353,076
特別損失		
固定資産除却損	182	
固定資産売却損	2,654	
ゴルフ会員権評価損	3,806	
		特別損失計 6,642
税引前中間純利益		4,346,433
法人税、住民税及び事業税		1,434,006
法人税等調整額		14,388
法人税等合計		1,448,394
中間純利益		2,898,038

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

	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	252,905	30,099,168
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	26,178	26,178
当中間期変動額 合計	26,178	327,860
当中間期末残高	226,727	30,427,029

## 重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27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、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)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。

## 追加情報

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
<p>当社は、平成27年9月30日開催の取締役会の決議に基づき、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」)の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」)、及び新光投信株式会社(以下「新光投信」)の機能統合に向けた具体的な準備を開始すべく、同日付で当社、TB、MHAM及び新光投信の間で「統合基本合意書」を締結いたしました。今後、統合に必要な各社の取締役会決議及び株主総会決議、国内外の関係当局への届出、許認可の取得等を前提として、平成28年度上期中の統合を予定しております。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 30%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 40%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 50%; text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27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27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

## (金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27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	10,613,571	10,613,571	-
(2) 金銭の信託	14,000,363	14,000,363	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	493,805	493,805	-
資産計	25,107,739	25,107,739	-
(1) 未払法人税等	1,486,583	1,486,583	-
負債計	1,486,583	1,486,583	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## 負債

### (1) 未払法人税等

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

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,316,596
差入保証金	771,427

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、時価開示の対象としておりません。

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、時価開示の対象としておりません。



## （有価証券関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）			
1．満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2．子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,316,596千円）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	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
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	493,805	159,101	334,703
（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31期中間会計期間末 （平成27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31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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	15,465,477	4,206,088	383,893	20,055,459

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,267,792円	89銭
1株当たり中間純利益金額	120,751円	62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
中間純利益	2,898,038千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,898,038千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第31期中間会計期間  
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、平成27年9月25日開催の取締役会において、子会社であるDIAM International Ltdの増資引受を決議いたしました。

## 1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

## 2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

## 3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a . 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b . 資本金の額

平成27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	343,104	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おります。

(注) 資本金の額は平成27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せん。）
- (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。  
（当ファンドの略称：DC内株イ）

# 独立監査人の監査報告書

平成27年6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27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28年3月23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

### P w C 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	鶴 田 光夫 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< D C 年金 > の平成27年2月10日から平成28年2月8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< D C 年金 > の平成28年2月8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27年11月25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27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。