

【表紙】
【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成21年5月8日
【計算期間】 第6期
（自 平成20年2月8日 至 平成21年2月9日）
【ファンド名】 D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >
【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 長浜 力雄
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】 大楽 信雄
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【電話番号】 03-3287-3110
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

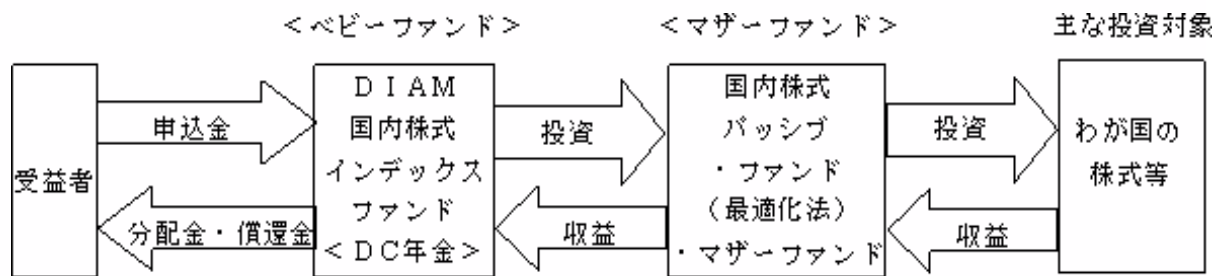
1【ファンドの性格】

(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。

当ファンドは契約型の追加型株式投資信託に属します。

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、受益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（「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。なお、当該マザーファンドは主に国内の株式に投資を行います。



当ファンドの信託金の限度額は、1兆円とします。

ベビーファンドはマザーファンドのほか、株式等に直接投資を行うこともあります。

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目指す旨の記載

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	グローバル ()		
	年2回			
	年4回	日本		日経225
債券 一般 公債 社債	年6回 (隔月)	北米	ファミリーファ ンド	
その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
不動産投信	日々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (株式))	その他 ()	中南米	ファンド・オブ ・ファンズ	その他 ()
資産複合 ()		アフリカ		
資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		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、マザーファンド受益証券（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。

前記の分類は、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、以下の方法でご確認ください。

・投資信託協会への照会

ホームページ URL <http://www.toushin.or.jp/>

(2) 【ファンドの仕組み】

ファンドの関係法人は次の通りです。

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。

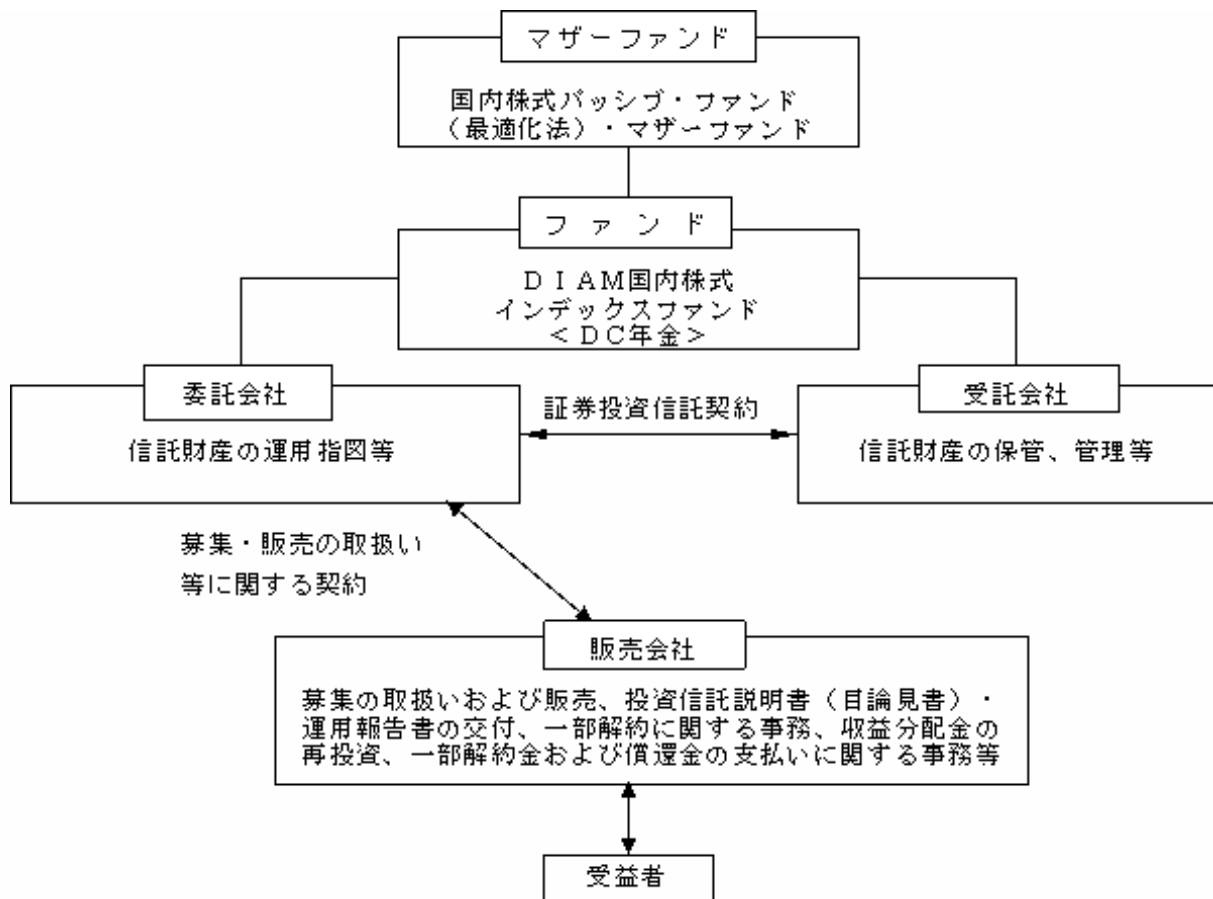
受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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。

ファンドの関係法人



・「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。

委託会社の概況

資本金の額

20億円（平成21年2月27日現在）

委託会社の沿革

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

ジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

(平成21年2月27日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険相互会社	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】

イ．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。

ロ．投資態度

- ・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目指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。

当ファンドおよびマザーファンドは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。当ファンドおよび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。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、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、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、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当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行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。

- ・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。
- ・信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

(2)【投資対象】

1.投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

- a.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます、以下同じ。）
 - イ.有価証券
 - ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条に定めるものに限ります。)
 - 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（「以下「マザーファンド」といいます。）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、前各号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)預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 15)外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 16)指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 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前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記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、前記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前号の権利の性質を有するもの
4. 前記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、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、前記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)国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資方針

<基本方針>

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

<主な投資対象>

東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

<投資態度>

1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。

2. 運用プロセス

1)流動性基準によるユニバース設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。

2)最適化法によるポートフォリオの構築

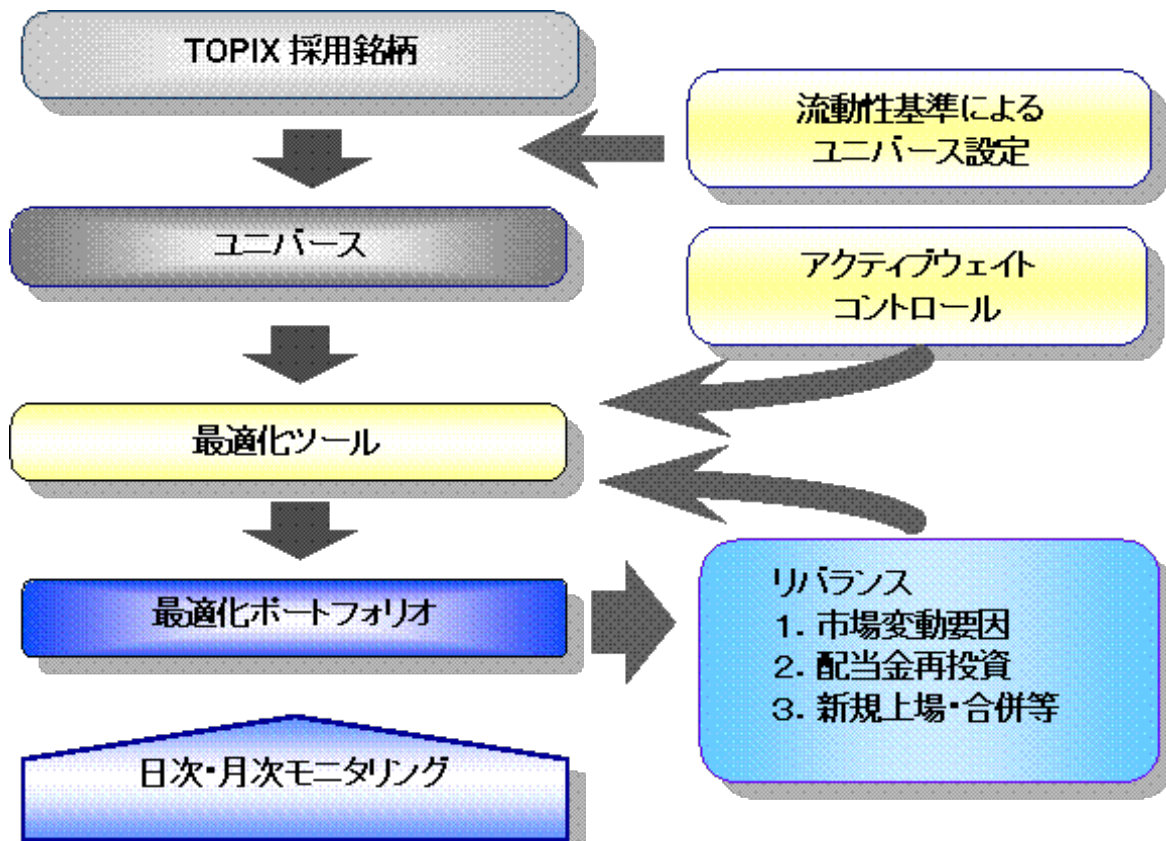
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3)リバランス

日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。

リバランス要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



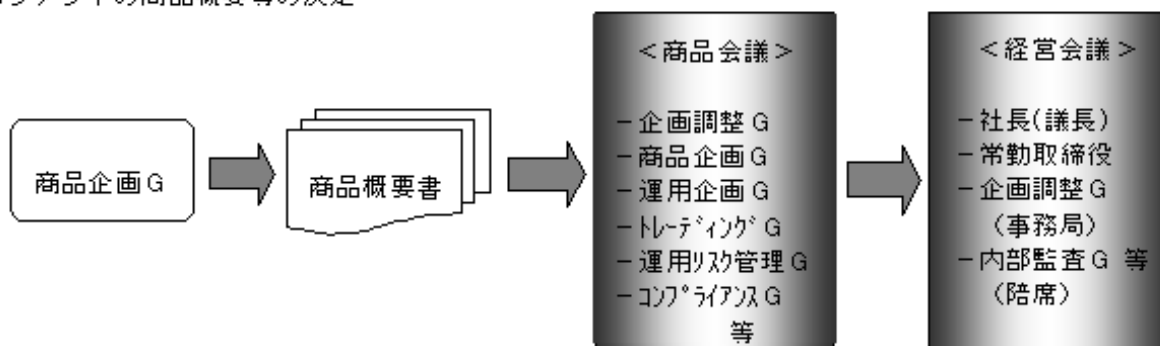
3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
6. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

< 主な投資制限 >

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

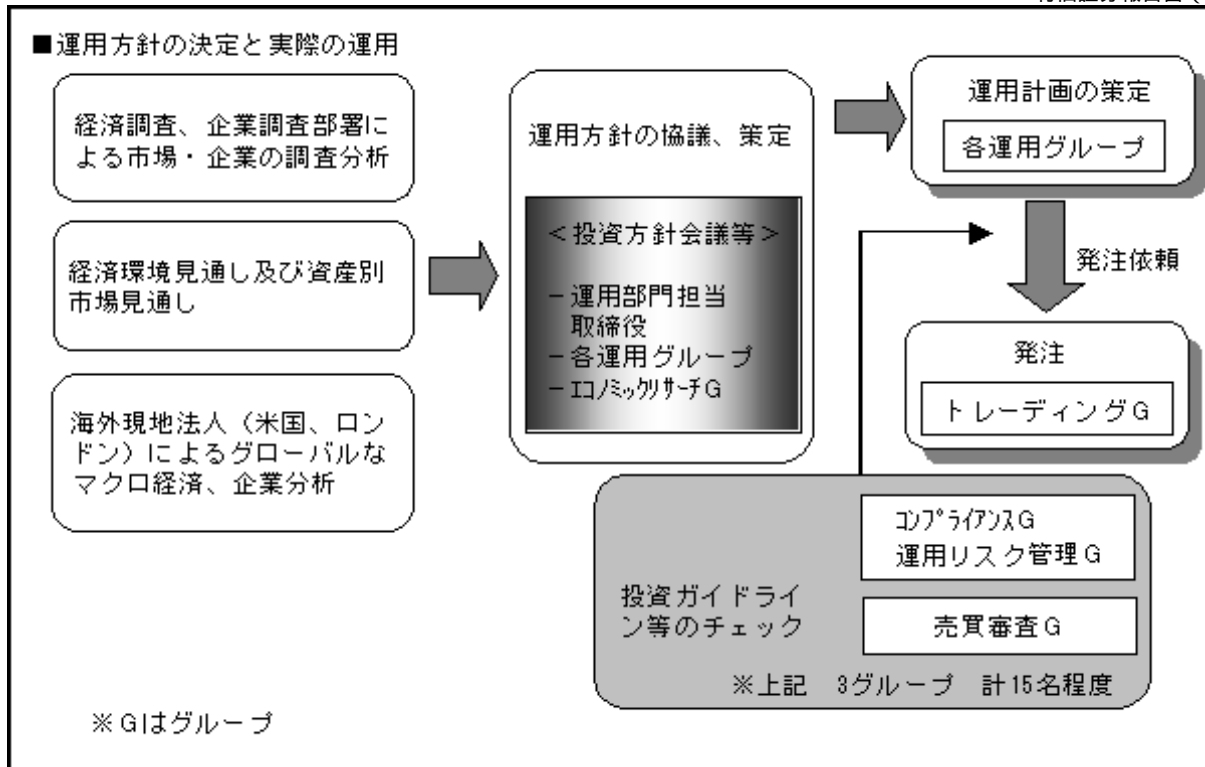
(3) 【運用体制】

■ ファンドの商品概要等の決定



※ Gはグループ

※ 商品会議は各部署のグループリーダーや実務担当者等 20 名程度が参加、経営会議は常勤取締役 8名により構成。



<ファンドの商品概要等の決定>

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

<運用方針の決定と実際の運用>

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

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

個別の有価証券等の発注は、運用担当者の発注依頼に基づき、運用部門から独立したトレーディンググループでその大半が執行されます。

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、運用リスク管理グループにて行われ、有価証券の売買執行等については売買審査グループにてチェックが行われます。

前記体制は平成21年2月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(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せん。

(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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、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) 前記(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、）の行使により取得可能な株券

6) 先物取引等の運用指図・目的（約款第20条）

- (a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

7) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

8) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第22条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
- 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b) 前(a)の1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

9) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第24条)

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

10) 外貨為替予約の指図(約款第25条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。
- (b) 前(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) 前(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

11) 資金の借入れ(約款第33条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場

合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

(d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1) 基準価額の主な変動要因

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

株式や短期金融商品等の発行者が経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想される場合、当該株式等の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

株式市場における売買量の欠如等の理由により、当ファンドにとって最適な時期で株式の売買ができず機会損失を被るリスクがあり、このようなリスクを流動性リスクといいます。

(2) その他の留意点

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及ぼす場合があります。

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目指して運用を行います。当該インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流出入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

当ファンドの収益分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。

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

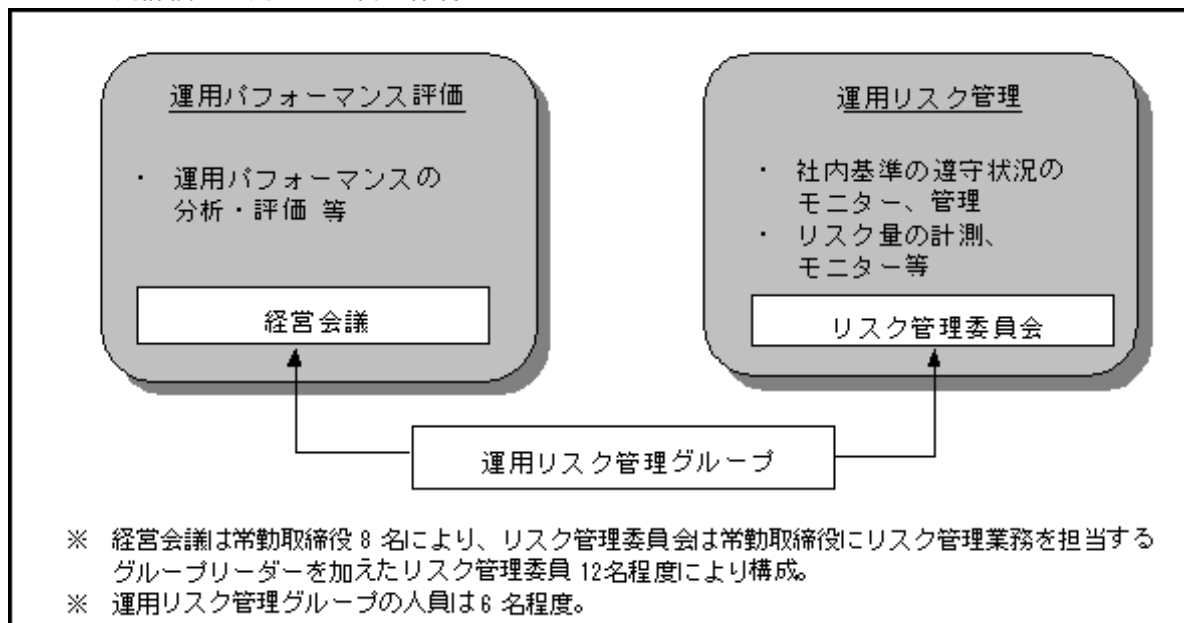
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合等、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（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。したがって元本が保証されているものではありません。
- ロ. 証券投資信託は、預金・金融債・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. 証券投資信託は金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、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. 証券投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります。これによる損失は購入者が負担することとなります。

<運用評価・運用リスク管理体制>



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立した運用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、運用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21年2月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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】

時期	項目	費用		
		総額	信託財産の純資産総額に対して	
毎日	信託報酬		年率0.231%（税抜0.22%）	
		配分	委託会社	年率0.084%（税抜0.08%）
			販売会社	年率0.1155%（税抜0.11%）
			受託会社	年率0.0315%（税抜0.03%）

信託報酬の総額は、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、また、信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中より支弁します。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

イ. 信託財産留保額

ありません。

ロ. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

(5)【課税上の取扱い】

確定拠出年金の加入者におかれましては、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。

なお、上記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金および一部解約時ならびに償還時の個別元本超過額については、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収されます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

なお、収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。また、地方税の源泉徴収はありません。

（注）法人の形態等により、税金の取扱いが異なることがありますので、ご注意ください。

税法および確定拠出年金法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

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 >

追加型株式投資信託について、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、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、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。（「特別分配金」については、次の< 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 >

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「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特別分配金となり、当該収益分配金から当該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には、前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21年3月5日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	22,014,227,066	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,421,770	0.02
合計(純資産総額)		22,010,805,296	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考) マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成21年3月5日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	145,441,388,849	93.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,014,421,202	6.44
合計(純資産総額)		155,455,810,051	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成21年3月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	23,663,578,487	9,759.80	23,095,186,257	9,303.00	22,014,227,066	100.02

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は1銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成21年3月5日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

【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) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年3月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	1,974,900	3,185.94	6,291,920,600	2,985.00	5,895,076,500	3.79
2	三菱UFJフィナン シャルG	株式	日本	銀行業	8,884,200	478.77	4,253,501,800	421.00	3,740,248,200	2.41
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,313,600	2,258.33	2,966,543,000	2,260.00	2,968,736,000	1.91
4	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	697,300	4,158.31	2,899,587,600	3,890.00	2,712,497,000	1.74
5	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	968,600	2,713.70	2,628,485,000	2,675.00	2,591,005,000	1.67
6	エヌ・ティ・ティ・ ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	14,991	150,299.28	2,253,136,520	147,500.00	2,211,172,500	1.42
7	武田薬品	株式	日本	医薬品	565,500	4,008.59	2,266,859,221	3,870.00	2,188,485,000	1.41
8	任 天 堂	株式	日本	その他 製品	81,100	27,001.60	2,189,830,000	26,810.00	2,174,291,000	1.40
9	キヤノン	株式	日本	電気機 器	891,200	2,561.24	2,282,581,500	2,235.00	1,991,832,000	1.28
10	三井住友フィナン シャルG	株式	日本	銀行業	640,200	3,381.18	2,164,628,400	2,955.00	1,891,791,000	1.22
11	パナソニック	株式	日本	電気機 器	1,639,100	1,118.80	1,833,827,300	1,118.00	1,832,513,800	1.18
12	みずほフィナンシャル G	株式	日本	銀行業	8,535,300	218.80	1,867,559,100	185.00	1,579,030,500	1.02
13	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	286,300	5,519.03	1,580,098,200	5,440.00	1,557,472,000	1.00
14	ソ ニ ー	株式	日本	電気機 器	815,000	1,828.16	1,489,950,800	1,783.00	1,453,145,000	0.93
15	関西電力	株式	日本	電気・ ガス業	638,100	2,274.31	1,451,238,600	2,250.00	1,435,725,000	0.92
16	東京海上HD	株式	日本	保険業	652,700	2,377.85	1,552,020,200	2,020.00	1,318,454,000	0.85
17	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,133,000	1,351.49	1,531,242,400	1,162.00	1,316,546,000	0.85
18	セブン&アイ・HL DGS	株式	日本	小売業	605,700	2,269.48	1,374,623,800	2,050.00	1,241,685,000	0.80
19	中部電力	株式	日本	電気・ ガス業	520,700	2,329.97	1,213,213,900	2,300.00	1,197,610,000	0.77
20	K D D I	株式	日本	情報・ 通信業	2,355	500,735.49	1,179,232,070	489,000.00	1,151,595,000	0.74
21	信越化学	株式	日本	化学	268,100	4,318.62	1,157,822,400	4,290.00	1,150,149,000	0.74
22	アステラス製薬	株式	日本	医薬品	360,800	3,465.62	1,250,394,800	3,160.00	1,140,128,000	0.73
23	三井物産	株式	日本	卸売業	1,306,000	1,028.45	1,343,159,000	871.00	1,137,526,000	0.73

24	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	4,223,000	280.58	1,184,869,000	259.00	1,093,757,000	0.70
25	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,056,000	1,189.67	1,256,290,000	1,001.00	1,057,056,000	0.68
26	ファナック	株式	日本	電気機器	148,600	6,213.77	923,365,900	6,440.00	956,984,000	0.62
27	J F Eホールディングス	株式	日本	鉄鋼	410,500	2,453.93	1,007,337,600	2,225.00	913,362,500	0.59
28	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	3,818	246,393.76	940,731,384	228,300.00	871,649,400	0.56
29	東北電力	株式	日本	電気・ガス業	384,000	2,170.78	833,580,000	2,200.00	844,800,000	0.54
30	りそなホールディングス	株式	日本	銀行業	489,700	1,473.10	721,379,000	1,632.00	799,190,400	0.51

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成21年3月5日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	11.36
	銀行業	9.33
	輸送用機器	8.62
	電気・ガス業	6.71
	情報・通信業	6.16
	化学	5.19
	医薬品	4.81
	陸運業	4.30
	卸売業	4.06
	機械	3.85
	小売業	3.50
	食料品	3.10
	その他製品	2.43
	鉄鋼	2.32
	保険業	2.30
	建設業	2.04
	不動産業	1.82
	サービス業	1.60
	精密機器	1.18
	非鉄金属	1.01
	証券、商品先物取引業	0.97
	ガラス・土石製品	0.97
	石油・石炭製品	0.87
	繊維製品	0.84
	空運業	0.66
	ゴム製品	0.63
海運業	0.61	
金属製品	0.60	
その他金融業	0.55	
パルプ・紙	0.42	
鉱業	0.40	
倉庫・運輸関連業	0.25	

	水産・農林業	0.11
合計		93.56

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成21年3月5日）、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（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成16年2月9日現在）	425	425	1.2564	1.2564
第2期末（平成17年2月7日現在）	4,179	4,179	1.4271	1.4271
第3期末（平成18年2月7日現在）	24,604	24,604	2.1436	2.1436
第4期末（平成19年2月7日現在）	32,044	32,044	2.1853	2.1853
第5期末（平成20年2月7日現在）	30,110	30,110	1.6674	1.6674
第6期末（平成21年2月9日現在）	22,737	22,737	1.0115	1.0115
平成20年3月末	28,885		1.5646	
4月末	32,775		1.7520	
5月末	34,952		1.8154	
6月末	32,904		1.7030	
7月末	32,857		1.6812	
8月末	31,745		1.6185	
9月末	27,850		1.4129	
10月末	23,156		1.1243	
11月末	23,104		1.0841	
12月末	24,430		1.1170	
平成21年1月末	23,167		1.0317	
2月末	22,343		0.9842	
3月5日	22,010		0.9631	

【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-
第5期	-
第6期	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1期	25.64
第2期	13.59
第3期	50.21
第4期	1.95
第5期	23.70
第6期	39.34

(注)収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【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

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みには、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（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前11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/>
電話番号：03-3287-3111
（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位とします。

お申込手数料
ありません。

払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込み方法

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

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

原則として販売会社の毎営業日の午後3時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前11時）までに解約の請求が行われ、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。

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、振替受益権をもって行うものとします。

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/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

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。

第3【管理及び運営】

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

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値に

よって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買取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、毎営業日、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/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

(2) 【保管】

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。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

(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が、下記(5)イ.の場合には、信託を終了する場合があります。

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

(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. 委託会社は前記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. 前記a. b.につき、前記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、解約した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. 前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、前記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、後記「ロ. 信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 前記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、新聞公告または書面にて付記します。

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、前記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. 委託会社は前記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 前記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、前記a. ~ e. の規定にしたがいます。
- g. 前記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、新聞公告または書面にて付記します。
- 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3ヵ月前までに、当事者間の別段の意志表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ. 公 告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ. 運用報告書

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

運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

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

2【受益者の権利等】

収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資される性質を有します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

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

なお、解約の請求を受益者がするとき、振替受益権をもって行うものとします。受益証券をお手許で保有されている方は、解約のお申込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

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4【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）ならびに同規則第2条の2の規定により、第5期計算期間（平成19年2月8日から平成20年2月7日まで）については改正前の、第6期計算期間（平成20年2月8日から平成21年2月9日まで）については改正後の「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5期計算期間（平成19年2月8日から平成20年2月7日まで）及び第6期計算期間（平成20年2月8日から平成21年2月9日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>

(1)【貸借対照表】

科目	注記 番号	第5期	第6期
		平成20年2月7日現在	平成21年2月9日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		116,079,129	47,091,376
親投資信託受益証券		30,109,116,479	22,736,213,156
流動資産合計		30,225,195,608	22,783,304,532
資産合計		30,225,195,608	22,783,304,532
負債の部			
流動負債			
未払解約金		74,222,906	15,580,087
未払受託者報酬		5,409,381	4,064,315
未払委託者報酬		34,259,585	25,740,830
その他未払費用		901,485	677,300
流動負債合計		114,793,357	46,062,532
負債合計		114,793,357	46,062,532
純資産の部			
元本等			
元本		18,058,615,198	22,479,101,954
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,051,787,053	258,140,046
（分配準備積立金）		3,257,509,873	2,636,555,486
元本等合計		30,110,402,251	22,737,242,000
純資産合計		30,110,402,251	22,737,242,000
負債純資産合計		30,225,195,608	22,783,304,532

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	注記 番号	第 5 期	第 6 期
		自平成19年2月8日 至平成20年2月7日	自平成20年2月8日 至平成21年2月9日
		金額（円）	金額（円）
営業収益			
受取利息		590,816	307,598
有価証券売買等損益		8,947,866,563	13,113,971,323
営業収益合計		8,947,275,747	13,113,663,725
営業費用			
受託者報酬		10,767,969	9,036,046
委託者報酬		68,197,596	57,228,625
その他費用		1,794,501	1,505,838
営業費用合計		80,760,066	67,770,509
営業損失（ ）		9,028,035,813	13,181,434,234
経常損失（ ）		9,028,035,813	13,181,434,234
当期純損失（ ）		9,028,035,813	13,181,434,234
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		615,981,971	817,567,481
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		17,380,497,861	12,051,787,053
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,412,851,185	3,269,296,554
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,412,851,185	3,269,296,554
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,329,508,151	2,699,076,808
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,329,508,151	2,699,076,808
分配金	*1	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,051,787,053	258,140,046

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 5 期 自平成19年2月8日 至平成20年2月7日	第 6 期 自平成20年2月8日 至平成21年2月9日
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しま す。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は計算期間 末日が休業日のため、平成20年2月 8日から平成21年2月9日までと なっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第 5 期	第 6 期
	平成20年2月7日現在	平成21年2月9日現在
*1 期首元本額	14,663,509,725円	18,058,615,198円
期中追加設定元本額	8,779,618,539円	8,569,368,552円
期中解約元本額	5,384,513,066円	4,148,881,796円
*2 計算期間末日における受益権の総数	18,058,615,198口	22,479,101,954口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第 5 期	第 6 期
	自平成19年2月8日 至平成20年2月7日	自平成20年2月8日 至平成21年2月9日
*1 分配金の計算過程	<p>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（8,794,277,180円）及び分配準備積立金（3,257,509,873円）より分配対象収益は12,051,787,053円（1万口当たり6,673.70円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>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（8,950,519,968円）及び分配準備積立金（2,636,555,486円）より分配対象収益は11,587,075,454円（1万口当たり5,154.59円）ですが、分配を行っておりません。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 5 期		第 6 期	
	自平成19年2月8日 至平成20年2月7日		自平成20年2月8日 至平成21年2月9日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(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	30,109,116,479	8,708,630,563	22,736,213,156	12,920,108,413
合計	30,109,116,479	8,708,630,563	22,736,213,156	12,920,108,413

（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 5 期 平成20年2月7日現在	第 6 期 平成21年2月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6674円 (16,674円)	1.0115円 (10,115円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	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	23,273,838,834	22,736,213,156	
合計		23,273,838,834	22,736,213,156	

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

科目	注記 番号	平成20年2月7日現在	平成21年2月9日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,743,218,360	4,930,190,043
株式		146,692,422,150	147,869,682,251
派生商品評価勘定		14,985,675	3,127,696
未収入金		-	207,783
未収配当金		109,387,423	166,599,495
前払金		205,176,888	160,008,901
差入委託証拠金		312,137,112	670,656,099

流動資産合計		154,077,327,608	153,800,472,268
資産合計		154,077,327,608	153,800,472,268
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		158,309,719	288,297,745
未払解約金		74,341,000	60,494,000
流動負債合計		232,650,719	348,791,745
負債合計		232,650,719	348,791,745
純資産の部			
元本等			
元本		95,789,041,926	157,086,250,410
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	58,055,634,963	3,634,569,887
元本等合計		153,844,676,889	153,451,680,523
純資産合計		153,844,676,889	153,451,680,523
負債純資産合計		154,077,327,608	153,800,472,268

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成19年2月8日 至平成20年2月7日	自平成20年2月8日 至平成21年2月9日
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）、金融商品取引所等が発表する基準値段、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。	株式 同左
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。	先物取引 同左

3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。</p> <p>ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、いまだ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		<p>計算期間の取扱い</p> <p>当該親投資信託の計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成20年2月8日から平成21年2月9日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年2月7日現在	平成21年2月9日現在
*1 本有価証券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	60,246,488,532円	95,789,041,926円
同期中追加設定元本額	46,622,540,569円	78,263,106,409円
同期中解約元本額	11,079,987,175円	16,965,897,925円
同期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	405,396,712円	1,013,772,754円
D I A M 国内株式パッシブ・ファンド	- 円	1,003,714円
D I A M 国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	18,746,725,907円	23,273,838,834円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 1安定型	382,636,675円	625,724,551円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 2安定・成長型	1,509,170,263円	2,241,917,454円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 3成長型	1,701,676,051円	2,297,175,375円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	316,291,369円	428,968,268円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	976,962,913円	1,202,087,156円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	782,038,583円	864,148,969円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	162,357,625円	138,572,797円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	858,436,355円	887,859,738円

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) <適格機関投資家限定>	974,365,482円	- 円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25V A (適格機関投資 家限定)	11,233,029,786円	12,956,290,996円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50V A (適格機関投資 家限定)	1,852,577,681円	1,966,390,580円
D I A M国際分散バランスファ ンド30V A (適格機関投資家限 定)	191,228,677円	232,547,839円
D I A M国際分散バランスファ ンド50V A (適格機関投資家限 定)	746,959,612円	825,131,793円
D I A M国内重視バランスファ ンド30V A (適格機関投資家限 定)	199,823,005円	256,062,674円
D I A M国内重視バランスファ ンド50V A (適格機関投資家限 定)	281,641,782円	331,792,349円
D I A M世界バランスファンド 40V A (適格機関投資家限定)	18,762,543,820円	22,073,160,231円
D I A M世界バランスファンド 50V A (適格機関投資家限定)	6,384,741,702円	7,078,877,417円
D I A Mバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	4,144,946,459円	6,078,713,400円
D I A Mバランスファンド37.5 V A (適格機関投資家限定)	2,605,582,629円	3,935,766,840円
D I A Mバランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	6,880,268,253円	9,149,389,827円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A (適格機関投資 家限定)	1,157,535,324円	1,339,088,250円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2 (適格機関投資 家限定)	2,109,630,419円	2,903,786,918円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30V A (適格機 関投資家限定)	841,301,139円	2,487,108,765円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	2,600,033,565円	14,526,685,966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)	137,341,195円	250,442,913円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド (適格機関投資家向け)	437,484,385円	534,502,143円

D I A M世界バランスファンド 55 V A（適格機関投資家限定）	2,878,627,754円	4,977,746,422円
D I A Mアイエヌジー世界バ ランスファンド35 V A（適格機関 投資家限定）	5,438,808,280円	10,113,143,503円
D I A Mグローバル分散ファン ド V A（適格機関投資家限定）	88,878,524円	500,099,046円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資家 限定）	- 円	19,285,014,224円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A（適格機関投資 家限定）	- 円	2,309,438,704円
（合 計）	95,789,041,926円	157,086,250,410円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	95,789,041,926口	157,086,250,410口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総 額を下回っており、その差額は 3,634,569,887円であります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	自平成19年2月8日 至平成20年2月7日		自平成20年2月8日 至平成21年2月9日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	146,692,422,150	41,950,071,272	147,869,682,251	80,934,547,087
合計	146,692,422,150	41,950,071,272	147,869,682,251	80,934,547,087

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

区分	自平成19年2月8日 至平成20年2月7日	自平成20年2月8日 至平成21年2月9日
1. 取引の内容	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。	同左

2. 取引に対する取組みと利用目的	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、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	株価の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成20年2月7日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,683,944,000	-	7,541,475,000	143,324,044
	TOPIX先物				
合 計		7,683,944,000	-	7,541,475,000	143,324,044

平成21年2月9日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	6,197,760,000	-	5,913,450,000	285,170,049
合 計		6,197,760,000	-	5,913,450,000	285,170,049

(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。

(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20年2月7日現在	平成21年2月9日現在
1口当たり純資産額	1.6061円	0.9769円
(1万口当たり純資産額)	(16,061円)	(9,769円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極 洋	72,000	190	13,680,000	
日本水産	192,400	211	40,596,400	
マルハニチロホールディングス	307,000	137	42,059,000	
ハウスイ	15,000	86	1,290,000	
サカタのタネ	30,900	1,259	38,903,100	
ホクト	15,500	2,110	32,705,000	
ショーボンドHD	16,500	1,796	29,634,000	
住石ホールディングス	46,300	81	3,750,300	
日鉄鉱業	43,000	323	13,889,000	
三井松島	53,000	108	5,724,000	
国際石油開発帝石	762	698,000	531,876,000	
関東天然瓦斯	20,000	555	11,100,000	
石油資源開発	23,700	4,080	96,696,000	
ダイセキ環境ソリューション	13	196,300	2,551,900	
間組	74,600	78	5,818,800	
東急建設	59,680	244	14,561,920	
コムシスホールディングス	81,000	719	58,239,000	

ミサワホーム	19,900	220	4,378,000
高松コンストラクションG P	12,700	1,527	19,392,900
東建コーポレーション	5,610	2,040	11,444,400
ヤマウラ	5,000	150	750,000
大成建設	738,000	178	131,364,000
大林組	467,000	407	190,069,000
清水建設	474,000	364	172,536,000
飛島建設	234,500	14	3,283,000
長谷工コーポレーション	834,500	66	55,077,000
松井建設	2,000	300	600,000
鹿島建設	684,000	222	151,848,000
不動テトラ	121,700	51	6,206,700
大末建設	47,000	22	1,034,000
鉄建建設	84,000	81	6,804,000
安藤建設	58,000	132	7,656,000
太平工業	15,000	209	3,135,000
西松建設	193,000	88	16,984,000
三井住友建設	92,100	58	5,341,800
大豊建設	49,000	43	2,107,000
前田建設	103,000	298	30,694,000
佐田建設	68,000	34	2,312,000
ナカノフドー建設	13,500	132	1,782,000
奥村組	159,000	366	58,194,000
大和小田急建設	6,000	180	1,080,000
東鉄工業	21,000	591	12,411,000
イチケン	21,000	99	2,079,000
浅沼組	50,000	51	2,550,000
戸田建設	179,000	278	49,762,000
熊谷組	110,000	43	4,730,000
青木あすなろ建設	7,500	390	2,925,000
北野建設	37,000	192	7,104,000
植木組	23,000	122	2,806,000
三井ホーム	22,000	431	9,482,000
矢作建設	21,000	448	9,408,000
ピーエス三菱	11,300	216	2,440,800
アゼル	28,000	6	168,000
大東建託	74,300	3,810	283,083,000
新日本建設	23,300	93	2,166,900
N I P P Oコーポレーション	34,000	639	21,726,000
東亜道路	33,000	119	3,927,000
前田道路	48,000	748	35,904,000
日本道路	55,000	187	10,285,000

東亜建設	148,000	120	17,760,000	
若築建設	96,000	31	2,976,000	
あおみ建設	112,000	20	2,240,000	
東洋建設	223,000	36	8,028,000	
五洋建設	195,000	113	22,035,000	
大成ロテック	32,000	117	3,744,000	
大林道路	23,000	134	3,082,000	
世紀東急	42,000	30	1,260,000	
福田組	24,000	149	3,576,000	
東北ミサワホーム	10,300	176	1,812,800	
住友林業	114,800	560	64,288,000	
日本基礎技術	24,500	175	4,287,500	
日成ビルド工業	53,000	39	2,067,000	
エス・バイ・エル	95,000	36	3,420,000	
巴コーポレーション	24,700	173	4,273,100	
パナホーム	63,000	517	32,571,000	
大和ハウス	416,000	730	303,680,000	
ライト工業	38,700	161	6,230,700	
積水ハウス	469,000	723	339,087,000	
日特建設	55,000	36	1,980,000	
北陸電気工事	2,000	320	640,000	
コミュニチュア	12,000	571	6,852,000	
ユアテック	27,000	502	13,554,000	
西部電気工業	1,000	399	399,000	
四電工	2,000	456	912,000	
中電工	24,600	1,480	36,408,000	
関電工	76,000	597	45,372,000	
大明	23,000	741	17,043,000	
きんでん	99,000	678	67,122,000	
東京エネシス	19,000	727	13,813,000	
トーエネック	25,000	521	13,025,000	
住友電設	14,000	521	7,294,000	
日本電設工業	34,000	996	33,864,000	
協和エクシオ	60,000	798	47,880,000	
新日本空調	13,600	730	9,928,000	
日本工営	54,000	210	11,340,000	
東電通	22,000	155	3,410,000	
日本電話施設	31,000	244	7,564,000	
九電工	31,000	625	19,375,000	
三機工業	40,000	559	22,360,000	
日揮	167,000	1,280	213,760,000	
中外炉工業	57,000	251	14,307,000	

ヤマト	16,000	285	4,560,000
太平電業	25,000	1,003	25,075,000
高砂熱学	48,000	642	30,816,000
日立プラントテクノロジー	45,000	292	13,140,000
三晃金属	19,000	253	4,807,000
NEC ネットエスアイ	14,200	888	12,609,600
朝日工業社	8,000	284	2,272,000
アタカ大機	4,000	203	812,000
大 気 社	24,100	1,295	31,209,500
ダイダン	15,000	379	5,685,000
日比谷総合設	25,000	679	16,975,000
東芝プラントシステム	27,000	910	24,570,000
日本製粉	105,000	454	47,670,000
日清製粉G本社	151,500	991	150,136,500
日東富士製粉	8,000	280	2,240,000
昭和産業	77,000	285	21,945,000
鳥越製粉	15,400	712	10,964,800
日本農産工業	43,000	219	9,417,000
協同飼料	60,000	100	6,000,000
中部飼料	16,000	681	10,896,000
日本配合飼料	47,000	96	4,512,000
ユニ・チャーム ペットケア	9,600	2,990	28,704,000
東洋精糖	29,000	96	2,784,000
日本甜菜糖	94,000	237	22,278,000
三井製糖	66,000	293	19,338,000
日本M & Aセンター	24	255,300	6,127,200
アコーディア・ゴルフ	388	56,400	21,883,200
パソナグループ	151	44,150	6,666,650
テンプホールディングス	18,100	557	10,081,700
森永製菓	179,000	197	35,263,000
明治製菓	250,000	357	89,250,000
中 村 屋	40,000	496	19,840,000
江崎グリコ	61,000	800	48,800,000
名糖産業	6,800	1,359	9,241,200
不 二 家	93,000	118	10,974,000
山崎製パン	112,000	1,130	126,560,000
第一屋製パン	27,000	85	2,295,000
モロゾフ	18,000	286	5,148,000
明治乳業	199,000	408	81,192,000
雪印乳業	183,000	261	47,763,000
森永乳業	142,000	288	40,896,000
ヤクルト	89,300	1,578	140,915,400

プリマハム	94,000	142	13,348,000
日本ハム	127,000	1,059	134,493,000
伊藤ハム	107,000	295	31,565,000
林兼産業	56,000	72	4,032,000
丸大食品	69,000	247	17,043,000
米久	16,500	986	16,269,000
S Foods	4,500	800	3,600,000
学情	6,900	341	2,352,900
スタジオアリス	7,400	526	3,892,400
シミック	250	24,940	6,235,000
システムプロ	97	39,550	3,836,350
NECフィールドینگ	12,600	1,095	13,797,000
新日鉄ソリューションズ	9,700	1,022	9,913,400
総合警備保障	51,800	793	41,077,400
日本駐車場開発	1,625	3,200	5,200,000
コア	6,400	529	3,385,600
カカクコム	119	311,000	37,009,000
アイロムホールディングス	319	2,305	735,295
ルネサンス	9,000	314	2,826,000
セキュアードキャピタルJ	47	30,100	1,414,700
新日本科学	6,100	378	2,305,800
ソネット・エムスリー	73	336,000	24,528,000
ディー・エヌ・エー	201	270,100	54,290,100
博報堂DYHLDGS	21,520	4,020	86,510,400
ぐるなび	81	228,000	18,468,000
一休	118	35,500	4,189,000
ジャパンベストレスキューS	24	38,500	924,000
ジェイコム	16	77,500	1,240,000
パシフィックゴルフGRP	382	47,800	18,259,600
サッポロホールディングス	237,000	409	96,933,000
アサヒビール	312,800	1,340	419,152,000
麒麟HD	682,000	1,009	688,138,000
宝ホールディングス	141,000	435	61,335,000
オエノンホールディングス	46,000	189	8,694,000
メルシャン	52,000	173	8,996,000
養命酒	3,000	838	2,514,000
三国コカ・コ-ラ	23,000	764	17,572,000
四国コカ・コーラ	8,400	769	6,459,600
コカ・コーラウエスト	51,400	1,713	88,048,200
コカコーラセントラルジャパン	19,100	1,303	24,887,300
ダイドードリンコ	7,700	2,405	18,518,500
伊藤園	46,400	1,195	55,448,000

キーコーヒー	14,000	1,460	20,440,000	
ユニカフェ	4,700	1,105	5,193,500	
ジャパンフーズ	2,800	711	1,990,800	
日清オイリオグループ	72,000	458	32,976,000	
不二製油	44,700	1,110	49,617,000	
J-オイルミルズ	62,000	314	19,468,000	
ローソン	46,100	4,110	189,471,000	
インターニックス	6,400	282	1,804,800	
サンエー	5,700	3,020	17,214,000	
キリン堂	6,400	494	3,161,600	
ダイユーエイト	1,900	613	1,164,700	
カワチ薬品	10,300	1,605	16,531,500	
エービーシー・マート	15,400	2,500	38,500,000	
ハードオフコーポレーション	7,200	377	2,714,400	
高千穂交易	6,400	1,000	6,400,000	
アスクル	14,100	1,825	25,732,500	
ゲオ	269	64,000	17,216,000	

[次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ポイント	13,200	3,840	50,688,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	5,000	125	625,000	
伊藤忠食品	3,800	3,280	12,464,000	
くらコーポレーション	43	144,400	6,209,200	
キャンドウ	79	92,700	7,323,300	
高千穂電気	9,900	755	7,474,500	
パル	3,800	962	3,655,600	
JALUX	4,600	1,309	6,021,400	
エディオン	58,400	329	19,213,600	
サーラコーポレーション	15,000	553	8,295,000	
トーメンデバイス	2,000	939	1,878,000	
バルス	81	98,500	7,978,500	
あみやき亭	27	135,500	3,658,500	
双日	910,500	134	122,007,000	
アルフレッサホールディングス	29,300	3,540	103,722,000	
ハニーズ	11,500	554	6,371,000	
クリエイトエス・ディー	5,300	1,694	8,978,200	
キッコーマン	146,000	771	112,566,000	
味の素	453,000	682	308,946,000	
キューピー	86,300	1,104	95,275,200	
ハウス食品	61,800	1,384	85,531,200	
カゴメ	64,800	1,326	85,924,800	
焼津水産化工	9,300	990	9,207,000	
アリアケジャパン	13,700	1,493	20,454,100	
ニチレイ	187,000	342	63,954,000	
横浜冷凍	35,000	611	21,385,000	
東洋水産	67,000	2,285	153,095,000	
日清食品HD	53,000	2,895	153,435,000	
永谷園	2,000	805	1,610,000	
フジッコ	18,000	1,108	19,944,000	
ロックフィールド	7,900	1,107	8,745,300	
日本たばこ産業	3,694	246,200	909,462,800	
わらべや日洋	8,600	1,333	11,463,800	
なとり	8,500	731	6,213,500	
片倉工業	18,000	833	14,994,000	
グンゼ	116,000	317	36,772,000	
昭栄	24,800	633	15,698,400	
神栄	9,000	140	1,260,000	
川島織物セルコン	56,000	72	4,032,000	

山下医科器械	400	1,027	410,800	
ラサ商事	8,200	351	2,878,200	
アルペン	11,300	1,620	18,306,000	
ビックカメラ	402	17,080	6,866,160	
DCM JAPAN HLDGS	73,400	483	35,452,200	
あいホールディングス	36,300	295	10,708,500	
J. フロントリテイリング	372,000	314	116,808,000	
ドトール・日レスHD	21,200	1,408	29,849,600	
マツモトキヨシHLDGS	27,400	1,681	46,059,400	
ココカラファインHD	8,400	1,100	9,240,000	
三越伊勢丹HD	268,800	651	174,988,800	
東洋紡績	519,000	133	69,027,000	
ユニチカ	358,000	65	23,270,000	
富士紡ホールディングス	65,000	76	4,940,000	
日清紡績	111,000	677	75,147,000	
倉敷紡績	161,000	138	22,218,000	
大和紡績	101,000	256	25,856,000	
シキボウ	102,000	97	9,894,000	
日東紡績	149,000	153	22,797,000	
トヨタ紡織	51,900	855	44,374,500	
日本毛織	53,000	571	30,263,000	
大東紡織	28,000	51	1,428,000	
トーア紡コーポレーション	64,000	52	3,328,000	
ダイドーリミテッド	21,300	610	12,993,000	
御幸ホールディングス	4,000	195	780,000	
東京建物不動産販	7,100	214	1,519,400	
野村不動産HLDGS	41,300	1,661	68,599,300	
ヒューリック	40,600	421	17,092,600	
帝国繊維	6,000	357	2,142,000	
ブックオフコーポレーション	8,200	829	6,797,800	
三井鉱山	94,500	117	11,056,500	
ミタチ産業	1,000	306	306,000	
JFE商事HLDGS	98,000	279	27,342,000	
あさひ	2,300	1,959	4,505,700	
サークルKサンクス	36,000	1,526	54,936,000	
日本調剤	2,650	1,141	3,023,650	
コスモス薬品	6,600	1,577	10,408,200	
グリーンホスピタルサプライ	140	49,300	6,902,000	
セブン&アイ・HLDGS	586,000	2,270	1,330,220,000	
ツルハホールディングス	10,000	2,770	27,700,000	
サンマルクホールディングス	4,700	2,800	13,160,000	
フェリシモ	4,300	1,540	6,622,000	

帝人	637,000	200	127,400,000
東レ	1,035,000	377	390,195,000
三菱レイヨン	388,000	200	77,600,000
クラレ	230,000	738	169,740,000
旭化成	972,000	339	329,508,000
サカイオーベックス	49,000	73	3,577,000
稲葉製作所	7,900	950	7,505,000
宮地エンジニアリングG	53,000	57	3,021,000
三協・立山HLDGS	198,000	63	12,474,000
トーカロ	9,600	851	8,169,600
アルファCO	5,400	607	3,277,800
SUMCO	83,200	1,263	105,081,600
住江織物	41,000	106	4,346,000
日本フェルト	10,700	390	4,173,000
イチカワ	2,000	253	506,000
日本バイリン	22,000	402	8,844,000
エコナック	46,000	40	1,840,000
日東製網	21,000	88	1,848,000
芦森工業	39,000	90	3,510,000
アツギ	146,000	122	17,812,000
ダイニック	31,000	119	3,689,000
共和レザー	9,900	398	3,940,200
セーレン	39,100	371	14,506,100
東海染工	17,000	68	1,156,000
小松精練	12,000	373	4,476,000
ワコールホールディングス	93,000	1,109	103,137,000
ホギメディカル	7,600	5,350	40,660,000
サンエー・インターナショナル	6,800	652	4,433,600
レナウン	26,800	117	3,135,600
ITホールディングス	47,700	1,228	58,575,600
特種東海HLDGS	108,000	233	25,164,000
ドワンゴ	73	156,000	11,388,000
ベリサーブ	8	143,700	1,149,600
マクロミル	60	97,600	5,856,000
ティーガイア	118	100,800	11,894,400
GMOペイメントゲートウェイ	24	94,600	2,270,400
インターネットイニシアティブ	85	87,500	7,437,500
ソネットエンタテインメント	83	181,500	15,064,500
SRAホールディングス	7,000	591	4,137,000
JBISホールディングス	17,700	371	6,566,700
朝日ネット	9,000	276	2,484,000
王子製紙	639,000	428	273,492,000

三菱製紙	222,000	140	31,080,000	
北越製紙	89,000	435	38,715,000	
中越パルプ	61,000	211	12,871,000	
巴川製紙	24,000	227	5,448,000	
大王製紙	66,000	887	58,542,000	
紀州製紙	54,000	90	4,860,000	
日本製紙G本社	72,600	2,710	196,746,000	
レンゴー	122,000	618	75,396,000	
トーモク	51,000	180	9,180,000	
ザ・パック	10,100	1,124	11,352,400	
コ・ブケミカル	21,000	201	4,221,000	
昭和電工	807,000	123	99,261,000	
住友化学	1,146,000	287	328,902,000	
日本化成	29,000	137	3,973,000	
住友精化	30,000	241	7,230,000	
日産化学	109,000	743	80,987,000	
ラサ工業	64,000	120	7,680,000	
クレハ	102,000	399	40,698,000	
テイカ	28,000	219	6,132,000	
石原産業	243,000	69	16,767,000	
片倉チツカリン	13,000	326	4,238,000	
日本曹達	93,000	319	29,667,000	
東ソー	416,000	177	73,632,000	
トクヤマ	191,000	515	98,365,000	
セントラル硝子	159,000	331	52,629,000	
東亜合成	171,000	233	39,843,000	
ダイソー	63,000	215	13,545,000	
関東電化	34,000	324	11,016,000	
電気化学	327,000	172	56,244,000	
イビデン	104,300	1,894	197,544,200	
信越化学	259,300	4,320	1,120,176,000	
日本カ - バイド	35,000	86	3,010,000	
堺化学	54,000	240	12,960,000	
エア・ウォーター	111,000	728	80,808,000	
大陽日酸	242,000	625	151,250,000	
日本化学工業	54,000	170	9,180,000	
日本パ - カライジング	37,000	763	28,231,000	
高圧ガス	24,000	371	8,904,000	
チタン工業	20,000	136	2,720,000	
四国化成	23,000	316	7,268,000	
戸田工業	25,000	258	6,450,000	
ステラ ケミファ	7,400	1,681	12,439,400	

保土谷化学	41,000	159	6,519,000
日本触媒	104,000	559	58,136,000
大日精化	57,000	226	12,882,000
カネカ	194,000	491	95,254,000
協和発酵キリン	213,000	847	180,411,000
三菱瓦斯化学	268,000	396	106,128,000
三井化学	475,000	238	113,050,000
J S R	141,600	1,144	161,990,400
東京応化工業	30,800	1,449	44,629,200
三菱ケミカルH L D G S	904,000	351	317,304,000
日本合成化学	41,000	210	8,610,000
ダイセル化学	202,000	367	74,134,000
住友ベークライト	159,000	383	60,897,000
積水化学	349,000	456	159,144,000
日本ゼオン	134,000	305	40,870,000
アイカ工業	48,700	841	40,956,700
宇部興産	652,000	179	116,708,000
積水樹脂	23,000	604	13,892,000
タキロン	38,000	264	10,032,000
旭有機材	57,000	260	14,820,000
日立化成	67,200	1,031	69,283,200
ニチバン	18,000	267	4,806,000
リケンテクノス	17,000	152	2,584,000
大倉工業	39,000	199	7,761,000
積水化成品	43,000	280	12,040,000
群栄化学	44,000	198	8,712,000
タイガース ポリマー	8,500	322	2,737,000
日本カクリット	13,600	337	4,583,200
日本化薬	118,000	425	50,150,000
イーピーエス	42	391,000	16,422,000
パナソニック電工 I S	3,000	1,595	4,785,000
フェイス	608	6,370	3,872,960
アミューズ	3,400	1,121	3,811,400
野村総合研究所	72,500	1,646	119,335,000
ドリームインキュベータ	50	49,500	2,475,000
サイバネットシステム	127	30,050	3,816,350
T A C	8,900	500	4,450,000
ケネディクス	406	12,530	5,087,180
電通	154,100	1,411	217,435,100
テイクアンドギヴニーズ	439	2,950	1,295,050
ぴあ	4,000	951	3,804,000
シンプレクス・テクノロジー	246	29,200	7,183,200

イオンファンタジー	5,100	785	4,003,500	
ソースネクスト	14	33,450	468,300	
ネクシィーズ	559	1,590	888,810	
日本精化	12,800	424	5,427,200	
A D E K A	67,300	499	33,582,700	
日油	138,000	338	46,644,000	
ミヨシ油脂	57,000	123	7,011,000	
ハリマ化成	9,000	348	3,132,000	
花 王	399,000	1,998	797,202,000	
第一工業製薬	26,000	175	4,550,000	
三洋化成	49,000	476	23,324,000	
武田薬品	564,500	4,010	2,263,645,000	
アステラス製薬	349,000	3,470	1,211,030,000	
大日本住友製薬	111,000	797	88,467,000	
塩野義製薬	227,000	1,669	378,863,000	
田辺三菱製薬	156,000	1,191	185,796,000	
わかもと製薬	4,000	349	1,396,000	
あすか製薬	15,000	825	12,375,000	
日本新薬	39,000	995	38,805,000	
中外製薬	206,800	1,695	350,526,000	
科研製薬	66,000	932	61,512,000	
エーザイ	191,700	3,220	617,274,000	
ロート製薬	71,000	995	70,645,000	
小野薬品	78,100	4,370	341,297,000	
久光製薬	48,400	3,120	151,008,000	
有機合成薬品	13,000	261	3,393,000	
持田製薬	64,000	1,061	67,904,000	
大正製薬	148,000	1,760	260,480,000	
参天製薬	48,300	2,670	128,961,000	
エスエス製薬	41,000	533	21,853,000	
扶桑薬品	53,000	252	13,356,000	
日本ケミファ	26,000	280	7,280,000	
ツムラ	45,800	2,735	125,263,000	
テルモ	107,100	3,110	333,081,000	
みらかホールディングス	31,000	1,766	54,746,000	
キッセイ薬品工業	32,000	2,020	64,640,000	
生化学工業	30,200	985	29,747,000	
栄研化学	10,500	635	6,667,500	
日水製薬	7,500	716	5,370,000	
鳥居薬品	9,700	1,488	14,433,600	
東和薬品	6,400	4,070	26,048,000	
沢井製薬	10,200	4,570	46,614,000	

ゼリア新薬工業	23,000	987	22,701,000
第一三共	458,300	2,090	957,847,000
キョーリン	38,000	1,209	45,942,000
大日本塗料	94,000	89	8,366,000
日本ペイント	172,000	327	56,244,000
関西ペイント	176,000	457	80,432,000
トウペ	13,000	73	949,000
中国塗料	45,000	555	24,975,000
日本特殊塗料	1,000	279	279,000
藤倉化成	18,400	429	7,893,600
太陽インキ製造	12,000	1,750	21,000,000
D I C	512,000	154	78,848,000
サカタインクス	32,000	277	8,864,000
東洋インキ	155,000	227	35,185,000
アルプス技研	7,200	529	3,808,800
サニックス	22,500	83	1,867,500
ダイオーズ	1,400	394	551,600
日本空調サービス	3,900	720	2,808,000
オリエンタルランド	43,900	6,520	286,228,000
ダスキン	46,800	1,483	69,404,400
パーク24	88,800	587	52,125,600
明光ネットワークジャパン	15,200	383	5,821,600
ファルコバイオシステムズ	8,900	685	6,096,500
クレスコ	2,500	973	2,432,500
フジ・メディア・HD	1,528	105,200	160,745,600
秀英予備校	3,500	372	1,302,000
田谷	900	662	595,800
ラウンドワン	23,200	677	15,706,400
リゾートトラスト	26,300	891	23,433,300
オービック	4,590	13,590	62,378,100
ティーディーシーソフトウェア	300	712	213,600
ヤフー	10,948	27,800	304,354,400
ビー・エム・エル	8,300	1,914	15,886,200
ワタベウェディング	4,700	1,320	6,204,000
トレンドマイクロ	71,000	2,680	190,280,000
もしもしホットライン	11,250	1,764	19,845,000
東急コミュニティー	4,000	1,605	6,420,000
リソー教育	1,594	3,380	5,387,720
日本オラクル	23,400	3,300	77,220,000
アルファシステムズ	4,100	1,663	6,818,300
フューチャーアーキテクト	177	32,900	5,823,300
ウェアハウス	4,900	415	2,033,500

シーエーシー	8,100	646	5,232,600
ソフトバンク・テクノ	4,100	547	2,242,700
トーセ	4,000	586	2,344,000
ユー・エス・エス	21,120	3,830	80,889,600
オービックビジネスC	4,650	3,260	15,159,000
日立ビジネスソリュー	5,900	487	2,873,300
伊藤忠テクノソリュー	18,200	2,125	38,675,000
アイティフォー	16,600	278	4,614,800
東京個別指導学院	13,600	120	1,632,000
東計電算	3,500	1,036	3,626,000
カルチュア・コンビニエンス	71,200	705	50,196,000
エクスネット	16	140,700	2,251,200
テー・オー・ダブリュー	3,700	561	2,075,700
大塚商会	11,700	3,550	41,535,000
総合メディカル	3,600	2,505	9,018,000
サイボウズ	216	15,600	3,369,600
ソフトブレーン	181	1,248	225,888
アグレックス	3,300	736	2,428,800
セントラルスポーツ	4,700	881	4,140,700
電通国際情報S	10,800	548	5,918,400
ウェザーニューズ	4,400	1,165	5,126,000
C I J	15,200	301	4,575,200
フルキャストホールディングス	109	4,640	505,760
富士フイルムHLDGS	380,100	1,926	732,072,600
コニカミノルタHLDGS	392,500	792	310,860,000
資生堂	265,000	1,480	392,200,000
ライオン	180,000	478	86,040,000
高砂香料	56,000	554	31,024,000
マンダム	15,800	1,780	28,124,000
ミルボン	6,500	2,250	14,625,000
ファンケル	29,500	1,085	32,007,500
コーセー	25,200	1,944	48,988,800
ドクターシーラボ	105	141,400	14,847,000
エステー	11,200	982	10,998,400
コニシ	12,800	737	9,433,600
長谷川香料	18,000	1,071	19,278,000
小林製薬	21,600	3,280	70,848,000
荒川化学工業	13,400	777	10,411,800
メック	10,400	312	3,244,800
日本高純度化学	42	194,900	8,185,800
荏原ユージライト	700	1,682	1,177,400
アース製薬	12,200	2,615	31,903,000

イハラケミカル	30,000	300	9,000,000	
北興化学	11,000	259	2,849,000	
大成ラミック	4,800	1,891	9,076,800	
クミアイ化学	41,000	314	12,874,000	
日本農薬	36,000	604	21,744,000	
新日本石油	1,082,000	436	471,752,000	
昭和シエル石油	122,100	866	105,738,600	
コスモ石油	430,000	272	116,960,000	
富士興産	58,000	73	4,234,000	
ニチレキ	14,000	292	4,088,000	
東燃ゼネラル石油	235,000	868	203,980,000	
ユシロ化学	7,900	912	7,204,800	
ビーピー・カストロール	9,500	219	2,080,500	
新日鉱ホールディングス	642,500	379	243,507,500	
AOCホールディングス	36,100	490	17,689,000	
出光興産	18,500	6,910	127,835,000	
横浜ゴム	190,000	319	60,610,000	
東洋ゴム	159,000	140	22,260,000	
ブリヂストン	488,000	1,250	610,000,000	
住友ゴム	133,500	612	81,702,000	
藤倉ゴム	11,200	292	3,270,400	
オカモト	66,000	310	20,460,000	
アキレス	130,000	122	15,860,000	
フコク	7,900	481	3,799,900	
ニッタ	14,000	1,119	15,666,000	
クリエートメディック	5,700	791	4,508,700	
東海ゴム	28,900	622	17,975,800	
三ツ星ベルト	48,000	444	21,312,000	
バンドー化学	57,000	205	11,685,000	
鬼怒川ゴム	37,000	160	5,920,000	
旭硝子	767,000	466	357,422,000	
日本板硝子	494,000	229	113,126,000	
石塚硝子	22,000	138	3,036,000	
有沢製作所	21,100	312	6,583,200	
日本山村硝子	74,000	204	15,096,000	
日本電気硝子	252,000	628	158,256,000	
オハラ	7,100	745	5,289,500	
住友大阪セメント	296,000	197	58,312,000	
太平洋セメント	614,000	144	88,416,000	
デイ・シイ	13,700	310	4,247,000	
リゾートソリューション	6,000	190	1,140,000	
日本ヒューム	7,000	274	1,918,000	

日本コンクリート	26,000	115	2,990,000
東海カーボン	135,000	345	46,575,000
日本カーボン	76,000	212	16,112,000
東洋炭素	6,700	3,290	22,043,000
ノリタケ	81,000	276	22,356,000
TOTO	241,000	436	105,076,000
日本碍子	187,000	1,210	226,270,000
日本特殊陶業	138,000	733	101,154,000
ダントーホールディングス	21,000	69	1,449,000
MARUWA	4,900	926	4,537,400
日本セラテック	17	30,200	513,400
品川白煉瓦	44,000	160	7,040,000
黒崎播磨	38,000	184	6,992,000
東京窯業	13,000	215	2,795,000
ニッカトー	6,600	406	2,679,600
フジインコーポレーテッド	15,700	1,030	16,171,000
エーアンドエーマテリアル	33,000	81	2,673,000
ニチアス	75,000	231	17,325,000
新日本製鐵	4,085,000	281	1,147,885,000
住友金属工業	2,662,000	204	543,048,000
神戸製鋼所	2,158,000	134	289,172,000
日新製鋼	596,000	175	104,300,000
中山製鋼所	85,000	227	19,295,000
合同製鐵	95,000	263	24,985,000
JFEホールディングス	397,100	2,460	976,866,000
東京製鐵	64,300	945	60,763,500
共英製鋼	12,400	1,601	19,852,400
大和工業	36,500	2,160	78,840,000
東京鐵鋼	31,000	230	7,130,000
大阪製鐵	9,800	1,350	13,230,000
淀川製鋼所	119,000	396	47,124,000
東洋鋼鈹	33,000	326	10,758,000
住友鋼管	11,100	591	6,560,100
丸一鋼管	43,400	2,130	92,442,000
モリ工業	28,000	212	5,936,000
大同特殊鋼	240,000	248	59,520,000
日本高周波	63,000	88	5,544,000
日本金属工業	106,000	118	12,508,000
日本冶金工	85,500	225	19,237,500
山陽特殊鋼	77,000	244	18,788,000
愛知製鋼	83,000	253	20,999,000
日立金属	101,000	537	54,237,000

日本金属	41,000	117	4,797,000
大平洋金属	108,000	442	47,736,000
日本電工	61,000	405	24,705,000
栗本鉄工所	69,000	56	3,864,000
旭テック	62,000	29	1,798,000
日本鑄鉄管	14,000	132	1,848,000
日本製鋼所	223,000	959	213,857,000
三菱製鋼	94,000	203	19,082,000
日亜鋼業	25,000	217	5,425,000
日本精線	13,000	197	2,561,000
日本軽金属	380,000	74	28,120,000
大紀アルミニウム	25,000	144	3,600,000
三井金属	450,000	162	72,900,000
東邦亜鉛	81,000	227	18,387,000
三菱マテリアル	945,000	247	233,415,000
住友鋳山	403,000	973	392,119,000
DOWAホールディングス	196,000	321	62,916,000
古河機金	264,000	81	21,384,000
エス・サイエンス	613,000	2	1,226,000
大阪チタニウム	15,300	2,060	31,518,000
東邦チタニウム	25,200	1,022	25,754,400
住友軽金属	224,000	83	18,592,000
古河スカイ	74,000	174	12,876,000
古河電工	489,000	308	150,612,000
住友電工	513,200	741	380,281,200
フジクラ	234,000	266	62,244,000
三菱電線工業	103,000	79	8,137,000
昭和電線HLDGS	188,000	64	12,032,000
東京特殊電線	21,000	96	2,016,000
タツタ電線	37,000	197	7,289,000
日立電線	122,000	170	20,740,000
沖電線	14,000	132	1,848,000
カナレ電気	1,900	1,000	1,900,000
平河ヒューテック	4,600	597	2,746,200
リョービ	95,000	151	14,345,000
アサヒプリテック	21,700	976	21,179,200
東洋製罐	120,000	1,313	157,560,000
ホッカンホールディングス	39,000	238	9,282,000
コロナ	7,300	867	6,329,100
横河ブリッジHLDGS	30,000	807	24,210,000
日本橋梁	7,050	218	1,536,900
松尾橋梁	27,000	79	2,133,000

駒井鉄工	25,000	185	4,625,000
ハルテック	16,000	72	1,152,000
サクラダ	40,000	6	240,000
高田機工	1,000	110	110,000
三和ホールディングス	156,000	245	38,220,000
文化シャツタ -	41,000	345	14,145,000
川田工業	40,000	98	3,920,000
東洋シャツタ -	4,300	530	2,279,000
住生活グループ	187,900	1,097	206,126,300
日本ファイルコン	12,000	405	4,860,000
ノーリツ	26,000	1,218	31,668,000
長府製作所	16,800	1,797	30,189,600
リンナイ	30,100	3,330	100,233,000
ユニプレス	20,600	573	11,803,800
ダイニチ工業	9,600	495	4,752,000
日東精工	20,000	242	4,840,000
三洋工業	24,000	144	3,456,000
岡 部	31,200	402	12,542,400
日立ツール	9,100	523	4,759,300
中国工業	22,000	88	1,936,000
東 プ レ	32,600	619	20,179,400
高周波熱錬	23,000	566	13,018,000
東京製綱	113,000	201	22,713,000
パイオラックス	6,900	1,411	9,735,900
日本発条	101,000	368	37,168,000
中央発條	7,000	254	1,778,000
アドバネクス	28,000	80	2,240,000
三浦工業	23,200	2,090	48,488,000
タ ク マ	62,000	140	8,680,000
ツ ガ ミ	45,000	148	6,660,000
オークマ	93,000	331	30,783,000
東芝機械	85,000	270	22,950,000
ア マ ダ	242,000	502	121,484,000
アイダエンジニア	40,900	294	12,024,600
牧野フライス	72,000	204	14,688,000
オーエスジー	64,100	545	34,934,500
ダイジェット	18,000	171	3,078,000
旭ダイヤモンド	39,000	452	17,628,000
森精機製作所	66,700	785	52,359,500
ディスコ	14,100	2,470	34,827,000
日東工器	9,300	1,445	13,438,500
豊田自動織機	120,300	2,040	245,412,000

豊和工業	91,000	51	4,641,000	
大阪機工	54,000	96	5,184,000	
石川製作所	34,000	53	1,802,000	
東洋機械金属	11,400	138	1,573,200	
オ - エム製作所	11,000	332	3,652,000	
津田駒工業	39,000	87	3,393,000	
エンシュウ	40,000	61	2,440,000	
島精機製作所	18,600	1,825	33,945,000	
日本スピンドル	22,000	145	3,190,000	
日阪製作所	17,000	856	14,552,000	
やまびこ	4,400	1,026	4,514,400	
ペガサスミシン製造	13,600	141	1,917,600	
ナプテスコ	64,000	602	38,528,000	
三井海洋開発	10,300	1,664	17,139,200	
レオン自動機	4,000	229	916,000	
S M C	46,400	9,190	426,416,000	
新川	14,000	1,109	15,526,000	
ホソカワミクロン	24,000	350	8,400,000	
ユニオンツール	8,600	1,745	15,007,000	
オイレス工業	18,200	1,012	18,418,400	
サトー	16,300	866	14,115,800	

[次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本エアーテック	6,300	336	2,116,800	
日精樹脂工業	13,400	235	3,149,000	
ワイエイシイ	6,900	303	2,090,700	
小松製作所	691,500	1,058	731,607,000	
住友重機械	391,000	292	114,172,000	
日立建機	79,300	1,111	88,102,300	
日工	18,000	268	4,824,000	
巴工業	6,500	879	5,713,500	
井関農機	157,000	277	43,489,000	
T O W A	13,800	142	1,959,600	
丸山製作所	35,000	169	5,915,000	
北川鉄工所	74,000	119	8,806,000	
シンニッタン	14,700	287	4,218,900	
クボタ	712,000	517	368,104,000	
荏原実業	4,700	848	3,985,600	
東洋エンジニア	98,000	302	29,596,000	
三菱化工機	48,000	224	10,752,000	
月島機械	23,000	443	10,189,000	
帝国電機製作所	5,800	1,211	7,023,800	
東京機械	48,000	153	7,344,000	
新東工業	31,600	595	18,802,000	
渋谷工業	9,300	691	6,426,300	
アイチ コーポレーション	26,000	389	10,114,000	
小森コーポレーション	44,200	836	36,951,200	
鶴見製作所	1,000	511	511,000	
住友精密	28,000	344	9,632,000	
酒井重工業	31,000	133	4,123,000	
荏原製作所	332,000	173	57,436,000	
石井鉄工所	24,000	152	3,648,000	
西島製作所	13,800	937	12,930,600	
千代田化工建	132,000	460	60,720,000	
ダイキン工業	162,400	2,305	374,332,000	
オルガノ	27,000	586	15,822,000	
ト - ヨ - カネツ	97,000	158	15,326,000	
栗田工業	85,800	2,140	183,612,000	
樺本チエイン	80,000	212	16,960,000	
大同工業	29,000	140	4,060,000	
T C M	41,000	116	4,756,000	
日本コンベヤ	58,000	71	4,118,000	

日機装	44,000	462	20,328,000
木村化工機	14,200	625	8,875,000
新興プランテック	27,800	681	18,931,800
アネスト岩田	31,000	243	7,533,000
ダイフク	63,000	509	32,067,000
加藤製作所	33,000	204	6,732,000
油研工業	29,000	148	4,292,000
タダノ	72,000	390	28,080,000
フジテック	44,000	321	14,124,000
シーケーディ	41,900	281	11,773,900
キトー	35	73,600	2,576,000
平和	40,200	874	35,134,800
理想科学工業	12,100	888	10,744,800
SANKYO	40,500	4,310	174,555,000
日本金銭機械	16,700	910	15,197,000
マースエンジニアリング	7,400	2,980	22,052,000
福島工業	5,200	690	3,588,000
キヤノンファインテック	13,900	890	12,371,000
アブリット	24,900	147	3,660,300
オーイズミ	2,400	178	427,200
ダイコク電機	6,200	1,421	8,810,200
アマノ	45,200	720	32,544,000
JUKI	77,000	81	6,237,000
サンデン	85,000	181	15,385,000
蛇の目ミシン	149,000	35	5,215,000
ブラザー工業	179,200	628	112,537,600
シルバー精工	225,000	4	900,000
マックス	26,000	962	25,012,000
モリタホールディングス	25,000	358	8,950,000
グローリー	47,100	1,543	72,675,300
大和冷機工業	25,000	295	7,375,000
セガサミーホールディングス	169,900	1,078	183,152,200
日本ピストンリング	62,000	82	5,084,000
リケン	69,000	188	12,972,000
帝国ピストン	18,200	361	6,570,200
ホシザキ電機	29,900	920	27,508,000
大豊工業	11,900	387	4,605,300
日本精工	305,000	364	111,020,000
NTN	261,000	243	63,423,000
ジェイテクト	148,400	577	85,626,800
不二越	150,000	146	21,900,000
ミネベア	221,000	332	73,372,000

日本トムソン	48,000	353	16,944,000
T H K	92,600	1,212	112,231,200
ユーシン精機	6,700	975	6,532,500
前澤給装工業	6,200	1,380	8,556,000
イーグル工業	18,000	293	5,274,000
前澤工業	13,500	155	2,092,500
日本ピラ - 工業	17,000	330	5,610,000
キッツ	67,000	288	19,296,000
日立	2,488,000	264	656,832,000
東芝	2,242,000	261	585,162,000
三菱電機	1,388,000	409	567,692,000
富士電機H L D G S	345,000	113	38,985,000
東洋電機製造	26,000	420	10,920,000
安川電機	163,000	397	64,711,000
神鋼電機	95,000	259	24,605,000
明電舎	137,000	237	32,469,000
オリジン電気	21,000	207	4,347,000
デンヨー	15,600	662	10,327,200
日立工機	48,100	877	42,183,700
三桜工業	19,400	339	6,576,600
マキタ	93,000	2,165	201,345,000
東芝テック	107,000	245	26,215,000
芝浦メカトロニクス	27,000	294	7,938,000
マブチモーター	23,300	3,400	79,220,000
日本電産	73,600	4,250	312,800,000
高岳製作所	59,000	168	9,912,000
ダイヘン	75,000	279	20,925,000
J V CケンウッドH D	553,300	37	20,472,100
日新電機	30,000	350	10,500,000
大崎電気	23,000	696	16,008,000
オムロン	176,600	1,074	189,668,400
日東工業	22,600	681	15,390,600
I D E C	20,000	667	13,340,000
エルピーダメモリ	65,600	725	47,560,000
ジーエス・ユアサコーポ	237,000	453	107,361,000
サクサホールディングス	39,000	106	4,134,000
メルコホールディングス	8,500	916	7,786,000
テクノメディカ	12	230,000	2,760,000
日本電気	1,499,000	247	370,253,000
富士通	1,528,000	371	566,888,000
沖電気	474,000	55	26,070,000
岩崎通信機	65,000	96	6,240,000

電気興業	40,000	513	20,520,000
サンケン電気	87,000	348	30,276,000
エプソントヨコム	52,000	160	8,320,000
ナカヨ通信機	13,000	130	1,690,000
アイホン	10,700	1,620	17,334,000
NECエレクトロニクス	28,300	472	13,357,600
セイコーエプソン	108,700	1,238	134,570,600
ワコム	291	68,700	19,991,700
アルバック	23,700	1,488	35,265,600
ピクセラ	6,000	143	858,000
ナナオ	12,700	1,759	22,339,300
日本信号	37,700	585	22,054,500
京三製作所	36,000	326	11,736,000
能美防災	20,000	881	17,620,000
ホーチキ	15,000	604	9,060,000
マスプロ電工	11,900	873	10,388,700
日本無線	58,000	132	7,656,000
パナソニック	1,586,000	1,120	1,776,320,000
シャープ	718,000	778	558,604,000
アンリツ	72,000	195	14,040,000
富士通ゼネラル	35,000	162	5,670,000
日立国際電気	41,000	520	21,320,000
ソニー	788,400	1,831	1,443,560,400
NECトーキン	47,000	148	6,956,000
T D K	77,700	3,630	282,051,000
帝国通信工業	38,000	184	6,992,000
三洋電機	1,469,000	138	202,722,000
宮越商事	3,100	332	1,029,200
ミツミ電機	52,400	1,250	65,500,000
タムラ製作所	45,000	173	7,785,000
アルプス電気	125,700	347	43,617,900
池上通信機	49,000	72	3,528,000
パイオニア	116,000	176	20,416,000
日本電波工業	11,500	1,362	15,663,000
日本トリム	2,250	1,976	4,446,000
ローランド ディー・ジー	5,700	1,145	6,526,500
コロムビアミュージックエンタ	85,000	26	2,210,000
山水電気	732,000	4	2,928,000
フオスタ - 電機	14,400	601	8,654,400
クラリオン	66,000	57	3,762,000
S M K	44,000	179	7,876,000
ヨコオ	13,300	414	5,506,200

東 光	69,000	105	7,245,000
ティアック	68,000	32	2,176,000
ホシデン	36,900	1,101	40,626,900
ヒロセ電機	25,900	8,670	224,553,000
日本航空電子	34,000	391	13,294,000
T O A	18,000	487	8,766,000
日立マクセル	32,200	775	24,955,000
ユニデン	43,000	113	4,859,000
アルパイン	32,200	561	18,064,200
スミダ コーポレーション	10,200	482	4,916,400
島田理化工業	8,400	115	966,000
アイコム	8,300	1,860	15,438,000
船井電機	13,300	1,762	23,434,600
横河電機	161,200	420	67,704,000
新電元工業	53,000	152	8,056,000
山武	38,200	1,656	63,259,200
日本光電工業	29,600	1,408	41,676,800
チ ノ ー	31,000	204	6,324,000
共和電業	3,000	242	726,000
日本電子材料	6,000	410	2,460,000
堀場製作所	21,600	1,462	31,579,200
アドバンテスト	101,200	1,380	139,656,000
小野測器	11,000	298	3,278,000
エスペック	14,600	484	7,066,400
サンクス	13,900	260	3,614,000
キーエンス	27,800	17,810	495,118,000
日置電機	7,300	1,420	10,366,000
シスメックス	28,400	2,635	74,834,000
メガチップス	13,700	1,521	20,837,700
O B A R A	9,600	569	5,462,400
日本電産コパル電子	15,600	410	6,396,000
ミヤチテクノス	7,500	442	3,315,000
東京電波	4,500	415	1,867,500
澤藤電機	6,000	155	930,000
デンソー	326,400	1,776	579,686,400
コーセル	20,000	771	15,420,000
日立メディコ	7,000	866	6,062,000
新日本無線	11,000	158	1,738,000
オブテックス	10,400	840	8,736,000
千代田インテグレ	9,200	1,142	10,506,400
東光電気	4,000	217	868,000
スタンレー電気	104,100	979	101,913,900

岩崎電気	51,000	157	8,007,000
ウシオ電機	83,700	1,254	104,959,800
岡谷電機	8,200	292	2,394,400
フェニックス電機	13,600	152	2,067,200
日本セラミック	11,200	828	9,273,600
新神戸電機	14,000	493	6,902,000
日本デジタル研究所	14,200	894	12,694,800
古河電池	11,000	810	8,910,000
双信電機	7,800	273	2,129,400
山一電機	12,300	161	1,980,300
図研	10,500	519	5,449,500
日本電子	56,000	243	13,608,000
カシオ	141,700	700	99,190,000
ファナック	143,700	6,220	893,814,000
F D K	65,000	149	9,685,000
日本シイエムケイ	29,000	290	8,410,000
エンプラス	8,900	814	7,244,600
ローム	76,700	4,810	368,927,000
浜松ホトニクス	54,100	1,485	80,338,500
三井ハイテック	19,800	501	9,919,800
新光電気工業	43,400	806	34,980,400
京セラ	132,500	6,130	812,225,000
協栄産業	7,000	198	1,386,000
日本インター	16,000	159	2,544,000
太陽誘電	72,000	593	42,696,000
村田製作所	166,300	3,840	638,592,000
ユーシン	17,800	281	5,001,800
双葉電子工業	26,400	1,296	34,214,400
日東電工	136,300	1,800	245,340,000
北陸電気工業	69,000	141	9,729,000
パナソニック電工	243,000	634	154,062,000
東海理化電機	39,000	710	27,690,000
ニチコン	46,900	643	30,156,700
日本ケミコン	76,000	185	14,060,000
K O A	22,200	442	9,812,400
三井造船	537,000	146	78,402,000
日立造船	663,000	87	57,681,000
佐世保重工業	89,000	157	13,973,000
三菱重工業	2,648,000	316	836,768,000
川崎重工業	1,233,000	169	208,377,000
I H I	1,018,000	98	99,764,000
日本車輛	68,000	270	18,360,000

日本輸送機	13,000	208	2,704,000
近畿車輛	26,000	416	10,816,000
日産自動車	1,877,800	261	490,105,800
いすゞ自動車	704,000	107	75,328,000
トヨタ自動車	1,910,300	3,190	6,093,857,000
日野自動車	212,000	171	36,252,000
三菱自動車工業	3,324,000	118	392,232,000
エフテック	5,100	412	2,101,200
武蔵精密工業	14,400	937	13,492,800
トヨタ車体	32,500	1,191	38,707,500
日産車体	51,000	581	29,631,000
関東自動車	22,700	785	17,819,500
新明和工業	67,000	228	15,276,000
極東開発工業	30,000	315	9,450,000
日信工業	27,100	828	22,438,800
トピー工業	134,000	158	21,172,000
ティラド	45,000	117	5,265,000
曙ブレーキ	41,200	346	14,255,200
タチエス	19,500	480	9,360,000
N O K	79,700	691	55,072,700
フタバ産業	31,900	246	7,847,400
カヤバ工業	103,000	133	13,699,000
シロキ工業	30,000	182	5,460,000
市光工業	38,000	105	3,990,000
大同メタル工業	25,000	302	7,550,000
プレス工業	58,000	116	6,728,000
カルソニックカンセイ	88,000	101	8,888,000
太平洋工業	31,000	232	7,192,000
ケーヒン	34,100	853	29,087,300
河西工業	21,000	199	4,179,000
アイシン精機	135,900	1,426	193,793,400
富士機工	18,000	93	1,674,000
マ ッ ダ	589,000	148	87,172,000
ダイハツ	158,000	746	117,868,000
愛知機械	38,000	165	6,270,000
今仙電機製作所	10,800	487	5,259,600
本田技研	1,270,600	2,260	2,871,556,000
スズキ	300,600	1,492	448,495,200
富士重工業	506,000	301	152,306,000
ヤマハ発動機	171,800	850	146,030,000
ショーワ	31,600	290	9,164,000
小糸製作所	74,000	547	40,478,000

T B K	17,000	107	1,819,000
エクセディ	17,900	1,064	19,045,600
ミツバ	28,000	238	6,664,000
豊田合成	41,900	1,162	48,687,800
愛三工業	18,100	401	7,258,100
ヨロズ	10,100	746	7,534,600
エフ・シー・シー	21,900	929	20,345,100
新家工業	35,000	136	4,760,000
シマノ	57,600	2,935	169,056,000
タカタ	26,400	633	16,711,200
テイ・エス テック	23,800	570	13,566,000
小野建	11,900	773	9,198,700
はるやま商事	6,900	333	2,297,700
佐島電機	11,900	392	4,664,800
カッパクリエイト	8,700	1,702	14,807,400
エコートレーディング	3,700	794	2,937,800
伯東	9,100	598	5,441,800
中山福	10,800	546	5,896,800
ライトオン	12,400	1,077	13,354,800
ナガイレーベン	8,300	1,890	15,687,000
ジーンズメイト	4,600	499	2,295,400
菱食	14,300	1,862	26,626,600
良品計画	15,500	3,420	53,010,000
三城	21,000	748	15,708,000
松田産業	10,700	881	9,426,700
メディセオ・パルタックHD	158,000	992	156,736,000
アドヴァン	10,400	354	3,681,600
S P K	4,100	1,021	4,186,100
アズワン	9,600	1,623	15,580,800
スズデン	5,800	575	3,335,000
尾家産業	5,300	791	4,192,300
シモジマ	10,200	1,126	11,485,200
ドウシシャ	8,100	1,076	8,715,600
コナカ	18,800	241	4,530,800
高速	9,600	520	4,992,000
ハウス ローゼ	1,600	1,376	2,201,600
G - 7ホールディングス	4,300	361	1,552,300
イオン北海道	11,500	310	3,565,000
コジマ	19,900	239	4,756,100
コーナン商事	17,200	1,006	17,303,200
黒田電気	21,200	632	13,398,400
ネットワークシステムズ	357	140,300	50,087,100

ワタミ	19,300	2,150	41,495,000
マルシェ	4,500	660	2,970,000
ドン・キホーテ	26,600	1,118	29,738,800
丸文	11,900	255	3,034,500
メガネトップ	6,500	1,019	6,623,500
西松屋チェーン	38,500	821	31,608,500
ゼンショー	49,300	507	24,995,100
ハピネット	4,100	1,190	4,879,000
幸楽苑	9,600	1,147	11,011,200
トーマンエレクトロニクス	4,700	1,047	4,920,900
ユニマットライフ	6,100	745	4,544,500
ハークスレイ	4,400	789	3,471,600
サイゼリヤ	16,800	1,040	17,472,000
エクセル	6,500	775	5,037,500
マルカキカイ	5,100	494	2,519,400
アルゴグラフィックス	5,900	1,053	6,212,700
ガリバーインターナショナル	3,490	1,460	5,095,400
日本エム・ディ・エム	13,200	149	1,966,800
ポプラ	5,500	593	3,261,500
ユナイテッドアローズ	19,900	513	10,208,700
進和	8,300	1,101	9,138,300
エスケイジャパン	2,000	153	306,000
ダイトエレクトロン	6,700	366	2,452,200
ハイデイ日高	6,500	1,088	7,072,000
シークス	9,600	264	2,534,400
京都きもの友禅	9,900	640	6,336,000
コロワイド	33,500	541	18,123,500
田中商事	4,000	309	1,236,000
オーハシテクニカ	10,100	655	6,615,500
壱番屋	5,400	1,936	10,454,400
マクニカ	5,900	1,168	6,891,200
白銅	5,300	500	2,650,000
トップカルチャー	5,400	272	1,468,800
スギホールディングス	23,500	1,980	46,530,000
島津製作所	164,000	567	92,988,000
J M S	25,000	413	10,325,000
アロカ	9,300	680	6,324,000
クボテック	40	15,900	636,000
モリテックス	7,800	368	2,870,400
長野計器	9,200	674	6,200,800
スター精密	28,400	898	25,503,200
東京計器	52,000	105	5,460,000

愛知時計	7,000	214	1,498,000
日本電産トーソク	5,100	683	3,483,300
東京精密	27,800	794	22,073,200
ニコン	259,000	967	250,453,000
トプコン	34,300	269	9,226,700
オリンパス	163,000	1,380	224,940,000
理研計器	12,600	592	7,459,200
大日本スクリーン	164,000	165	27,060,000
キヤノン電子	13,500	1,076	14,526,000
タムロン	13,000	791	10,283,000
HOYA	341,300	1,693	577,820,900
ノーリツ鋼機	13,500	651	8,788,500
エー・アンド・デイ	12,400	221	2,740,400
キヤノン	862,100	2,565	2,211,286,500
リコー	481,000	1,146	551,226,000
日本電産コパル	14,600	590	8,614,000
日本電産サンキョー	44,000	341	15,004,000
シチズンホールディングス	192,900	367	70,794,300
リズム時計	77,000	83	6,391,000
SRIスポーツ	96	76,000	7,296,000
バンダイナムコHLDGS	161,500	822	132,753,000
共立印刷	15,000	131	1,965,000
フランスベッドHLDGS	101,000	130	13,130,000
パイロットコーポレーション	141	123,200	17,371,200
エイベックス・グループHD	27,800	894	24,853,200
トッパン・フォームズ	31,900	968	30,879,200
フジシールインターナショナル	16,600	1,355	22,493,000
タカラトミー	44,800	429	19,219,200
廣済堂	13,300	240	3,192,000
アーク	43,400	92	3,992,800
スルガ	4,300	1,050	4,515,000
アロン化成	9,000	292	2,628,000
タカノ	5,900	585	3,451,500
プロネクサス	18,200	617	11,229,400
ホクシン	13,900	129	1,793,100
ウッドワン	30,000	287	8,610,000
大建工業	67,000	187	12,529,000
きもと	12,800	234	2,995,200
シーアイ化成	10,000	217	2,170,000
凸版印刷	452,000	617	278,884,000
大日本印刷	453,000	877	397,281,000
図書印刷	33,000	221	7,293,000

共同印刷	51,000	206	10,506,000	
日本写真印刷	22,800	2,525	57,570,000	
光村印刷	3,000	306	918,000	
藤森工業	10,500	590	6,195,000	
宝印刷	7,600	702	5,335,200	
前澤化成工業	11,300	843	9,525,900	
コ ン ビ	10,000	706	7,060,000	
アシックス	148,000	608	89,984,000	
ツ ツ ミ	5,700	1,809	10,311,300	
ジェイ エス ピー	10,300	563	5,798,900	
ニ チ ハ	17,500	585	10,237,500	
ローランド	10,600	977	10,356,200	
エフピコ	7,800	4,200	32,760,000	
小松ウオール工業	6,200	1,013	6,280,600	
ヤマハ	118,400	789	93,417,600	
河合楽器	59,000	84	4,956,000	
クリナップ	16,200	403	6,528,600	
ピジョン	9,400	2,100	19,740,000	
天馬	11,700	975	11,407,500	
パラマウントベッド	14,900	1,072	15,972,800	
兼松日産農林	27,000	64	1,728,000	
キングジム	12,800	696	8,908,800	
リンテック	28,300	1,199	33,931,700	
田崎真珠	23,000	66	1,518,000	
信越ポリマー	30,700	410	12,587,000	
東 リ	43,000	156	6,708,000	
イトーキ	31,800	282	8,967,600	
任 天 堂	78,500	27,000	2,119,500,000	
三菱鉛筆	14,300	997	14,257,100	
タカラスタンダ - ド	69,000	536	36,984,000	
コ ク ヨ	77,300	645	49,858,500	
ナカバヤシ	36,000	190	6,840,000	
ニ フ コ	32,300	793	25,613,900	
ダイワ精工	76,000	132	10,032,000	
サンウエーブ	21,000	141	2,961,000	
岡村製作所	62,000	563	34,906,000	
日本バルカー	62,000	172	10,664,000	
M U T O Hホールディングス	18,000	163	2,934,000	
伊 藤 忠	1,097,000	471	516,687,000	
丸 紅	1,283,000	340	436,220,000	
ム ト ウ	17,700	392	6,938,400	
高 島	28,000	140	3,920,000	

F & A アクアホールディングス	13,100	854	11,187,400
三陽商会	76,000	321	24,396,000
長瀬産業	77,000	780	60,060,000
ナイガイ	48,000	49	2,352,000
蝶理	94,000	105	9,870,000
豊田通商	147,000	841	123,627,000
オンワ - ドホールディングス	104,000	568	59,072,000
三共生興	26,400	168	4,435,200
兼松	313,000	85	26,605,000
美津濃	74,000	391	28,934,000
シルバーオックス	15,000	40	600,000
ツカモトコーポレーション	29,000	60	1,740,000
ファミリーマート	45,200	3,060	138,312,000
ルック	24,000	73	1,752,000
三井物産	1,263,000	1,030	1,300,890,000
日本紙パルプ	77,000	268	20,636,000
東京エレクトロン	108,300	3,480	376,884,000
日立ハイテクノロジーズ	50,800	1,304	66,243,200
カメイ	4,000	398	1,592,000
東都水産	26,000	111	2,886,000
日本マタイ	28,000	107	2,996,000
スターゼン	52,000	230	11,960,000
セイコーHD	54,000	190	10,260,000
山善	56,800	334	18,971,200
椿本興業	17,000	188	3,196,000
住友商事	866,000	890	770,740,000
日本ユニシス	35,300	734	25,910,200
内田洋行	35,000	317	11,095,000
三菱商事	1,095,900	1,353	1,482,752,700
第一実業	34,000	269	9,146,000
キャノンマーケティングJPN	55,800	1,327	74,046,600
西華産業	64,000	214	13,696,000
佐藤商事	13,700	559	7,658,300
菱洋エレクトロ	15,000	726	10,890,000
東京産業	17,500	244	4,270,000
ユアサ商事	163,000	94	15,322,000
神鋼商事	38,000	174	6,612,000
阪和興業	147,000	269	39,543,000
カナデン	2,000	419	838,000
菱電商事	23,000	507	11,661,000
ニプロ	36,000	1,314	47,304,000
フルサト工業	9,600	791	7,593,600

岩谷産業	163,000	222	36,186,000	
すてきナイスグループ	61,000	164	10,004,000	
昭光通商	60,000	97	5,820,000	
ニチモウ	24,000	124	2,976,000	
富士通ビジネス	8,700	1,183	10,292,100	
極東貿易	21,000	145	3,045,000	
イワキ	16,000	157	2,512,000	
兼松エレクトロニクス	9,800	690	6,762,000	
三愛石油	36,000	398	14,328,000	
稲畑産業	39,900	284	11,331,600	
G S Iクレオス	39,000	88	3,432,000	
明和産業	13,000	124	1,612,000	
ゴ・ルドウイン	36,000	126	4,536,000	
東京スタイル	52,000	643	33,436,000	
ユニ・チャーム	31,800	6,120	194,616,000	
デザート	43,000	337	14,491,000	
ヤマトインタ - ナショナル	12,000	393	4,716,000	
東邦薬品	33,700	821	27,667,700	
サンゲツ	25,500	1,718	43,809,000	
ミツウロコ	24,700	567	14,004,900	
シナネン	37,000	416	15,392,000	

[前へ](#) [次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
伊藤忠エネクス	37,800	656	24,796,800	
ザ・トーカイ	35,000	381	13,335,000	
サンリオ	40,800	839	34,231,200	
サンワ テクノス	7,800	344	2,683,200	
リョーサン	23,700	2,185	51,784,500	
新光商事	15,000	686	10,290,000	
トーヨー	24,000	307	7,368,000	
三信電気	17,800	656	11,676,800	
東陽テクニカ	16,800	798	13,406,400	
モスフード サービス	21,000	1,397	29,337,000	
加賀電子	16,100	990	15,939,000	
三益半導体	13,000	972	12,636,000	
ソーダニツカ	2,000	299	598,000	
立花エレテック	9,900	794	7,860,600	
木曽路	17,000	1,686	28,662,000	
千趣会	26,500	525	13,912,500	
タカキュー	9,000	134	1,206,000	
ケーヨー	30,600	515	15,759,000	
アデランスホールディングス	17,400	736	12,806,400	
上新電機	35,000	646	22,610,000	
日本瓦斯	15,900	1,300	20,670,000	
ベスト電器	46,000	286	13,156,000	
マルエツ	30,000	489	14,670,000	
ロイヤルホールディングス	24,700	902	22,279,400	
東天紅	4,000	148	592,000	
いなげや	5,000	879	4,395,000	
島忠	35,600	1,789	63,688,400	
チヨダ	21,200	1,413	29,955,600	
鈴丹	3,200	172	550,400	
ライフコーポレーション	9,700	1,586	15,384,200	
カスミ	31,000	388	12,028,000	
リンガーハット	11,400	1,124	12,813,600	
さが美	11,000	102	1,122,000	
MR MAX	16,600	380	6,308,000	
テンアライド	10,700	298	3,188,600	
AOKIホールディングス	15,900	907	14,421,300	
オークワ	21,000	1,246	26,166,000	
コメリ	20,100	1,662	33,406,200	
青山商事	37,300	1,284	47,893,200	

しまむら	15,200	5,680	86,336,000
C F Sコーポレーション	13,500	607	8,194,500
高島屋	199,000	588	117,012,000
丸善	75,000	61	4,575,000
松屋	29,700	1,334	39,619,800
エイチ・ツー・オーリテイリング	96,000	555	53,280,000
丸栄	22,000	160	3,520,000
ニッセンHD	35,300	505	17,826,500
パルコ	42,300	749	31,682,700
丸井グループ	191,900	469	90,001,100
クレディセゾン	125,800	914	114,981,200
原信ナルスHLDGS	9,700	990	9,603,000
オーエムシーカード	51,600	167	8,617,200
井筒屋	85,000	47	3,995,000
ダイエー	67,900	380	25,802,000
イズミヤ	49,000	524	25,676,000
イオン	591,500	691	408,726,500
ユニー	110,000	795	87,450,000
イズミ	40,100	1,257	50,405,700
東武ストア	17,000	350	5,950,000
平和堂	30,200	1,326	40,045,200
フジ	16,600	1,690	28,054,000
ヤオコー	8,500	2,890	24,565,000
ゼビオ	15,500	1,413	21,901,500
ケーズホールディングス	25,700	1,298	33,358,600
OLYMPIC	10,700	601	6,430,700
東日カーライフグループ	28,000	38	1,064,000
新生銀行	857,000	110	94,270,000
あおぞら銀行	533,000	107	57,031,000
三菱UFJフィナンシャルG	8,594,200	479	4,116,621,800
りそなホールディングス	473,800	1,472	697,433,600
中央三井トラストHD	749,000	330	247,170,000
三井住友フィナンシャルG	619,300	3,380	2,093,234,000
第四銀行	205,000	377	77,285,000
北越銀行	167,000	176	29,392,000
西日本シティ銀行	478,000	215	102,770,000
札幌北洋ホール	220,800	317	69,993,600
千葉銀行	579,000	486	281,394,000
横浜銀行	1,012,000	439	444,268,000
常陽銀行	569,000	473	269,137,000
群馬銀行	342,000	515	176,130,000
武蔵野銀行	22,300	3,150	70,245,000

千葉興業銀行	28,100	1,065	29,926,500	
関東つくば銀行	41,500	275	11,412,500	
東京都民銀行	27,700	1,399	38,752,300	
七十七銀行	247,000	448	110,656,000	
青森銀行	92,000	378	34,776,000	
秋田銀行	101,000	353	35,653,000	
山形銀行	90,000	507	45,630,000	
岩手銀行	9,900	5,490	54,351,000	
東邦銀行	115,000	376	43,240,000	
荘内銀行	74,000	144	10,656,000	
東北銀行	78,000	149	11,622,000	
みちのく銀行	75,000	181	13,575,000	
ふくおかフィナンシャルG	633,000	321	203,193,000	
静岡銀行	459,000	862	395,658,000	
十六銀行	190,000	379	72,010,000	
スルガ銀行	171,000	750	128,250,000	
八十二銀行	277,000	493	136,561,000	
山梨中央銀行	98,000	502	49,196,000	
大垣共立銀行	168,000	420	70,560,000	
福井銀行	127,000	319	40,513,000	
北國銀行	169,000	315	53,235,000	
清水銀行	5,000	4,140	20,700,000	
滋賀銀行	137,000	509	69,733,000	
南都銀行	146,000	486	70,956,000	
百五銀行	145,000	489	70,905,000	
京都銀行	251,000	876	219,876,000	
三重銀行	66,000	293	19,338,000	
池田銀行	13,400	3,690	49,446,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,027,000	185	189,995,000	
広島銀行	432,000	367	158,544,000	
山陰合同銀行	89,000	670	59,630,000	
中国銀行	121,000	1,209	146,289,000	
鳥取銀行	52,000	271	14,092,000	
伊予銀行	167,000	1,060	177,020,000	
百十四銀行	172,000	438	75,336,000	
四国銀行	107,000	414	44,298,000	
阿波銀行	131,000	551	72,181,000	
鹿児島銀行	103,000	668	68,804,000	
大分銀行	80,000	530	42,400,000	
宮崎銀行	76,000	327	24,852,000	
肥後銀行	116,000	532	61,712,000	
佐賀銀行	90,000	308	27,720,000	

十八銀行	94,000	309	29,046,000
沖縄銀行	12,100	3,230	39,083,000
琉球銀行	31,000	819	25,389,000
住友信託	1,392,000	415	577,680,000
みずほ信託銀行	1,396,000	95	132,620,000
八千代銀行	8,800	3,270	28,776,000
みずほフィナンシャルG	8,256,700	219	1,808,217,300
紀陽ホールディングス	582,000	121	70,422,000
山口フィナンシャルG	136,000	951	129,336,000
フィデック	54	4,550	245,700
芙蓉総合リース	15,400	1,348	20,759,200
興銀リース	20,500	1,196	24,518,000
センチュリーリーシングシステム	19,300	694	13,394,200
S B Iホールディングス	11,597	11,130	129,074,610
日本証券金融	56,300	384	21,619,200
大阪証券金融	18,500	180	3,330,000
アイフル	76,650	200	15,330,000
日本アジア投資	66,000	54	3,564,000
ポケットカード	14,700	225	3,307,500
長野銀行	56,000	226	12,656,000
名古屋銀行	142,000	513	72,846,000
愛知銀行	5,400	6,690	36,126,000
第三銀行	91,000	294	26,754,000
中京銀行	69,000	305	21,045,000
東日本銀行	77,000	264	20,328,000
愛媛銀行	93,000	282	26,226,000
トマト銀行	59,000	233	13,747,000
みなと銀行	152,000	141	21,432,000
京葉銀行	132,000	440	58,080,000
関西アーバン銀行	155,000	134	20,770,000
栃木銀行	79,000	491	38,789,000
北日本銀行	5,000	2,675	13,375,000
香川銀行	56,000	474	26,544,000
東和銀行	130,000	69	8,970,000
徳島銀行	43,000	465	19,995,000
福島銀行	184,000	52	9,568,000
大東銀行	102,000	62	6,324,000
武富士	93,000	681	63,333,000
リコーリース	10,200	1,312	13,382,400
シンキ	23,000	99	2,277,000
イオン クレジットサービス	65,200	860	56,072,000
N I Sグループ	88,600	23	2,037,800

アコム	66,340	2,815	186,747,100
プロミス	68,450	1,697	116,159,650
ロプロ	49,800	22	1,095,600
東京リース	17,800	592	10,537,600
ジャックス	89,000	176	15,664,000
日立キャピタル	34,500	978	33,741,000
セントラルファイナンス	60,000	146	8,760,000
オリックス	72,330	3,490	252,431,700
三菱UFJリース	37,170	2,130	79,172,100
ジャフコ	22,300	1,667	37,174,100
SFCG	3,350	2,335	7,822,250
大和証券G本社	972,000	433	420,876,000
野村ホールディングス	1,542,300	490	755,727,000
新光証券	374,000	189	70,686,000
みずほインベスタズ証	341,000	73	24,893,000
岡三証券グループ	125,000	343	42,875,000
丸三証券	48,800	456	22,252,800
東洋証券	55,000	150	8,250,000
東海東京証券	171,000	206	35,226,000
光世証券	40,000	75	3,000,000
水戸証券	49,000	237	11,613,000
いちよし証券	34,400	468	16,099,200
松井証券	111,900	629	70,385,100
だいこう証券ビジ	6,600	625	4,125,000
マネックスG	755	26,980	20,369,900
カブドットコム証券	314	97,200	30,520,800
極東証券	18,200	378	6,879,600
岩井証券	15,200	661	10,047,200
三井住友海上HD	350,100	2,420	847,242,000
SONY FH	522	296,100	154,564,200
小林洋行	4,200	345	1,449,000
日本興亜損害保険	565,000	695	392,675,000
損害保険ジャパン	684,000	567	387,828,000
ニッセイ同和損害保険	162,000	471	76,302,000
あいおい損害保険	384,000	417	160,128,000
富士火災	176,000	77	13,552,000
東京海上HD	631,400	2,380	1,502,732,000
アサックス	16	60,200	963,200
NECキャピタルソリューション	5,200	708	3,681,600
T&Dホールディングス	193,300	2,780	537,374,000
三井不動産	651,000	1,242	808,542,000
三菱地所	1,021,000	1,190	1,214,990,000

平和不動産	103,500	232	24,012,000
東京建物	220,000	296	65,120,000
ダイビル	37,800	831	31,411,800
サンケイビル	22,100	451	9,967,100
東急不動産	295,000	282	83,190,000
京阪神不動産	18,000	365	6,570,000
住友不動産	374,000	1,120	418,880,000
東宝不動産	16,100	464	7,470,400
藤和不動産	48,000	49	2,352,000
太平洋興発	49,000	51	2,499,000
有楽土地	13,000	92	1,196,000
大京	158,000	57	9,006,000
テーオーシー	56,500	356	20,114,000
東京楽天地	27,000	364	9,828,000
レオパレス21	102,900	736	75,734,400
フジ住宅	17,900	259	4,636,100
空港施設	15,700	510	8,007,000
明和地所	7,400	450	3,330,000
住友不動産販売	6,570	2,470	16,227,900
ゴールドクレスト	11,520	1,936	22,302,720
ジョイント・コーポレーション	19,200	116	2,227,200
東栄住宅	10,800	115	1,242,000
日本エスリード	5,100	468	2,386,800
東急リバブル	15,600	395	6,162,000
飯田産業	5,800	408	2,366,400
日神不動産	8,700	188	1,635,600
アーネストワン	23,800	105	2,499,000
タカラレーベン	6,700	195	1,306,500
パシフィックHD	343	2,810	963,830
サンヨーハウジ名古屋	62	77,000	4,774,000
イオンモール	66,800	1,323	88,376,400
フージャースコーポレーション	113	1,730	195,490
サンシティ	165	3,000	495,000
ゼクス	81	1,592	128,952
タクトホーム	72	21,000	1,512,000
ランド	40	13,000	520,000
リサ・パートナーズ	202	37,950	7,665,900
エヌ・ティ・ティ都市開発	911	86,600	78,892,600
サンフロンティア不動産	135	17,680	2,386,800
大和システム	6,200	100	620,000
ランドビジネス	99	14,600	1,445,400
アトリウム	15,900	183	2,909,700

東武鉄道	636,000	484	307,824,000	
相模鉄道	195,000	386	75,270,000	
東京急行	817,000	387	316,179,000	
京浜急行	373,000	660	246,180,000	
小田急電鉄	478,000	697	333,166,000	
京王電鉄	387,000	475	183,825,000	
京成電鉄	240,000	472	113,280,000	
富士急行	42,000	404	16,968,000	
新京成電鉄	6,000	338	2,028,000	
東日本旅客鉄道	277,100	5,510	1,526,821,000	
西日本旅客鉄道	1,387	351,000	486,837,000	
東海旅客鉄道	1,241	558,000	692,478,000	
アートコーポレーション	3,000	1,191	3,573,000	
西日本鉄道	196,000	354	69,384,000	
ハマキョウレックス	4,700	1,875	8,812,500	
サカイ引越センター	2,700	1,924	5,194,800	
近畿鉄道	1,344,000	395	530,880,000	
阪急阪神HLDGS	998,000	453	452,094,000	
南海電鉄	313,000	409	128,017,000	
京阪電鉄	336,000	395	132,720,000	
名糖運輸	7,300	775	5,657,500	
名古屋鉄道	523,000	275	143,825,000	
日本通運	638,000	329	209,902,000	
ヤマトホールディングス	296,000	959	283,864,000	
山九	181,000	297	53,757,000	
日新	57,000	217	12,369,000	
丸運	10,400	265	2,756,000	
丸全昭和運輸	46,000	291	13,386,000	
センコー	53,000	292	15,476,000	
トナミホールディングス	38,000	239	9,082,000	
日本梱包運輸	41,000	810	33,210,000	
日石輸送	12,000	171	2,052,000	
福山通運	116,000	375	43,500,000	
セイノーホールディングス	115,000	449	51,635,000	
神奈川中央交通	5,000	506	2,530,000	
日立物流	31,100	913	28,394,300	
日本郵船	795,000	506	402,270,000	
商船三井	779,000	608	473,632,000	
川崎汽船	353,000	395	139,435,000	
新和海運	59,000	264	15,576,000	
乾汽船	17,500	673	11,777,500	
明治海運	13,400	409	5,480,600	

飯野海運	71,700	579	41,514,300
太平洋海運	27,000	111	2,997,000
共栄タンカー	13,000	234	3,042,000
第一中央汽船	97,000	260	25,220,000
全日本空輸	1,533,000	337	516,621,000
日本航空	2,149,000	186	399,714,000
パスコ	18,000	145	2,610,000
国際航業HLDGS	11,000	225	2,475,000
三菱倉庫	106,000	881	93,386,000
三井倉庫	64,000	301	19,264,000
住友倉庫	118,000	359	42,362,000
渋沢倉庫	46,000	380	17,480,000
ヤマタネ	79,000	96	7,584,000
東陽倉庫	28,000	172	4,816,000
日本トランスシティ	32,000	292	9,344,000
ケイヒン	34,000	118	4,012,000
安田倉庫	11,000	784	8,624,000
東洋埠頭	46,000	135	6,210,000
宇徳	11,500	299	3,438,500
上組	177,000	662	117,174,000
サンリツ	1,700	495	841,500
キムラユニティー	3,400	703	2,390,200
キューソー流通システム	4,600	908	4,176,800
郵船航空サービス	11,700	1,037	12,132,900
近鉄エクスプレス	13,300	1,680	22,344,000
東海運	11,000	263	2,893,000
バンテックHD	70	85,500	5,985,000
東京放送	87,900	1,171	102,930,900
日本テレビ放送網	14,060	8,670	121,900,200
テレビ朝日	373	115,200	42,969,600
テレビ東京	5,800	3,930	22,794,000
スカパーJSA THD	1,116	35,650	39,785,400
アイ・ティー・シーネットワーク	34	139,700	4,749,800
イー・アクセス	657	60,300	39,617,100
NECモバイルリング	5,600	1,399	7,834,400
日本電信電話	674,600	4,160	2,806,336,000
KDDI	2,278	501,000	1,141,278,000
光通信	18,800	1,589	29,873,200
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	14,501	150,300	2,179,500,300
インボイス	8,078	377	3,045,406
GMOインターネット	27,700	405	11,218,500
学習研究社	50,000	130	6,500,000

ゼンリン	21,200	813	17,235,600
昭文社	8,400	413	3,469,200
角川グループHLDGS	12,600	1,607	20,248,200
インプレスホールディングス	10,400	101	1,050,400
東京電力	937,000	2,715	2,543,955,000
中部電力	503,600	2,330	1,173,388,000
関西電力	617,200	2,275	1,404,130,000
中国電力	222,800	2,245	500,186,000
北陸電力	152,700	2,410	368,007,000
東北電力	371,500	2,170	806,155,000
四国電力	157,200	2,810	441,732,000
九州電力	328,400	2,235	733,974,000
北海道電力	139,300	2,065	287,654,500
沖縄電力	10,500	5,840	61,320,000
電源開発	107,600	3,170	341,092,000
東京瓦斯	1,882,000	382	718,924,000
大阪瓦斯	1,595,000	343	547,085,000
東邦瓦斯	388,000	507	196,716,000
北海道瓦斯	33,000	252	8,316,000
西部瓦斯	171,000	238	40,698,000
静岡瓦斯	46,000	486	22,356,000
アイネット	7,800	440	3,432,000
松竹	82,000	628	51,496,000
東宝	104,900	1,585	166,266,500
エイチ・アイ・エス	14,300	1,625	23,237,500
東映	62,000	388	24,056,000
葵プロモーション	3,000	318	954,000
ベンチャーリンク	56,400	16	902,400
NTTデータ	906	259,000	234,654,000
共立メンテナンス	6,300	1,681	10,590,300
イチネンホールディングス	15,800	422	6,667,600
建設技術研究所	8,900	578	5,144,200
燦ホールディングス	3,300	1,824	6,019,200
スバル興業	3,000	291	873,000
東京テアトル	57,000	214	12,198,000
テクモ	11,300	664	7,503,200
光栄	13,000	770	10,010,000
吉本興業	23,600	1,082	25,535,200
ホリプロ	5,800	792	4,593,600
よみうりランド	36,000	279	10,044,000
東京都競馬	108,000	127	13,716,000
常磐興産	55,000	147	8,085,000

カナモト	20,000	309	6,180,000
東京ドーム	115,000	267	30,705,000
D T S	14,000	701	9,814,000
スクウェア・エニックス・HD	37,300	2,115	78,889,500
シーイーシー	9,000	681	6,129,000
日立ソフトウェア	20,800	1,215	25,272,000
カプコン	31,100	1,811	56,322,100
東海観光	58,000	21	1,218,000
日本空港ビルデング	35,300	1,002	35,370,600
トランス・コスモス	20,300	483	9,804,900
乃村工藝社	31,000	251	7,781,000
ジャステック	8,000	509	4,072,000
住商情報システム	15,000	1,190	17,850,000
藤田観光	46,000	352	16,192,000
近畿日本ツーリスト	50,000	88	4,400,000
日本管財	5,800	1,475	8,555,000
白 洋 舎	5,000	258	1,290,000
セコム	150,800	3,370	508,196,000
C S Kホールディングス	44,200	351	15,514,200
日本システムウエア	3,400	283	962,200
セントラル警備保障	7,300	826	6,029,800
日立情報	12,000	1,603	19,236,000
アイネス	17,900	438	7,840,200
丹青社	5,000	200	1,000,000
メイテック	26,200	1,395	36,549,000
T K C	14,300	1,907	27,270,100
アサツー ディ・ケイ	31,300	1,694	53,022,200
富士ソフト	18,100	1,454	26,317,400
ソラン	15,200	433	6,581,600
応用地質	18,100	940	17,014,000
船井総合研究所	20,600	451	9,290,600
日システム	25,900	627	16,239,300
進学会	6,500	246	1,599,000
丸紅建材リース	17,000	102	1,734,000
コナミ	66,200	1,550	102,610,000
ベネッセコーポレーション	54,100	3,730	201,793,000
イオンディライト	11,500	1,439	16,548,500
ナック	4,400	811	3,568,400
福井コンピュータ	1,500	253	379,500
ニチイ学館	18,600	1,260	23,436,000
ダイセキ	22,900	1,276	29,220,400
元気寿司	5,100	1,216	6,201,600

トラスコ中山	17,100	1,005	17,185,500
ヤマダ電機	71,210	3,730	265,613,300
オートバックスセブン	23,600	2,395	56,522,000
アークランドサカモト	10,700	870	9,309,000
ニトリ	31,700	5,520	174,984,000
ユーエスシー	6,000	745	4,470,000
グルメ杵屋	1,000	638	638,000
愛眼	12,400	435	5,394,000
吉野家ホールディングス	337	110,600	37,272,200
日商エレクトロニクス	7,100	501	3,557,100
加藤産業	21,300	1,360	28,968,000
イエローハット	15,400	297	4,573,800
富士エレクトロニクス	8,600	745	6,407,000
松屋フーズ	7,400	1,269	9,390,600
J B C Cホールディングス	12,700	545	6,921,500
J Kホールディングス	12,500	457	5,712,500
ユニダックス	6,000	410	2,460,000
サガミチェーン	18,000	843	15,174,000
日伝	6,200	2,460	15,252,000
バイタルネット	19,100	537	10,256,700
北沢産業	11,000	138	1,518,000
杉本商事	8,800	924	8,131,200
因幡電機産業	14,200	2,195	31,169,000
セシール	15,900	115	1,828,500
住金物産	76,000	225	17,100,000
プレナス	18,500	1,409	26,066,500
ミニストップ	11,200	1,604	17,964,800
イマージュホールディングス	5,600	230	1,288,000
アークス	17,600	1,460	25,696,000
バロー	29,400	764	22,461,600
ミスミグループ本社	49,300	1,151	56,744,300
江守商事	3,400	680	2,312,000
アルテック	4,400	127	558,800
大庄	9,000	1,424	12,816,000
タキヒヨー	28,000	485	13,580,000
ファーストリテイリング	34,300	11,150	382,445,000
ソフトバンク	598,800	1,424	852,691,200
スズケン	52,000	2,300	119,600,000
サンドラッグ	28,000	1,770	49,560,000
ジェコス	10,600	422	4,473,200
ヤマザワ	4,700	1,265	5,945,500
やまや	1,800	456	820,800

ペルーナ	18,300	250	4,575,000	
合計	212,961,141		147,869,682,251	

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

「注記表(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。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年3月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	22,065,349,470円
負債総額	54,544,174円
純資産総額（ - ）	22,010,805,296円
発行済数量	22,854,538,846口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9631円

（参考）マザーファンドの現況

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21年3月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	155,598,022,527円
負債総額	142,212,476円
純資産総額（ - ）	155,455,810,051円
発行済数量	167,103,071,583口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9303円

第5【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	342,319,925	3,838,586
第2期	2,786,767,317	196,338,675
第3期	10,152,833,879	1,603,466,761
第4期	7,400,148,798	4,214,916,172
第5期	8,779,618,539	5,384,513,066
第6期	8,569,368,552	4,148,881,796

第三部【特別情報】

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

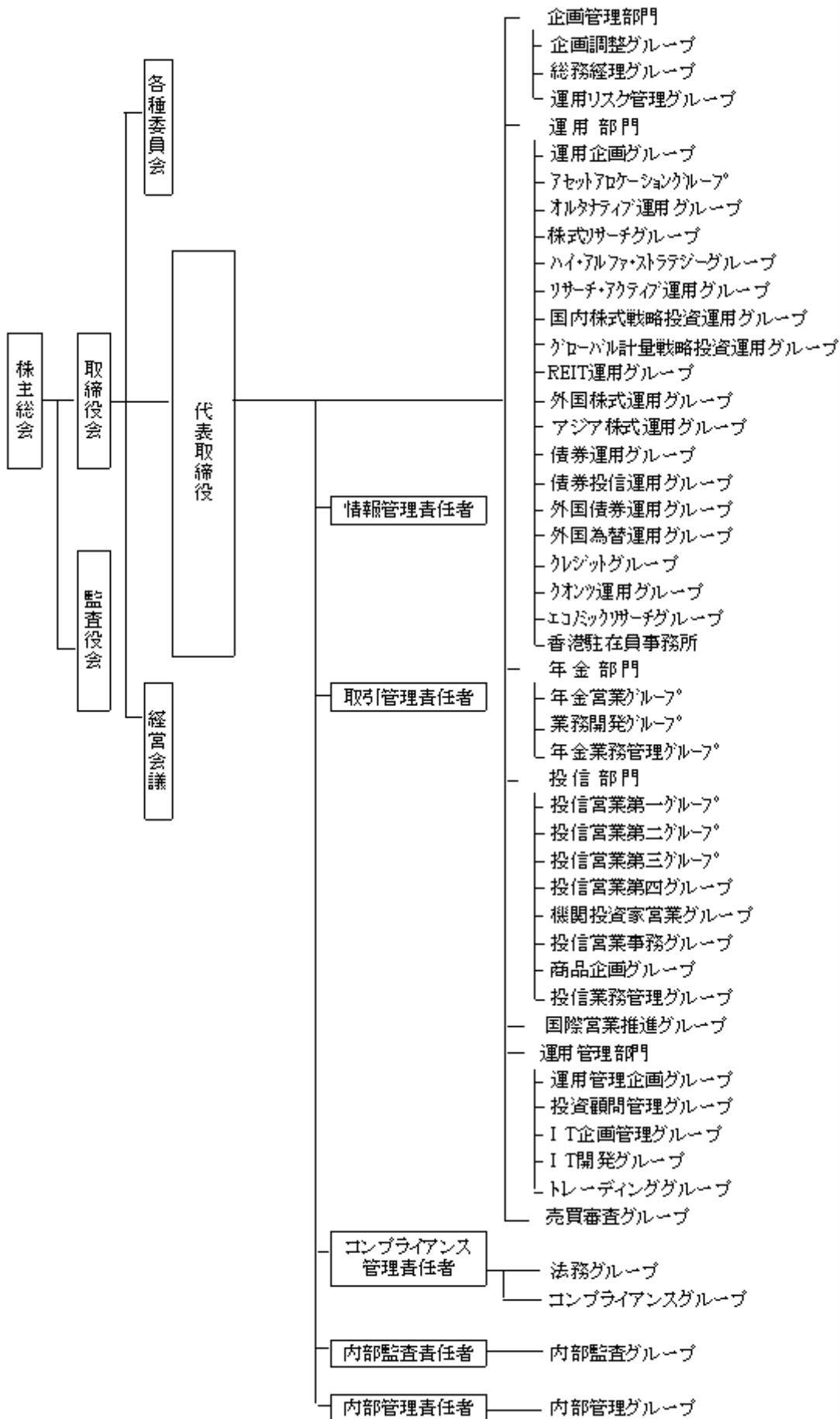
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成21年2月27日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

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、代表取締役を選任し、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、取締役社長1名、取締役副社長、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、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決めます。

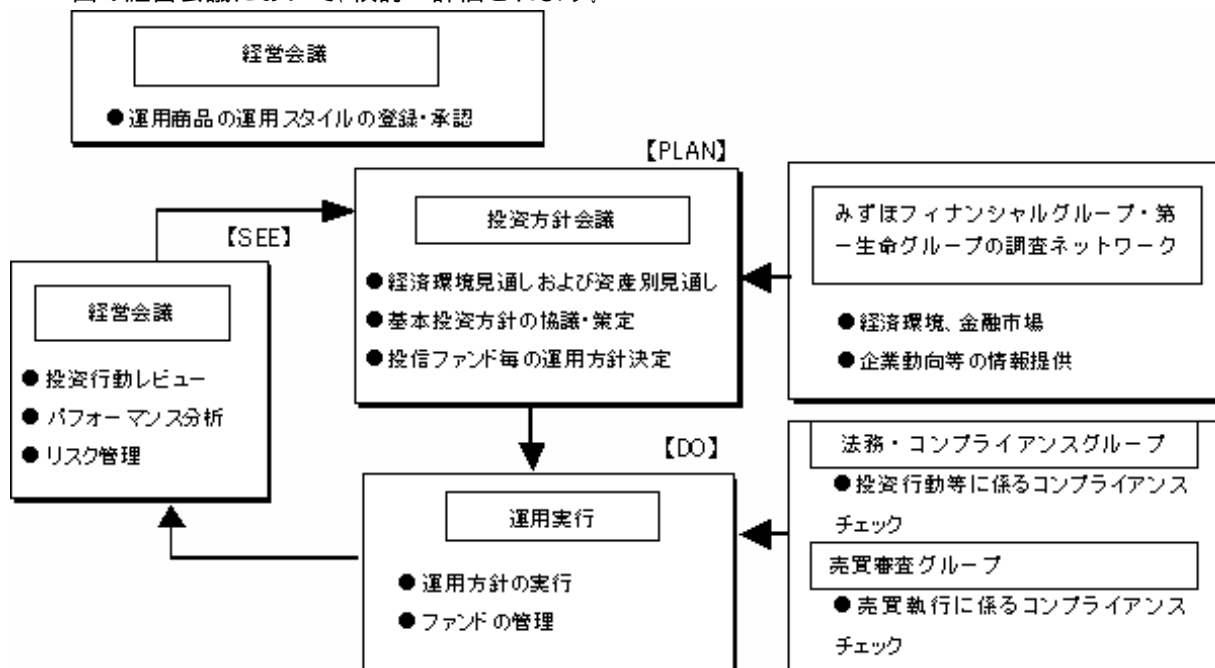
投資運用の意思決定機構

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登録および承認は、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、委員長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見直しおよび資産別市場見直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回の経営会議において、検討・評価されます。



上記体制は平成21年2月27日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、証券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」に定める投資助言業務を行っています。

平成21年2月27日現在、委託会社の運用する証券投資信託は251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	19	71,724,743,774
追加型株式投資信託	219	2,722,406,586,890
単位型公社債投資信託	13	105,533,006,203
追加型公社債投資信託	0	0
合計	251	2,899,664,336,867

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、以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）または「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、以下「中間財務諸表等規則」という。）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。

なお、第24期中間会計期間（自平成20年4月1日至平成20年9月30日）は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成20年8月7日内閣府令第50号）附則第4条により改正前の中間財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表およ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、証券取引法第193条の2の規定に基づき第22期事業年度（自平成18年4月1日至平成19年3月31日）の財務諸表について、また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第23期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）の財務諸表について、新日本監査法人の監査を受け、第24期中間会計期間（自平成20年4月1日至平成20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。

なお、新日本有限責任監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成20年7月1日をもって新日本監査法人から名称変更しております。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	第22期（平成19年3月31日現在）			第23期（平成20年3月31日現在）		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
(資産の部)							
流動資産							
現金・預金			-		13,267,152		
現金			1,087		-		
預金			11,618,410		-		
支払委託金			5,262		-		
収益分配金		2,122			-		
償還金		3,139			-		
前払費用			52,870		64,301		
未収委託者報酬			3,305,752		3,423,783		
未収収益	2		1,989,832		1,933,135		
繰延税金資産			463,175		553,910		
その他			27,610		43,115		
流動資産計			17,464,001	81.0	19,285,400	73.5	
固定資産							
有形固定資産			566,274	2.6	488,486	1.9	
建物	1	385,746			335,163		
器具備品	1	180,528			153,323		
無形固定資産			621,524	2.9	616,621	2.3	
商標権	1	2,872			2,104		
ソフトウェア	1	610,731			606,677		
電話加入権		7,148			7,148		
電話施設利用権	1	771			691		
投資その他の資産			2,897,263	13.5	5,842,772	22.3	
投資有価証券		127,525			3,097,362		
関係会社株式		1,410,844			1,261,144		
繰延税金資産		144,409			233,849		
長期差入保証金		1,143,241			1,194,310		
預託金		1,000			-		
その他		97,471			83,032		
貸倒引当金		27,228			26,925		
固定資産計			4,085,063	19.0	6,947,880	26.5	
資産合計			21,549,064	100.0	26,233,280	100.0	

区分	注記 番号	第22期（平成19年3月31日現在）			第23期（平成20年3月31日現在）		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
（負債の部）							
流動負債							
預り金			173,471		162,809		
未払金			1,775,461		2,186,170		
未払収益分配金		8,569		8,470			
未払償還金		53,576		50,930			
未払手数料		1,464,902		1,527,000			
その他未払金		248,414		599,769			
未払費用	2		1,656,967		1,653,424		
未払法人税等			2,262,679		2,575,999		
未払消費税等			279,396		316,821		
前受収益			3,433		-		
賞与引当金			557,836		687,832		
流動負債計			6,709,246	31.1	7,583,058	28.9	
固定負債							
役員退職慰労引当金			121,274		179,237		
退職給付引当金			182,197		334,280		
固定負債計			303,471	1.4	513,518	1.9	
負債合計			7,012,717	32.5	8,096,577	30.8	
（純資産の部）							
株主資本							
資本金			2,000,000	9.3	2,000,000	7.6	
資本剰余金			2,428,478	11.3	2,428,478	9.3	
資本準備金		2,428,478		2,428,478			
利益剰余金			10,106,875	46.9	13,718,238	52.3	
利益準備金		123,293		123,293			
その他利益剰余金							
別途積立金		4,640,000		7,040,000			
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		4,843,582		6,054,944			
株主資本合計			14,535,353	67.5	18,146,716	69.2	
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金			992		10,012		
評価・換算差額等合計			992	0.0	10,012	0.0	
純資産合計			14,536,346	67.5	18,136,703	69.2	
負債・純資産合計			21,549,064	100.0	26,233,280	100.0	

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)			第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
営業収益			32,125,919	100.0		40,502,581	100.0
委託者報酬		25,222,520			32,833,957		
販売手数料		2,990			-		
顧問料		6,207,737			6,804,888		
その他営業収益		692,671			863,734		
営業費用							
支払手数料			11,361,954			14,748,737	
広告宣伝費			539,570			830,858	
公告費			11,612			3,293	
受益証券発行費			51,476			2,167	
調査費			4,740,502			6,268,709	
調査費		2,194,949			2,415,829		
委託調査費		2,545,553			3,852,880		
委託計算費			383,253			345,695	
営業雑経費			690,767			1,143,457	
通信費		23,506			33,290		
印刷費		600,301			1,041,499		
協会費		18,099			22,173		
諸会費		38			41		
支払販売手数料		48,822			46,452		
営業費用計			17,779,137	55.3		23,342,919	57.6
一般管理費							
給料			3,631,878			4,082,147	
役員報酬	1	205,347			223,147		
給料・手当		2,916,607			3,258,097		
賞与		509,924			600,902		
交際費			43,931			44,264	
寄付金			20			4,010	
旅費交通費			249,538			309,129	
租税公課			85,465			103,549	
不動産賃借料			702,262			754,728	
退職給付費用			73,952			88,449	
固定資産減価償却費			357,945			337,808	
福利厚生費			19,772			23,757	
修繕費			65,984			16,394	
賞与引当金繰入			557,836			687,832	
役員退職慰労引当金繰入			53,548			60,123	
役員退職金			528			528	
機器リース料			9,688			1,207	
事務委託費			188,274			279,797	
消耗品費			46,333			76,448	
器具備品費			63,518			10,563	
諸経費			200,560			204,099	
一般管理費計			6,351,042	19.8		7,084,837	17.5
営業利益			7,995,739	24.9		10,074,823	24.9

区分	注記 番号	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)			第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
営業外収益							
受取配当金		6,575			92,575		
受取利息		16,790			59,127		
時効成立分配金		306			298		
投資信託解約益		138,631			-		
為替差益		-			14,223		
雑収入		3,092			7,064		
営業外収益計			165,395	0.5		173,289	0.4
営業外費用							
為替差損		36,555			-		
時効成立後支払分配金		672			557		
投資信託解約損		-			109,677		
営業外費用計			37,227	0.1		110,234	0.3
経常利益			8,123,907	25.3		10,137,878	25.0
特別利益							
関係会社株式売却益		-			39,215		
貸倒引当金戻入益		-			123		
特別利益計			-	-		39,338	0.1
特別損失							
固定資産除却損	2	11,778			10,466		
貯蔵品処分損		84,277			-		
ゴルフ会員権売却損		-			5,200		
退職給付費用		-			106,395		
特別損失計			96,055	0.3		122,062	0.3
税引前当期純利益			8,027,852	25.0		10,055,154	24.8
法人税、住民税及び事業税					4,252,414		
法人税等	3	3,397,409			-		
法人税等調整額		115,869	3,281,540	10.2	172,622	4,079,792	10.0
当期純利益			4,746,311	14.8		5,975,362	14.8

（３）【株主資本等変動計算書】

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本 剰余金	利益 準備金	利益剰余金				
		資本 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	
平成18年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	3,240,000	300,000	200,000	3,297,270	11,589,042
事業年度中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							1,800,000	1,800,000
別途積立金の 積立（千円）				1,400,000			1,400,000	-
当期純利益 （千円）							4,746,311	4,746,311
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）								
事業年度中の 変動額合計（千円）	-	-	-	1,400,000	-	-	1,546,311	2,946,311
平成19年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	4,640,000	300,000	200,000	4,843,582	14,535,353

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成18年3月31日 残高（千円）	-	11,589,042
事業年度中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		1,800,000
別途積立金の 積立（千円）		-
当期純利益 （千円）		4,746,311
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）	992	992
事業年度中の 変動額合計（千円）	992	2,947,304
平成19年3月31日 残高（千円）	992	14,536,346

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本 剰余金	利益 準備金	利益剰余金				
		資本 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	
平成19年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	4,640,000	300,000	200,000	4,843,582	14,535,353
事業年度中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							2,364,000	2,364,000
別途積立金の 積立（千円）				2,400,000			2,400,000	-
当期純利益 （千円）							5,975,362	5,975,362
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）								
事業年度中の 変動額合計（千円）	-	-	-	2,400,000	-	-	1,211,362	3,611,362
平成20年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	7,040,000	300,000	200,000	6,054,944	18,146,716

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成19年3月31日 残高（千円）	992	14,536,346
事業年度中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		2,364,000
別途積立金の 積立（千円）		-
当期純利益 （千円）		5,975,362
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）	11,004	11,004
事業年度中の 変動額合計（千円）	11,004	3,600,357
平成20年3月31日 残高（千円）	10,012	18,136,703

[次へ](#)

重要な会計方針

第22期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)	第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>4. 外貨建の資産およ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。</p> <p>5. 引当金の計上基準 (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しております。 (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しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 同左</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正法人税法に規定する方法により減価償却費を計上してしております。 なお、この変更による営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(追加情報) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年3月31日以前に取得した有形固定資産については、償却可能限度額まで償却が終了した翌事業年度から、残存簿価を5年間で均等償却してしております。 なお、これにより営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 同左</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>5. 引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左</p>

第22期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)	第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)
<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職給付会計に関する実務指針（中間報告）（日本公認会計士協会会計制度委員会報告第13号）に定める簡便法（期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法）により、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>6. リース取引の処理方法 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更) 従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用しておりましたが、当事業年度末から原則法に変更いたしました。 この変更は、従業員数の増加に伴い、退職給付債務の数理計算に用いられる基礎率の推定について一定の有効性が確保されることによって、原則法による計算の結果に一定の高い水準の信頼性が得られたことから、退職給付費用の期間損益計算をより適正化するために行ったものであります。 この変更に伴い、当事業年度末における簡便法と原則法により計算した退職給付債務の差額106,395千円を特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法によった場合と比較して、税引前当期純利益は106,395千円減少しております。 なお、上記に記載の通り退職給付債務の算定方法の変更が当事業年度末に行われたため、当中間会計期間は従来の方法によっております。したがって、当中間会計期間は、当事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。</p> <p>(4) 同左</p> <p>6. リース取引の処理方法 同左</p> <p>7. 消費税等の処理方法 同左</p>

会計方針の変更

第22期（平成19年3月31日現在）	第23期（平成20年3月31日現在）
<p>(貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準) 当事業年度より、貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等（「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成17年12月9日 企業会計基準第5号）および「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準委員会 平成17年12月9日 企業会計基準適用指針第8号））を適用しております。従来の「資本の部」の合計に相当する金額は14,536,346千円であります。 なお、当事業年度における貸借対照表の純資産の部については、財務諸表等規則および「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」の改正に伴い、改正後の財務諸表等規則および「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」により作成しております。</p>	

表示方法の変更

第22期（平成19年3月31日現在）	第23期（平成20年3月31日現在）

	<p>金融商品取引業等に関する内閣府令が制定されたことに伴い、以下のとおり表示方法を変更しております。</p> <p>(貸借対照表)</p> <p>前事業年度において区分掲記していた「現金」および「預金」は、当事業年度から「現金・預金」として表示しております。なお、当事業年度末における「現金」および「預金」の金額はそれぞれ1,205千円、13,265,946千円であります。</p> <p>(損益計算書)</p> <p>前事業年度において区分掲記していた「法人税等」は当事業年度から「法人税、住民税及び事業税」として表示しております。</p>
--	--

注記事項

(貸借対照表関係)

第22期 (平成19年3月31日現在)	第23期 (平成20年3月31日現在)												
<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 310,209千円</p> <p>器具備品 169,451千円</p> <p>商標権 4,814千円</p> <p>ソフトウェア 677,186千円</p> <p>電話施設利用権 825千円</p> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産およ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。</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <tr> <td>流動資産</td> <td>未収収益</td> <td>367,395千円</td> </tr> <tr> <td>流動負債</td> <td>未払費用</td> <td>694,532千円</td> </tr> </table>	流動資産	未収収益	367,395千円	流動負債	未払費用	694,532千円	<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 373,021千円</p> <p>器具備品 229,532千円</p> <p>商標権 5,582千円</p> <p>ソフトウェア 653,371千円</p> <p>電話施設利用権 905千円</p> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産およ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。</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <tr> <td>流動資産</td> <td>未収収益</td> <td>379,257千円</td> </tr> <tr> <td>流動負債</td> <td>未払費用</td> <td>641,087千円</td> </tr> </table>	流動資産	未収収益	379,257千円	流動負債	未払費用	641,087千円
流動資産	未収収益	367,395千円											
流動負債	未払費用	694,532千円											
流動資産	未収収益	379,257千円											
流動負債	未払費用	641,087千円											

(損益計算書関係)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
<p>1. 役員報酬の限度額</p> <p>取締役 年額250,000千円</p> <p>監査役 年額 50,000千円</p> <p>2. 固定資産除却損の内訳</p> <p>建物 4,738千円</p> <p>器具備品 5,960千円</p> <p>ソフトウェア 1,079千円</p> <p>3. 法人税等には、法人住民税および事業税が含まれております。</p>	<p>1. 役員報酬の限度額</p> <p>同左</p> <p>2. 固定資産除却損の内訳</p> <p>建物 3,634千円</p> <p>器具備品 5,271千円</p> <p>ソフトウェア 1,560千円</p> <p>3.</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第22期（自平成18年4月1日 至平成19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	前事業年度末 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18年6月28日 定時株主総会	普通 株式	1,800,000	75,000	平成18年3月31日	平成18年6月29日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29日

第23期（自平成19年4月1日 至平成20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	前事業年度末 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19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(リース取引関係)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)				第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)			
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	91,585千円	-	91,585千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額相当額	39,283千円	-	39,283千円	減価償却累計額相当額	29,608千円	-	29,608千円
期末残高相当額	52,301千円	-	52,301千円	期末残高相当額	60,993千円	-	60,993千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料	18,391千円			未経過リース料	22,595千円		
期末残高相当額		38,155千円	56,546千円	期末残高相当額		39,602千円	62,197千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額			
支払リース料		20,361千円		支払リース料		25,173千円	
減価償却費相当額		16,593千円		減価償却費相当額		20,191千円	
支払利息相当額		1,717千円		支払利息相当額		1,754千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2.オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2.オペレーティング・リース取引 同左			

（有価証券関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

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で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	60,000	61,674	1,674
小計	60,000	61,674	1,674
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	60,000	61,674	1,674

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

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
1,661,631	138,848	217

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 65,851千円

8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

第23期（平成20年3月31日現在）

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で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
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）	3,031,000	3,014,115	16,884
小計	3,031,000	3,014,115	16,884
合計	3,031,000	3,014,115	16,884

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

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
574,322	3,196	112,873

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 83,246千円

8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

1．取引の状況に関する事項

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替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。
(5)取引に係るリスク管理体制	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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、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。

2．取引の時価等に関する事項

区分	種類	第22期(平成19年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	59,269	-	59,231	38
合計		59,269	-	59,231	38

（注1）時価の算定方法

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。

第23期（平成20年3月31日現在）

1. 取引の状況に関する事項

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替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。
(5)取引に係るリスク管理体制	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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、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。

2. 取引の時価等に関する事項

区分	種類	第23期(平成20年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	523,028	-	508,267	14,760
	合計	523,028	-	508,267	14,760

(注1) 時価の算定方法

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。

(退職給付関係)

第22期(平成19年3月31日現在)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

当社は、簡便法(退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法)を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成19年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務	(期末自己都合要支給額)	182,197
	退職給付引当金		182,197
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		48,032
	確定拠出年金	拠出額	25,920
	退職給付費用		73,952

第23期(平成20年3月31日現在)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

当社は、当事業年度末から原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成20年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		334,280
	退職給付引当金		334,280
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		165,213
	確定拠出年金	拠出額	29,631
	退職給付費用		194,844

3. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第23期 (平成20年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第22期	第23期
	(平成19年3月31日現在)	(平成20年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	172,434	197,866
未払事業所税	5,303	5,714
賞与引当金	227,039	279,947
未払法定福利費	24,208	27,884
未払確定拠出年金掛金	1,506	2,610
減価償却超過額（一括償却資産）	12,020	10,139
繰延資産償却超過額（税法上）	20,071	27,940
その他（未払金等）	590	1,807
退職給付引当金	74,154	136,052
役員退職慰労引当金	49,358	72,949
ゴルフ会員権評価損	3,135	3,135
貸倒引当金繰入額	18,442	14,840
其他有価証券評価差額金	-	6,871
繰延税金資産合計	608,266	787,759
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	681	-
繰延税金負債合計	681	-
差引繰延税金資産の純額	607,584	787,759

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

第22期については、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。

第23期については、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。

（持分法損益等）

第22期(平成19年3月31日現在)	第23期(平成20年3月31日現在)
関連会社に関する投資の金額 149,700千円	
持分法を適用した場合の投資の金額 329,065千円	
持分法を適用した場合の投資利益の金額 75,398千円	

(関連当事者との取引)

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

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				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名，出向3名，転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投信の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	841,610	未収収益	240,078
								販売手数料の支払	48,822	-	-
								保険料の支払	5,031	-	-

取引条件およ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) 支払販売手数料は、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3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

(2)子会社等

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	DLIBJ Asset Management 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	875,761	未払費用	447,362
	DLIBJ Asset Management 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	461,432	未払費用	246,903

取引条件および取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を含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) 上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

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				
兄弟会社	株式会社 みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	銀行業	-	-	当社設定投信の販売	投資信託の販売代行手数料	1,987,532	未払手数料	198,163
	株式会社 みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	10,709億円	銀行業	-	-	当社設定投信の販売	投資信託の販売代行手数料	576,293	未払手数料	97,572
	みずほ第一 フィナンシャル テクノロ ジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	-	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払 業務委託料の支払	355,655 21,239	未払費用 -	161,101 -

取引条件およ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、一般的取引条件を含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）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を含めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

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				
法人主要株主	第一生命 保険相互 会社	東京都千代田区	4,200億円 （基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有） 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運用および 助言、当社 設定投信 の販売	資産運用の 助言の顧問料の受入	833,702	未収収益	219,740
								販売手数料の支払	46,452	-	-
								保険料の支払	5,707	-	-

取引条件およ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）支払販売手数料は、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3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

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	1,096,514	未払 費用	456,913
	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	466,450	未払 費用	184,052

取引条件およ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) 上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

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				
兄 弟 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	2,104,660	未払 手数料	145,839
	株式会社 みずほコーポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	739,368	未払 手数料	137,112
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究 等	-	-	当社預 り資産 の運 用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払 業務委託 料の支払	340,983 16,800	未払 費用 -	153,240 -

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

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

(1株当たり情報)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
1株当たり純資産額 605,681円10銭 1株当たり当期純利益金額 197,762円99銭	1株当たり純資産額 755,695円99銭 1株当たり当期純利益金額 248,973円42銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

(注) 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22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
当期純利益	4,746,311千円	5,975,362千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,746,311千円	5,975,362千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
	平成20年3月28日開催の取締役会の決議により、平成20年4月1日付にて100%出資の子会社DIAM SINGAPORE PTE.LTD.を設立し、その後、平成20年4月14日付にて株主割当増資を実施いたしました。(出資の総額400,000千円、資本金400,000千円)

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

区分	注記番号	第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）		
		内訳（千円）	金額（千円）	構成比（％）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金			12,331,764	
前払費用			113,461	
未収委託者報酬			3,183,483	
未収運用受託報酬			1,545,690	
未収投資助言報酬			377,271	
未収収益			258,713	
繰延税金資産			502,506	
その他			55,461	
流動資産合計			18,368,353	77.6
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	310,866		
器具備品	1	146,942		
建設仮勘定		52,584		
無形固定資産				
商標権	1	1,719		
ソフトウェア	1	561,075		
ソフトウェア仮勘定		138,221		
電話加入権		7,148		
電話施設利用権	1	651		
投資その他の資産				
投資有価証券		766,642		
関係会社株式		1,661,144		
繰延税金資産		317,458		
長期差入保証金		1,169,961		
その他		207,761		
貸倒引当金		26,925		
固定資産合計			5,315,252	22.4
資産合計			23,683,606	100.0

区分	注記番号	第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）		
		内訳（千円）	金額（千円）	構成比（％）
（負債の部）				
流動負債				
預り金			38,403	
未払金			1,779,310	
未払収益分配金		8,311		
未払償還金		50,646		
未払手数料		1,373,667		
その他未払金		346,684		
未払費用			1,572,614	
未払法人税等			1,594,756	
未払消費税等			91,285	
前受収益			12,580	
賞与引当金			715,530	
その他			365	
流動負債合計			5,804,848	24.5
固定負債				
退職給付引当金			369,364	
役員退職慰労引当金			147,947	
固定負債合計			517,311	2.2
負債合計			6,322,159	26.7
（純資産の部）				
株主資本				
資本金			2,000,000	8.4
資本剰余金			2,428,478	10.2
資本準備金		2,428,478		
利益剰余金			13,062,550	55.2
利益準備金		123,293		
その他利益剰余金				
別途積立金		10,040,000		
研究開発積立金		300,000		
運用責任準備積立金		200,000		
繰越利益剰余金		2,399,256		
株主資本合計			17,491,028	73.8
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金			129,581	
評価・換算差額等合計			129,581	0.5
純資産合計			17,361,446	73.3
負債・純資産合計			23,683,606	100.0

区分	注記番号	第24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)		
		内訳(千円)	金額(千円)	百分比(%)
営業外収益				
受取配当金		1,575		
受取利息		30,350		
先物利益		97,476		
雑収入		3,796		
営業外収益合計			133,198	0.7
営業外費用				
為替差損		39,429		
時効成立後支払分配金		198		
投資信託解約損		38,254		
営業外費用合計			77,882	0.4
経常利益			3,981,874	21.9
特別損失				
固定資産除却損		2,315		
特別損失合計			2,315	0.0
税引前中間純利益			3,979,559	21.9
法人税、住民税及び事業税		1,585,387		
法人税等調整額		49,860	1,635,247	9.0
中間純利益			2,344,311	12.9

(3) 中間株主資本等変動計算書

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

	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				
				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	
平成20年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	7,040,000	300,000	200,000	6,054,944	18,146,716
中間会計期間中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							3,000,000	3,000,000
別途積立金の 積立（千円）				3,000,000			3,000,000	-
中間純利益（千円）							2,344,311	2,344,311
株主資本以外の 項目の中間会計 期間中の変動額 （純額）（千円）								
中間会計期間中の 変動額合計（千円）	-	-	-	3,000,000	-	-	3,655,688	655,688
平成20年9月30日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	10,040,000	300,000	200,000	2,399,256	17,491,028

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成20年3月31日 残高（千円）	10,012	18,136,703
中間会計期間中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		3,000,000
別途積立金の 積立（千円）		-
中間純利益（千円）		2,344,311
株主資本以外の 項目の中間会計 期間中の変動額 （純額）（千円）	119,568	119,568
中間会計期間中の 変動額合計（千円）	119,568	775,257
平成20年9月30日 残高（千円）	129,581	17,361,446

[前へ](#) [次へ](#)

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

項目	第24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
1. 有価証券の評価基準および評価方法	(1)子会社株式および関連会社株式 ：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. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 ... 10～15年 器具備品 ... 2～15年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：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。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
4. 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。 (追加情報) 従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用していましたが、前事業年度末から原則法に変更いたしました。 なお、上記の通り退職給付債務の算定方法の変更が前事業年度末に行われたため、前中間会計期間は従来の方によっております。したがって、前中間会計期間は、前事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。 (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。
5. 外貨建ての資産およ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。
6. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
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：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

会計方針の変更	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当中間会計期間における中間貸借対照表および中間損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>
表示方法の変更	<p>（中間貸借対照表）</p> <p>1．前中間会計期間において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当中間会計期間から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前中間会計期間末における「未収運用受託報酬」の金額は1,600,614千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は410,692千円であります。</p> <p>2．前中間会計期間において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間から区分掲記しております。なお、前中間会計期間末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は27,931千円であります。</p> <p>（中間損益計算書）</p> <p>前中間会計期間において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当中間会計期間から区分掲記しております。なお、前中間会計期間における「運用受託報酬」の金額は2,551,064千円であり、「投資助言報酬」の金額は735,233千円であります。</p>

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第24期中間会計期間末 （平成20年9月30日現在）	
1．固定資産の減価償却累計額	建物	... 401,730千円
	器具備品	... 261,226千円
	商標権	... 5,967千円
	ソフトウェア	... 549,824千円
	電話施設利用権	... 945千円

（中間損益計算書関係）

項目	第24期中間会計期間 （自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）	
1．減価償却実施額	有形固定資産	... 62,606千円
	無形固定資産	... 103,590千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20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	前事業年度末 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20年6月27日 定時株主総会	普通株式	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(リース取引関係)

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

1. ファイナンス・リース取引

(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース資産の内容
該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および中間期末残高相当額

	器具備品
取得価額相当額	90,601千円
減価償却累計額相当額	40,972千円
中間期末残高相当額	49,629千円

未経過リース料中間期末残高相当額

1年以内	1年超	合計
22,920千円	28,059千円	50,980千円

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額

支払リース料	12,048千円
減価償却費相当額	11,363千円
支払利息相当額	831千円

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

(有価証券関係)

第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの
該当事項はありません。
2. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの
該当事項はありません。
3. その他有価証券で時価のあるもの

区分	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額(千円)	差額 (千円)
株式	371,914	304,829	67,084
債券	-	-	-
その他(投資信託)	529,999	378,566	151,433
合計	901,914	683,396	218,518

4. 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

非上場株式(店頭売買株式を除く)

中間貸借対照表計上額

83,246千円

(デリバティブ取引関係)

デリバティブ取引の契約額等、時価および評価損益の状況

1. 通貨関連

対象物の種類	取引の種類	第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
通貨	為替予約取引 売建				
	米ドル	26,961	-	26,289	672
	香港ドル	33,800	-	34,075	275
	豪ドル	91,717	-	87,387	4,329
	シンガポールドル	16,233	-	16,323	89
	合計	168,712	-	164,076	4,636

2. 株式関連

対象物の種類	取引の種類	第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
株式	株価指数先物取引 売建	358,295	-	333,026	25,268
	合計	358,295	-	333,026	25,268

(持分法損益等)

第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)	
1株当たり純資産額	723,393円61銭
1株当たり中間純利益金額	97,679円66銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
--

中間純利益	2,344,311千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,344,311千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
該当事項はありません。

[前](#)△

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) 自己又はその取締役若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、若しくは取引の公正を害し、又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、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）又は子法人等（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又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又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、運用財産の額若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又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、若しくは取引の公正を害し、又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
当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (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受託会社

b. 資本金の額

平成20年3月末日現在 247,231百万円

c. 事業の内容

日本において信託銀行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。

(平成20年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
損保ジャパンDC証券株式会社	11,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	650,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社みずほコーポレート銀行	1,070,965	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険相互会社	()420,000	日本において保険業務を営んでおります。

() 「基金」および「基金償却積立て額」の総額

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】

第一生命保険相互会社は、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【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成20年5月7日
有価証券報告書	平成20年5月7日
半期報告書	平成20年11月7日
有価証券届出書の訂正届出書	平成20年11月7日

独立監査人の監査報告書

平成21年3月18日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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20年2月8日から平成21年2月9日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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していることを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年2月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月13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

新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 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19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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20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。

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

[委託会社の監査報告書（中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成20年12月12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	山本 禎良 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 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20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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20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20年4月1日から平成20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。

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年3月11日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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19年2月8日から平成20年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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している。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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20年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

[委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成19年6月28日

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 印

当監査法人は、証券取引法第193条の2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」に掲げられている興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社の平成18年4月1日から平成19年3月31日までの第22期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社の平成19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。

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