

【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23年5月6日
【計算期間】 第8期
（自 平成22年2月9日 至 平成23年2月7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 中島 敬雄
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】 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。

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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。

㈱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。

㈱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。

㈱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㈱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が、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、㈱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。

㈱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。

㈱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、㈱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。

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。

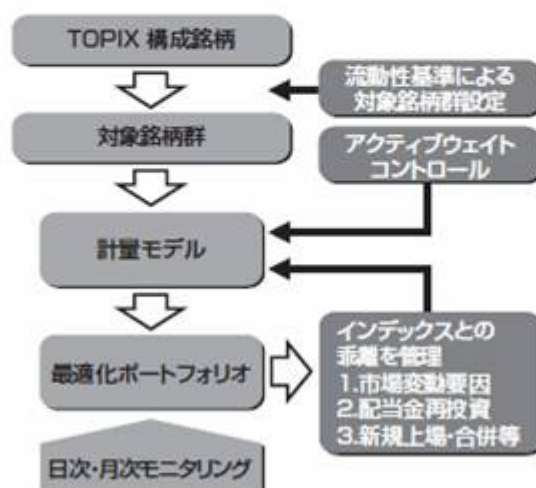
当ファンドの信託金の限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 主に国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資を行い、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」* に連動する投資成果をめざして運用を行います。

*東証株価指数(TOPIX)は、東証の知的財産であり、これらの指数の算出、指数の公表、利用など同指数に関する権利は東証が有しています。東証株価指数(TOPIX)の算出においては、電子計算機の障害または天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、その算出を延期または中止する場合があります。また、東証は、同指数がいかなる場合においても真正であることを保証するものではなく、同指数の算出において、指数に誤差が発生しても、東証は一切その賠償の責めを負いません。

2 流動性を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックス「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」とポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



3 株式(株価指数先物取引を含みます。)の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

○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
	海外	債券	
		不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

補足分類

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

○属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

上記の分類は、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。

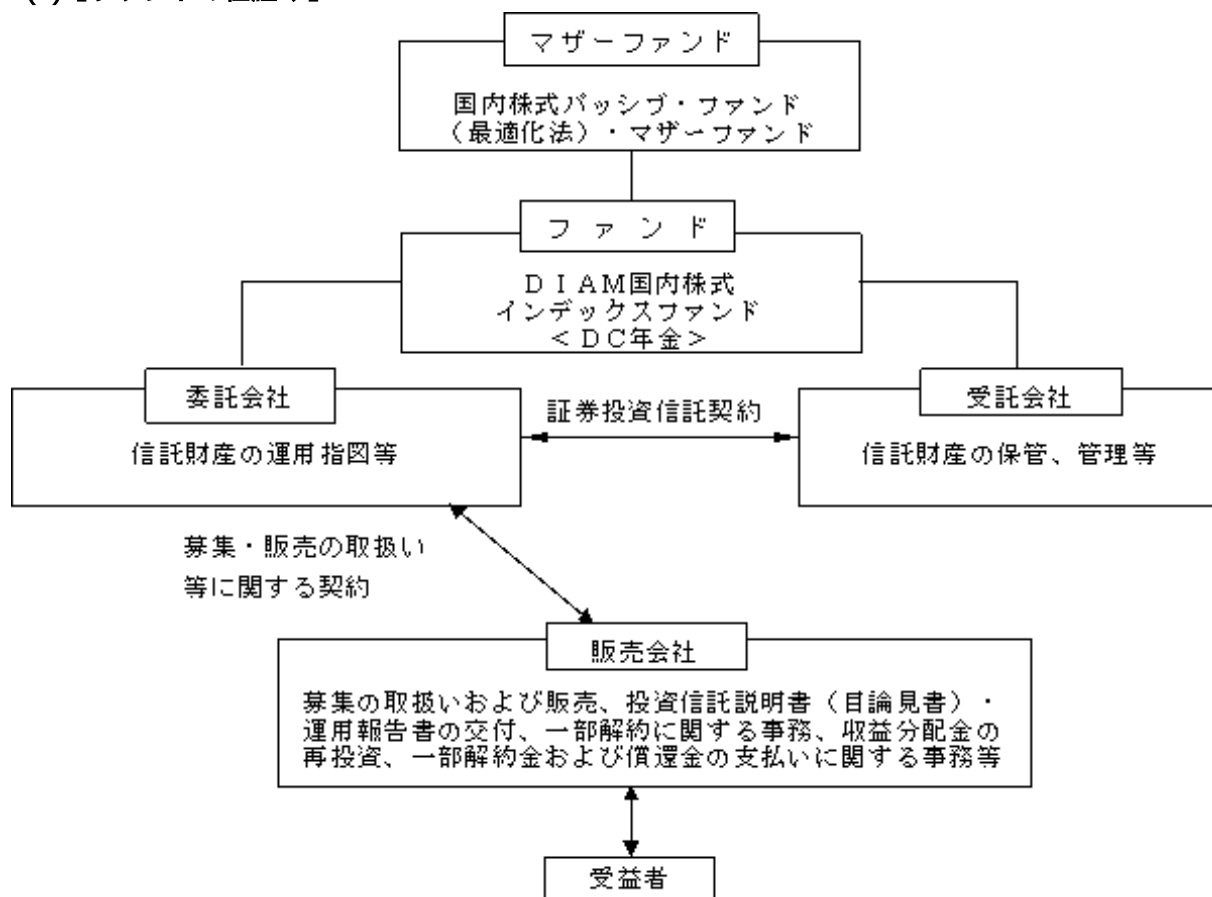
・投資信託協会への照会

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

(2)【ファンドの沿革】

平成14年11月15日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

平成17年10月 1日 信託報酬率の変更

(3)【ファンドの仕組み】

委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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。

○委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成23年2月28日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日 会社設立

平成10年3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

平成10年12月1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成23年2月28日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資態度>

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 有価証券等の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかるオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】**1.投資の対象とする資産の種類（約款第15条）**

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

- a. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます、以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
- b. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

2.有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1) 株券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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、上記1)の証券または証書、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに11)および14)の証券または証書のうち2)から6)までの性質を有するものを以下「公社債」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、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、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

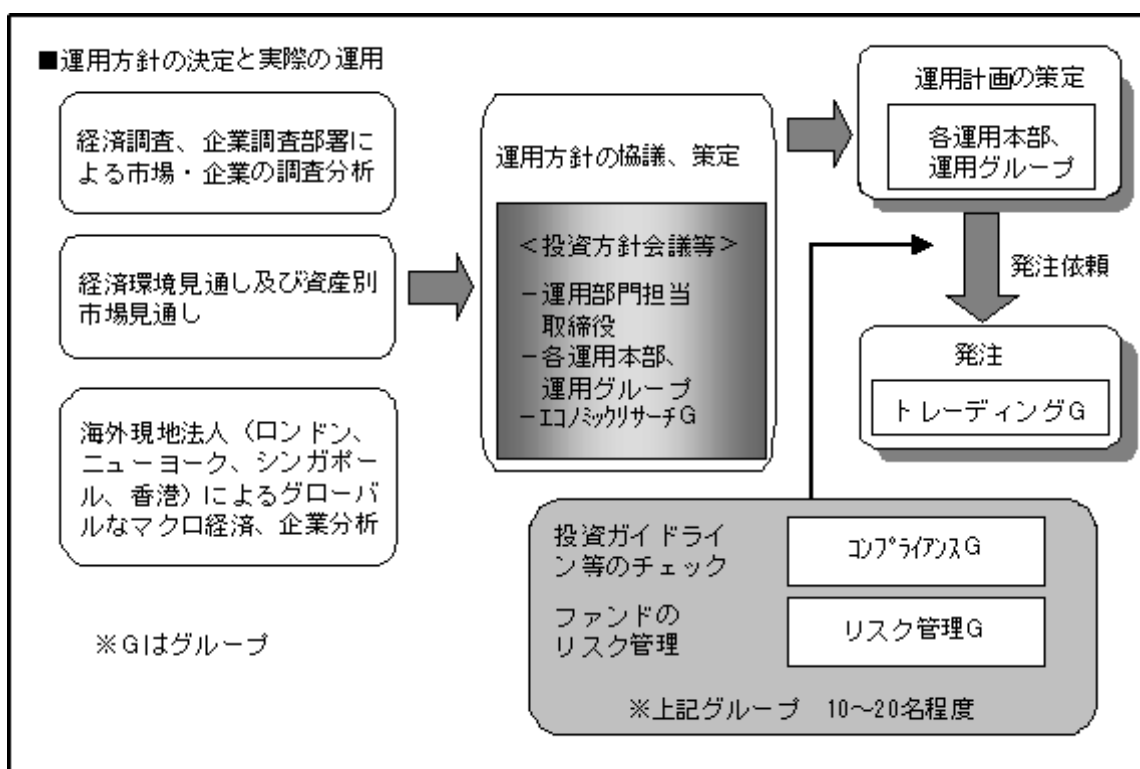
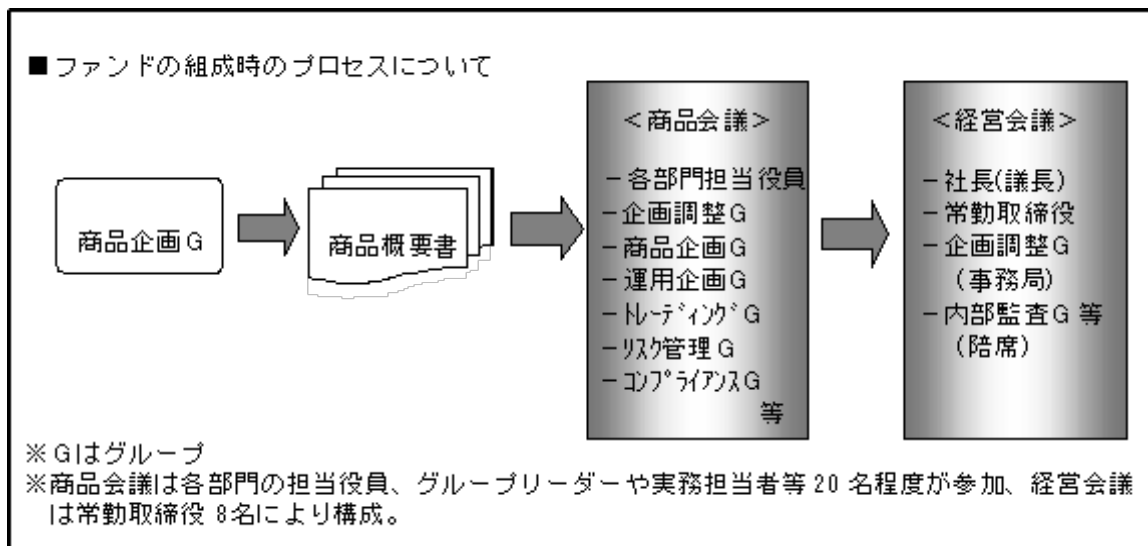
（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（T O P I X）（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（T O P I X）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 運用プロセス 1)流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、T O P I X採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

	3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 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	株式への投資割合には、制限を設けません。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3)【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

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

<運用方針の決定と実際の運用>

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

す。

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

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

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

上記体制は平成23年4月1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、）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

1) 株式への実質投資割合（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

2) 外貨建資産への実質投資割合（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

4) 投資する株式等の範囲（約款第18条）

委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所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との指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(b) 上記(a)の信用取引の指図は、次の1.～5.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～5.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券

2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券

4. 売り出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6) 先物取引等の運用指図・目的（約款第20条）

(a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号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、

金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことの指図をすることができます。

- (b) 金利先渡し取引および為替先渡し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) 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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、金利先渡し取引および為替先渡し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) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b) 上記(a)の1)～2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入の指図を行うものとします。

9) 特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第24条）

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

10) 外貨為替予約の指図（約款第25条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

11) 資金の借入れ（約款第33条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (b) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金

借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

(d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1) 基準価額の主な変動要因

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

○ 株価変動リスク

当ファンドは株式に実質的に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○ 信用リスク

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。

(2) 分配金に関する留意点

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

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

○ 収益分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基

準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

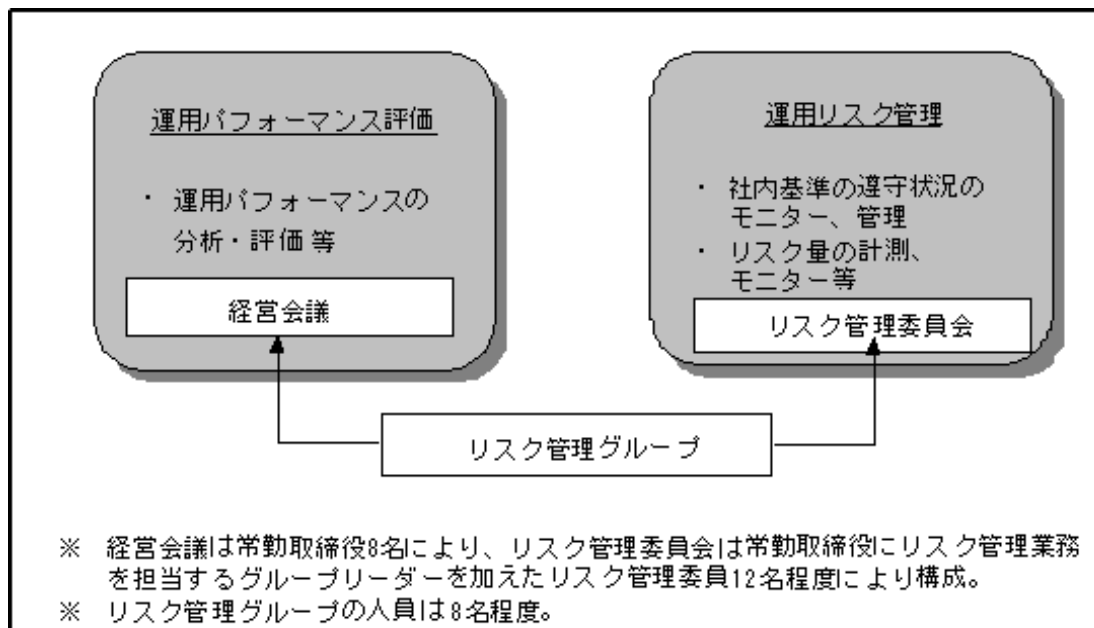
(3)その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、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めざ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も信託を終了（繰上償還）する場合があります。

○注意事項

- イ.当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。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、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

上記体制は平成23年4月1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		
毎日	信託報酬	総額	信託財産の純資産総額に対して 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、日々の基準価額に反映され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）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す。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ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、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。

○法人の受益者に対する課税

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%(所得税7%)の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成24年1月1日からは、15%(所得税15%)となる予定です。

○益金不算入制度、配当控除の適用

益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

税法および確定拠出年金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。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成23年2月28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	38,162,757,537	100.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,229,839	0.01
合 計（純資産総額）		38,157,527,698	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23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	266,954,973,308	96.64
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,281,457,862	3.36
合 計（純資産総額）		276,236,431,170	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23年2月28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	30,773,935,600	12,255.33	37,714,482,583	12,401.00	38,162,757,537	100.01

（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23年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

（注）投資比率とは、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23年2月28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	2,686,700	3,490.00	9,376,583,000	3,820.00	10,263,194,000	3.72
2	三菱UFJフィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	15,620,500	447.00	6,982,363,500	453.00	7,076,086,500	2.56
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,764,300	3,510.00	6,192,693,000	3,545.00	6,254,443,500	2.26
4	キャノン	株式	日本	電気機 器	1,299,100	3,940.00	5,118,454,000	3,940.00	5,118,454,000	1.85
5	三井住友フィナ ンシャルG	株式	日本	銀行業	1,560,900	2,909.00	4,540,658,100	3,085.00	4,815,376,500	1.74
6	みずほフィナン シャルG	株式	日本	銀行業	25,228,400	164.00	4,137,457,600	168.00	4,238,371,200	1.53
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,652,800	2,362.00	3,903,913,600	2,261.00	3,736,980,800	1.35
8	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,174,200	2,872.00	3,372,302,400	2,993.00	3,514,380,600	1.27
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	820,500	4,010.00	3,290,205,000	4,065.00	3,335,332,500	1.21
10	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	1,539,200	2,064.00	3,176,908,800	2,114.00	3,253,868,800	1.18
11	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	775,000	3,870.00	2,999,250,000	3,990.00	3,092,250,000	1.12
12	ソフトバンク	株式	日本	情報・ 通信業	913,900	2,961.00	2,706,057,900	3,355.00	3,066,134,500	1.11
13	任天堂	株式	日本	その他 製品	119,600	22,890.00	2,737,644,000	23,970.00	2,866,812,000	1.04
14	ファナック	株式	日本	電気機 器	217,700	12,380.00	2,695,126,000	12,680.00	2,760,436,000	1.00
15	三井物産	株式	日本	卸売業	1,781,600	1,486.00	2,647,457,600	1,486.00	2,647,457,600	0.96
16	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	17,060	149,300.00	2,547,058,000	153,500.00	2,618,710,000	0.95
17	小松製作所	株式	日本	機械	1,037,600	2,552.00	2,647,955,200	2,495.00	2,588,812,000	0.94
18	三菱地所	株式	日本	不動産 業	1,445,000	1,605.00	2,319,225,000	1,668.00	2,410,260,000	0.87
19	日立	株式	日本	電気機 器	4,694,000	498.00	2,337,612,000	495.00	2,323,530,000	0.84
20	パナソニック	株式	日本	電気機 器	2,070,800	1,082.00	2,240,605,600	1,101.00	2,279,950,800	0.83

21	野村ホールディングス	株式	日本	証券、商品先物取引業	4,346,400	522.00	2,268,820,800	518.00	2,251,435,200	0.82
22	東 芝	株式	日本	電気機器	4,127,000	523.00	2,158,421,000	535.00	2,207,945,000	0.80
23	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	2,641,700	867.00	2,290,353,900	835.00	2,205,819,500	0.80
24	東京海上HD	株式	日本	保険業	783,500	2,508.00	1,965,018,000	2,679.00	2,098,996,500	0.76
25	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	363,600	5,330.00	1,937,988,000	5,690.00	2,068,884,000	0.75
26	三菱電機	株式	日本	電気機器	2,091,000	1,008.00	2,107,728,000	967.00	2,021,997,000	0.73
27	セブン＆アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	863,300	2,167.00	1,870,771,100	2,277.00	1,965,734,100	0.71
28	関西電力	株式	日本	電気・ガス業	853,300	2,088.00	1,781,690,400	2,146.00	1,831,181,800	0.66
29	信越化学	株式	日本	化学	364,700	4,835.00	1,763,324,500	4,695.00	1,712,266,500	0.62
30	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	5,745,000	309.00	1,775,205,000	296.00	1,700,520,000	0.62

(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23年2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	14.10
	輸送用機器	10.01
	銀行業	9.34
	化学	5.67
	情報・通信業	5.42
	卸売業	5.07
	機械	4.82
	電気・ガス業	4.52
	医薬品	4.15
	小売業	3.38
	陸運業	3.35
	食料品	2.79
	保険業	2.52
	不動産業	2.45
	鉄鋼	2.21
	その他製品	2.00
	建設業	1.91
	サービス業	1.63
	証券、商品先物取引業	1.49
	非鉄金属	1.34
	精密機器	1.32

ガラス・土石製品	1.30
繊維製品	0.89
石油・石炭製品	0.85
その他金融業	0.78
金属製品	0.65
ゴム製品	0.58
鉱業	0.58
海運業	0.55
パルプ・紙	0.35
空運業	0.30
倉庫・運輸関連業	0.22
水産・農林業	0.09
合計	96.64

(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23年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (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
第7期末（平成22年2月8日現在）	31,206	31,206	1.1660	1.1660
第8期末（平成23年2月7日現在）	38,104	38,104	1.2631	1.2631
平成22年2月末	31,750	—	1.1808	—
3月末	35,495	—	1.3035	—
4月末	36,064	—	1.3151	—
5月末	32,666	—	1.1723	—
6月末	31,928	—	1.1212	—
7月末	32,617	—	1.1316	—
8月末	31,124	—	1.0721	—
9月末	32,646	—	1.1136	—
10月末	32,073	—	1.0888	—
11月末	34,435	—	1.1554	—
12月末	36,287	—	1.2073	—

平成23年1月末	36,923	—	1.2224	—
2月末	38,157	—	1.2780	—

【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	-
第7期	-
第8期	-

【収益率の推移】

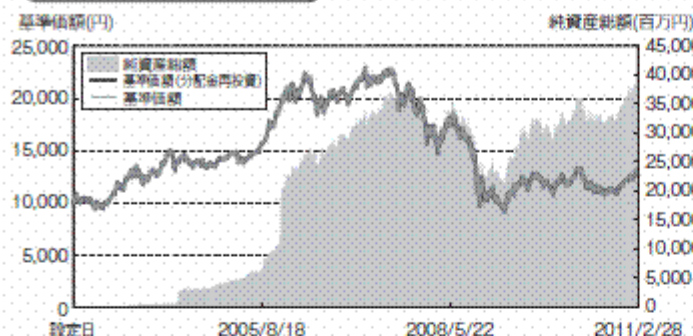
	収益率（％）
第1期	25.64
第2期	13.59
第3期	50.21
第4期	1.95
第5期	23.70
第6期	39.34
第7期	15.27
第8期	8.33

(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

< 参考情報 >

データの基準日:2011年2月28日

基準価額・純資産の推移 (設定日(2002年11月15日)～2011年2月28日)



分配の推移(税引前)

第4期	(2007.02.07)	0円
第5期	(2008.02.07)	0円
第6期	(2009.02.09)	0円
第7期	(2010.02.08)	0円
第8期	(2011.02.07)	0円
設定来累計		0円

(注) 分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

(注) 投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

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

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	日本	96.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.36
合計(純資産総額)		100.00

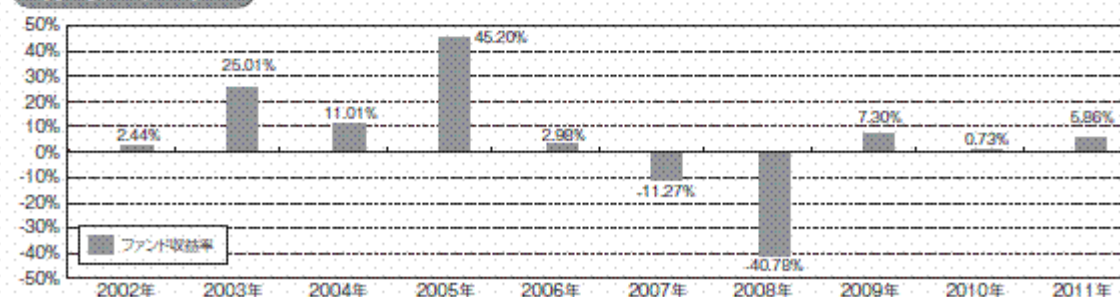
組入上位5業種

業種	投資比率(%)
電気機器	14.10
輸送用機器	10.01
銀行業	9.34
化学	5.67
情報・通信業	5.42

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.72
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.56
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.26
4	キヤノン	株式	日本	電気機器	1.85
5	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.74
6	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.53
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.35
8	ソニー	株式	日本	電気機器	1.27
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	1.21
10	東京電力	株式	日本	電気・ガス業	1.18

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出してあります。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2002年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(4)【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7期	8,901,159,838	4,615,887,504
第8期	7,387,878,523	3,984,381,861

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

- ・当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

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

- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

お申込価額（発行価格）

- ・お申込日の基準価額 とします。

収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

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/>

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

解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

基準価額（1万口当たり）は、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/>

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

(2)【保管】

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

す。

(5)【その他】

イ．償還規定

- a. 委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 委託会社は上記a. b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記a. b. につき、上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約し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. 上記c. ～e. の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

ロ．信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と

合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

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

八.関係法人との契約の更改

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

二.公 告

委託会社が受益者に対してする公告は、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/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資される性質を有します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者となります。）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は、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3【ファンドの経理状況】

- （１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- （２）当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成21年2月10日から平成22年2月8日まで）及び第8期計算期間（平成22年2月9日から平成23年2月7日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【D I A M国内株式インデックスファンド＜D C年金＞】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第 7 期 平成22年 2 月 8 日現在	第 8 期 平成23年 2 月 7 日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	69,142,368	100,648,787
親投資信託受益証券	31,205,507,518	38,104,775,192
未収入金	-	19,394,000
流動資産合計	31,274,649,886	38,224,817,979
資産合計	31,274,649,886	38,224,817,979
負債の部		
流動負債		
未払解約金	30,996,633	79,831,103
未払受託者報酬	5,006,575	5,361,486
未払委託者報酬	31,708,562	33,956,328
その他未払費用	834,337	893,498
流動負債合計	68,546,107	120,042,415
負債合計	68,546,107	120,042,415
純資産の部		
元本等		
元本	26,764,374,288	30,167,870,950
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,441,729,491	7,936,904,614
（ 分配準備積立金 ）	2,192,378,634	1,906,331,272
元本等合計	31,206,103,779	38,104,775,564
純資産合計	31,206,103,779	38,104,775,564
負債純資産合計	31,274,649,886	38,224,817,979

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 7 期 自 平成21年 2 月10日 至 平成22年 2 月 8 日	第 8 期 自 平成22年 2 月 9 日 至 平成23年 2 月 7 日
営業収益		
受取利息	50,903	39,315
有価証券売買等損益	3,615,740,362	2,985,785,674
営業収益合計	3,615,791,265	2,985,824,989
営業費用		
受託者報酬	9,129,359	10,599,296
委託者報酬	57,819,773	67,129,456
その他費用	1,521,389	1,766,396
営業費用合計	68,470,521	79,495,148
営業利益	3,547,320,744	2,906,329,841
経常利益	3,547,320,744	2,906,329,841
当期純利益	3,547,320,744	2,906,329,841
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	589,603,541	94,863,457
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	258,140,046	4,441,729,491
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,377,992,472	1,358,646,151
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,377,992,472	1,358,646,151
剰余金減少額又は欠損金増加額	152,120,230	674,937,412
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	152,120,230	674,937,412
分配金	*1 -	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,441,729,491	7,936,904,614

(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 7 期 自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7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 しております。	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前計算 期間末日及び当計算期間末日が 休業日のため、平成21年2月10日 から平成22年2月8日までとなっ ております。	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は前計算 期間末日が休業日のため、平成22 年2月9日から平成23年2月7日ま でとなっております。

(追加情報)

第 7 期 自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7日
-----	当計算期間より、「金融商品に関す る会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品 の時価等の開示に関する適用指針」 （企業会計基準適用指針第19号 平 成20年3月10日）を適用しておりま す。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 7 期 平成22年2月8日現在	第 8 期 平成23年2月7日現在
*1 期首元本額	22,479,101,954円	26,764,374,288円
期中追加設定元本額	8,901,159,838円	7,387,878,523円
期中解約元本額	4,615,887,504円	3,984,381,861円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	26,764,374,288口	30,167,870,950口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 7 期 自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7日
*1 分配金の計算過程		

	計算期間末における費用控除後の配当等収益（48,929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（11,603,657,042円）及び分配準備積立金（2,192,329,705円）より分配対象収益は13,796,035,676円（1万口当たり5,154.63円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（39,036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（13,644,111,555円）及び分配準備積立金（1,906,292,236円）より分配対象収益は15,550,442,827円（1万口当たり5,154.64円）であります。分配を行っておりません。
--	---	---

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第 7 期 自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	-----	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	-----	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	-----	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 7 期 平成22年2月8日現在	第 8 期 平成23年2月7日現在
----	----------------------	----------------------

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	第 7 期 自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	
種 類	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	31,205,507,518	3,424,425,272
合計	31,205,507,518	3,424,425,272

	第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券	2,941,573,598	
合計	2,941,573,598	

（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 7 期 平成22年2月8日現在	第 8 期 平成23年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1660円 (11,660円)	1.2631円 (12,631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

平成23年2月7日現在

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	31,093,247,811	38,104,775,192	
合 計		31,093,247,811	38,104,775,192	

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22年2月8日現在	平成23年2月7日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,350,645,281	4,327,746,026
株式	*2	261,572,590,158	273,563,558,237
派生商品評価勘定		-	73,279,820
未収入金		-	1,267,049
未収配当金		215,027,184	248,961,162
前払金		34,008,884	-
差入委託証拠金		43,075,116	-
流動資産合計		271,215,346,623	278,214,812,294
資産合計		271,215,346,623	278,214,812,294
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		44,114,982	-
前受金		-	45,931,000
未払金		8,261,526,569	-
未払解約金		62,428,000	68,903,000
流動負債合計		8,368,069,551	114,834,000
負債合計		8,368,069,551	114,834,000
純資産の部			
元本等			
元本		232,901,625,288	226,920,593,309
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		29,945,651,784	51,179,384,985
元本等合計		262,847,277,072	278,099,978,294
純資産合計		262,847,277,072	278,099,978,294
負債純資産合計		271,215,346,623	278,214,812,294

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21年2月10日 至平成22年2月8日	自平成22年2月9日 至平成23年2月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 等における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準 ずる価額）、又は金融商品取引業 者等から提示される気配相場に 基づいて評価しております。	株式及び新株予約権証券 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. 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 当該親投資信託の計算期間は前 計算期間末日及び当計算期間末 日が休業日のため、平成21年2月 10日から平成22年2月8日までと なっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は前 計算期間末日が休業日のため、平 成22年2月9日から平成23年2月7 日までとなっております。

（追加情報）

自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	自平成22年2月9日 至平成23年2月7日
-----	当計算期間より、「金融商品に関す る会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品 の時価等の開示に関する適用指針」 （企業会計基準適用指針第19号 平 成20年3月10日）を適用しておりま す。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年2月8日現在	平成23年2月7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	157,086,250,410円	232,901,625,288円
同期中追加設定元本額	123,394,520,355円	41,108,058,720円

同期中解約元本額	47,579,145,477円	47,089,090,699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	1,258,922,774円	1,632,201,799円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	644,300,658円	1,051,730,628円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	27,649,749,706円	31,093,247,811円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型	635,747,140円	712,139,658円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型	2,474,377,355円	2,753,718,902円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型	2,658,962,444円	2,879,900,485円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	418,128,815円	439,327,114円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,260,397,262円	1,346,266,486円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	977,452,014円	1,026,991,340円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	164,685,197円	146,626,731円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,273,651,301円	1,333,348,096円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	11,726,090円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	275,146,268円	254,234,637円
D I A Mグローバル・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家限定）	11,700,205,783円	10,258,858,383円
D I A Mグローバル・バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	1,874,985,588円	1,749,020,252円
D I A M国際分散バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定）	220,008,763円	201,395,341円
D I A M国際分散バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	810,954,385円	768,230,703円
D I A M国内重視バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定）	228,201,911円	218,275,389円
D I A M国内重視バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	303,242,611円	287,503,938円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限定）	20,820,640,574円	19,218,353,105円

D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	6,793,130,129円	6,403,299,958円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	5,530,105,198円	4,985,484,853円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限定）	3,760,303,889円	3,364,210,374円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	8,739,073,910円	7,923,905,765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）	1,257,074,327円	1,197,644,228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）	2,690,427,301円	2,518,998,194円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A（適格 機関投資家限定）	2,801,786,396円	2,563,374,021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）	14,595,421,536円	13,799,025,986円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	243,609,429円	204,230,422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）	541,675,984円	291,738,856円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限定）	4,816,933,532円	4,705,490,295円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A（適格機 関投資家限定）	9,344,521,039円	8,713,351,160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）	452,944,061円	443,102,609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）	41,417,690,500円	39,457,105,770円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A（適格機関投 資家限定）	2,913,465,663円	2,681,236,251円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A（適格機関投 資家限定）	5,160,519,246円	4,783,662,672円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定）	25,332,390,052円	23,902,624,473円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	282,855,217円	272,794,912円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	91,029円	91,930円

D I A Mバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	140,254円	144,867円
D I A M世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,438,338,219円	20,842,866,754円
D I A M世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,269,806円	199,881,436円
D I A M国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,183,612円	76,294,306円
D I A Mバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	52,699,854円	206,717,719円
D I A Mバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	86,022円	86,168円
D I A Mバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	128,534円	132,442円
（合 計）	232,901,625,288円	226,920,593,309円
*2 差入代用有価証券	-----	株式 1,745,000,000円
*3 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	232,901,625,288口	226,920,593,309口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	自平成22年2月9日 至平成23年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	-----	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年2月8日現在	平成23年2月7日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	-----	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	-----	(1)株式 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「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。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	-----	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	自平成21年2月10日 至平成22年2月8日	
種 類	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	261,572,590,158	18,756,184,188
合計	261,572,590,158	18,756,184,188

	自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
株式	18,328,050,286	

合計	18,328,050,286
----	----------------

（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21年2月10日 至平成22年2月8日	自平成22年2月9日 至平成23年2月7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。	-----
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。	-----
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。	-----
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。	-----
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。	-----

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

平成22年2月8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	1,447,139,000	-	1,403,175,000	44,114,982

合 計	1,447,139,000	-	1,403,175,000	44,114,982
-----	---------------	---	---------------	------------

平成23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 TOPIX先物	4,417,219,000	-	4,490,810,000	73,279,820
合 計		4,417,219,000	-	4,490,810,000	73,279,820

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年2月8日現在	平成23年2月7日現在
1口当たり純資産額	1.1286円	1.2255円
(1万口当たり純資産額)	(11,286円)	(12,255円)

[次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成23年2月7日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	99,000	186	18,414,000	
日本水産	281,700	279	78,594,300	
マルハニチロホールディングス	484,000	147	71,148,000	
ハウスイ	20,000	110	2,200,000	
サカタのタネ	33,000	1,240	40,920,000	
ホクト	24,900	1,901	47,334,900	
ショーボンドHD	21,700	1,799	39,038,300	
ミライト・ホールディングス	64,100	642	41,152,200	
住石ホールディングス	68,500	87	5,959,500	
日鉄鉱業	62,000	443	27,466,000	
三井松島	140,000	182	25,480,000	
国際石油開発帝石	2,461	542,000	1,333,862,000	
日本海洋掘削	6,000	3,380	20,280,000	
関東天然瓦斯	25,000	468	11,700,000	
石油資源開発	38,500	3,620	139,370,000	
ダイセキ環境ソリューション	21	81,400	1,709,400	
間組	97,200	71	6,901,200	
東急建設	86,880	247	21,459,360	
コムシスホールディングス	118,600	884	104,842,400	
ミサワホーム	29,000	422	12,238,000	
高松コンストラクションGP	18,700	1,159	21,673,300	
東建コーポレーション	8,190	3,280	26,863,200	
ヤマウラ	8,500	226	1,921,000	
大成建設	1,154,000	201	231,954,000	
大 林 組	730,000	392	286,160,000	
清水建設	691,000	353	243,923,000	
飛島建設	706,000	25	17,650,000	
長谷工コーポレーション	1,517,500	77	116,847,500	
松井建設	2,000	316	632,000	
鹿島建設	1,069,000	221	236,249,000	
不動テトラ	179,900	54	9,714,600	
大末建設	88,000	42	3,696,000	
鉄建建設	150,000	91	13,650,000	
安藤建設	83,000	112	9,296,000	
太平工業	48,000	409	19,632,000	
西松建設	320,000	113	36,160,000	
三井住友建設	134,600	67	9,018,200	
大豊建設	75,000	85	6,375,000	
前田建設	150,000	279	41,850,000	
佐田建設	88,000	38	3,344,000	

ナカノフドー建設	19,000	244	4,636,000	
奥 村 組	232,000	319	74,008,000	
大和小田急建設	12,500	220	2,750,000	
東鉄工業	32,000	650	20,800,000	
イチケン	29,000	122	3,538,000	
浅沼組	83,000	57	4,731,000	
戸田建設	262,000	320	83,840,000	
熊 谷 組	185,000	63	11,655,000	
青木あすなろ建設	17,000	394	6,698,000	
北野建設	55,000	208	11,440,000	
植 木 組	33,000	140	4,620,000	
三井ホーム	27,000	468	12,636,000	
矢作建設	30,400	501	15,230,400	
ピーエス三菱	16,700	267	4,458,900	
大東建託	95,000	6,500	617,500,000	
新日本建設	29,500	246	7,257,000	
N I P P O	57,000	614	34,998,000	
東亜道路	49,000	134	6,566,000	
前田道路	71,000	727	51,617,000	
日本道路	74,000	215	15,910,000	
東亜建設	200,000	106	21,200,000	
若築建設	137,000	48	6,576,000	
東洋建設	333,000	48	15,984,000	
五洋建設	271,500	143	38,824,500	
大林道路	32,000	169	5,408,000	
世紀東急	64,000	52	3,328,000	
福 田 組	34,000	168	5,712,000	
住友林業	167,500	738	123,615,000	
日本基礎技術	33,900	253	8,576,700	
日成ビルド工業	75,000	56	4,200,000	
エス・バイ・エル	117,000	59	6,903,000	
巴コーポレーション	34,600	258	8,926,800	
パナホーム	80,000	532	42,560,000	
大和ハウス	606,000	1,027	622,362,000	
ライト工業	54,400	229	12,457,600	
積水ハウス	729,000	819	597,051,000	
日特建設	71,000	68	4,828,000	
北陸電気工事	2,000	229	458,000	
ユアテック	40,000	363	14,520,000	
西部電気工業	1,000	355	355,000	
四電工	6,000	365	2,190,000	
中電工	35,900	1,039	37,300,100	
関 電 工	112,000	534	59,808,000	
きんでん	163,000	778	126,814,000	
東京エネシス	28,000	560	15,680,000	
トーエネック	36,000	465	16,740,000	
住友電設	18,200	339	6,169,800	
日本電設工業	45,000	820	36,900,000	

協和エクシオ	88,000	821	72,248,000	
新日本空調	18,400	478	8,795,200	
日本工営	77,000	269	20,713,000	
日本電話施設	39,000	259	10,101,000	
九電工	46,000	576	26,496,000	
三機工業	56,000	552	30,912,000	
日 揮	244,000	2,043	498,492,000	
中外炉工業	78,000	359	28,002,000	
ヤマト	16,000	305	4,880,000	
太平電業	32,000	680	21,760,000	
高砂熱学	70,200	683	47,946,600	
三晃金属	28,000	186	5,208,000	
N E C ネットズエスアイ	20,800	1,122	23,337,600	
朝日工業社	8,000	365	2,920,000	
アタカ大機	17,000	248	4,216,000	
大 気 社	37,500	1,389	52,087,500	
ダイダン	25,000	465	11,625,000	
日比谷総合設	32,800	771	25,288,800	
東芝プラントシステム	39,000	1,140	44,460,000	
日本製粉	142,000	411	58,362,000	
日清製粉 G 本社	220,500	1,075	237,037,500	
日東富士製粉	8,000	320	2,560,000	
昭和産業	102,000	252	25,704,000	
鳥越製粉	21,900	721	15,789,900	
協同飼料	89,000	108	9,612,000	
中部飼料	21,600	600	12,960,000	
日本配合飼料	77,000	114	8,778,000	
東洋精糖	39,000	120	4,680,000	
日本甜菜糖	136,000	212	28,832,000	
三井製糖	97,000	338	32,786,000	
ネクスト	57	85,600	4,879,200	
日本 M & A センター	50	422,000	21,100,000	
アコーディア・ゴルフ	637	67,100	42,742,700	
パソナグループ	196	68,900	13,504,400	
リンクアンドモチベーション	51	49,950	2,547,450	
テンプホールディングス	31,100	764	23,760,400	
森永製菓	241,000	198	47,718,000	
中 村 屋	58,000	400	23,200,000	
江崎グリコ	88,000	949	83,512,000	
名糖産業	11,200	1,109	12,420,800	
不 二 家	140,000	156	21,840,000	
山崎製パン	178,000	970	172,660,000	
第一屋製パン	36,000	94	3,384,000	
モロゾフ	40,000	270	10,800,000	
森永乳業	206,000	356	73,336,000	
ヤクルト	130,400	2,309	301,093,600	
明治ホールディングス	72,100	3,830	276,143,000	
雪印メグミルク	47,800	1,471	70,313,800	

プリマハム	138,000	104	14,352,000	
日本ハム	169,000	1,122	189,618,000	
伊藤ハム	134,000	317	42,478,000	
林兼産業	80,000	90	7,200,000	
丸大食品	108,000	268	28,944,000	
米 久	21,500	710	15,265,000	
S F o o d s	16,000	746	11,936,000	
学情	8,200	304	2,492,800	
スタジオアリス	9,500	840	7,980,000	
シミック	430	23,340	10,036,200	
システナ	213	104,100	22,173,300	
N E Cフィールドینگ	18,300	1,045	19,123,500	
新日鉄ソリューションズ	17,800	1,869	33,268,200	
総合警備保障	82,500	1,014	83,655,000	
日本駐車場開発	2,367	4,150	9,823,050	
コア	8,300	716	5,942,800	
カカコム	156	467,000	72,852,000	
アイロムホールディングス	503	2,420	1,217,260	
ルネサンス	11,400	302	3,442,800	
新日本科学	14,200	380	5,396,000	
エムスリー	89	438,500	39,026,500	
ディー・エヌ・エー	88,300	2,878	254,127,400	
博報堂D Y H L D G S	31,410	4,820	151,396,200	
ぐるなび	118	123,500	14,573,000	
一休	162	38,400	6,220,800	
ジャパンベストレスキューS	35	69,400	2,429,000	
ジェイコムホールディングス	22	143,600	3,159,200	
P G Mホールディングス	477	52,400	24,994,800	
サッポロホールディングス	345,000	375	129,375,000	
アサヒビール	456,000	1,561	711,816,000	
麒麟H D	975,000	1,118	1,090,050,000	
宝ホールディングス	206,000	494	101,764,000	
オエノンホールディングス	68,000	204	13,872,000	
養 命 酒	3,000	800	2,400,000	
三国コカ・コ・ラ	30,000	749	22,470,000	
コカ・コーラウエスト	75,000	1,467	110,025,000	
コカコーラセントラルジャパン	28,000	1,127	31,556,000	
ダイドードリンコ	10,200	3,130	31,926,000	
伊 藤 園	73,700	1,422	104,801,400	
キーコーヒー	21,900	1,487	32,565,300	
ユニカフェ	6,300	405	2,551,500	
ジャパンフーズ	3,800	824	3,131,200	
日清オイリオグループ	105,000	416	43,680,000	
不二製油	59,200	1,201	71,099,200	
J - オイルミルズ	91,000	261	23,751,000	
ローソン	74,200	4,115	305,333,000	
インターニックス	9,100	399	3,630,900	
サンエー	7,300	3,325	24,272,500	

キリン堂	9,500	429	4,075,500	
ダイユーエイト	1,900	573	1,088,700	
カワチ薬品	14,900	1,770	26,373,000	
エービーシー・マート	25,300	3,270	82,731,000	
ハードオフコーポレーション	10,800	450	4,860,000	
高千穂交易	9,200	953	8,767,600	
アスクル	15,400	1,650	25,410,000	
ゲオ	354	100,000	35,400,000	
ポイント	18,040	3,820	68,912,800	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	121	605,000	
伊藤忠食品	5,400	3,010	16,254,000	
くらコーポレーション	11,200	1,275	14,280,000	
キャンドゥ	91	72,900	6,633,900	
エレマテック	17,200	1,233	21,207,600	
バル	6,200	3,140	19,468,000	
J A L U X	6,800	783	5,324,400	
エディオン	78,000	810	63,180,000	
サーラコーポレーション	21,000	467	9,807,000	
トーマンデバイス	2,700	2,317	6,255,900	
バルス	100	81,400	8,140,000	
あみやき亭	37	290,000	10,730,000	
東京エレクトロンデバイス	43	200,000	8,600,000	
ひらまつ	42	101,600	4,267,200	
双日	1,433,600	189	270,950,400	
アルフレッサホールディングス	56,000	3,130	175,280,000	
ハニーズ	18,760	1,081	20,279,560	
キッコーマン	199,000	915	182,085,000	
味の素	660,000	910	600,600,000	
キュービー	126,000	1,018	128,268,000	
ハウス食品	86,200	1,353	116,628,600	
カゴメ	87,600	1,519	133,064,400	
焼津水産化工	11,900	857	10,198,300	
アリアケジャパン	20,200	1,464	29,572,800	
ニチレイ	274,000	385	105,490,000	
横浜冷凍	47,100	592	27,883,200	
東洋水産	105,000	1,810	190,050,000	
日清食品H D	87,100	2,961	257,903,100	
永谷園	2,000	874	1,748,000	
フジッコ	27,000	1,016	27,432,000	
ロックフィールド	12,200	1,328	16,201,600	
日本たばこ産業	5,050	333,000	1,681,650,000	
わらべや日洋	13,700	1,038	14,220,600	
なとり	12,900	844	10,887,600	
片倉工業	26,200	811	21,248,200	
ゲンゼ	155,000	365	56,575,000	
昭栄	39,100	730	28,543,000	
神栄	28,000	162	4,536,000	
川島織物セルコン	83,000	70	5,810,000	

山下医科器械	1,900	1,150	2,185,000	
ラサ商事	10,300	386	3,975,800	
アルペン	16,300	1,552	25,297,600	
アルコニックス	3,400	2,309	7,850,600	
ビックカメラ	521	34,300	17,870,300	
D C Mホールディングス	101,900	508	51,765,200	
M o n o t a R O	4,200	902	3,788,400	
あい ホールディングス	45,600	335	15,276,000	
ユニバース	3,300	1,247	4,115,100	
J . フロント リテイリング	505,000	440	222,200,000	
ドトール・日レスHD	37,600	1,099	41,322,400	
マツモトキヨシH L D G S	39,600	1,837	72,745,200	
ココカラファイン	20,600	1,826	37,615,600	
三越伊勢丹HD	425,200	994	422,648,800	
東洋紡績	809,000	152	122,968,000	
ユニチカ	512,000	80	40,960,000	
富士紡ホールディングス	101,000	173	17,473,000	
日清紡ホールディングス	145,000	921	133,545,000	
倉敷紡績	216,000	164	35,424,000	
ダイワボウHD	197,000	204	40,188,000	
シキボウ	138,000	117	16,146,000	
日東紡績	185,000	250	46,250,000	
トヨタ紡織	75,800	1,340	101,572,000	
クリエイトSDH	7,500	1,955	14,662,500	
バイタルK S K HD	40,300	655	26,396,500	
U K Cホールディングス	12,600	1,032	13,003,200	
C H Iグループ	12,100	313	3,787,300	
日本毛織	78,000	738	57,564,000	
大東紡織	36,000	80	2,880,000	
トーア紡コーポレーション	77,000	75	5,775,000	
ダイドーリミテッド	28,500	775	22,087,500	
東京建物不動産販	6,000	333	1,998,000	
野村不動産H L D G S	89,700	1,576	141,367,200	
ヒューリック	60,800	673	40,918,400	
帝国繊維	24,000	542	13,008,000	
ブックオフコーポレーション	13,100	726	9,510,600	
日本コークス工業	183,000	176	32,208,000	
ミタチ産業	3,800	455	1,729,000	
J F E 商事H L D G S	144,000	419	60,336,000	
あさひ	8,900	1,355	12,059,500	
サークルKサンクス	46,400	1,333	61,851,200	
日本調剤	2,700	3,450	9,315,000	
コスモス薬品	9,400	3,370	31,678,000	
シップヘルスケアHD	27,800	1,034	28,745,200	
セブン&アイ・H L D G S	895,100	2,167	1,939,681,700	
ツルハホールディングス	19,100	4,080	77,928,000	
サンマルクホールディングス	6,900	3,595	24,805,500	
フェリシモ	6,100	1,028	6,270,800	

トリドール	79	118,300	9,345,700	
帝 人	862,000	416	358,592,000	
東 レ	1,757,000	605	1,062,985,000	
ク ラ レ	335,300	1,189	398,671,700	
旭 化 成	1,322,000	561	741,642,000	
サカイ オーベックス	64,000	130	8,320,000	
稲葉製作所	11,000	876	9,636,000	
宮地エンジニアリング G	73,000	88	6,424,000	
三協・立山 H L D G S	263,000	116	30,508,000	
トーカロ	11,700	1,620	18,954,000	
アルファ C O	7,100	921	6,539,100	
S U M C O	138,800	1,338	185,714,400	
川田テクノロジーズ	5,200	1,566	8,143,200	
住江織物	57,000	221	12,597,000	
日本フェルト	13,800	420	5,796,000	
イチカワ	14,000	173	2,422,000	
日本バイリ - ン	25,000	449	11,225,000	
エコナックホールディングス	70,000	35	2,450,000	
日東製網	27,000	102	2,754,000	
芦森工業	55,000	135	7,425,000	
アツギ	196,000	112	21,952,000	
ダイニック	44,000	176	7,744,000	
共和レザー	14,100	326	4,596,600	
セーレン	56,700	632	35,834,400	
東海染工	31,000	88	2,728,000	
小松精練	38,000	363	13,794,000	
ワコールホールディングス	135,000	1,139	153,765,000	
ホギメディカル	12,200	3,765	45,933,000	
サンエー・インターナショナル	9,600	1,038	9,964,800	
レナウン	43,600	222	9,679,200	
クラウドディア	2,400	1,321	3,170,400	
I Tホールディングス	70,800	936	66,268,800	
グリー	68,900	1,286	88,605,400	
コーエーテクモ H D	42,400	687	29,128,800	
三菱総合研究所	8,300	1,875	15,562,500	
特種東海製紙	143,000	201	28,743,000	
ドワンゴ	107	232,700	24,898,900	
ベリサーブ	13	123,000	1,599,000	
マクロミル	20,800	1,069	22,235,200	
ティーガイア	172	152,500	26,230,000	
G M Oペイメントゲートウェイ	46	233,500	10,741,000	
ザッパラス	117	129,300	15,128,100	
インターネットイニシアティブ	125	251,200	31,400,000	
ソネットエンタテインメント	121	292,200	35,356,200	
S R Aホールディングス	11,300	940	10,622,000	
J B I Sホールディングス	22,400	330	7,392,000	
朝日ネット	18,000	349	6,282,000	
王子製紙	1,003,000	399	400,197,000	

三菱製紙	325,000	108	35,100,000	
北越紀州製紙	141,000	490	69,090,000	
中越パルプ	88,000	162	14,256,000	
巴川製紙	39,000	295	11,505,000	
大王製紙	96,000	583	55,968,000	
日本製紙G本社	109,600	2,244	245,942,400	
レンゴー	182,000	557	101,374,000	
トーモク	72,000	263	18,936,000	
ザ・パックス	16,200	1,435	23,247,000	
コ－プケミカル	36,000	123	4,428,000	
昭和電工	1,512,000	190	287,280,000	
住友化学	1,561,000	463	722,743,000	
日本化成	43,000	222	9,546,000	
住友精化	48,000	402	19,296,000	
日産化学	164,200	1,007	165,349,400	
ラサ工業	86,000	106	9,116,000	
クレハ	148,000	481	71,188,000	
テイカ	39,000	357	13,923,000	
石原産業	381,000	120	45,720,000	
片倉チツカリン	13,000	269	3,497,000	
日本曹達	135,000	414	55,890,000	
東ソー	567,000	288	163,296,000	
トクヤマ	353,000	435	153,555,000	
セントラル硝子	218,000	399	86,982,000	
東亜合成	231,000	416	96,096,000	
ダイソー	92,000	275	25,300,000	
関東電化	51,000	737	37,587,000	
電気化学	477,000	401	191,277,000	
イビデン	132,000	2,741	361,812,000	
信越化学	378,200	4,835	1,828,597,000	
日本カ－バイド	54,000	259	13,986,000	
堺 化 学	71,000	467	33,157,000	
エア・ウォーター	183,000	1,076	196,908,000	
大陽日酸	299,000	736	220,064,000	
日本化学工業	85,000	240	20,400,000	
日本パ－カラライジング	54,000	1,339	72,306,000	
高圧ガス	34,000	518	17,612,000	
チタン工業	27,000	539	14,553,000	
四国化成	33,000	506	16,698,000	
戸田工業	33,000	938	30,954,000	
ステラ ケミファ	10,000	3,835	38,350,000	
保土谷化学	52,000	375	19,500,000	
日本触媒	186,000	942	175,212,000	
大日精化	82,000	489	40,098,000	
カネカ	283,000	591	167,253,000	
協和発酵キリン	272,000	862	234,464,000	
三菱瓦斯化学	358,000	621	222,318,000	
三井化学	1,032,000	327	337,464,000	

J S R	189,500	1,784	338,068,000	
東京応化工業	40,800	1,932	78,825,600	
三菱ケミカルH L D G S	1,318,500	612	806,922,000	
日本合成化学	53,000	566	29,998,000	
ダイセル化学	295,000	577	170,215,000	
住友ベークライト	213,000	539	114,807,000	
積水化学	472,000	648	305,856,000	
日本ゼオン	212,000	800	169,600,000	
アイカ工業	66,400	1,054	69,985,600	
宇部興産	952,000	266	253,232,000	
積水樹脂	33,000	848	27,984,000	
タキロン	54,000	312	16,848,000	
旭有機材	82,000	245	20,090,000	
日立化成	98,100	1,902	186,586,200	
ニチバン	23,000	325	7,475,000	
リケンテクノス	41,000	320	13,120,000	
大倉工業	55,000	294	16,170,000	
積水化成品	52,000	372	19,344,000	
群栄化学	63,000	260	16,380,000	
タイガース ポリマー	11,500	410	4,715,000	
日本カネリット	18,500	490	9,065,000	
日本化薬	160,000	892	142,720,000	
イーピーエス	123	193,700	23,825,100	
パナソニック電工I S	4,300	2,156	9,270,800	
フェイス	727	10,220	7,429,940	
アミューズ	6,700	974	6,525,800	
野村総合研究所	121,100	1,887	228,515,700	
ドリームインキュベータ	66	66,100	4,362,600	
サイバネットシステム	178	22,650	4,031,700	
T A C	13,600	340	4,624,000	
ケネディクス	2,552	22,460	57,317,920	
電通	206,000	2,587	532,922,000	
インテージ	6,400	1,849	11,833,600	
テイクアンドギヴニーズ	1,133	8,200	9,290,600	
びあ	6,800	894	6,079,200	
シンプレクスホールディング	357	42,000	14,994,000	
イオンファンタジー	7,400	1,181	8,739,400	
ソースネクスト	43	22,340	960,620	
ネクシィーズ	977	2,991	2,922,207	
メディカルシステムネットワーク	3,100	657	2,036,700	
日本精化	19,200	560	10,752,000	
A D E K A	91,000	983	89,453,000	
日油	199,000	432	85,968,000	
ミヨシ油脂	80,000	139	11,120,000	
ハリマ化成	9,000	624	5,616,000	
花王	618,300	2,201	1,360,878,300	
第一工業製薬	38,000	336	12,768,000	
三洋化成	64,000	702	44,928,000	

武田薬品	850,700	4,010	3,411,307,000	
アステラス製薬	504,100	3,245	1,635,804,500	
大日本住友製薬	160,900	806	129,685,400	
塩野義製薬	331,000	1,551	513,381,000	
田辺三菱製薬	189,000	1,425	269,325,000	
わかもと製薬	4,000	256	1,024,000	
あすか製薬	27,000	611	16,497,000	
日本新薬	52,000	1,146	59,592,000	
中外製薬	226,200	1,528	345,633,600	
科研製薬	96,000	1,057	101,472,000	
エーザイ	279,600	2,954	825,938,400	
ロート製薬	103,000	932	95,996,000	
小野薬品	113,900	4,175	475,532,500	
久光製薬	64,100	3,350	214,735,000	
有機合成薬品	17,000	241	4,097,000	
持田製薬	91,000	959	87,269,000	
大正製薬	182,000	1,847	336,154,000	
参天製薬	70,400	2,995	210,848,000	
扶桑薬品	77,000	245	18,865,000	
日本ケミファ	35,000	300	10,500,000	
ツムラ	62,000	2,597	161,014,000	
日医工	21,500	2,228	47,902,000	
テ ル モ	170,400	4,410	751,464,000	
みらかホールディングス	55,100	3,075	169,432,500	
キッセイ薬品工業	46,100	1,645	75,834,500	
生化学工業	43,800	920	40,296,000	
栄研化学	17,900	1,065	19,063,500	
日水製薬	10,100	721	7,282,100	
鳥居薬品	15,600	1,810	28,236,000	
東和薬品	11,600	4,500	52,200,000	
沢井製薬	14,900	7,120	106,088,000	
ゼリア新薬工業	33,000	1,020	33,660,000	
第一三共	763,900	1,856	1,417,798,400	
キョーリン製薬H D	61,000	1,537	93,757,000	
大幸薬品	7,800	1,102	8,595,600	
大塚ホールディングス	394,300	2,039	803,977,700	
大日本塗料	132,000	132	17,424,000	
日本ペイント	197,000	674	132,778,000	
関西ペイント	257,000	868	223,076,000	
トウペ	21,000	84	1,764,000	
中国塗料	61,000	793	48,373,000	
日本特殊塗料	18,100	400	7,240,000	
藤倉化成	29,000	628	18,212,000	
太陽ホールディングス	16,900	2,848	48,131,200	
D I C	866,000	190	164,540,000	
サカタインクス	47,000	439	20,633,000	
東洋インキ	205,000	443	90,815,000	
アルプス技研	10,300	667	6,870,100	

サニックス	33,200	199	6,606,800	
ダイオーズ	1,400	484	677,600	
日本空調サービス	6,400	745	4,768,000	
オリエンタルランド	61,200	7,920	484,704,000	
ダスキン	63,600	1,570	99,852,000	
パーク24	100,400	900	90,360,000	
明光ネットワークジャパン	17,200	724	12,452,800	
ファルコSDホールディングス	11,600	798	9,256,800	
クレスコ	5,400	588	3,175,200	
フジ・メディア・HD	2,228	133,000	296,324,000	
秀英予備校	4,100	373	1,529,300	
田谷	900	667	600,300	
ラウンドワン	57,700	461	26,599,700	
リゾートトラスト	34,900	1,406	49,069,400	
オービック	7,370	16,440	121,162,800	
ティーディーシーソフトウェア	4,900	756	3,704,400	
ヤフー	15,661	30,650	480,009,650	
ビー・エム・エル	13,400	2,249	30,136,600	
ワタベウェディング	6,800	903	6,140,400	
トレンドマイクロ	94,400	2,590	244,496,000	
もしもしホットライン	14,150	1,861	26,333,150	
東急コミュニティー	5,900	2,514	14,832,600	
リソー教育	2,319	5,290	12,267,510	
日本オラクル	34,200	3,785	129,447,000	
アルファシステムズ	5,900	1,434	8,460,600	
フューチャーアーキテクト	260	40,250	10,465,000	
ウェアハウス	5,500	300	1,650,000	
シーエーシー	13,200	663	8,751,600	
ソフトバンク・テクノ	5,300	717	3,800,100	
トーセ	4,100	579	2,373,900	
ユー・エス・エス	29,540	6,940	205,007,600	
オービックビジネスC	5,450	5,140	28,013,000	
日立ビジネスソリュー	7,100	780	5,538,000	
伊藤忠テクノソリュー	30,300	2,927	88,688,100	
アイティフォー	24,100	292	7,037,200	
東京個別指導学院	16,700	238	3,974,600	
東計電算	4,100	1,178	4,829,800	
カルチュア・コンビニエンス	117,600	598	70,324,800	
エクスネット	18	137,000	2,466,000	
テー・オー・ダブリュー	6,500	495	3,217,500	
大塚商会	17,000	5,710	97,070,000	
総合メディカル	4,700	2,422	11,383,400	
サイボウズ	283	24,040	6,803,320	
ソフトブレーン	328	7,800	2,558,400	
アグレックス	5,500	839	4,614,500	
セントラルスポーツ	7,500	921	6,907,500	
電通国際情報S	13,300	644	8,565,200	
ウェザーニューズ	4,800	1,873	8,990,400	

C I J	20,700	279	5,775,300	
フルキャストホールディングス	212	35,500	7,526,000	
富士フイルムH L D G S	485,100	2,982	1,446,568,200	
コニカミノルタH L D G S	572,500	779	445,977,500	

[次へ](#)

平成23年2月7日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
資 生 堂	377,000	1,660	625,820,000	
ライオン	262,000	443	116,066,000	
高砂香料	75,000	539	40,425,000	
マンダム	22,800	2,167	49,407,600	
ミルボン	12,200	2,150	26,230,000	
ファンケル	43,900	1,204	52,855,600	
コーセー	40,800	2,187	89,229,600	
ドクターシーラボ	151	312,500	47,187,500	
ポーラ・オルビスHD	20,200	1,728	34,905,600	
エステー	11,100	982	10,900,200	
コ ニ シ	18,000	1,097	19,746,000	
長谷川香料	29,000	1,376	39,904,000	
小林製薬	31,500	3,885	122,377,500	
荒川化学工業	17,900	888	15,895,200	
メック	15,100	458	6,915,800	
日本高純度化学	65	267,000	17,355,000	
荏原ユージライト	3,400	2,180	7,412,000	
アース製薬	16,400	2,780	45,592,000	
イハラケミカル	43,000	315	13,545,000	
北興化学	11,000	298	3,278,000	
大成ラミック	6,600	2,435	16,071,000	
クミアイ化学	47,000	289	13,583,000	
日本農薬	47,000	463	21,761,000	
昭和シエル石油	203,200	705	143,256,000	
コスモ石油	628,000	277	173,956,000	
富士興産	83,000	84	6,972,000	
ニチレキ	30,000	344	10,320,000	
東燃ゼネラル石油	342,000	941	321,822,000	
ユシロ化学	11,400	1,411	16,085,400	
ビーピー・カストロール	10,400	340	3,536,000	
AOCホールディングス	57,900	521	30,165,900	
出光興産	26,900	8,820	237,258,000	
JXホールディングス	2,519,900	582	1,466,581,800	
横浜ゴム	254,000	426	108,204,000	
東洋ゴム	188,000	204	38,352,000	
ブリヂストン	711,600	1,628	1,158,484,800	
住友ゴム	159,200	876	139,459,200	
藤倉ゴム	14,600	405	5,913,000	
オカモト	87,000	327	28,449,000	
アキレス	185,000	126	23,310,000	
フ コ ク	9,600	943	9,052,800	
ニッタ	20,400	1,700	34,680,000	
クリエートメディック	7,400	854	6,319,600	
東海ゴム工業	35,000	1,115	39,025,000	

三ツ星ベルト	59,000	522	30,798,000	
バンドー化学	81,000	373	30,213,000	
鬼怒川ゴム	54,000	479	25,866,000	
旭硝子	1,119,000	1,093	1,223,067,000	
日本板硝子	974,000	212	206,488,000	
石塚硝子	31,000	180	5,580,000	
有沢製作所	35,400	470	16,638,000	
日本山村硝子	99,000	252	24,948,000	
日本電気硝子	469,000	1,293	606,417,000	
オハラ	8,700	1,098	9,552,600	
住友大阪セメント	433,000	194	84,002,000	
太平洋セメント	961,000	113	108,593,000	
デイ・シイ	24,300	162	3,936,600	
リゾートソリューション	21,000	161	3,381,000	
日本ヒュ－ム	20,000	286	5,720,000	
日本コンクリート	38,000	163	6,194,000	
東海カーボン	213,000	503	107,139,000	
日本カーボン	112,000	256	28,672,000	
東洋炭素	12,600	4,675	58,905,000	
ノリタケ	118,000	344	40,592,000	
TOTO	326,000	642	209,292,000	
日本碍子	273,000	1,465	399,945,000	
日本特殊陶業	201,000	1,219	245,019,000	
ダントーホールディングス	37,000	80	2,960,000	
MARUWA	5,200	2,577	13,400,400	
品川リフラクトリーズ	58,000	285	16,530,000	
黒崎播磨	49,000	372	18,228,000	
東京窯業	13,000	224	2,912,000	
ニッカトー	8,800	420	3,696,000	
フジミインコーポレーテッド	20,900	1,317	27,525,300	
エーアンドエーマテリアル	50,000	57	2,850,000	
ニチアス	110,000	476	52,360,000	
新日本製鐵	5,957,000	309	1,840,713,000	
住友金属工業	4,206,000	219	921,114,000	
神戸製鋼所	3,146,000	224	704,704,000	
日新製鋼	870,000	177	153,990,000	
中山製鋼所	116,000	125	14,500,000	
合同製鐵	127,000	181	22,987,000	
JFEホールディングス	537,700	2,742	1,474,373,400	
東京製鐵	125,200	909	113,806,800	
共英製鋼	24,200	1,322	31,992,400	
大和工業	51,800	2,687	139,186,600	
東京鐵鋼	47,000	260	12,220,000	
大阪製鐵	14,300	1,448	20,706,400	
淀川製鋼所	174,000	362	62,988,000	
東洋鋼鈑	54,000	549	29,646,000	
住友鋼管	15,600	680	10,608,000	
丸一鋼管	76,000	1,861	141,436,000	

モリ工業	38,000	416	15,808,000	
大同特殊鋼	380,000	534	202,920,000	
日本高周波	90,000	110	9,900,000	
日本金属工業	167,000	110	18,370,000	
日本冶金工	117,000	249	29,133,000	
山陽特殊鋼	112,000	536	60,032,000	
愛知製鋼	120,000	603	72,360,000	
日立金属	148,000	1,113	164,724,000	
日本金属	59,000	179	10,561,000	
大平洋金属	158,000	744	117,552,000	
日本電工	89,000	652	58,028,000	
栗本鉄工所	118,000	130	15,340,000	
旭テック	160,000	33	5,280,000	
日本鑄鉄管	26,000	131	3,406,000	
日本製鋼所	350,000	881	308,350,000	
三菱製鋼	137,000	295	40,415,000	
日亜鋼業	32,000	227	7,264,000	
日本精線	18,000	521	9,378,000	
日本軽金属	514,000	185	95,090,000	
大紀アルミニウム	36,000	277	9,972,000	
三井金属	656,000	312	204,672,000	
東邦亜鉛	128,000	449	57,472,000	
三菱マテリアル	1,417,000	271	384,007,000	
住友鉱山	626,000	1,442	902,692,000	
D O W Aホールディングス	271,000	619	167,749,000	
古河機金	383,000	101	38,683,000	
大阪チタニウム	24,800	5,870	145,576,000	
東邦チタニウム	36,900	2,523	93,098,700	
住友軽金属	378,000	114	43,092,000	
古河スカイ	92,000	269	24,748,000	
古河電工	714,000	394	281,316,000	
住友電工	801,900	1,216	975,110,400	
フジクラ	340,000	415	141,100,000	
昭和電線H L D G S	273,000	98	26,754,000	
東京特殊電線	34,000	88	2,992,000	
タツタ電線	44,000	294	12,936,000	
日立電線	178,000	232	41,296,000	
沖 電 線	25,000	156	3,900,000	
カナレ電気	2,800	1,206	3,376,800	
平河ヒューテック	4,600	745	3,427,000	
リョービ	127,000	362	45,974,000	
アサヒHD	31,800	1,746	55,522,800	
東洋製罐	160,400	1,593	255,517,200	
ホッカンホールディングス	55,000	267	14,685,000	
コロナ	10,500	852	8,946,000	
横河ブリッジH L D G S	41,000	527	21,607,000	
日本橋梁	9,150	187	1,711,050	
駒井ハルテック	45,000	222	9,990,000	

サクラダ	205,000	18	3,690,000	
高田機工	23,000	215	4,945,000	
三和ホールディングス	228,000	266	60,648,000	
文化シャツタ -	59,000	217	12,803,000	
東洋シャツタ -	5,000	378	1,890,000	
住生活グループ	274,100	1,814	497,217,400	
日本ファイルコン	16,900	425	7,182,500	
ノーリツ	41,200	1,348	55,537,600	
長府製作所	21,900	1,918	42,004,200	
リンナイ	36,600	5,270	192,882,000	
ユニプレス	27,500	1,752	48,180,000	
ダイニチ工業	11,800	583	6,879,400	
日東精工	33,000	280	9,240,000	
三洋工業	31,000	114	3,534,000	
岡 部	49,000	426	20,874,000	
日立ツール	13,200	927	12,236,400	
中国工業	37,000	96	3,552,000	
東 プ レ	43,800	697	30,528,600	
高周波熱錬	30,400	731	22,222,400	
東京製綱	155,000	288	44,640,000	
バイオラックス	9,800	1,918	18,796,400	
日本発条	164,000	961	157,604,000	
中央発條	29,000	349	10,121,000	
アドパネクス	43,000	98	4,214,000	
三浦工業	36,600	2,339	85,607,400	
タ ク マ	83,000	287	23,821,000	
ツ ガ ミ	64,000	598	38,272,000	
オークマ	148,000	739	109,372,000	
東芝機械	135,000	494	66,690,000	
ア マ ダ	320,000	712	227,840,000	
アイダエンジニア	58,800	406	23,872,800	
牧野フライス	105,000	735	77,175,000	
オーエスジー	100,000	1,197	119,700,000	
ダイジェット	22,000	131	2,882,000	
旭ダイヤモンド	48,000	1,585	76,080,000	
森精機製作所	119,600	1,043	124,742,800	
ディスコ	22,900	5,760	131,904,000	
日東工器	13,300	2,113	28,102,900	
豊田自動織機	197,400	2,613	515,806,200	
豊和工業	119,000	83	9,877,000	
大阪機工	77,000	126	9,702,000	
石川製作所	49,000	78	3,822,000	
東洋機械金属	18,600	277	5,152,200	
オ - エム製作所	20,000	455	9,100,000	
津田駒工業	55,000	192	10,560,000	
エンシュウ	52,000	106	5,512,000	
島精機製作所	29,600	2,028	60,028,800	
日阪製作所	29,000	1,184	34,336,000	

やまびこ	9,000	923	8,307,000	
ペガサスミシン製造	22,500	269	6,052,500	
ナプテスコ	85,600	1,997	170,943,200	
三井海洋開発	18,700	1,503	28,106,100	
レオン自動機	22,000	216	4,752,000	
S M C	67,700	14,720	996,544,000	
新川	16,200	906	14,677,200	
ホソカワミクロン	38,000	378	14,364,000	
ユニオンツール	14,000	2,052	28,728,000	
オイレス工業	22,900	1,684	38,563,600	
サトー	21,600	1,059	22,874,400	
日本エアーテック	7,200	406	2,923,200	
日精樹脂工業	18,500	307	5,679,500	
ワイエイシイ	9,800	704	6,899,200	
小松製作所	1,075,900	2,552	2,745,696,800	
住友重機械	579,000	598	346,242,000	
日立建機	101,400	1,993	202,090,200	
日 工	18,000	285	5,130,000	
巴工業	8,600	1,453	12,495,800	
井関農機	232,000	234	54,288,000	
T O W A	21,800	683	14,889,400	
丸山製作所	52,000	182	9,464,000	
北川鉄工所	105,000	162	17,010,000	
シンニッタン	21,600	424	9,158,400	
クボタ	952,000	855	813,960,000	
荏原実業	5,800	1,166	6,762,800	
東洋エンジニア	143,000	323	46,189,000	
三菱化工機	70,000	186	13,020,000	
月島機械	37,000	748	27,676,000	
帝国電機製作所	7,700	1,908	14,691,600	
東京機械	69,000	77	5,313,000	
新東工業	45,700	856	39,119,200	
渋谷工業	13,000	812	10,556,000	
アイチ コーポレーション	37,900	376	14,250,400	
小森コーポレーション	59,800	906	54,178,800	
鶴見製作所	14,000	588	8,232,000	
住友精密	40,000	517	20,680,000	
酒井重工業	45,000	163	7,335,000	
荏原製作所	398,000	450	179,100,000	
石井鉄工所	34,000	174	5,916,000	
西島製作所	26,200	1,686	44,173,200	
千代田化工建	158,000	749	118,342,000	
ダイキン工業	236,800	2,919	691,219,200	
オルガノ	39,000	649	25,311,000	
ト - ヨ - カネツ	122,000	154	18,788,000	
栗田工業	125,200	2,440	305,488,000	
椿本チエイン	116,000	484	56,144,000	
大同工業	45,000	196	8,820,000	

日本コンベヤ	73,000	89	6,497,000	
日 機 装	76,000	697	52,972,000	
木村化工機	20,800	664	13,811,200	
新興プランテック	46,700	830	38,761,000	
アネスト岩田	40,000	400	16,000,000	
ダイフク	92,000	612	56,304,000	
加藤製作所	53,000	208	11,024,000	
油研工業	40,000	187	7,480,000	
タダノ	96,000	445	42,720,000	
フジテック	64,000	439	28,096,000	
シーケーディ	60,700	907	55,054,900	
キトー	65	101,400	6,591,000	
平和	47,100	1,333	62,784,300	
理想科学工業	16,900	1,415	23,913,500	
S A N K Y O	65,700	4,615	303,205,500	
日本金銭機械	20,100	648	13,024,800	
マースエンジニアリング	10,700	1,467	15,696,900	
福島工業	6,900	1,034	7,134,600	
オーイズミ	7,800	364	2,839,200	
ダイコク電機	9,000	1,028	9,252,000	
ア マ ノ	60,300	799	48,179,700	
J U K I	131,000	176	23,056,000	
サンデン	123,000	416	51,168,000	
蛇の目ミシン	210,000	78	16,380,000	
ブラザー工業	280,200	1,328	372,105,600	
マックス	38,000	1,009	38,342,000	
モリタホールディングス	38,000	566	21,508,000	
グローリー	60,100	1,939	116,533,900	
大和冷機工業	31,000	461	14,291,000	
セガサミーホールディングス	215,100	1,796	386,319,600	
日本ピストンリング	85,000	240	20,400,000	
リ ケ ン	86,000	403	34,658,000	
帝国ピストン	26,300	975	25,642,500	
ホシザキ電機	43,700	1,582	69,133,400	
大豊工業	15,300	906	13,861,800	
日本精工	482,000	830	400,060,000	
N T N	502,000	461	231,422,000	
ジェイテクト	230,300	1,208	278,202,400	
不 二 越	218,000	407	88,726,000	
ミネベア	322,000	501	161,322,000	
日本トムソン	74,000	729	53,946,000	
T H K	144,100	2,293	330,421,300	
ユーシン精機	10,900	1,690	18,421,000	
前澤給装工業	8,600	1,055	9,073,000	
イーグル工業	27,000	1,039	28,053,000	
前澤工業	14,700	280	4,116,000	
日本ピラ - 工業	24,000	735	17,640,000	
キッツ	89,100	386	34,392,600	

日 立	4,867,000	498	2,423,766,000	
東 芝	4,279,000	523	2,237,917,000	
三菱電機	2,168,000	1,008	2,185,344,000	
富士電機H L D G S	653,000	281	183,493,000	
東洋電機製造	35,000	534	18,690,000	
安川電機	238,000	922	219,436,000	
シンフォニア テクノロジー	131,000	285	37,335,000	
明 電 舎	215,000	404	86,860,000	
オリジン電気	29,000	556	16,124,000	
デンヨー	20,600	714	14,708,400	
日立工機	58,000	828	48,024,000	
三桜工業	25,100	838	21,033,800	
マキタ	141,400	3,785	535,199,000	
東芝テック	136,000	394	53,584,000	
芝浦メカトロニクス	38,000	323	12,274,000	
マブチモーター	31,000	4,140	128,340,000	
日本電産	107,400	8,100	869,940,000	
高岳製作所	86,000	505	43,430,000	
ダイヘン	119,000	385	45,815,000	
J V C ケンウッドH D	80,600	407	32,804,200	
日新電機	36,000	607	21,852,000	
大崎電気	31,000	858	26,598,000	
オムロン	241,400	2,240	540,736,000	
日東工業	32,700	985	32,209,500	
I D E C	25,900	794	20,564,600	
エルピーダメモリ	191,200	1,292	247,030,400	
ジーエス・ユアサ コーポ	418,000	585	244,530,000	
サクサホールディングス	55,000	167	9,185,000	
メルコホールディングス	12,000	3,145	37,740,000	
テクノメディカ	13	295,000	3,835,000	
日本電気	2,805,000	238	667,590,000	
富 士 通	2,090,000	531	1,109,790,000	
沖 電 気	790,000	72	56,880,000	
岩崎通信機	99,000	71	7,029,000	
電気興業	67,000	426	28,542,000	
サンケン電気	127,000	460	58,420,000	
ナカヨ通信機	18,000	218	3,924,000	
アイホン	14,100	1,261	17,780,100	
ルネサスエレクトロニクス	56,200	921	51,760,200	
セイコーエプソン	147,900	1,373	203,066,700	
ワコム	426	133,800	56,998,800	
アルバック	39,900	2,019	80,558,100	
アクセル	7,500	2,256	16,920,000	
ピクセラ	9,100	267	2,429,700	
ナナオ	18,400	2,042	37,572,800	
日本信号	50,500	724	36,562,000	
京三製作所	47,000	464	21,808,000	
能美防災	29,000	544	15,776,000	

ホーチキ	20,000	426	8,520,000	
マスプロ電工	15,200	795	12,084,000	
日本無線	65,000	245	15,925,000	
パナソニック	2,146,900	1,082	2,322,945,800	
シャープ	972,000	885	860,220,000	
アンリツ	95,000	726	68,970,000	
富士通ゼネラル	51,000	521	26,571,000	
日立国際電気	50,000	745	37,250,000	
ソ ニ ー	1,217,400	2,872	3,496,372,800	
T D K	122,100	5,860	715,506,000	
帝国通信工業	54,000	200	10,800,000	
三洋電機	1,659,000	123	204,057,000	
宮越商事	6,400	328	2,099,200	
ミツミ電機	76,600	1,353	103,639,800	
タムラ製作所	66,000	253	16,698,000	
アルプス電気	171,000	1,088	186,048,000	
池上通信機	70,000	67	4,690,000	
パイオニア	307,200	379	116,428,800	
日本電波工業	16,800	1,562	26,241,600	
日本トリム	2,550	1,804	4,600,200	
ローランド ディー . ジー .	9,700	1,318	12,784,600	
日本コロムビア	175,000	49	8,575,000	
山水電気	1,393,000	3	4,179,000	
フオスタ - 電機	20,500	2,260	46,330,000	
クラリオン	114,000	168	19,152,000	
S M K	64,000	459	29,376,000	
ヨコオ	18,400	663	12,199,200	
東 光	92,000	191	17,572,000	
ティアック	120,000	44	5,280,000	
ホシデン	53,800	931	50,087,800	
ヒロセ電機	35,000	9,090	318,150,000	
日本航空電子	50,000	621	31,050,000	
T O A	27,000	457	12,339,000	
ユニデン	64,000	265	16,960,000	
アルパイン	42,200	1,164	49,120,800	
スミダコーポレーション	13,400	989	13,252,600	
アイコム	12,100	2,310	27,951,000	
船井電機	19,400	2,674	51,875,600	
横河電機	217,200	720	156,384,000	
新電元工業	77,000	481	37,037,000	
山武	60,700	2,037	123,645,900	
日本光電工業	40,200	1,801	72,400,200	
チ ノ ー	43,000	217	9,331,000	
共和電業	3,000	277	831,000	
日本電子材料	9,400	588	5,527,200	
堀場製作所	37,300	2,392	89,221,600	
アドバンテスト	147,800	1,751	258,797,800	
小野測器	23,000	265	6,095,000	

エスベック	22,600	676	15,277,600	
パナソニック電工 S U N X	19,300	479	9,244,700	
キーエンス	48,400	22,500	1,089,000,000	
日置電機	10,600	1,693	17,945,800	
シスメックス	38,100	5,400	205,740,000	
メガチップス	19,400	1,781	34,551,400	
O B A R A	15,500	1,077	16,693,500	
日本電産コパル電子	22,500	677	15,232,500	
ミヤチテクノス	11,400	751	8,561,400	
東京電波	6,400	745	4,768,000	
澤藤電機	14,000	311	4,354,000	
デンソー	476,200	3,060	1,457,172,000	
コーセル	28,900	1,312	37,916,800	
日立メディコ	16,000	832	13,312,000	
新日本無線	16,000	290	4,640,000	
オプテックス	15,000	1,219	18,285,000	
千代田インテグレ	8,600	1,368	11,764,800	
東光電気	14,000	590	8,260,000	
スタンレー電気	146,500	1,421	208,176,500	
岩崎電気	80,000	169	13,520,000	
ウシオ電機	131,600	1,692	222,667,200	
岡谷電機	12,500	396	4,950,000	
ヘリオステクノH	20,100	248	4,984,800	
日本セラミック	14,200	1,500	21,300,000	
新神戸電機	17,000	1,055	17,935,000	
日本デジタル研究所	18,300	932	17,055,600	
古河電池	15,000	604	9,060,000	
双信電機	10,600	512	5,427,200	
山一電機	22,000	345	7,590,000	
図 研	15,100	664	10,026,400	
日本電子	81,000	288	23,328,000	
カ シ オ	206,700	671	138,695,700	
ファナック	225,800	12,380	2,795,404,000	
日本シイエムケイ	42,400	440	18,656,000	
エンプラス	10,900	1,194	13,014,600	
ロ ー ム	108,600	5,430	589,698,000	
浜松ホトニクス	84,600	3,130	264,798,000	
三井ハイテック	25,800	480	12,384,000	
新光電気工業	54,500	980	53,410,000	
京 セ ラ	180,300	8,820	1,590,246,000	
協栄産業	24,000	191	4,584,000	
太陽誘電	97,000	1,297	125,809,000	
村田製作所	227,500	5,910	1,344,525,000	
ユーシン	25,900	685	17,741,500	
双葉電子工業	37,100	1,648	61,140,800	
日東電工	187,100	4,700	879,370,000	
北陸電気工業	88,000	182	16,016,000	
パナソニック電工	203,000	992	201,376,000	

東海理化電機	50,700	1,587	80,460,900	
ニチコン	68,300	1,204	82,233,200	
日本ケミコン	134,000	440	58,960,000	
K O A	27,200	974	26,492,800	
三井造船	840,000	224	188,160,000	
日立造船	912,500	129	117,712,500	
佐世保重工業	142,000	197	27,974,000	
三菱重工業	3,634,000	340	1,235,560,000	
川崎重工業	1,687,000	328	553,336,000	
I H I	1,482,000	208	308,256,000	
日本車輛	79,000	461	36,419,000	
日本輸送機	27,000	226	6,102,000	
近畿車輛	33,000	474	15,642,000	
日産自動車	2,739,100	867	2,374,799,700	
いすゞ自動車	1,256,000	390	489,840,000	
トヨタ自動車	2,785,800	3,490	9,722,442,000	*
日野自動車	271,000	452	122,492,000	
三菱自動車工業	4,475,000	119	532,525,000	
エフテック	7,500	1,649	12,367,500	
武蔵精密工業	21,000	2,101	44,121,000	
トヨタ車体	39,400	1,527	60,163,800	
日産車体	85,000	725	61,625,000	
関東自動車	32,900	679	22,339,100	
新明和工業	97,000	368	35,696,000	
極東開発工業	41,000	400	16,400,000	
日信工業	44,100	1,552	68,443,200	
トピー工業	178,000	231	41,118,000	
ティラド	71,000	394	27,974,000	
曙ブレーキ	100,800	568	57,254,400	
タチエス	28,300	1,484	41,997,200	
N O K	104,800	1,657	173,653,600	
フタバ産業	61,300	644	39,477,200	
カヤバ工業	135,000	723	97,605,000	
シロキ工業	48,000	328	15,744,000	
市光工業	52,000	283	14,716,000	
大同メタル工業	33,000	792	26,136,000	
プレス工業	100,000	451	45,100,000	
カルソニックカンセイ	110,000	375	41,250,000	
太平洋工業	44,000	530	23,320,000	
ケーヒン	44,800	1,820	81,536,000	
河西工業	27,000	589	15,903,000	
アイシン精機	178,500	3,180	567,630,000	
富士機工	25,000	379	9,475,000	
マ ッ ダ	1,678,000	218	365,804,000	
ダイハツ	230,000	1,322	304,060,000	
愛知機械	49,000	401	19,649,000	
今仙電機製作所	14,700	1,295	19,036,500	
本田技研	1,829,400	3,510	6,421,194,000	

スズキ	453,300	1,987	900,707,100	
富士重工業	685,000	721	493,885,000	
ヤマハ発動機	329,600	1,544	508,902,400	
ショーワ	46,100	715	32,961,500	
小糸製作所	108,000	1,445	156,060,000	
T B K	22,000	523	11,506,000	
エクセディ	26,200	2,819	73,857,800	
ミツバ	40,000	796	31,840,000	
豊田合成	61,200	1,834	112,240,800	
愛三工業	26,200	802	21,012,400	
ヨ ロ ズ	13,000	1,596	20,748,000	
エフ・シー・シー	31,900	2,008	64,055,200	
新家工業	53,000	133	7,049,000	
シマノ	89,400	4,130	369,222,000	
タカタ	33,600	2,702	90,787,200	
テイ・エス テック	41,200	1,719	70,822,800	
小 野 建	18,700	760	14,212,000	
はるやま商事	10,200	469	4,783,800	
佐島電機	14,500	628	9,106,000	
カップクリエイト	15,750	2,000	31,500,000	
エコートレーディング	5,500	834	4,587,000	
伯東	13,100	909	11,907,900	
中山福	13,000	605	7,865,000	
ライトオン	16,000	455	7,280,000	
ナガイレーベン	11,600	2,078	24,104,800	
ジーンズメイト	6,700	292	1,956,400	
菱食	20,800	1,863	38,750,400	
良品計画	24,500	3,780	92,610,000	
三城ホールディングス	26,500	875	23,187,500	
松田産業	15,700	1,401	21,995,700	
メディバルHD	197,400	756	149,234,400	
アドヴァン	13,100	679	8,894,900	
S P K	4,800	1,273	6,110,400	
アズワン	14,000	1,784	24,976,000	
スズデン	7,600	531	4,035,600	
尾家産業	6,800	797	5,419,600	
シモジマ	14,900	1,039	15,481,100	
ドウシシャ	10,200	1,942	19,808,400	
コナカ	25,000	440	11,000,000	
高速	13,100	756	9,903,600	
ハウス ローゼ	2,000	1,278	2,556,000	
G - 7ホールディングス	5,600	530	2,968,000	
イオン北海道	16,400	315	5,166,000	
コ ジ マ	25,900	542	14,037,800	
コーナン商事	20,700	1,181	24,446,700	
黒田電気	28,600	1,144	32,718,400	
ネットワンシステムズ	521	133,000	69,293,000	
エコス	7,400	471	3,485,400	

ワタミ	25,300	1,713	43,338,900	
マルシェ	6,400	704	4,505,600	
ドン・キホーテ	41,400	2,841	117,617,400	
丸文	17,100	537	9,182,700	
メガネトップ	22,400	839	18,793,600	
西松屋チェーン	46,800	755	35,334,000	
ゼンショー	81,500	862	70,253,000	
ハピネット	5,700	1,059	6,036,300	
幸楽苑	13,500	1,252	16,902,000	
トーメンエレクトロニクス	8,800	1,389	12,223,200	
ハークスレイ	6,000	515	3,090,000	
サイゼリヤ	28,100	1,608	45,184,800	
エクセル	10,400	1,068	11,107,200	
マルカキカイ	7,200	635	4,572,000	
アルゴグラフィックス	8,100	1,100	8,910,000	
ガリバーインターナショナル	5,750	3,640	20,930,000	
日本エム・ディ・エム	19,000	229	4,351,000	
ポプラ	6,600	484	3,194,400	
ユナイテッドアローズ	20,200	1,308	26,421,600	
進和	11,800	994	11,729,200	
エスケイジャパン	5,900	289	1,705,100	
ダイトエレクトロン	9,200	665	6,118,000	
ハイデイ日高	9,500	1,413	13,423,500	
シークス	13,500	1,045	14,107,500	
京都きもの友禅	13,900	940	13,066,000	
コロワイド	71,000	490	34,790,000	
田中商事	7,400	333	2,464,200	
オーハシテクニカ	12,200	630	7,686,000	
壺番屋	7,700	2,397	18,456,900	
マクニカ	9,800	2,166	21,226,800	
白銅	7,100	956	6,787,600	
トップカルチャー	8,100	386	3,126,600	
スギホールディングス	34,100	2,020	68,882,000	
島津製作所	259,000	660	170,940,000	
J M S	34,000	299	10,166,000	
クボテック	48	33,400	1,603,200	
モリテックス	4,800	431	2,068,800	
長野計器	14,500	757	10,976,500	
スター精密	41,400	988	40,903,200	
東京計器	77,000	128	9,856,000	
愛知時計	7,000	234	1,638,000	
日本電産トーソク	13,200	872	11,510,400	
東京精密	41,700	1,370	57,129,000	
ニコン	377,800	1,998	754,844,400	
トプコン	50,100	461	23,096,100	
オリンパス	255,700	2,458	628,510,600	
理研計器	17,800	796	14,168,800	
大日本スクリーン	239,000	798	190,722,000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年2月7日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
キヤノン電子	19,900	2,396	47,680,400	
タムロン	21,000	1,679	35,259,000	
H O Y A	497,900	2,035	1,013,226,500	
ノーリツ鋼機	19,700	522	10,283,400	
エー・アンド・デイ	21,300	356	7,582,800	
キヤノン	1,347,000	3,940	5,307,180,000	
リ コ ー	652,000	1,076	701,552,000	
日本電産コパル	17,100	1,287	22,007,700	
日本電産サンキョー	51,000	681	34,731,000	
シチズンホールディングス	235,800	556	131,104,800	
リズム時計	108,000	138	14,904,000	
S R I スポーツ	139	93,200	12,954,800	
バンダイナムコH L D G S	252,600	964	243,506,400	
共立印刷	20,600	133	2,739,800	
フランスベッドH L D G S	146,000	113	16,498,000	
パイロットコーポレーション	205	159,900	32,779,500	
エイベックス・グループH D	40,400	1,199	48,439,600	
トッパン・フォームズ	46,500	826	38,409,000	
フジシールインターナショナル	22,300	1,865	41,589,500	
タカラトミー	64,700	682	44,125,400	
廣済堂	17,700	122	2,159,400	
アーク	73,000	156	11,388,000	
レック	6,000	1,580	9,480,000	
アロン化成	17,000	393	6,681,000	
タカノ	8,700	534	4,645,800	
プロネクス	24,200	446	10,793,200	
ホクシン	17,300	115	1,989,500	
ウッドワン	37,000	296	10,952,000	
大建工業	90,000	233	20,970,000	
き も と	20,300	761	15,448,300	
凸版印刷	612,000	766	468,792,000	
大日本印刷	660,000	1,127	743,820,000	
図書印刷	37,000	158	5,846,000	
共同印刷	68,000	195	13,260,000	
日本写真印刷	39,400	2,085	82,149,000	
光村印刷	3,000	294	882,000	
藤森工業	16,300	1,352	22,037,600	
宝印刷	9,200	674	6,200,800	
前澤化成工業	16,400	766	12,562,400	
アシックス	202,000	1,139	230,078,000	
ツ ツ ミ	9,500	2,256	21,432,000	
ジェイ エス ピー	14,800	1,506	22,288,800	
ニ チ ハ	22,800	835	19,038,000	
ローランド	20,700	980	20,286,000	

エフピコ	11,200	4,990	55,888,000	
小松ウオール工業	8,300	802	6,656,600	
ヤマハ	172,700	1,110	191,697,000	
河合楽器	80,000	199	15,920,000	
クリナップ	22,400	676	15,142,400	
ビジョン	15,000	2,456	36,840,000	
天馬	20,300	880	17,864,000	
パラマウントベッド	17,100	2,159	36,918,900	
兼松日産農林	34,000	132	4,488,000	
キングジム	16,700	630	10,521,000	
リンテック	46,400	2,360	109,504,000	
田崎真珠	42,000	78	3,276,000	
信越ポリマー	44,600	545	24,307,000	
東 リ	61,000	161	9,821,000	
イトーキ	46,400	231	10,718,400	
任 天 堂	124,000	22,890	2,838,360,000	
三菱鉛筆	18,500	1,357	25,104,500	
タカラスタンダ - ド	101,000	533	53,833,000	
コ ク ヨ	112,700	701	79,002,700	
ナカバヤシ	47,000	181	8,507,000	
ニ フ コ	43,400	2,258	97,997,200	
グローブライド	99,000	110	10,890,000	
岡村製作所	83,000	522	43,326,000	
日本バルカー	95,000	279	26,505,000	
M U T O Hホールディングス	26,000	220	5,720,000	
伊 藤 忠	1,494,000	895	1,337,130,000	
丸 紅	1,872,000	667	1,248,624,000	
スクロール	30,200	370	11,174,000	
高 島	38,000	141	5,358,000	
F & A アクアホールディングス	16,800	845	14,196,000	
三陽商会	110,000	314	34,540,000	
長瀬産業	121,000	1,091	132,011,000	
ナイガイ	65,000	47	3,055,000	
蝶 理	144,000	116	16,704,000	
豊田通商	238,700	1,563	373,088,100	
オンワ - ドホールディングス	151,000	772	116,572,000	
三共生興	36,700	326	11,964,200	
兼 松	485,000	92	44,620,000	
美 津 濃	107,000	413	44,191,000	
ツカモトコーポレーション	38,000	95	3,610,000	
ファミリーマート	72,300	3,090	223,407,000	
ルック	37,000	143	5,291,000	
三井物産	1,847,300	1,486	2,745,087,800	
日本紙パルプ	122,000	327	39,894,000	
東京エレクトロン	170,200	5,490	934,398,000	
日立ハイテクノロジーズ	64,900	2,114	137,198,600	
カメイ	26,000	404	10,504,000	
東都水産	36,000	164	5,904,000	

スターゼン	74,000	248	18,352,000	
セイコーHD	113,000	273	30,849,000	
山 善	82,600	497	41,052,200	
椿本興業	23,000	239	5,497,000	
住友商事	1,178,900	1,266	1,492,487,400	
日本ユニシス	58,900	694	40,876,600	
内田洋行	46,000	317	14,582,000	
三菱商事	1,713,800	2,362	4,047,995,600	
第一実業	47,000	367	17,249,000	
キャノンマーケティングJPN	71,100	1,153	81,978,300	
西華産業	84,000	220	18,480,000	
佐藤商事	19,300	537	10,364,100	
菱洋エレクトロ	28,200	940	26,508,000	
東京産業	23,000	272	6,256,000	
ユアサ商事	222,000	102	22,644,000	
神鋼商事	55,000	224	12,320,000	
阪和興業	200,000	403	80,600,000	
カナデン	2,000	532	1,064,000	
菱電商事	35,000	587	20,545,000	
ニプロ	43,200	1,609	69,508,800	
フルサト工業	12,800	541	6,924,800	
岩谷産業	239,000	258	61,662,000	
すてきナイスグループ	94,000	176	16,544,000	
昭光通商	80,000	136	10,880,000	
ニチモウ	33,000	210	6,930,000	
極東貿易	29,000	175	5,075,000	
イワキ	24,000	222	5,328,000	
兼松エレクトロニクス	14,100	865	12,196,500	
三愛石油	51,000	416	21,216,000	
稲畑産業	57,500	550	31,625,000	
G S Iクレオス	56,000	136	7,616,000	
明和産業	17,800	317	5,642,600	
ゴ - ルドウィン	51,000	287	14,637,000	
東京スタイル	83,000	647	53,701,000	
ユニ・チャーム	125,300	3,270	409,731,000	
デサント	57,000	427	24,339,000	
ヤマトインタ - ナショナル	13,800	401	5,533,800	
東邦ホールディングス	65,300	1,000	65,300,000	
サンゲツ	38,000	2,006	76,228,000	
ミツウロコ	34,700	522	18,113,400	
シナネン	46,000	391	17,986,000	
伊藤忠エネクス	47,500	480	22,800,000	
ザ・トーカイ	51,000	344	17,544,000	
サンリオ	59,900	2,574	154,182,600	
サンワ テクノス	10,500	745	7,822,500	
リョーサン	34,900	2,220	77,478,000	
新光商事	20,200	748	15,109,600	
トーヨー	46,000	309	14,214,000	

三信電気	26,600	721	19,178,600	
東陽テクニカ	29,200	859	25,082,800	
モスフード サービス	28,200	1,555	43,851,000	
加賀電子	21,300	1,057	22,514,100	
三益半導体	16,700	1,033	17,251,100	
ソーダニツカ	2,000	374	748,000	
立花エレテック	13,100	760	9,956,000	
木曽路	24,600	1,739	42,779,400	
千 趣 会	38,800	531	20,602,800	
タカキュー	17,000	166	2,822,000	
ケーヨー	40,300	443	17,852,900	
ユニヘアー	24,700	867	21,414,900	
上新電機	46,000	817	37,582,000	
日本瓦斯	20,500	1,184	24,272,000	
ベスト電器	67,000	264	17,688,000	
マルエツ	44,000	329	14,476,000	
ロイヤルホールディングス	33,100	862	28,532,200	
東 天 紅	14,000	148	2,072,000	
いなげや	24,000	895	21,480,000	
島 忠	41,400	1,883	77,956,200	
チヨダ	28,100	1,180	33,158,000	
鈴 丹	5,500	166	913,000	
ライフコーポレーション	13,500	1,259	16,996,500	
カ ス ミ	44,200	469	20,729,800	
リンガーハット	16,500	1,112	18,348,000	
さ が 美	18,000	120	2,160,000	
M R M A X	21,500	295	6,342,500	
テンアライド	13,800	296	4,084,800	
A O K Iホールディングス	19,900	1,375	27,362,500	
オークワ	31,000	889	27,559,000	
コメリ	29,200	2,041	59,597,200	
青山商事	54,400	1,425	77,520,000	
しまむら	22,300	7,470	166,581,000	
C F Sコーポレーション	21,000	467	9,807,000	
高 島 屋	290,000	705	204,450,000	
松 屋	39,500	659	26,030,500	
エイチ・ツー・オーリテイリング	125,000	640	80,000,000	
丸 栄	35,000	110	3,850,000	
ニッセンHD	42,600	545	23,217,000	
パ ル コ	55,500	795	44,122,500	
丸井グループ	279,000	739	206,181,000	
クレディセゾン	162,300	1,594	258,706,200	
原信ナルスHLDGS	12,900	1,259	16,241,100	
セディナ	218,500	172	37,582,000	
井 筒 屋	115,000	65	7,475,000	
ダイエー	99,100	320	31,712,000	
イズミヤ	75,000	364	27,300,000	
イオン	754,200	1,055	795,681,000	

ユ ニ ー	173,800	845	146,861,000	
イ ズ ミ	58,600	1,262	73,953,200	
東武ストア	30,000	258	7,740,000	
平 和 堂	43,300	1,103	47,759,900	
フ ジ	23,900	1,790	42,781,000	
ヤオコー	9,400	2,560	24,064,000	
ゼビオ	25,800	1,914	49,381,200	
ケースホールディングス	49,200	2,720	133,824,000	
P a l t a c	13,100	1,489	19,505,900	
O L Y M P I C	14,600	623	9,095,800	
東日カーライフグループ	31,000	97	3,007,000	
新生銀行	1,110,000	104	115,440,000	
あおぞら銀行	778,000	183	142,374,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	16,196,600	447	7,239,880,200	
りそなホールディングス	1,320,400	436	575,694,400	
中央三井トラストＨＤ	1,229,000	336	412,944,000	
三井住友フィナンシャルＧ	1,618,500	2,909	4,708,216,500	
第四銀行	280,000	289	80,920,000	
北越銀行	241,000	188	45,308,000	
西日本シティ銀行	750,000	261	195,750,000	
札幌北洋ホール	322,300	422	136,010,600	
千葉銀行	844,000	522	440,568,000	
横浜銀行	1,466,000	421	617,186,000	
常陽銀行	830,000	372	308,760,000	
群馬銀行	500,000	494	247,000,000	
武蔵野銀行	34,900	2,549	88,960,100	
千葉興業銀行	40,800	522	21,297,600	
筑波銀行	94,700	294	27,841,800	
東京都民銀行	40,400	1,192	48,156,800	
七十七銀行	361,000	463	167,143,000	
青森銀行	172,000	255	43,860,000	
秋田銀行	147,000	260	38,220,000	
山形銀行	131,000	397	52,007,000	
岩手銀行	14,500	3,995	57,927,500	
東邦銀行	181,000	268	48,508,000	
東北銀行	121,000	137	16,577,000	
みちのく銀行	108,000	178	19,224,000	
ふくおかフィナンシャルＧ	868,000	355	308,140,000	
静岡銀行	665,000	771	512,715,000	
十六銀行	264,000	270	71,280,000	
スルガ銀行	226,000	774	174,924,000	
八十二銀行	402,000	489	196,578,000	
山梨中央銀行	131,000	445	58,295,000	
大垣共立銀行	285,000	275	78,375,000	
福井銀行	185,000	259	47,915,000	
北國銀行	245,000	282	69,090,000	
清水銀行	7,300	3,750	27,375,000	
滋賀銀行	201,000	457	91,857,000	

南都銀行	199,000	439	87,361,000	
百五銀行	193,000	375	72,375,000	
京都銀行	383,000	772	295,676,000	
三重銀行	96,000	239	22,944,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,498,000	173	259,154,000	
広島銀行	631,000	360	227,160,000	
山陰合同銀行	129,000	620	79,980,000	
中国銀行	175,000	978	171,150,000	
鳥取銀行	69,000	181	12,489,000	
伊予銀行	229,000	711	162,819,000	
百十四銀行	251,000	327	82,077,000	
四国銀行	155,000	292	45,260,000	
阿波銀行	178,000	511	90,958,000	
鹿児島銀行	138,000	555	76,590,000	
大分銀行	139,000	316	43,924,000	
宮崎銀行	143,000	228	32,604,000	
肥後銀行	168,000	477	80,136,000	
佐賀銀行	130,000	237	30,810,000	
十八銀行	137,000	261	35,757,000	
沖縄銀行	16,200	3,365	54,513,000	
琉球銀行	45,100	970	43,747,000	
住友信託	1,917,000	505	968,085,000	
みずほ信託銀行	2,034,000	84	170,856,000	
八千代銀行	11,200	2,670	29,904,000	
みずほフィナンシャルG	26,125,700	164	4,284,614,800	
紀陽ホールディングス	850,000	115	97,750,000	
山口フィナンシャルG	213,000	843	179,559,000	
フィデック	130	13,350	1,735,500	
芙蓉総合リース	20,400	3,070	62,628,000	
興銀リース	29,800	2,187	65,172,600	
東京センチュリーリース	50,200	1,559	78,261,800	
S B Iホールディングス	25,501	12,010	306,267,010	
日本証券金融	88,400	627	55,426,800	
大阪証券金融	25,100	172	4,317,200	
アイフル	176,700	84	14,842,800	
日本アジア投資	148,000	66	9,768,000	
ポケットカード	20,900	332	6,938,800	
長野銀行	76,000	190	14,440,000	
名古屋銀行	193,000	272	52,496,000	
愛知銀行	7,200	5,150	37,080,000	
第三銀行	131,000	238	31,178,000	
中京銀行	89,000	212	18,868,000	
東日本銀行	112,000	202	22,624,000	
愛媛銀行	136,000	242	32,912,000	
トマト銀行	85,000	156	13,260,000	
みなと銀行	222,000	159	35,298,000	
京葉銀行	176,000	423	74,448,000	
関西アーバン銀行	299,000	142	42,458,000	

栃木銀行	108,000	408	44,064,000	
北日本銀行	6,800	2,126	14,456,800	
東和銀行	230,000	99	22,770,000	
福島銀行	266,000	62	16,492,000	
大東銀行	138,000	72	9,936,000	
リコーリース	14,800	2,398	35,490,400	
イオン クレジットサービス	95,200	1,252	119,190,400	
N I Sグループ	160,500	9	1,444,500	
ア コ ム	43,040	1,420	61,116,800	
プロミス	108,950	666	72,560,700	
ジャックス	142,000	273	38,766,000	
日立キャピタル	50,500	1,330	67,165,000	
オリックス	111,300	8,800	979,440,000	
三菱ＵＦＪリース	54,270	3,285	178,276,950	
ジャフコ	29,300	2,539	74,392,700	
トモニホールディングス	164,200	345	56,649,000	
大和証券Ｇ本社	2,120,000	436	924,320,000	
野村ホールディングス	4,506,700	522	2,352,497,400	
みずほ証券	547,000	234	127,998,000	
みずほインベスタズ証	498,000	89	44,322,000	
岡三証券グループ	182,000	342	62,244,000	
丸三証券	68,700	476	32,701,200	
東洋証券	81,000	145	11,745,000	
東海東京ＨＤ	246,000	300	73,800,000	
光世証券	54,000	91	4,914,000	
水戸証券	58,000	141	8,178,000	
いちよし証券	48,200	627	30,221,400	
松井証券	127,000	575	73,025,000	
N K S Jホールディングス	1,790,000	581	1,039,990,000	
だいこう証券ビジ	13,200	325	4,290,000	
マネックスＧ	1,261	23,570	29,721,770	
カブドットコム証券	92,000	359	33,028,000	
極東証券	29,000	692	20,068,000	
岩井コスモホールディング	20,300	577	11,713,100	
フィデアホール	123,500	245	30,257,500	
池田泉州ＨＤ	600,600	120	72,072,000	
M S & A D	639,600	1,999	1,278,560,400	
S O N Y F H	1,025	312,000	319,800,000	
小林洋行	5,200	231	1,201,200	
第一生命	8,582	137,500	1,180,025,000	
富士火災	189,000	113	21,357,000	
東京海上ＨＤ	812,400	2,508	2,037,499,200	
アサックス	31	100,300	3,109,300	
N E Cキャピタルソリューション	5,800	1,402	8,131,600	
T & Dホールディングス	389,950	2,300	896,885,000	
三井不動産	1,009,000	1,703	1,718,327,000	
三菱地所	1,498,000	1,605	2,404,290,000	
平和不動産	162,000	270	43,740,000	

東京建物	437,000	391	170,867,000
ダイビル	63,100	706	44,548,600
サンケイビル	41,600	568	23,628,800
東急不動産	431,000	436	187,916,000
京阪神不動産	25,800	406	10,474,800
住友不動産	513,000	2,072	1,062,936,000
東宝不動産	22,800	598	13,634,400
太平洋興発	74,000	76	5,624,000
大京	359,000	177	63,543,000
テーオーシー	83,400	349	29,106,600
東京楽天地	27,000	293	7,911,000
レオパレス 2 1	128,800	137	17,645,600
フジ住宅	22,500	450	10,125,000
空港施設	22,600	385	8,701,000
明和地所	12,300	607	7,466,100
住友不動産販売	7,720	4,350	33,582,000
ゴールドクレスト	19,270	2,242	43,203,340
東栄住宅	16,300	1,273	20,749,900
日本エスリード	9,400	875	8,225,000
東急リバブル	22,700	1,064	24,152,800
飯田産業	24,200	971	23,498,200
日神不動産	12,700	646	8,204,200
アーネストワン	39,800	1,056	42,028,800
タカラレーベン	20,200	705	14,241,000
サンヨーハウジ 名古屋	93	86,800	8,072,400
イオンモール	97,600	2,173	212,084,800
フージャースコーポレーション	329	43,000	14,147,000
サンシティ	511	3,000	1,533,000
タクトホーム	97	99,300	9,632,100
ランド	22,600	21	474,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,551	90,900	140,985,900
サンフロンティア不動産	199	13,170	2,620,830
ランドビジネス	146	17,940	2,619,240
東武鉄道	926,000	458	424,108,000
相鉄ホールディングス	341,000	265	90,365,000
東京急行	1,191,000	375	446,625,000
京浜急行	557,000	681	379,317,000
小田急電鉄	695,000	779	541,405,000
京王電鉄	563,000	549	309,087,000
京成電鉄	349,000	566	197,534,000
富士急行	60,000	430	25,800,000
新京成電鉄	23,000	346	7,958,000
東日本旅客鉄道	377,000	5,330	2,009,410,000
西日本旅客鉄道	2,020	315,500	637,310,000
東海旅客鉄道	1,882	718,000	1,351,276,000
アートコーポレーション	4,600	1,594	7,332,400
西日本鉄道	282,000	345	97,290,000
ハマキョウレックス	6,200	2,700	16,740,000

サカイ引越センター	4,100	1,779	7,293,900	
近畿鉄道	1,958,000	257	503,206,000	
阪急阪神H L D G S	1,455,000	383	557,265,000	
南海電鉄	453,000	337	152,661,000	
京阪電鉄	487,000	339	165,093,000	
名糖運輸	8,700	685	5,959,500	
名古屋鉄道	757,000	222	168,054,000	
日本通運	858,000	336	288,288,000	
ヤマトホールディングス	441,200	1,268	559,441,600	
山 九	263,000	381	100,203,000	
日 新	83,000	247	20,501,000	
丸 運	13,300	219	2,912,700	
丸全昭和運輸	74,000	287	21,238,000	
センコー	87,000	283	24,621,000	
トナミホールディングス	45,000	170	7,650,000	
日本梱包運輸	65,000	975	63,375,000	
日石輸送	12,000	203	2,436,000	
福山通運	151,000	414	62,514,000	
セイノーホールディングス	168,000	580	97,440,000	
神奈川中央交通	26,000	415	10,790,000	
日立物流	37,900	1,268	48,057,200	
日本郵船	1,831,000	365	668,315,000	
商船三井	1,055,000	546	576,030,000	
川崎汽船	670,000	352	235,840,000	
N S ユナイテッド海運	78,000	205	15,990,000	
乾 汽 船	25,800	539	13,906,200	
明治海運	19,700	327	6,441,900	
飯野海運	105,000	392	41,160,000	
共栄タンカー	19,000	172	3,268,000	
第一中央汽船	142,000	202	28,684,000	
全日本空輸	2,891,000	299	864,409,000	
バスコ	25,000	270	6,750,000	
国際航業H L D G S	12,000	265	3,180,000	
三菱倉庫	154,000	1,123	172,942,000	
三井倉庫	101,000	363	36,663,000	
住友倉庫	159,000	446	70,914,000	
渋沢倉庫	57,000	285	16,245,000	
ヤマタネ	108,000	123	13,284,000	
東陽倉庫	30,000	195	5,850,000	
日本トランスシティ	46,000	323	14,858,000	
ケイヒン	41,000	100	4,100,000	
安田倉庫	19,200	503	9,657,600	
東洋埠頭	66,000	139	9,174,000	
宇徳	16,400	272	4,460,800	
上 組	240,000	700	168,000,000	
サンリツ	1,700	614	1,043,800	
キムラユニティー	4,800	714	3,427,200	
キューソー流通システム	7,400	852	6,304,800	

郵船ロジスティクス	17,100	1,204	20,588,400	
近鉄エクスプレス	19,400	2,510	48,694,000	
東海運	12,900	205	2,644,500	
バンテック	101	119,600	12,079,600	
東京放送HD	115,400	1,103	127,286,200	
日本テレビ放送網	18,780	13,550	254,469,000	
テレビ朝日	542	139,000	75,338,000	
スカパーJSATHD	1,628	31,050	50,549,400	
テレビ東京HD	9,700	1,236	11,989,200	
アイ・ティー・シーネットワーク	18,500	502	9,287,000	
イー・アクセス	1,166	49,700	57,950,200	
NECモバイリング	7,800	2,681	20,911,800	
日本電信電話	803,600	3,870	3,109,932,000	
KDDI	3,321	478,500	1,589,098,500	
光通信	27,500	2,128	58,520,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	17,690	149,300	2,641,117,000	
GMOインターネット	60,600	500	30,300,000	
学研ホールディングス	93,000	190	17,670,000	
ゼンリン	31,000	977	30,287,000	
昭文社	13,200	676	8,923,200	
角川グループHDGS	20,300	2,242	45,512,600	
インプレスホールディングス	18,300	159	2,909,700	
東京電力	1,596,000	2,064	3,294,144,000	
中部電力	667,800	2,109	1,408,390,200	
関西電力	884,900	2,088	1,847,671,200	
中国電力	299,800	1,701	509,959,800	
北陸電力	222,500	2,014	448,115,000	
東北電力	541,700	1,851	1,002,686,700	
四国電力	219,700	2,432	534,310,400	
九州電力	478,800	1,849	885,301,200	
北海道電力	203,000	1,725	350,175,000	
沖縄電力	13,000	3,860	50,180,000	
電源開発	134,500	2,527	339,881,500	
東京瓦斯	2,711,000	368	997,648,000	
大阪瓦斯	2,180,000	316	688,880,000	
東邦瓦斯	559,000	426	238,134,000	
北海道瓦斯	45,000	252	11,340,000	
西部瓦斯	245,000	212	51,940,000	
静岡瓦斯	56,500	498	28,137,000	
アイネット	10,800	477	5,151,600	
松竹	132,000	623	82,236,000	
東宝	140,100	1,348	188,854,800	
エイチ・アイ・エス	23,100	2,161	49,919,100	
東映	90,000	434	39,060,000	
葵プロモーション	7,500	480	3,600,000	
C&I HOLDINGS	136,500	5	682,500	
NTTデータ	1,510	296,400	447,564,000	
共立メンテナンス	10,200	1,430	14,586,000	

イチネンホールディングス	23,900	448	10,707,200	
建設技術研究所	13,900	478	6,644,200	
アインファーマシーズ	7,100	3,005	21,335,500	
燦ホールディングス	4,900	1,329	6,512,100	
スバル興業	3,000	241	723,000	
東京テアトル	89,000	125	11,125,000	
ホリプロ	8,100	794	6,431,400	
よみうりランド	52,000	308	16,016,000	
東京都競馬	157,000	130	20,410,000	
常磐興産	72,000	126	9,072,000	
カナモト	30,000	431	12,930,000	
東京ドーム	169,000	208	35,152,000	
D T S	20,400	1,040	21,216,000	
スクウェア・エニックス・H D	69,900	1,452	101,494,800	
シーイーシー	14,200	445	6,319,000	
カプコン	45,600	1,480	67,488,000	
東海観光	108,000	23	2,484,000	
日本空港ビルデング	68,400	1,290	88,236,000	
トランス・コスモス	29,500	825	24,337,500	
乃村工藝社	45,000	325	14,625,000	
ジャステック	13,200	498	6,573,600	
住商情報システム	21,900	1,399	30,638,100	
藤田観光	58,000	384	22,272,000	
近畿日本ツーリスト	73,000	80	5,840,000	
日本管財	8,500	1,420	12,070,000	
白 洋 舎	5,000	226	1,130,000	
セコム	235,600	3,960	932,976,000	
C S K	76,100	381	28,994,100	
日本システムウエア	8,200	381	3,124,200	
セントラル警備保障	10,500	879	9,229,500	
アイネス	29,000	701	20,329,000	
丹青社	5,000	349	1,745,000	
メイテック	33,200	1,705	56,606,000	
T K C	16,300	1,715	27,954,500	
アサツー ディ・ケイ	36,500	2,313	84,424,500	
富士ソフト	28,800	1,492	42,969,600	
応用地質	22,000	723	15,906,000	
船井総合研究所	24,300	529	12,854,700	
N S D	41,400	882	36,514,800	
進学会	12,700	317	4,025,900	
丸紅建材リース	24,000	100	2,400,000	
コナミ	98,600	1,655	163,183,000	
ベネッセホールディングス	71,600	3,630	259,908,000	
イオンディライト	25,600	1,556	39,833,600	
ナック	5,300	1,160	6,148,000	
福井コンピュータ	1,500	471	706,500	
ニチイ学館	39,400	719	28,328,600	
ダイセキ	33,500	1,566	52,461,000	

日鐵商事	48,000	282	13,536,000	
元気寿司	6,700	998	6,686,600	
トラスコ中山	27,000	1,425	38,475,000	
ヤマダ電機	97,520	6,210	605,599,200	
オートバックスセブン	27,700	3,215	89,055,500	
アークランドサカモト	12,500	1,038	12,975,000	
ニトリホールディングス	42,350	7,120	301,532,000	
グルメ杵屋	16,000	501	8,016,000	
愛 眼	17,800	463	8,241,400	
吉野家ホールディングス	582	108,800	63,321,600	
加藤産業	31,000	1,328	41,168,000	
イエローハット	20,200	942	19,028,400	
富士エレクトロニクス	12,200	1,693	20,654,600	
松屋フーズ	10,400	1,489	15,485,600	
J B C Cホールディングス	18,200	548	9,973,600	
J Kホールディングス	20,500	425	8,712,500	
サガミチェーン	26,000	476	12,376,000	
日 伝	8,900	2,340	20,826,000	
北沢産業	11,000	186	2,046,000	
杉本商事	11,800	737	8,696,600	
因幡電機産業	25,300	2,390	60,467,000	
住金物産	101,000	220	22,220,000	
ブレナス	27,000	1,430	38,610,000	
ミニストップ	15,900	1,488	23,659,200	
イマージュホールディングス	8,900	314	2,794,600	
アークス	27,400	1,313	35,976,200	
パ ロ ー	42,500	762	32,385,000	
ミスミグループ本社	72,300	2,110	152,553,000	
江守商事	4,900	864	4,233,600	
アルテック	9,100	337	3,066,700	
ベ ル ク	10,600	1,010	10,706,000	
大 庄	11,700	1,141	13,349,700	
タキヒヨー	33,000	416	13,728,000	
ファーストリテイリング	50,000	12,870	643,500,000	
ソフトバンク	947,500	2,961	2,805,547,500	
スズケン	88,500	2,268	200,718,000	
サンドラッグ	40,700	2,490	101,343,000	
ジェコス	16,500	327	5,395,500	
ヤマザワ	5,800	1,170	6,786,000	
や ま や	3,500	833	2,915,500	
ベルーナ	26,650	543	14,470,950	
合計	332,106,049		273,563,558,237	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株数
トヨタ自動車	500,000

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23年2月28日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	38,421,344,530円
負債総額	263,816,832円
純資産総額（ - ）	38,157,527,698円
発行済数量	29,858,028,389口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2780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23年2月28日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	276,342,113,170円
負債総額	105,682,000円
純資産総額（ - ）	276,236,431,170円
発行済数量	222,749,743,528口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2401円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

会社の意思決定機構

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

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

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

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

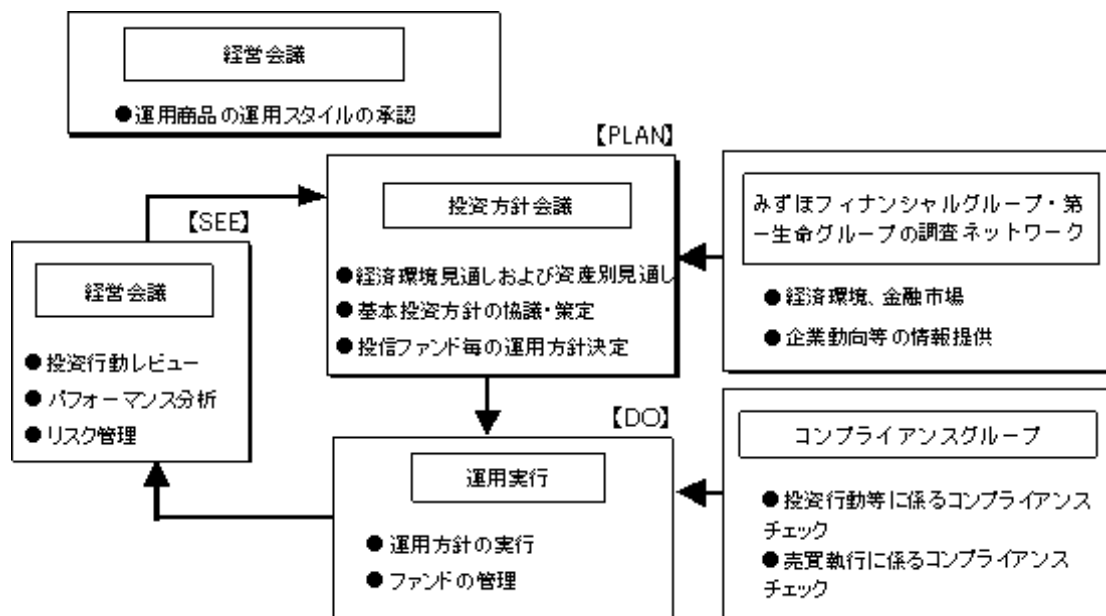
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成23年2月28日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は283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	18	76,217,626,291
追加型株式投資信託	251	4,223,166,294,931
単位型公社債投資信託	13	110,051,164,480
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	307,143,149
合計	283	4,409,742,228,851

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、「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期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正後の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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）および第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第26期中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,558,999	13,820,588
金銭の信託	-	399,833
前払費用	54,242	33,221
未収委託者報酬	2,254,741	3,169,323
未収運用受託報酬	1,046,291	1,000,785
未収投資助言報酬	2 252,337	2 271,577
未収収益	197,045	247,552
未収消費税等	98,402	-
繰延税金資産	369,826	383,608
その他	23,865	21,009
流動資産計	16,855,752	19,347,501
固定資産		
有形固定資産	501,481	599,421
建物	1 283,511	1 237,642
器具備品	1 201,169	1 351,237
建設仮勘定	16,799	10,541
無形固定資産	721,812	964,184
商標権	1 1,335	1 804
ソフトウェア	1 555,121	1 557,870
ソフトウェア仮勘定	157,595	397,829
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 611	1 531
投資その他の資産	4,051,090	5,247,891
投資有価証券	498,041	1,194,081
関係会社株式	1,661,144	2,161,144
繰延税金資産	442,390	403,908
長期差入保証金	1,169,961	1,187,070
その他	306,478	328,612
貸倒引当金	26,925	26,925
固定資産計	5,274,384	6,811,497
資産合計	22,130,137	26,158,999

（単位：千円）

	第24期 （平成21年3月31日現在）	第25期 （平成22年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	37,445	119,466
未払金	1,293,636	1,526,031
未払収益分配金	8,201	7,837
未払償還金	48,993	96,340
未払手数料	931,529	1,206,815
その他未払金	304,912	215,038
未払費用	2 1,040,620	2 1,522,325
未払法人税等	179,557	1,283,275
未払消費税等	-	113,923
賞与引当金	618,303	572,614
その他	20,741	38,231
流動負債計	3,190,304	5,175,867
固定負債		
退職給付引当金	404,437	488,790
役員退職慰労引当金	145,732	96,342
固定負債計	550,169	585,133
負債合計	3,740,474	5,761,000
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	13,962,732	15,737,995
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	10,040,000	11,650,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,299,438	3,464,702
株主資本計	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,547	231,525
評価・換算差額等計	1,547	231,525
純資産合計	18,389,662	20,397,999
負債・純資産合計	22,130,137	26,158,999

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）		第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	24,552,133		26,734,588	
運用受託報酬	4,509,994		4,297,349	
投資助言報酬	1,228,096		1,027,153	
その他営業収益	697,007		723,055	
営業収益計		30,987,232		32,782,146
営業費用				
支払手数料	10,967,681		13,000,141	
広告宣伝費	488,151		218,782	
公告費	-		1,767	
調査費	5,076,631		5,056,427	
調査費	2,506,175		2,555,070	
委託調査費	2,570,455		2,501,356	
委託計算費	325,174		351,370	
営業雑経費	812,013		679,608	
通信費	35,872		32,088	
印刷費	732,985		613,198	
協会費	25,313		21,225	
諸会費	41		41	
支払販売手数料	17,800		13,054	
営業費用計		17,669,652		19,308,097
一般管理費				
給料	4,587,983		4,678,614	
役員報酬	1 234,353		1 244,725	
給料・手当	3,647,502		3,840,052	
賞与	706,127		593,836	
交際費	44,085		45,342	
寄付金	4,462		3,450	
旅費交通費	308,237		269,516	
租税公課	82,762		85,030	
不動産賃借料	801,086		791,980	
退職給付費用	106,223		132,513	
固定資産減価償却費	330,412		397,252	
福利厚生費	22,556		22,233	
修繕費	6,755		5,615	
賞与引当金繰入	618,303		572,614	
役員退職慰労引当金繰入	42,570		45,086	
役員退職金	13,175		18,129	
機器リース料	973		2,191	
事務委託費	247,087		285,449	
消耗品費	84,099		78,753	
器具備品費	6,094		2,046	
諸経費	177,386		88,728	
一般管理費計		7,484,253		7,524,549
営業利益		5,833,325		5,949,500

（単位：千円）

	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）		第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	4,558		5,287	
受取利息	59,458		18,745	
時効成立分配金	164		157	
投資信託解約益	-		559,971	
先物利益	180,422		-	
雑収入	5,482		3,431	
営業外収益計		250,086		587,592
営業外費用				
為替差損	24,553		17,771	
時効成立後支払分配金	517		444	
投資信託解約損	38,254		-	
先物損失	-		719,577	
金銭の信託運用損	-		1,116	
営業外費用計		63,325		738,911
経常利益		6,020,086		5,798,181
特別損失				
固定資産除却損	2	14,476	2	21,626
固定資産売却損		-		2,464
ゴルフ会員権評価損		6,000		-
投資有価証券評価損		484,009		-
特別損失計		504,485		24,090
税引前当期純利益		5,515,600		5,774,091
法人税、住民税及び事業税		2,301,373		2,508,095
法人税等調整額		30,266		135,267
法人税等合計		2,271,106		2,372,828
当期純利益		3,244,494		3,401,263

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	前期末残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	前期末残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	前期末残高	7,040,000	10,040,000
	当期変動額	3,000,000	1,610,000
	当期末残高	10,040,000	11,650,000
	研究開発積立金		
	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	前期末残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	前期末残高	6,054,944	3,299,438
	当期変動額		
	剰余金の配当	3,000,000	1,626,000
	別途積立金の積立	3,000,000	1,610,000
	当期純利益	3,244,494	3,401,263
	当期末残高	3,299,438	3,464,702
	株主資本合計		
	前期末残高	18,146,716	18,391,210
	当期変動額	244,494	1,775,263
	当期末残高	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	10,012	1,547
	当期変動額（純額）	8,464	233,073
	当期末残高	1,547	231,525
純資産合計			
	前期末残高	18,136,703	18,389,662
	当期変動額	252,958	2,008,336
	当期末残高	18,389,662	20,397,999

[次へ](#)

重要な会計方針

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31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：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） 定率法によっております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 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。 (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. 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。 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おります。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、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。 (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。	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 2. 金銭の信託の評価基準および評価方法 時価法 3. デリバティブの評価基準および評価方法 同左 4. 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） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左 (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） 同左 5. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左 6. 引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左 (3) 同左 (会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正（その3）」（企業会計基準委員会 平成20年7月31日 企業会計基準第19号）を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響はありません。 (4) 同左

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
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. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。	7. リース取引の処理方法 同左 8. 消費税等の処理方法 同左

会計方針の変更

第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
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、当事業年度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。 これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。 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。	

表示方法の変更

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
（貸借対照表） 1．前事業年度において「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、当事業年度から「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、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。 2．前事業年度において「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、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。 （損益計算書） 前事業年度において「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、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。	

追加情報

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
	当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）																																
1．固定資産の減価償却累計額 <table><tr><td>建物</td><td>426,679千円</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>290,397千円</td></tr><tr><td>商標権</td><td>6,351千円</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>648,713千円</td></tr><tr><td>電話施設利用権</td><td>985千円</td></tr></table> 2．関係会社項目 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。 <table><tr><td>流動資産</td><td>未収投資助言報酬</td><td>251,392千円</td></tr><tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>345,744千円</td></tr></table>	建物	426,679千円	器具備品	290,397千円	商標権	6,351千円	ソフトウェア	648,713千円	電話施設利用権	985千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円	流動負債	未払費用	345,744千円	1．固定資産の減価償却累計額 <table><tr><td>建物</td><td>471,484千円</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>356,326千円</td></tr><tr><td>商標権</td><td>6,882千円</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>684,370千円</td></tr><tr><td>電話施設利用権</td><td>1,065千円</td></tr></table> 2．関係会社項目 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。 <table><tr><td>流動資産</td><td>未収投資助言報酬</td><td>270,492千円</td></tr><tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>400,075千円</td></tr></table>	建物	471,484千円	器具備品	356,326千円	商標権	6,882千円	ソフトウェア	684,370千円	電話施設利用権	1,065千円	流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動負債	未払費用	400,075千円
建物	426,679千円																																
器具備品	290,397千円																																
商標権	6,351千円																																
ソフトウェア	648,713千円																																
電話施設利用権	985千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円																															
流動負債	未払費用	345,744千円																															
建物	471,484千円																																
器具備品	356,326千円																																
商標権	6,882千円																																
ソフトウェア	684,370千円																																
電話施設利用権	1,065千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円																															
流動負債	未払費用	400,075千円																															

（損益計算書関係）

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
1. 役員報酬の限度額 取締役 年額250,000千円 監査役 年額 50,000千円 2. 固定資産除却損の内訳 建物 2,251千円 器具備品 9,818千円 ソフトウェア 2,406千円	1. 役員報酬の限度額 同左 2. 固定資産除却損の内訳 建物 1,199千円 器具備品 15,159千円 ソフトウェア 5,267千円

（株主資本等変動計算書関係）

第24期（自平成20年4月1日 至平成21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

（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21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

第25期（自平成21年4月1日 至平成22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21年6月29日 定時株主総会	普通株式	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30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22年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

（リース取引関係）

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22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																																
<table><tr><td></td><td>器具備品</td><td>その他</td><td>合計</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>90,601千円</td><td>-</td><td>90,601千円</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>52,335千円</td><td>-</td><td>52,335千円</td></tr><tr><td>期末残高相当額</td><td>38,265千円</td><td>-</td><td>38,265千円</td></tr></table>		器具備品	その他	合計	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	52,335千円	-	52,335千円	期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円	<table><tr><td></td><td>器具備品</td><td>その他</td><td>合計</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>90,601千円</td><td>-</td><td>90,601千円</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>75,063千円</td><td>-</td><td>75,063千円</td></tr><tr><td>期末残高相当額</td><td>15,538千円</td><td>-</td><td>15,538千円</td></tr></table>		器具備品	その他	合計	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	75,063千円	-	75,063千円	期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円
	器具備品	その他	合計																														
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	52,335千円	-	52,335千円																														
期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円																														
	器具備品	その他	合計																														
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	75,063千円	-	75,063千円																														
期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円																														
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																																
<table><tr><td></td><td>1年以内</td><td>1年超</td><td>合計</td></tr><tr><td>未経過リース料 期末残高相当額</td><td>23,251千円</td><td>16,350千円</td><td>39,602千円</td></tr></table>		1年以内	1年超	合計	未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円	<table><tr><td></td><td>1年以内</td><td>1年超</td><td>合計</td></tr><tr><td>未経過リース料 期末残高相当額</td><td>15,764千円</td><td>586千円</td><td>16,350千円</td></tr></table>		1年以内	1年超	合計	未経過リース料 期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円																
	1年以内	1年超	合計																														
未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円																														
	1年以内	1年超	合計																														
未経過リース料 期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円																														
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																																
<table><tr><td>支払リース料</td><td>24,096千円</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>22,727千円</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>1,501千円</td></tr></table>	支払リース料	24,096千円	減価償却費相当額	22,727千円	支払利息相当額	1,501千円	<table><tr><td>支払リース料</td><td>24,096千円</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>22,727千円</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>845千円</td></tr></table>	支払リース料	24,096千円	減価償却費相当額	22,727千円	支払利息相当額	845千円																				
支払リース料	24,096千円																																
減価償却費相当額	22,727千円																																
支払利息相当額	1,501千円																																
支払リース料	24,096千円																																
減価償却費相当額	22,727千円																																
支払利息相当額	845千円																																
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 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額																																
	<table><tr><td></td><td>1年以内</td><td>1年超</td><td>合計</td></tr><tr><td></td><td>1,609千円</td><td>1,475千円</td><td>3,084千円</td></tr></table>		1年以内	1年超	合計		1,609千円	1,475千円	3,084千円																								
	1年以内	1年超	合計																														
	1,609千円	1,475千円	3,084千円																														

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	
(1)金融商品に対する取組方針	資金運用については短期的な預金等に限定しております。 デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。 取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。
(2)金融商品の内容およびそのリスク	投資有価証券および金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託であり、為替および市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。 長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。 デリバティブ取引は、投資有価証券および金銭の信託に係る為替および市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引および株価指数先物取引等であります。
(3)金融商品に係るリスク管理体制	信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理 為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理 組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて取引残高、損益およびリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理 取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。
(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、デリバティブ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. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	13,820,588	13,820,588	-
(2) 金銭の信託	399,833	399,833	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	1,111,335	1,111,335	-
(4) 長期差入保証金	61,485	61,485	-
資産計	15,393,243	15,393,243	-
(1) 未払法人税等	1,283,275	1,283,275	-
負債計	1,283,275	1,283,275	-
デリバティブ取引(*)	(38,094)	(38,094)	-

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 投資有価証券

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

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負 債

(1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

(注3) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,819,459	-	-	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
(3) 長期差入保証金(*)	61,485	-	-	-
合計	13,880,945	-	-	-

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

(注4) 社債、新株予約権付社債および長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

第24期（平成21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	146,101	146,101	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	271,802	269,192	2,610
小計	417,904	415,294	2,610
合計	417,904	415,294	2,610

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）
3,021,000	20,615	58,869

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） 82,746千円

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25期（平成22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

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

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（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	368,968	146,101	222,866
債券	-	-	-
その他（投資信託）	716,414	544,802	171,611
小計	1,085,382	690,904	394,477
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）	25,953	30,000	4,047
小計	25,953	30,000	4,047
合計	1,111,335	720,904	390,430

（注）非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
2,070,000	563,988	4,017

（金銭の信託関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	399,833	838

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
(1)取引の内容 為替予約取引及び株価指数先物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及び株価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 為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。 (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

（１）通貨関連

区分	種類	第24期(平成21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	24,432	-	24,960	528
	香港ドル	34,020	-	34,412	392
	豪ドル	77,510	-	78,736	1,226
	シンガポールドル	12,564	-	12,672	107
合計		148,527	-	150,782	2,255

（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。

（２）株式関連

区分	種類	第24期(平成21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	株価指数先物取引 売建	212,667	-	230,215	17,547
合計		212,667	-	230,215	17,547

（注2）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25期（平成22年3月31日現在）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（１）通貨関連

区分	種類	第25期(平成22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	22,960	-	743	743
	香港ドル	27,416	-	264	264
	豪ドル	101,481	-	1,076	1,076
	シンガポールドル	14,547	-	154	154
合計		166,405	-	2,238	2,238

（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。

（２）株式関連

区分	種類	第25期(平成22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	株価指数先物取引 売建	561,971	-	29,413	29,413
合計		561,971	-	29,413	29,413

（注2）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。

(3) 不動産投資信託関連

区分	種類	第25期(平成22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	REIT指数先物取引 売建	104,418	-	6,442	6,442
合計		104,418	-	6,442	6,442

(注3) 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。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

第24期（平成21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、原則法を適用しております。

(1) 退職給付債務 (平成21年3月31日現在) (千円)

退職給付債務	431,448
未認識数理計算上の差異	27,011
退職給付引当金	404,437

(2) 退職給付費用 (千円)

勤務費用	71,958
確定拠出年金 拠出額	34,264
退職給付費用	106,223

3. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

		第24期 (平成21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
(3)	数理計算上の差異の処理年数(年)	5

第25期（平成22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

第25期
(平成22年3月31日現在) (千円)

(1)	退職給付債務	530,305
(2)	未認識数理計算上の差異	41,515
	退職給付引当金	488,790

3．退職給付費用に関する事項

第25期
(自 平成21年4月 1日
至 平成22年3月31日) (千円)

(1)	勤務費用	82,653
(2)	利息費用	6,471
(3)	数理計算上の差異の費用処理額	5,402
(4)	確定拠出年金 拠出額	37,987
	退職給付費用	132,513

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第25期 (平成22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
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

（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24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	19,218	108,541
未払事業所税	6,269	6,290
賞与引当金	251,649	233,054
未払法定福利費	27,146	26,912
未払確定拠出年金掛金	2,667	2,712
減価償却超過額	7,579	17,598
減価償却超過額（一括償却資産）	8,559	6,098
繰延資産償却超過額（税法上）	46,274	89,657
その他（未払金等）	461	-
退職給付引当金	164,605	198,937
役員退職慰労引当金	59,313	39,211
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	196,991	66,421
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	1,062	-
繰延税金資産合計	812,216	815,851
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	28,334
繰延税金負債合計	-	28,334
差引繰延税金資産の純額	812,216	787,517

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24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25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。

（関連当事者との取引）

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

(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				
その他の関係会社	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	718,870	未収投資助言報酬	172,117
								販売手数料の支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

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	933,784	未払費用	236,518
	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	324,748	未払費用	109,093

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				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,531,236	未払 手数料	96,917
								預金の引出 (純額)	300,370	現金・ 預金	322,365
								受取利息	894	未収 収益	-
	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、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	701,162	未払 手数料	91,628
								預金の引出 (純額)	1,034,219	現金・ 預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収 収益	4,158
	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	299,054	未払 費用	117,438
								業務委託料 の支払	17,550	未払 費用	2,677

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。

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

第25期（自平成21年4月1日 至平成22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				
その他の関係会社	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（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 投資の販売	資産運用の 助言の顧問料 の受入	711,279	未収投資 助言報酬	190,025
								販売手数料の 支払	13,054	-	-
								保険料の支払	6,572	-	-

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。
- （注5）平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(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	785,924	未払費用	296,169
	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	244,629	未払費用	98,673

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				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払 手数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコーポ レート銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払 手数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	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	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理サー ビス信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産 管理等	-	-	当社信託 財産の 運用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
								信託報酬の 支払	130		

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。
- (注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）
1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25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。	1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30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。

（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24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）
当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）
平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management(HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。 当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。 <子会社の概要> 商 号： DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容： 資産運用業務 設 立 年 月 日： 平成21年3月19日 資 本 金： 500,000千円 発行済株式総数： 500,000株 出 資 の 総 額： 500,000千円 出 資 比 率： 当社100%	—

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
(資産の部)	
流動資産	
現金・預金	11,413,600
金銭の信託	2,920,386
前払費用	70,721
未収委託者報酬	2,870,054
未収運用受託報酬	1,587,601
未収投資助言報酬	258,177
未収収益	248,853
繰延税金資産	379,771
その他	27,218
流動資産計	19,776,384
固定資産	
有形固定資産	475,455
建物	1 200,226
器具備品	1 275,229
無形固定資産	1,053,160
商標権	1 657
ソフトウェア	1 843,268
ソフトウェア仮勘定	201,594
電話加入権	7,148
電話施設利用権	1 491
投資その他の資産	4,780,724
投資有価証券	744,900
関係会社株式	2,161,144
繰延税金資産	501,175
長期差入保証金	1,126,064
その他	274,365
貸倒引当金	26,925
固定資産計	6,309,341
資産合計	26,085,726

（単位：千円）

	第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	48,469
未払金	1,382,417
未払収益分配金	5,782
未払償還金	96,340
未払手数料	1,104,913
その他未払金	175,381
未払費用	1,319,766
未払法人税等	1,403,804
未払消費税等	127,640
前受収益	4,618
賞与引当金	574,949
その他	1,954
流動負債計	4,863,621
固定負債	
退職給付引当金	527,297
役員退職慰労引当金	114,975
固定負債計	642,273
負債合計	5,505,894
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	16,008,292
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	13,430,000
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	1,954,999
株主資本計	20,436,770
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	143,061
評価・換算差額等計	143,061
純資産合計	20,579,831
負債・純資産合計	26,085,726

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,201,192	
運用受託報酬	2,208,627	
投資助言報酬	507,704	
その他営業収益	389,513	
営業収益計		15,307,036
営業費用		
支払手数料	5,187,472	
広告宣伝費	138,372	
公告費	2,297	
調査費	2,474,627	
調査費	1,342,551	
委託調査費	1,132,076	
委託計算費	170,599	
営業雑経費	360,908	
通信費	15,757	
印刷費	314,154	
協会費	11,780	
諸会費	19	
支払販売手数料	19,198	
営業費用計		8,334,278
一般管理費		
給料	2,017,035	
役員報酬	114,069	
給料・手当	1,902,965	
交際費	19,811	
寄付金	3,335	
旅費交通費	125,337	
租税公課	48,553	
不動産賃借料	379,036	
退職給付費用	66,781	
固定資産減価償却費	1 243,188	
福利厚生費	11,501	
修繕費	20,312	
賞与引当金繰入	574,949	
役員退職慰労引当金繰入	26,751	
役員退職金	540	
機器リース料	1,135	
事務委託費	140,006	
消耗品費	35,920	
器具備品費	258	
諸経費	78,421	
一般管理費計		3,792,878
営業利益		3,179,879

（単位：千円）

	第26期中間会計期間 （自平成22年4月1日至平成22年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	4,651	
受取利息	5,935	
時効成立分配金	15	
為替差益	4,255	
投資信託解約益	86,546	
先物利益	26,131	
金銭信託運用益	20,662	
雑収入	7,666	
営業外収益計		155,865
経常利益		3,335,745
特別損失		
固定資産除却損	27,791	
固定資産売却損	1,440	
特別損失計		29,232
税引前中間純利益		3,306,512
法人税、住民税及び事業税		1,388,928
法人税等調整額		32,712
法人税等合計		1,356,215
中間純利益		1,950,296

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	前期末残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	前期末残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	前期末残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	前期末残高	11,650,000
	当中間期変動額	1,780,000
	当中間期末残高	13,430,000
	研究開発積立金	
	前期末残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	前期末残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	前期末残高	3,464,702
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	1,680,000
	別途積立金の積立	1,780,000
	中間純利益	1,950,296
	当中間期末残高	1,954,999
	利益剰余金合計	
	前期末残高	15,737,995
	当中間期変動額	270,296
	当中間期末残高	16,008,292
	株主資本合計	
	前期末残高	20,166,473
	当中間期変動額	270,296

	当中間期末残高	20,436,770
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	前期末残高	231,525
	当中間期変動額（純額）	88,464
	当中間期末残高	143,061
純資産合計		
	前期末残高	20,397,999
	当中間期変動額	181,832
	当中間期末残高	20,579,831

[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26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22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. 金銭の信託の評価基準および評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産（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 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20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
5. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 (4) 役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建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。
7. 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。
8. 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。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
----	-------------------------------

1．固定資産の減価償却累計額	建物	...	468,310千円
	器具備品	...	423,931千円
	商標権	...	2,281千円
	ソフトウェア	...	667,311千円
	電話施設利用権	...	1,105千円

(中間損益計算書関係)

項目	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)		
1．減価償却実施額	有形固定資産	...	100,890千円
	無形固定資産	...	142,297千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22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22年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(リース取引関係)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22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「4. 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	56,261千円
減価償却累計額相当額	50,252千円
中間期末残高相当額	6,009千円

未経過リース料中間期末残高相当額

<u>1年以内</u>	<u>1 年 超</u>	<u>合 計</u>
6,401千円	-	6,401千円

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	10,125千円
減価償却費相当額	9,528千円
支払利息相当額	176千円

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。

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

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料中間期末残高相当額

<u>1年以内</u>	<u>1 年 超</u>	<u>合 計</u>
1,609千円	670千円	2,279千円

（金融商品関係）

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,413,600	11,413,600	-
(2) 金銭の信託	2,920,386	2,920,386	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	662,154	662,154	-
資産計	14,996,141	14,996,141	-
(1) 未払法人税等	1,403,804	1,403,804	-
負債計	1,403,804	1,403,804	-
デリバティブ取引(*)	(195)	(195)	-

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額82,746千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（中間貸借対照表計上額1,126,064千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
2. 子会社株式および関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	339,574	146,101	193,472
債券	-	-	-
その他（投資信託）	299,201	244,802	54,398
小計	638,775	390,904	247,870
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	23,379	30,000	6,621
小計	23,379	30,000	6,621
合計	662,154	420,904	241,249

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額82,746千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（金銭の信託関係）

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

区分	種類	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	21,781	-	565	565
	香港ドル	24,339	-	128	128
	豪ドル	92,448	-	229	229
	シンガポールドル	13,986	-	17	17
合計		152,556	-	481	481

（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。

（2）株式関連

区分	種類	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	株価指数先物取引 売建	292,423	-	676	676
合計		292,423	-	676	676

（注2）時価の算定方法

取引所の価格によっております。

（セグメント情報等）

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	12,201,192	2,716,331	389,513	15,307,036

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（追加情報）

当中間会計期間より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

（持分法損益等）

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）		
1株当たり純資産額	857,492円	98銭
1株当たり中間純利益金額	81,262円	37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26期中間会計期間 （自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
中間純利益	1,950,296千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,950,296千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更等
平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。
・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- (1) 受託会社
 - a. 名称
みずほ信託銀行株式会社
 - b. 資本金の額
平成22年3月末日現在 247,260百万円
 - 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22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	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	700,000	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	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社()	()210,200	日本において保険業務を営んでおります。

()平成22年4月1日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

第一生命保険株式会社は、委託会社の株式を12,000株（持株比率50.00%）所有しています。
この他に、委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【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22年5月7日
有価証券報告書	平成22年5月7日
半期報告書	平成22年11月8日
有価証券届出書の訂正届出書	平成22年11月8日

独立監査人の監査報告書

平成 2 3 年 3 月 1 6 日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御 中

あらた監査法人

指 定 社 員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指 定 社 員 公認会計士 和 田 渉 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22年2月9日から平成23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国内株式インデックスファンド＜D C年金＞の平成23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。

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[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22年6月30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	浅野 功	印
--------------------	-------	------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25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22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22年12月10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 公認会計士 浅野 功 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 近藤 敏弘 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、「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22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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に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22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22年4月1日から平成22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 2 2 年 3 月 1 7 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 柴 毅 印
業務執行社員指 定 社 員 公認会計士 和 田 渉 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 2 1 年 2 月 1 0 日から平成 2 2 年 2 月 8 日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この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国内株式インデックスファンド＜D C年金＞の平成 2 2 年 2 月 8 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[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 2 1 年 6 月 2 9 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 1 9 3 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 2 0 年 4 月 1 日から平成 2 1 年 3 月 3 1 日までの第 2 4 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 2 1 年 3 月 3 1 日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績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。

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。