

【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25年5月7日
【計算期間】	第6期（自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日）
【ファンド名】	D I A M D C 国内株式インデックスファンド
【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。

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

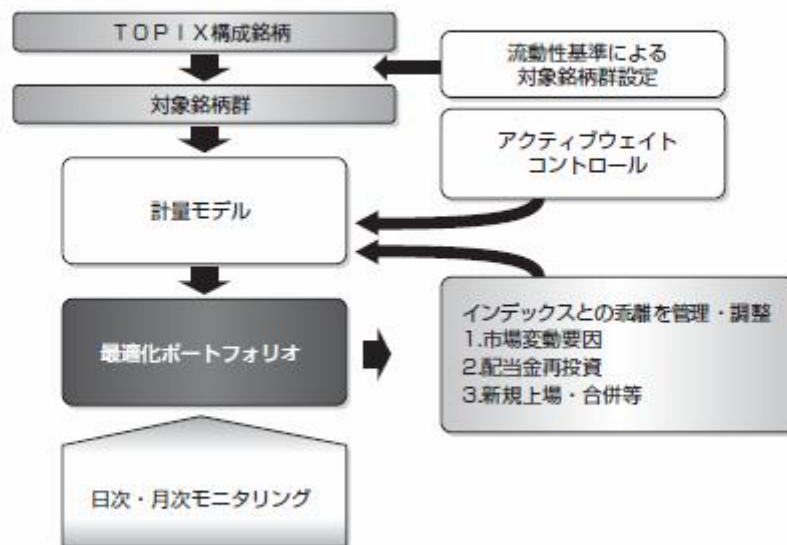
<ファンドの特色>

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

※東証株価指数（TOPIX）とは、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の指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証証券取引所」といいます。）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及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証証券取引所が有しています。

東証証券取引所は、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。東証証券取引所は、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。東証証券取引所は、TOPIXの指数値及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。また東証証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、東証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。東証証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。東証証券取引所は、当社又は国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、東証証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

- ② 流動性を基準に投資対象銘柄を設定し、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、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

分配方針

年1回の決算時（毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日。））に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・ 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・ 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

○商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国 内	株 式	インデックス型
	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	グローバル () 日本		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券 (株式))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

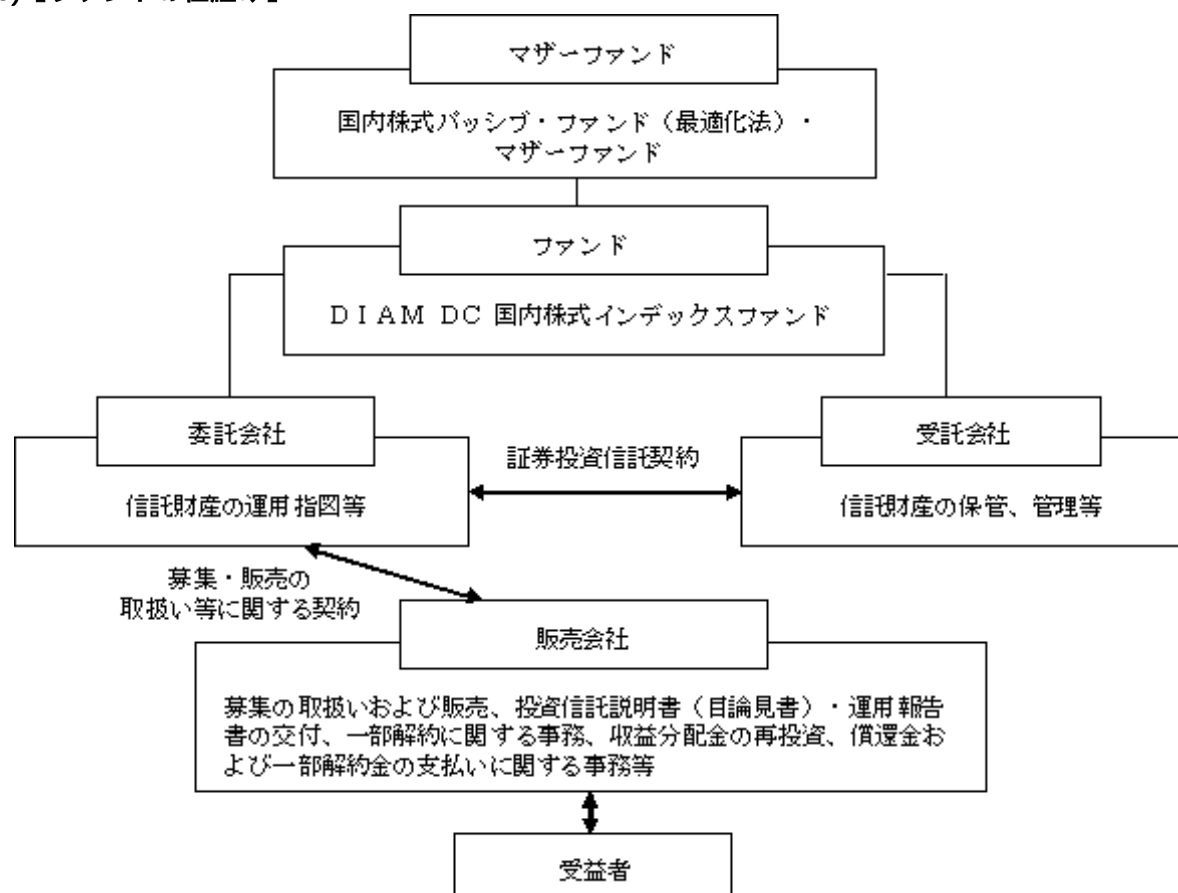
投資形態

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

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

(2)【ファンドの沿革】

平成19年9月27日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(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。また、販売会社として募集等の業務を行います。

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を行い、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います。



○ 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25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及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25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】

イ．基本方針

この投資信託は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

ロ．投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

ハ．投資態度

- ・主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・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。
- ・株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- ・株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産（約款第16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22条、第23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17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、上記1)～10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 外国貸付債権信託受益権（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 13) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 14) 預託証書（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18)の有価証券の性質を有するもの

なお、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)までの証券および11)ならびに14)の証券または証書のうち2)から6)までの証券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17条第2項）

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

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

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第17条第3項）

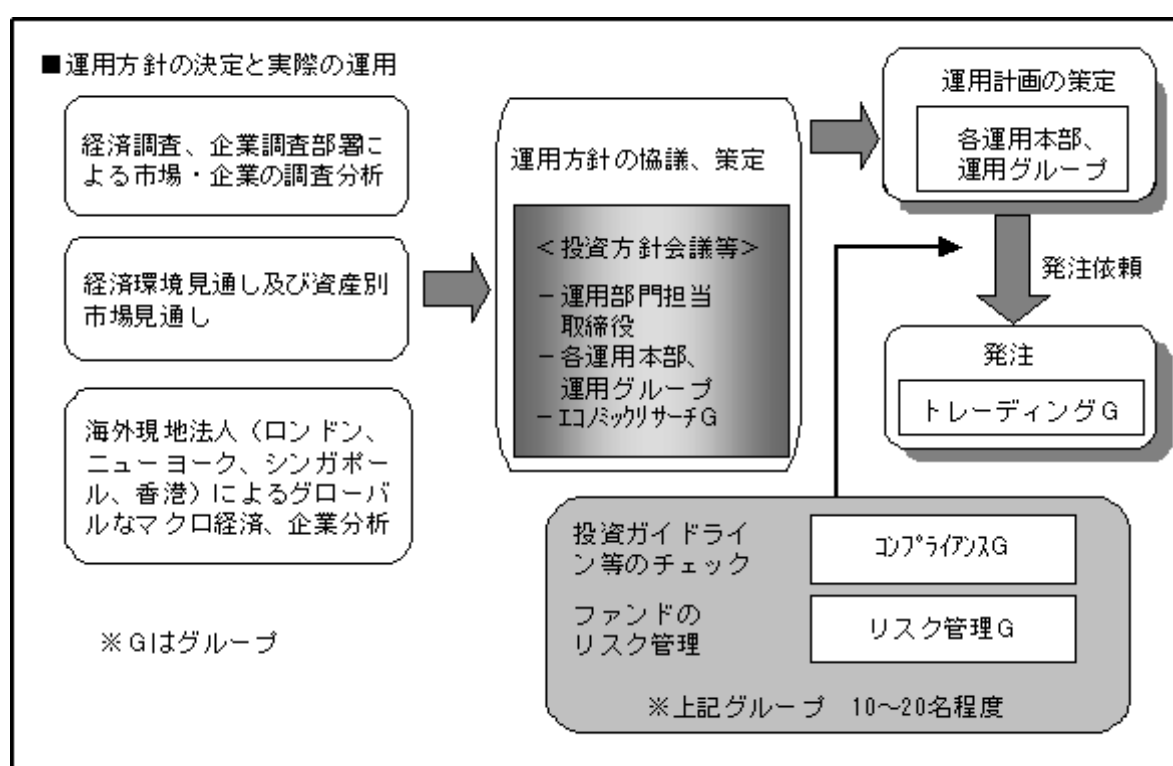
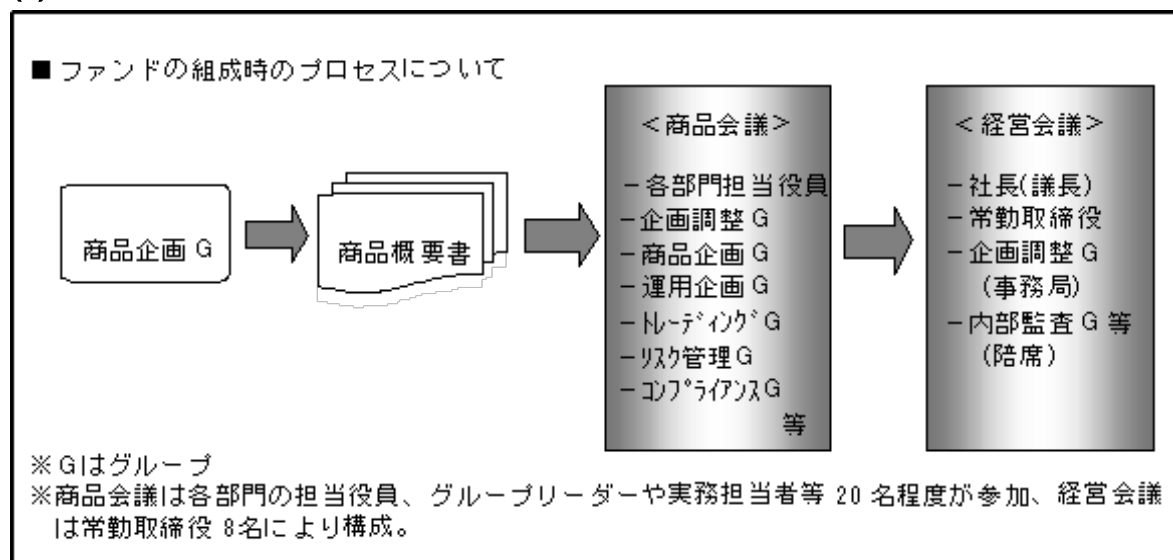
（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
-------	-----------------------------

基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	1．主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2．最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3．株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4．株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5．非株式割合は原則として信託財産総額の50％以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10％以下とします。 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。

「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25年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年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等収益および売買益（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) 留保金の運用方針

留保金の運用については、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

1) 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係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係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金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額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」と言います。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係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係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時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。

3. 上記1. および2. におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

2) 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20条）

(a) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。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。

(b) 上記(a)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

5) 信用取引の指図範囲（約款第21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、株券の引き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（約款第22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。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係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係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係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（約款第23条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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24条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b) 上記(a)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26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および範囲（約款第27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34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の議決権（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、当該株式の議決権の総数に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、当該株式を投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図してはなりません。

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

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

3【投資リスク】

(1) 基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き等により影響を受けますが、運用による損益

は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

○ 株価変動リスク

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

○ 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

(2) 分配金に関する留意点

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

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

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

(3) その他の留意点

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

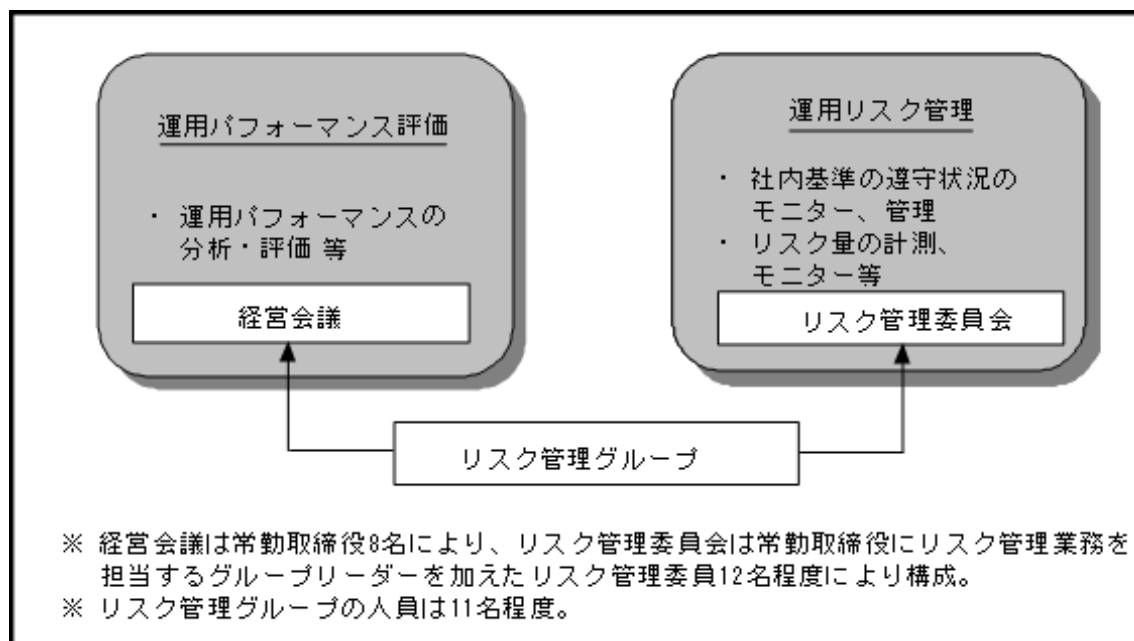
○ 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

○ 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、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情がある場合、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（外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
 - ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
 - ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
 - ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

上記体制は平成25年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は次の通りです。

ファンドの日々の基準価額に対して、信託財産の純資産総額に年率0.1785%（税抜 0.17%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分は、委託会社が年率0.084%（税抜 0.08%）、販売会社が年率0.063%（税抜0.06%）、受託会社が年率0.0315%（税抜 0.03%）です。

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）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替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用に係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係る手数料・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および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係る手数料・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および外貨建資産の保管等に関する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

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。

○個人の受益者に対する課税

時 期	項 目	税 金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して10.147%
換金（解約）時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して10.147%

税金は表に記載の時期に適用されます。

上記の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

上記の税率には復興特別所得税が含まれます。平成26年1月1日以降は20.315%の税率となる予定です。

○法人の受益者に対する課税

平成25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換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））の税率に

よる源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

上記7.147%の税率は平成26年1月1日以降、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））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。

上記は、平成25年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、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 >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合に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の受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成25年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	4,613,997,749	100.01
内 日本	4,613,997,749	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	475,719	0.01
純資産総額	4,613,522,030	100.00

（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25年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	293,219,741,292	97.46
内 日本	293,219,741,292	97.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,646,290,232	2.54
純資産総額	300,866,031,524	100.00

その他資産の投資状況

平成25年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,787,420,000	2.59
内 日本	7,787,420,000	2.59

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で分けした地域別の内訳です。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成25年2月28日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	3,460,584,827	1.3240 4,581,988,217	1.3333 4,613,997,749	- -	100.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.01%
合計	100.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【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25年2月28日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,798,100	4,815.00 13,472,851,500	4,765.00 13,332,946,500	- -	4.43%
2	三菱ＵＦＪフィナン シャルＧ 日本	株式 銀行業	16,277,300	538.00 8,757,187,400	513.00 8,350,254,900	- -	2.78%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,837,500	3,580.00 6,578,250,000	3,455.00 6,348,562,500	- -	2.11%
4	三井住友フィナンシャ ルＧ 日本	株式 銀行業	1,625,700	3,790.00 6,161,403,000	3,710.00 6,031,347,000	- -	2.00%
5	みずほフィナンシャル Ｇ 日本	株式 銀行業	27,707,900	209.00 5,790,951,100	204.00 5,652,411,600	- -	1.88%
6	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,352,900	3,310.00 4,478,099,000	3,365.00 4,552,508,500	- -	1.51%
7	武田薬品 日本	株式 医薬品	854,500	4,700.00 4,016,150,000	4,795.00 4,097,327,500	- -	1.36%
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	904,900	4,050.00 3,664,845,000	4,250.00 3,845,825,000	- -	1.28%
9	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,027,900	3,465.00 3,561,673,500	3,435.00 3,530,836,500	- -	1.17%
10	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,505,000	2,143.00 3,225,215,000	2,310.00 3,476,550,000	- -	1.16%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	226,800	14,790.00 3,354,372,000	14,310.00 3,245,508,000	- -	1.08%
12	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,082,000	3,000.00 3,246,000,000	2,925.00 3,164,850,000	- -	1.05%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,677,300	1,953.00 3,275,766,900	1,839.00 3,084,554,700	- -	1.03%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	401,700	6,440.00 2,586,948,000	6,840.00 2,747,628,000	- -	0.91%
15	日 立 日本	株式 電気機器	5,230,000	536.48 2,805,796,809	520.00 2,719,600,000	- -	0.90%
16	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,751,400	993.00 2,732,140,200	937.00 2,578,061,800	- -	0.86%
17	三井物産 日本	株式 卸売業	1,855,200	1,406.00 2,608,411,200	1,374.00 2,549,044,800	- -	0.85%
18	エヌ・ティ・ティ・ド コモ 日本	株式 情報・通信業	17,712	136,900.00 2,424,772,800	143,400.00 2,539,900,800	- -	0.84%
19	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	506,400	4,750.00 2,405,400,000	5,010.00 2,537,064,000	- -	0.84%
20	小松製作所 日本	株式 機械	1,063,700	2,458.00 2,614,574,600	2,338.00 2,486,930,600	- -	0.83%
21	セブン＆アイ・ＨＬＤ ＧＳ 日本	株式 小売業	899,200	2,817.00 2,533,046,400	2,706.00 2,433,235,200	- -	0.81%

22	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	9,640,000	273.00 2,631,720,000	251.00 2,419,640,000	- -	0.80%
23	三井不動産 日本	株式 不動産業	1,013,000	2,095.00 2,122,235,000	2,358.00 2,388,654,000	- -	0.79%
24	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	4,394,400	531.00 2,333,426,400	532.00 2,337,820,800	- -	0.78%
25	信越化学 日本	株式 化学	409,100	5,590.00 2,286,869,000	5,700.00 2,331,870,000	- -	0.78%
26	東京海上ＨＤ 日本	株式 保険業	832,500	2,713.00 2,258,572,500	2,618.00 2,179,485,000	- -	0.72%
27	K D D I 日本	株式 情報・通信業	303,300	6,840.00 2,074,572,000	6,960.00 2,110,968,000	- -	0.70%
28	デンソー 日本	株式 輸送用機器	538,100	3,700.00 1,990,970,000	3,890.00 2,093,209,000	- -	0.70%
29	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	714,800	2,473.00 1,767,700,400	2,844.00 2,032,891,200	- -	0.68%
30	三菱重工業 日本	株式 機械	3,650,000	522.00 1,905,300,000	514.00 1,876,100,000	- -	0.62%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年2月28日現在

種類	投資比率
株式	97.46%
合計	97.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成25年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.36%
輸送用機器		11.31%
銀行業		10.43%
情報・通信業		5.87%
化学		5.55%
医薬品		5.04%
機械		5.00%
卸売業		4.98%
陸運業		4.07%
小売業		3.95%
食料品		3.82%
不動産業		3.24%
建設業		2.40%
保険業		2.31%
電気・ガス業		2.10%
サービス業		2.05%
鉄鋼		1.73%
証券、商品先物取引業		1.52%
その他製品		1.29%
精密機器		1.25%
非鉄金属		1.05%
その他金融業		1.04%

ゴム製品	0.92%
ガラス・土石製品	0.90%
繊維製品	0.78%
石油・石炭製品	0.77%
金属製品	0.66%
鉱業	0.56%
空運業	0.54%
海運業	0.34%
パルプ・紙	0.29%
倉庫・運輸関連業	0.25%
水産・農林業	0.08%
合計	97.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年2月28日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX 先物 2503月	買建	802	7,656,978,726	7,787,420,000	2.59%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(3)【運用実績】**【純資産の推移】**

直近日（平成25年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）(円)	1口当たりの 純資産額 （分配付）(円)
第1計算期間末 （平成20年2月7日）	651	651	0.8081	0.8081
第2計算期間末 （平成21年2月9日）	990	990	0.4906	0.4906
第3計算期間末 （平成22年2月8日）	1,420	1,420	0.5658	0.5658
第4計算期間末 （平成23年2月7日）	2,000	2,000	0.6132	0.6132
第5計算期間末 （平成24年2月7日）	2,823	2,823	0.5150	0.5150
第6計算期間末 （平成25年2月7日）	4,521	4,521	0.6603	0.6603
平成24年2月末日	3,064	-	0.5572	-
3月末日	3,266	-	0.5755	-
4月末日	3,285	-	0.5416	-
5月末日	3,098	-	0.4847	-
6月末日	3,435	-	0.5191	-
7月末日	3,360	-	0.4962	-
8月末日	3,351	-	0.4932	-
9月末日	3,420	-	0.5021	-
10月末日	3,481	-	0.5054	-
11月末日	3,638	-	0.5320	-
12月末日	3,923	-	0.5859	-
平成25年1月末日	4,339	-	0.6406	-
2月末日	4,613	-	0.6648	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	19.2
第2計算期間	39.3
第3計算期間	15.3
第4計算期間	8.4
第5計算期間	16.0
第6計算期間	28.2

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

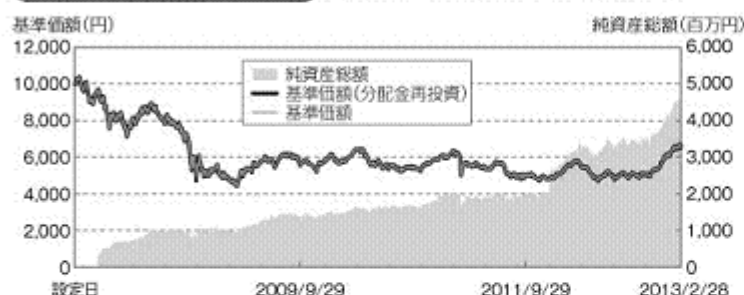
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

<<参考情報>>

データの基準日：2013年2月28日

基準価額・純資産の推移

〈設定日(2007年9月27日)～2013年2月28日〉



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日：2007年9月27日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第2期	(2009.02.09)	0円
第3期	(2010.02.08)	0円
第4期	(2011.02.07)	0円
第5期	(2012.02.07)	0円
第6期	(2013.02.07)	0円
設定来累計		0円

(注) 分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 (注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド (注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。
 内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.46
内 日本	97.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.54
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.59

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.36%
2	輸送用機器	11.31%
3	銀行業	10.43%
4	情報・通信業	5.87%
5	化学	5.55%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.43%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.78%
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.11%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.00%
5	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.88%
6	キヤノン	株式	日本	電気機器	1.51%
7	武田薬品	株式	日本	医薬品	1.36%
8	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.28%
9	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.17%
10	三菱地所	株式	日本	不動産業	1.16%

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2007年は設定日から年末までの収益率、および2013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。

※2006年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」です。

○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。

○当該ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	887,594,024	81,655,660
第2計算期間	2,103,679,461	890,672,245
第3計算期間	1,667,777,180	1,175,183,209
第4計算期間	1,536,529,943	786,254,485
第5計算期間	3,335,462,010	1,114,450,026
第6計算期間	3,710,441,727	2,345,929,733

（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（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従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。また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。
- ・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、お申込みの受付に係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係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係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係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。

「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。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、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）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

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。

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。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時までには解約の請求が行われ、かつ、解約の受付に係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係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、当該一部解約に係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。

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お支払いします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、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19年9月27日から無期限です。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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係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. 委託会社は上記a.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。

- c. 上記a.につき、上記b.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。
- d. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨及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。
- e. 上記b.～d.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b.の一定の期間が一月を下らずにその公告及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。
- f. 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。
- g. 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。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託者を選任します。委託会社が新受託者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。
- i. 上記b.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係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ができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続き

は、公告または書面に付記します。

- h. 上記b.に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

八．関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係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、自動的に全額再投資されます。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）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て）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）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係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、当該一部解約に係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。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

（１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間（平成24年2月8日から平成25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 D C 国内株式インデックスファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 平成24年2月7日現在	第6期 平成25年2月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,706,594	41,734,848
親投資信託受益証券	2,823,759,013	4,521,213,173
未収入金	150,000	-
流動資産合計	2,827,615,607	4,562,948,021
資産合計	2,827,615,607	4,562,948,021
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,836,640	38,048,494
未払受託者報酬	333,488	577,764
未払委託者報酬	1,556,437	2,696,482
その他未払費用	52,713	91,389
流動負債合計	3,779,278	41,414,129
負債合計	3,779,278	41,414,129
純資産の部		
元本等		
元本	₁ 5,482,826,993	₁ 6,847,338,987
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	₂ 2,658,990,664	₂ 2,325,805,095
（分配準備積立金）	78,944,964	750,534,611
元本等合計	2,823,836,329	4,521,533,892
純資産合計	2,823,836,329	4,521,533,892
負債純資産合計	2,827,615,607	4,562,948,021

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 自 平成23年2月8日 至 平成24年2月7日	第6期 自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日
営業収益		
受取利息	4,268	9,748
有価証券売買等損益	272,529,291	971,471,160
営業収益合計	272,525,023	971,480,908
営業費用		
受託者報酬	635,852	1,077,861
委託者報酬	2,967,630	5,030,418
その他費用	100,494	170,483
営業費用合計	3,703,976	6,278,762
営業利益又は営業損失（ ）	276,228,999	965,202,146
経常利益又は経常損失（ ）	276,228,999	965,202,146
当期純利益又は当期純損失（ ）	276,228,999	965,202,146
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	59,362,365	67,229,383
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,261,551,347	2,658,990,664
剰余金増加額又は欠損金減少額	448,141,579	1,126,053,514
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	448,141,579	1,126,053,514
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,628,714,262	1,690,840,708
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,628,714,262	1,690,840,708
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,658,990,664	2,325,805,095

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目		第5期 平成24年2月7日現在	第6期 平成25年2月7日現在
1 .	1 期首元本額	3,261,815,009円	5,482,826,993円
	期中追加設定元本額	3,335,462,010円	3,710,441,727円
	期中一部解約元本額	1,114,450,026円	2,345,929,733円
2 .	受益権の総数	5,482,826,993口	6,847,338,987口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,658,990,664円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,325,805,095円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目		第5期 自 平成23年2月8日 至 平成24年2月7日	第6期 自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日
1 .	1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（39,607,008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（111,476,059円）及び分配準備積立金（39,337,956円）より分配対象収益は190,421,023円（1万口当たり347.30円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（78,600,581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（617,048,364円）、信託約款に規定される収益調整金（185,451,769円）及び分配準備積立金（54,885,666円）より分配対象収益は935,986,380円（1万口当たり1,366.93円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自 平成23年2月8日 至 平成24年2月7日	第6期 自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 平成24年2月7日現在	第6期 平成25年2月7日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 平成24年2月7日現在	第6期 平成25年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）

親投資信託受益証券	240,186,528	946,821,051
合計	240,186,528	946,821,051

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 平成24年2月7日現在	第6期 平成25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）	0.5150円 (5,150円)	0.6603円 (6,603円)

(4)【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

（ 1 ）株式

該当事項はありません。

（ 2 ）株式以外の有価証券

平成25年2月7日現在

種 類	銘 柄	券面総額 （ 円 ）	評価額 （ 円 ）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最 適化法）・マザーファンド	3,414,040,001	4,521,213,173	
親投資信託受益証券 合計		3,414,040,001	4,521,213,173	
合計		3,414,040,001	4,521,213,173	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成24年2月7日現在	平成25年2月7日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,363,963,411	2,428,250,326
株式	2	253,387,727,604	300,995,330,408
派生商品評価勘定		145,965,712	123,804,084
未収入金		15,027,336	-
未収配当金		274,105,417	327,925,207
流動資産合計		257,186,789,480	303,875,310,025
資産合計		257,186,789,480	303,875,310,025
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	35,216
前受金		130,996,000	113,911,000
未払解約金		81,267,000	654,635,000
流動負債合計		212,263,000	768,581,216
負債合計		212,263,000	768,581,216
純資産の部			
元本等			
元本	1	249,229,464,222	228,887,294,836
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		7,745,062,258	74,219,433,973
元本等合計		256,974,526,480	303,106,728,809
純資産合計		256,974,526,480	303,106,728,809
負債純資産合計		257,186,789,480	303,875,310,025

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成24年2月7日現在	平成25年2月7日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	226,920,593,309円	249,229,464,222円
同期中追加設定元本額	66,279,901,769円	50,371,879,068円
同期中一部解約元本額	43,971,030,856円	70,714,048,454円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	2,738,588,899円	3,414,040,001円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,043,633,268円	1,141,796,064円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金>	34,455,257,218円	37,368,445,139円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型	925,425,479円	866,462,466円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型	3,401,440,637円	3,337,620,222円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型	3,422,156,802円	3,562,974,990円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	508,920,813円	474,683,047円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,541,596,037円	1,538,790,047円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,163,271,959円	1,201,444,752円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	131,173,730円	122,917,254円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,458,141,145円	1,510,569,975円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	20,123,737円	19,742,481円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	- 円	43,570円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	- 円	69,532円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	- 円	97,297円
投資のコンシェルジュ	- 円	2,916,326円
クルーズコントロール	- 円	4,551,628円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	273,143,125円	207,330,889円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	10,848,726,918円	9,496,505,123円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,784,889,063円	1,693,923,553円
D I A M国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	214,619,558円	196,321,988円
D I A M国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	826,819,576円	754,060,647円
D I A M国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	224,839,985円	191,888,966円
D I A M国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	298,371,564円	275,573,071円
D I A M世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	20,621,073,216円	18,703,199,503円
D I A M世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	6,818,227,913円	6,212,388,614円
D I A Mバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	5,342,574,432円	4,577,251,839円
D I A Mバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	3,489,438,622円	3,045,090,590円
D I A Mバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	8,054,144,562円	7,124,455,334円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	1,252,097,402円	1,052,805,601円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	2,722,971,152円	2,286,348,172円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,770,463,631円	2,289,200,859円
D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	15,530,537,665円	12,951,946,542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）	246,895,382円	183,644,962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）	5,071,285,516円	4,193,380,732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）	9,604,697,727円	8,789,640,440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）	488,514,372円	420,403,174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）	43,300,098,584円	37,330,815,031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）	2,817,633,611円	2,325,133,781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）	5,342,331,400円	4,462,368,016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）	26,387,900,604円	23,002,160,828円
	D I A Mバランス3 0 V A（適格機関投資家限 定）	305,023,572円	199,299,465円
	D I A Mバランス5 0 V A（適格機関投資家限 定）	105,664円	71,957,769円
	D I A Mバランス7 0 V A（適格機関投資家限 定）	162,492円	158,048円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド4 V A （適格機関投資家限定）	23,137,555,872円	20,058,437,698円
	D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家 限定）	312,273,959円	257,282,523円
	D I A M国内バランス3 0 V A（適格機関投資家 限定）	98,972,357円	79,882,612円
	D I A Mバランス2 0 V A（適格機関投資家限 定）	233,095,763円	188,563,237円
	D I A Mバランス4 0 V A（適格機関投資家限 定）	99,142円	91,104円
	D I A Mバランス6 0 V A（適格機関投資家限 定）	150,097円	141,970円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7 V A （1 2 1 2）（適格機関 投資家限定）	- 円	1,292,493,310円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7 V A （1 3 0 3）（適格機関 投資家限定）	- 円	405,984,054円
	計	249,229,464,222円	228,887,294,836円
2 .	受益権の総数	249,229,464,222口	228,887,294,836口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 1,493,000,000円	株式 2,407,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成23年2月8日 至 平成24年2月7日	自 平成24年2月8日 至 平成25年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年2月7日現在	平成25年2月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(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)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
-----------------------------	--	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成24年2月7日現在	平成25年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	47,367,839,954	62,100,064,005
合計	47,367,839,954	62,100,064,005

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成24年2月7日 現在				平成25年2月7日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	3,343,208,000	-	3,489,440,000	146,232,000	2,025,344,000	-	2,149,225,000	123,881,000
合計	3,343,208,000	-	3,489,440,000	146,232,000	2,025,344,000	-	2,149,225,000	123,881,000

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

	平成24年2月7日現在	平成25年2月7日現在
１口当たり純資産額	1.0311円	1.3243円
（１万口当たり純資産額）	(10,311円)	(13,243円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

平成25年2月7日現在

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備 考
		単 価	金 額	
極 洋	110,000	209	22,990,000	
日本水産	272,200	199	54,167,800	
マルハニチロホールディングス	486,000	157	76,302,000	
ハウスイ	20,000	122	2,440,000	
サカタのタネ	37,700	1,111	41,884,700	
ホクト	26,000	1,738	45,188,000	
ショーボンドHD	22,500	3,395	76,387,500	
ミライト・ホールディングス	72,100	902	65,034,200	
住石ホールディングス	74,800	96	7,180,800	
日鉄鉱業	64,000	454	29,056,000	
三井松島	165,000	204	33,660,000	
国際石油開発帝石	3,069	523,000	1,605,087,000	
日本海洋掘削	6,300	2,964	18,673,200	
関東天然瓦斯	26,000	498	12,948,000	
石油資源開発	36,000	3,340	120,240,000	
ダイセキ環境ソリューション	21	136,000	2,856,000	
間組	85,800	257	22,050,600	
東急建設	89,720	232	20,815,040	
コムシスホールディングス	123,000	1,151	141,573,000	
ミサワホーム	29,900	1,229	36,747,100	
高松コンストラクションGP	19,300	1,357	26,190,100	
東建コーポレーション	9,440	5,080	47,955,200	
ヤマウラ	8,500	271	2,303,500	
大成建設	1,277,000	283	361,391,000	
大 林 組	758,000	477	361,566,000	
清水建設	773,000	314	242,722,000	
飛島建設	156,600	111	17,382,600	
長谷工コーポレーション	1,578,000	89	140,442,000	
松井建設	2,000	324	648,000	
鹿島建設	1,110,000	291	323,010,000	
不動テトラ	179,200	187	33,510,400	
大末建設	97,000	70	6,790,000	
鉄建建設	155,000	136	21,080,000	
安藤建設	85,000	136	11,560,000	
太平工業	45,000	381	17,145,000	
西松建設	312,000	171	53,352,000	
三井住友建設	352,000	101	35,552,000	
大豊建設	71,000	159	11,289,000	
前田建設	156,000	362	56,472,000	
佐田建設	88,000	87	7,656,000	
ナカノフドー建設	19,500	262	5,109,000	
奥 村 組	224,000	354	79,296,000	
大和小田急建設	13,000	210	2,730,000	
東鉄工業	33,000	1,317	43,461,000	

イチケン	26,000	182	4,732,000	
浅沼組	77,000	75	5,775,000	
戸田建設	294,000	244	71,736,000	
熊 谷 組	183,000	111	20,313,000	
青木あすなろ建設	14,500	530	7,685,000	
北野建設	59,000	229	13,511,000	
植 木 組	33,000	199	6,567,000	
三井ホーム	33,000	505	16,665,000	
矢作建設	31,600	420	13,272,000	
ピーエス三菱	16,200	589	9,541,800	
大東建託	95,900	8,440	809,396,000	
新日本建設	30,400	257	7,812,800	
N I P P O	59,000	1,232	72,688,000	
東亜道路	48,000	333	15,984,000	
前田道路	73,000	1,376	100,448,000	
日本道路	75,000	410	30,750,000	
東亜建設	222,000	140	31,080,000	
若築建設	137,000	107	14,659,000	
東洋建設	78,700	304	23,924,800	
五洋建設	301,000	239	71,939,000	
大林道路	30,000	343	10,290,000	
世紀東急	93,000	98	9,114,000	
福 田 組	38,000	380	14,440,000	
住友林業	174,000	874	152,076,000	
日本基礎技術	30,800	321	9,886,800	
日成ビルド工業	75,000	194	14,550,000	
エス・パイ・エル	129,000	163	21,027,000	
巴コーポレーション	35,600	345	12,282,000	
パナホーム	95,000	576	54,720,000	
大和ハウス	630,000	1,699	1,070,370,000	
ライト工業	57,200	443	25,339,600	
積水ハウス	758,000	1,008	764,064,000	
日特建設	21,800	388	8,458,400	
北陸電気工事	15,000	286	4,290,000	
ユアテック	41,000	306	12,546,000	
西部電気工業	1,000	400	400,000	
四電工	6,000	322	1,932,000	
中電工	37,200	834	31,024,800	
関 電 工	117,000	446	52,182,000	
きんでん	168,000	608	102,144,000	
東京エネシス	26,000	457	11,882,000	
トーエネック	36,000	478	17,208,000	
住友電設	17,700	1,244	22,018,800	
日本電設工業	46,000	912	41,952,000	
協和エクシオ	91,300	1,033	94,312,900	
新日本空調	19,000	525	9,975,000	
日本工営	79,000	339	26,781,000	
N D S	42,000	267	11,214,000	
九電工	41,000	462	18,942,000	
三機工業	59,000	502	29,618,000	
日 揮	254,000	2,477	629,158,000	

中外炉工業	82,000	249	20,418,000	
ヤマト	16,000	308	4,928,000	
太平電業	31,000	534	16,554,000	
高砂熱学	73,000	707	51,611,000	
三晃金属	29,000	243	7,047,000	
N E C ネットエスアイ	21,200	1,734	36,760,800	
朝日工業社	28,000	296	8,288,000	
アタカ大機	16,000	344	5,504,000	
大 気 社	36,300	1,889	68,570,700	
ダイダン	25,000	526	13,150,000	
日比谷総合設	31,400	993	31,180,200	
東芝プラントシステム	41,000	1,094	44,854,000	
日本製粉	156,000	396	61,776,000	
日清製粉 G 本社	229,500	1,094	251,073,000	
日東富士製粉	8,000	313	2,504,000	
昭和産業	106,000	292	30,952,000	
鳥越製粉	21,100	621	13,103,100	
協同飼料	91,000	106	9,646,000	
中部飼料	22,800	526	11,992,800	
日本配合飼料	72,000	115	8,280,000	
東洋精糖	41,000	105	4,305,000	
日本甜菜糖	132,000	176	23,232,000	
三井製糖	101,000	308	31,108,000	
ネクスト	10,600	936	9,921,600	
日本 M & A センター	12,100	3,240	39,204,000	
ノバレーゼ	63	57,000	3,591,000	
アコーディア・ゴルフ	1,031	82,500	85,057,500	
タケエイ	2,400	2,810	6,744,000	
パソナグループ	235	47,000	11,045,000	
リンクアンドモチベーション	98	42,950	4,209,100	
G C A サヴィアングループ	10,600	1,068	11,320,800	
エス・エム・エス	66	262,000	17,292,000	
テンプホールディングス	32,100	1,216	39,033,600	
クックパッド	4,700	2,986	14,034,200	
エスクリ	4,900	705	3,454,500	
森永製菓	250,000	195	48,750,000	
中 村 屋	60,000	417	25,020,000	
江崎グリコ	92,000	896	82,432,000	
名糖産業	11,500	979	11,258,500	
不 二 家	145,000	201	29,145,000	
山崎製パン	185,000	1,079	199,615,000	
第一屋製パン	37,000	90	3,330,000	
モロゾフ	41,000	302	12,382,000	
亀田製菓	14,300	1,987	28,414,100	
カルビー	22,900	7,990	182,971,000	
森永乳業	214,000	298	63,772,000	
ヤクルト	147,700	3,545	523,596,500	
明治ホールディングス	74,900	4,030	301,847,000	
雪印メグミルク	49,700	1,509	74,997,300	
プリマハム	143,000	169	24,167,000	
日本ハム	192,000	1,331	255,552,000	

伊藤ハム	139,000	421	58,519,000	
林兼産業	84,000	84	7,056,000	
丸大食品	123,000	302	37,146,000	
米 久	22,500	948	21,330,000	
S F o o d s	16,500	897	14,800,500	
学情	8,100	337	2,729,700	
スタジオアリス	11,000	1,289	14,179,000	
シミックホールディングス	9,000	1,462	13,158,000	
システナ	238	84,100	20,015,800	
N E C フィールドイング	19,100	1,102	21,048,200	
新日鉄住金 S O L	14,800	1,792	26,521,600	
総合警備保障	85,600	1,183	101,264,800	
日本駐車場開発	2,473	5,750	14,219,750	
コア	8,600	724	6,226,400	
カカクコム	32,100	3,495	112,189,500	
アイロムホールディングス	456	5,620	2,562,720	
ルネサンス	10,700	737	7,885,900	
新日本科学	14,500	353	5,118,500	
ツクイ	10,500	1,737	18,238,500	
エムスリー	558	156,700	87,438,600	
ベストブライダル	69	88,500	6,106,500	
ディー・エヌ・エー	116,100	3,115	361,651,500	
博報堂 D Y H L D G S	32,600	6,450	210,270,000	
ぐるなび	16,500	1,024	16,896,000	
一休	147	89,500	13,156,500	
ジャパンベストレスキュー S	31	83,100	2,576,100	
ジェイコムホールディングス	4,400	725	3,190,000	
P G M ホールディングス	333	69,800	23,243,400	
サッポロホールディングス	414,000	331	137,034,000	
アサヒグループホールディン	507,700	2,005	1,017,938,500	
キリン H D	1,081,000	1,212	1,310,172,000	
宝ホールディングス	198,000	778	154,044,000	
オエノンホールディングス	67,000	228	15,276,000	
養 命 酒	3,000	797	2,391,000	
三国コカ・コ・ラ	26,500	989	26,208,500	
コカ・コーラウエスト	85,800	1,517	130,158,600	
コカコーラセントラルジャパン	32,100	1,284	41,216,400	
ダイドードリンコ	12,900	3,785	48,826,500	
伊 藤 園	68,900	1,788	123,193,200	
キーコーヒー	22,400	1,611	36,086,400	
ユニカフェ	6,100	525	3,202,500	
ジャパンフーズ	3,800	987	3,750,600	
日清オイリオグループ	111,000	329	36,519,000	
不二製油	61,500	1,220	75,030,000	
J - オイルミルズ	107,000	268	28,676,000	
ローソン	84,200	6,930	583,506,000	
サンエー	8,400	3,790	31,836,000	
キリン堂	8,200	715	5,863,000	
ダイユーエイト	4,600	674	3,100,400	
カワチ薬品	15,500	1,914	29,667,000	
エービーシー・マート	26,300	3,300	86,790,000	

ハードオフコーポレーション	11,000	645	7,095,000	
高千穂交易	9,700	913	8,856,100	
アスクル	15,200	1,362	20,702,400	
ゲオホールディングス	380	91,800	34,884,000	
ポイント	20,490	3,210	65,772,900	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	30,000	90	2,700,000	
伊藤忠食品	5,600	3,210	17,976,000	
くらコーポレーション	13,100	1,286	16,846,600	
キャンドウ	119	116,900	13,911,100	
エレマテック	10,500	1,236	12,978,000	
パル	6,450	4,280	27,606,000	
J A L U X	7,000	916	6,412,000	
エディオン	96,100	409	39,304,900	
あらた	50,000	333	16,650,000	
サーラコーポレーション	19,300	491	9,476,300	
トーメンデバイス	3,400	1,812	6,160,800	
J Pホールディングス	7,100	1,216	8,633,600	
あみやき亭	39	210,000	8,190,000	
東京エレクトロンデバイス	47	148,500	6,979,500	
ひらまつ	77	160,500	12,358,500	
双日	1,402,600	149	208,987,400	
ゲンキー	2,200	2,056	4,523,200	
アルフレッサホールディングス	57,600	4,365	251,424,000	
大黒天物産	3,800	2,303	8,751,400	
ハニーズ	19,490	1,119	21,809,310	
キッコーマン	206,000	1,369	282,014,000	
味の素	665,000	1,212	805,980,000	
キュービー	128,600	1,198	154,062,800	
ハウス食品	89,000	1,408	125,312,000	
カゴメ	90,800	1,704	154,723,200	
焼津水産化工	13,000	820	10,660,000	
アリアケジャパン	23,300	1,696	39,516,800	
ニチレイ	284,000	479	136,036,000	
横浜冷凍	55,800	640	35,712,000	
東洋水産	116,000	2,659	308,444,000	
日清食品H D	98,700	3,470	342,489,000	
永谷園	7,000	884	6,188,000	
フジッコ	28,000	1,042	29,176,000	
ロックフィールド	13,700	1,557	21,330,900	
日本たばこ産業	1,119,600	3,000	3,358,800,000	
ケンコーマヨネーズ	7,900	899	7,102,100	
わらべや日洋	15,200	1,479	22,480,800	
なとり	12,400	907	11,246,800	
片倉工業	29,700	895	26,581,500	
グンゼ	177,000	241	42,657,000	
ヒューリック	288,100	650	187,265,000	
神栄	29,000	117	3,393,000	
山下医科器械	1,800	1,347	2,424,600	
ラサ商事	10,500	500	5,250,000	
アルペン	16,900	1,613	27,259,700	
アルコニックス	6,300	1,602	10,092,600	

ビックカメラ	842	46,000	38,732,000	
D C Mホールディングス	114,900	616	70,778,400	
M o n o t a R O	14,900	3,455	51,479,500	
あい ホールディングス	35,700	790	28,203,000	
J . フロント リテイリング	525,000	522	274,050,000	
ドトール・日レスHD	39,100	1,259	49,226,900	
マツモトキヨシH L D G S	37,500	2,236	83,850,000	
broncoビリー	1,500	2,450	3,675,000	
スタートトゥデイ	46,100	1,092	50,341,200	
物語コーポレーション	2,900	2,230	6,467,000	
ココカラファイン	23,200	2,969	68,880,800	
三越伊勢丹HD	442,000	926	409,292,000	
東洋紡	997,000	176	175,472,000	
ユニチカ	646,000	55	35,530,000	
富士紡ホールディングス	113,000	277	31,301,000	
日清紡ホールディングス	150,000	706	105,900,000	
倉敷紡績	242,000	161	38,962,000	
ダイワボウHD	202,000	186	37,572,000	
シキボウ	144,000	120	17,280,000	
日東紡績	174,000	360	62,640,000	
トヨタ紡織	78,800	1,241	97,790,800	
ウエルシアHD	7,800	3,650	28,470,000	
クリエイトSDH	9,400	2,952	27,748,800	
バイタルK S K HD	41,900	856	35,866,400	
八洲電機	17,000	380	6,460,000	
U K Cホールディングス	13,200	2,100	27,720,000	
丸善CH I H D	13,200	285	3,762,000	
T O K A Iホールディングス	86,800	298	25,866,400	
日本毛織	74,000	616	45,584,000	
大東紡織	37,000	80	2,960,000	
トーア紡コーポレーション	107,000	72	7,704,000	
ダイドーリミテッド	26,700	667	17,808,900	
東京建物不動産販	11,800	348	4,106,400	
三栄建築設計	5,700	889	5,067,300	
野村不動産H L D G S	106,600	1,625	173,225,000	
常和ホールディングス	4,300	2,006	8,625,800	
帝国繊維	25,000	662	16,550,000	
ブックオフコーポレーション	12,300	705	8,671,500	
日本コークス工業	190,500	130	24,765,000	
ミタチ産業	3,800	445	1,691,000	
あさひ	12,800	1,262	16,153,600	
日本調剤	2,810	2,335	6,561,350	
コスモス薬品	11,200	9,980	111,776,000	
シップヘルスケアHD	31,800	2,441	77,623,800	
ソフトクリエイトHD	2,500	1,470	3,675,000	
セブン＆アイ・H L D G S	930,400	2,817	2,620,936,800	
ツルハホールディングス	21,800	7,950	173,310,000	
サンマルクホールディングス	7,200	3,755	27,036,000	
フェリシモ	6,400	1,079	6,905,600	
トリドール	19,200	930	17,856,000	
クスリのアオキ	3,300	5,460	18,018,000	

帝 人	896,000	203	181,888,000	
東 レ	1,826,000	526	960,476,000	
ク ラ レ	402,000	1,185	476,370,000	
旭 化 成	1,472,000	541	796,352,000	
サカイ オーベックス	62,000	147	9,114,000	
稲葉製作所	10,100	1,102	11,130,200	
宮地エンジニアリングG	79,000	175	13,825,000	
トーカロ	13,300	1,359	18,074,700	
アルファCO	8,100	1,010	8,181,000	
SUMCO	144,300	945	136,363,500	
川田テクノロジーズ	5,400	1,624	8,769,600	
住江織物	60,000	211	12,660,000	
日本フェルト	14,300	422	6,034,600	
イチカワ	14,000	165	2,310,000	
日本バイリン	30,000	439	13,170,000	
エコナックホールディングス	72,000	52	3,744,000	
日東製網	27,000	138	3,726,000	

[次へ](#)

平成25年2月7日現在

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備 考
		単 価	金 額	
芦森工業	56,000	140	7,840,000	
アツギ	197,000	114	22,458,000	
ダイニック	45,000	180	8,100,000	
共和レザー	13,400	303	4,060,200	
セーレン	63,400	547	34,679,800	
東海染工	34,000	107	3,638,000	
小松精練	39,000	399	15,561,000	
ワコールホールディングス	140,000	948	132,720,000	
ホギメディカル	14,900	4,580	68,242,000	
レナウン	50,800	157	7,975,600	
クラウドシア	2,500	1,153	2,882,500	
T S I ホールディングス	121,500	462	56,133,000	
デジタルハーツ	4,000	696	2,784,000	
I T ホールディングス	73,600	1,084	79,782,400	
ネオス	45	59,200	2,664,000	
電算システム	2,500	1,361	3,402,500	
グリー	114,800	1,396	160,260,800	
コーエーテクモHD	44,000	842	37,048,000	
三菱総合研究所	8,600	1,894	16,288,400	
ボルテージ	3,600	919	3,308,400	
K L a b	6,700	502	3,363,400	
ポールトゥウィン・ピットクル	3,500	1,581	5,533,500	
ネクソン	182,400	956	174,374,400	
エイチーム	1,500	2,749	4,123,500	
特種東海製紙	137,000	217	29,729,000	
ドワンゴ	115	210,800	24,242,000	
ベリサーブ	13	152,700	1,985,100	
マクロミル	22,000	1,110	24,420,000	
ティーガイア	27,800	928	25,798,400	
G M O ペイメントゲートウェイ	7,300	1,375	10,037,500	
ザッパラス	125	99,300	12,412,500	
インターネットイニシアティブ	26,100	2,582	67,390,200	
S R A ホールディングス	10,800	994	10,735,200	
朝日ネット	19,000	443	8,417,000	
王子ホールディングス	1,042,000	300	312,600,000	
三菱製紙	336,000	94	31,584,000	
北越紀州製紙	146,500	477	69,880,500	
中越パルプ	91,000	156	14,196,000	
巴川製紙	37,000	168	6,216,000	
大王製紙	99,000	632	62,568,000	
日本製紙G本社	113,900	1,492	169,938,800	
レンゴー	189,000	453	85,617,000	
トーモク	75,000	265	19,875,000	
ザ・パック	16,800	1,528	25,670,400	
コ - プケミカル	37,000	119	4,403,000	
昭和電工	1,467,000	149	218,583,000	

住友化学	1,622,000	288	467,136,000	
日本化成	45,000	147	6,615,000	
住友精化	45,000	329	14,805,000	
日産化学	167,700	1,175	197,047,500	
ラサ工業	84,000	141	11,844,000	
クレハ	166,000	350	58,100,000	
テイカ	40,000	276	11,040,000	
石原産業	425,000	84	35,700,000	
片倉チツカリン	13,000	219	2,847,000	
日本曹達	141,000	421	59,361,000	
東ソー	632,000	244	154,208,000	
トクヤマ	343,000	200	68,600,000	
セントラル硝子	211,000	276	58,236,000	
東亜合成	277,000	368	101,936,000	
ダイソー	95,000	262	24,890,000	
関東電化	57,000	199	11,343,000	
電気化学	473,000	339	160,347,000	
イビデン	137,200	1,526	209,367,200	
信越化学	423,300	5,590	2,366,247,000	
日本カ - バイド	69,000	453	31,257,000	
堺 化 学	89,000	267	23,763,000	
エア・ウォーター	195,000	1,161	226,395,000	
大陽日酸	310,000	650	201,500,000	
日本化学工業	89,000	132	11,748,000	
日本パ - カライジング	56,000	1,538	86,128,000	
高圧ガス	36,000	516	18,576,000	
チタン工業	28,000	249	6,972,000	
四国化成	34,000	622	21,148,000	
戸田工業	34,000	367	12,478,000	
ステラ ケミファ	10,400	1,948	20,259,200	
保土谷化学	54,000	173	9,342,000	
日本触媒	171,000	881	150,651,000	
大日精化	85,000	431	36,635,000	
カネカ	294,000	495	145,530,000	
協和発酵キリン	283,000	870	246,210,000	
三菱瓦斯化学	372,000	639	237,708,000	
三井化学	1,002,000	212	212,424,000	
J S R	232,800	1,856	432,076,800	
東京応化工業	45,600	1,961	89,421,600	
大阪有機化学	16,200	388	6,285,600	
三菱ケミカルH L D G S	1,476,000	444	655,344,000	
日本合成化学	48,000	711	34,128,000	
ダイセル	281,000	677	190,237,000	
住友ベ - クライト	184,000	393	72,312,000	
積水化学	484,000	865	418,660,000	
日本ゼオン	203,000	852	172,956,000	
アイカ工業	66,500	1,514	100,681,000	
宇部興産	1,130,000	197	222,610,000	
積水樹脂	34,000	1,071	36,414,000	
タキロン	56,000	352	19,712,000	
旭有機材	85,000	212	18,020,000	

日立化成	102,000	1,347	137,394,000	
ニチバン	22,000	281	6,182,000	
リケンテクノス	39,000	260	10,140,000	
大倉工業	57,000	306	17,442,000	
積水化成品	61,000	216	13,176,000	
群栄化学	66,000	227	14,982,000	
タイガース ポリマー	11,900	329	3,915,100	
ミライアル	5,900	1,800	10,620,000	
日本カ - リット	19,200	478	9,177,600	
日本化薬	166,000	1,022	169,652,000	
イーピーエス	140	233,600	32,704,000	
パナソニック インフォシス	5,300	2,052	10,875,600	
フェイス	775	10,280	7,967,000	
アミューズ	7,200	1,892	13,622,400	
野村総合研究所	125,800	2,037	256,254,600	
ドリームインキュベータ	75	91,300	6,847,500	
サイバネットシステム	196	25,650	5,027,400	
T A C	14,400	200	2,880,000	
ケネディクス	2,244	26,500	59,466,000	
電通	214,100	2,660	569,506,000	
インテージ	6,600	2,380	15,708,000	
テイクアンドグヴィニーズ	917	9,520	8,729,840	
ぴあ	7,000	1,385	9,695,000	
シンプレクスホールディング	414	30,750	12,730,500	
イオンファンタジー	7,700	1,347	10,371,900	
ソースネクスト	5,500	383	2,106,500	
ネクシィーズ	923	2,476	2,285,348	
メディカルシステムネットワ ーク	12,300	395	4,858,500	
日本精化	20,200	574	11,594,800	
A D E K A	101,800	838	85,308,400	
日油	184,000	418	76,912,000	
ミヨシ油脂	83,000	178	14,774,000	
ハリマ化成グループ	20,300	471	9,561,300	
花 王	626,000	2,821	1,765,946,000	
第一工業製薬	44,000	245	10,780,000	
三洋化成	74,000	500	37,000,000	
武田薬品	884,200	4,700	4,155,740,000	
アステラス製薬	524,000	4,750	2,489,000,000	
大日本住友製薬	167,200	1,250	209,000,000	
塩野義製薬	344,100	1,708	587,722,800	
田辺三菱製薬	196,500	1,251	245,821,500	
わかもと製薬	7,000	229	1,603,000	
あすか製薬	28,000	613	17,164,000	
日本新薬	49,000	1,124	55,076,000	
中外製薬	274,200	1,917	525,641,400	
科研製薬	93,000	1,449	134,757,000	
エーザイ	290,600	3,770	1,095,562,000	
ロート製薬	99,000	1,135	112,365,000	
小野薬品	115,500	4,900	565,950,000	
久光製薬	73,300	4,975	364,667,500	

有機合成薬品	18,000	249	4,482,000	
持田製薬	89,000	1,139	101,371,000	
参天製薬	80,700	3,730	301,011,000	
扶桑薬品	80,000	371	29,680,000	
日本ケミファ	33,000	568	18,744,000	
ツムラ	64,400	3,075	198,030,000	
日医工	34,300	1,926	66,061,800	
テ ル モ	172,700	3,995	689,936,500	
みらかホールディングス	61,500	4,065	249,997,500	
キッセイ薬品工業	43,900	1,741	76,429,900	
生化学工業	45,400	1,001	45,445,400	
栄研化学	16,900	1,197	20,229,300	
日水製薬	9,800	970	9,506,000	
鳥居薬品	14,200	2,166	30,757,200	
東和薬品	12,000	4,835	58,020,000	
富士製薬工業	6,100	1,615	9,851,500	
沢井製薬	15,500	9,740	150,970,000	
ゼリア新薬工業	34,000	1,388	47,192,000	
第一三共	744,400	1,559	1,160,519,600	
キョーリン製薬H D	63,000	1,868	117,684,000	
大幸薬品	11,000	918	10,098,000	
ダイト	6,600	1,300	8,580,000	
大塚ホールディングス	468,300	2,970	1,390,851,000	
大正製薬H D	56,800	6,250	355,000,000	
大日本塗料	136,000	187	25,432,000	
日本ペイント	204,000	860	175,440,000	
関西ペイント	267,000	998	266,466,000	
トウペ	21,000	124	2,604,000	
中国塗料	73,000	469	34,237,000	
日本特殊塗料	19,000	391	7,429,000	
藤倉化成	27,900	387	10,797,300	
太陽ホールディングス	19,400	2,765	53,641,000	
D I C	836,000	186	155,496,000	
サカタインクス	49,000	476	23,324,000	
東洋インキS Cホールディン	213,000	397	84,561,000	
アルプス技研	9,800	656	6,428,800	
サニックス	34,200	353	12,072,600	
ダイオーズ	5,100	547	2,789,700	
日本空調サービス	6,600	800	5,280,000	
オリエンタルランド	70,000	12,490	874,300,000	
ダスキン	65,000	1,815	117,975,000	
パーク2 4	115,800	1,618	187,364,400	
明光ネットワークジャパン	21,600	1,072	23,155,200	
ファルコS Dホールディングス	12,900	1,034	13,338,600	
クレスコ	5,100	637	3,248,700	
フジ・メディア・H D	2,152	148,800	320,217,600	
秀英予備校	5,000	357	1,785,000	
田谷	4,400	728	3,203,200	
ラウンドワン	73,500	526	38,661,000	
リゾートトラスト	39,900	1,993	79,520,700	
オービック	7,660	19,810	151,744,600	

T D Cソフトウェアエンジニア	4,700	792	3,722,400	
ヤフー	16,298	37,600	612,804,800	
ビー・エム・エル	13,900	2,270	31,553,000	
ワタベウェディング	7,200	766	5,515,200	
トレンドマイクロ	88,300	2,787	246,092,100	
もしもしホットライン	39,000	1,286	50,154,000	
東急コミュニティー	6,100	3,520	21,472,000	
リソー教育	2,417	7,600	18,369,200	
日本オラクル	44,400	3,820	169,608,000	
アルファシステムズ	7,300	1,096	8,000,800	
フューチャーアーキテクト	270	36,600	9,882,000	
ウェアハウス	4,800	224	1,075,200	
シーエーシー	13,800	740	10,212,000	
ソフトバンク・テクノ	5,400	927	5,005,800	
トーセ	5,900	571	3,368,900	
ユー・エス・エス	26,300	10,220	268,786,000	
オービックビジネスC	7,050	5,000	35,250,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,200	3,925	102,835,000	
アイティフォー	25,200	345	8,694,000	
東京個別指導学院	12,400	230	2,852,000	
東計電算	4,100	1,285	5,268,500	
エックスネット	18	127,400	2,293,200	
テー・オー・ダブリュー	8,200	534	4,378,800	
大塚商会	19,900	8,490	168,951,000	
総合メディカル	5,400	3,005	16,227,000	
サイボウズ	369	26,930	9,937,170	
ソフトブレーン	326	13,690	4,462,940	
アグレックス	6,200	850	5,270,000	
セントラルスポーツ	7,400	1,514	11,203,600	
電通国際情報S	13,700	924	12,658,800	
イーエムシステムズ	3,400	1,713	5,824,200	
ウェザーニューズ	5,800	2,266	13,142,800	
C I J	22,500	357	8,032,500	
WOWOW	69	206,900	14,276,100	
フルキャストホールディングス	220	17,900	3,938,000	
富士フイルムH L D G S	504,000	1,828	921,312,000	
コニカミノルタH L D G S	595,000	726	431,970,000	
資 生 堂	419,900	1,174	492,962,600	
ライオン	272,000	441	119,952,000	
高砂香料	78,000	489	38,142,000	
マンダム	25,400	2,780	70,612,000	
ミルボン	11,700	3,025	35,392,500	
ファンケル	59,600	1,040	61,984,000	
コーセー	42,400	1,979	83,909,600	
ドクターシーラボ	160	269,000	43,040,000	
ポーラ・オルビスHD	28,000	2,909	81,452,000	
ノエビアホールディングス	13,900	1,386	19,265,400	
エステー	14,800	979	14,489,200	
コ ニ シ	17,200	1,837	31,596,400	
長谷川香料	30,100	1,152	34,675,200	
小林製薬	35,700	4,305	153,688,500	

荒川化学工業	19,000	729	13,851,000	
メック	17,300	525	9,082,500	
日本高純度化学	64	232,400	14,873,600	
J C U	3,500	3,570	12,495,000	
新田ゼラチン	9,100	1,092	9,937,200	
アース製薬	17,100	2,963	50,667,300	
イハラケミカル	40,000	484	19,360,000	
北興化学	11,000	270	2,970,000	
大成ラミック	6,700	2,471	16,555,700	
クミアイ化学	49,000	512	25,088,000	
日本農薬	54,000	588	31,752,000	
昭和シエル石油	211,500	523	110,614,500	
コスモ石油	653,000	205	133,865,000	
富士興産	8,000	585	4,680,000	
ニチレキ	29,000	584	16,936,000	
東燃ゼネラル石油	356,000	805	286,580,000	
ユシロ化学	12,900	875	11,287,500	
ビーピー・カストロール	9,800	378	3,704,400	
A O Cホールディングス	54,800	388	21,262,400	
M O R E S C O	4,900	840	4,116,000	
出光興産	28,000	8,110	227,080,000	
J Xホールディングス	2,619,200	554	1,451,036,800	
横浜ゴム	264,000	729	192,456,000	
東洋ゴム	196,000	334	65,464,000	
ブリヂストン	739,600	2,473	1,829,030,800	
住友ゴム	183,900	1,257	231,162,300	
藤倉ゴム	14,000	268	3,752,000	
オカモト	84,000	309	25,956,000	
アキレス	192,000	133	25,536,000	
フ コ ク	10,000	798	7,980,000	
ニッタ	23,300	1,583	36,883,900	
クリエートメディック	7,000	817	5,719,000	
東海ゴム工業	43,600	1,046	45,605,600	
三ツ星ベルト	60,000	501	30,060,000	
パンドー化学	81,000	290	23,490,000	
鬼怒川ゴム	42,000	548	23,016,000	
旭 硝 子	1,162,000	663	770,406,000	
日本板硝子	1,075,000	124	133,300,000	
石塚硝子	31,000	152	4,712,000	
有沢製作所	36,800	369	13,579,200	
日本山村硝子	94,000	183	17,202,000	
日本電気硝子	418,000	448	187,264,000	
オハラ	9,000	674	6,066,000	
住友大阪セメント	419,000	300	125,700,000	
太平洋セメント	1,299,000	255	331,245,000	
デイ・シイ	24,600	331	8,142,600	
リゾートソリューション	21,000	190	3,990,000	
日本ヒュ - ム	23,000	511	11,753,000	
日本コンクリ - ト	40,000	328	13,120,000	
ジャパンパイル	16,800	585	9,828,000	
東海カーボン	205,000	374	76,670,000	

日本カーボン	124,000	189	23,436,000	
東洋炭素	11,600	2,209	25,624,400	
ノリタケ	123,000	250	30,750,000	
T O T O	365,000	767	279,955,000	
日本碍子	307,000	961	295,027,000	
日本特殊陶業	203,000	1,174	238,322,000	
ダントーホールディングス	36,000	112	4,032,000	
M A R U W A	5,200	2,667	13,868,400	
品川リフラクトリーズ	60,000	218	13,080,000	
黒崎播磨	51,000	257	13,107,000	
東京窯業	30,000	168	5,040,000	
ニッカトー	8,100	425	3,442,500	
フジインコーポレーテッド	21,500	1,426	30,659,000	
エーアンドエーマテリアル	50,000	91	4,550,000	
ニチアス	105,000	535	56,175,000	
新日鐵住金	9,974,000	273	2,722,902,000	
神戸製鋼所	3,270,000	137	447,990,000	
中山製鋼所	119,000	70	8,330,000	

[次へ](#)

平成25年2月7日現在

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備 考
		単 価	金 額	
合同製鐵	132,000	200	26,400,000	
J F Eホールディングス	601,900	2,182	1,313,345,800	
日新製鋼H D	99,800	726	72,454,800	
東京製鐵	130,200	530	69,006,000	
共英製鋼	22,000	1,676	36,872,000	
大和工業	48,800	2,643	128,978,400	
東京鐵鋼	46,000	407	18,722,000	
大阪製鐵	11,800	1,581	18,655,800	
淀川製鋼所	168,000	368	61,824,000	
東洋鋼鈑	49,000	326	15,974,000	
住友鋼管	16,000	760	12,160,000	
丸一鋼管	78,900	2,215	174,763,500	
モリ工業	36,000	268	9,648,000	
大同特殊鋼	365,000	487	177,755,000	
日本高周波	94,000	104	9,776,000	
日本冶金工	173,500	134	23,249,000	
山陽特殊製鋼	117,000	369	43,173,000	
愛知製鋼	125,000	424	53,000,000	
日立金属	167,000	872	145,624,000	
日本金属	61,000	133	8,113,000	
大平洋金属	151,000	515	77,765,000	
日本電工	93,000	302	28,086,000	
栗本鉄工所	103,000	359	36,977,000	
日本鑄鉄管	25,000	269	6,725,000	
日本製鋼所	364,000	486	176,904,000	
三菱製鋼	142,000	200	28,400,000	
日亜鋼業	33,000	236	7,788,000	
日本精線	16,000	338	5,408,000	
大紀アルミニウム	40,000	222	8,880,000	
日本軽金属H D	494,700	113	55,901,100	
三井金属	601,000	228	137,028,000	
東邦亜鉛	133,000	407	54,131,000	
三菱マテリアル	1,380,000	292	402,960,000	
住友鉱山	610,000	1,500	915,000,000	
D O W Aホールディングス	260,000	637	165,620,000	
古河機金	398,000	105	41,790,000	
大阪チタニウム	23,200	1,991	46,191,200	
東邦チタニウム	39,900	844	33,675,600	
住友軽金属	569,000	93	52,917,000	
古河スカイ	80,000	271	21,680,000	
古河電工	742,000	214	158,788,000	
住友電工	833,400	1,079	899,238,600	
フジクラ	380,000	269	102,220,000	
昭和電線H L D G S	306,000	90	27,540,000	
東京特殊電線	34,000	108	3,672,000	
タツタ電線	44,000	663	29,172,000	

日立電線	184,000	152	27,968,000	
沖 電 線	27,000	142	3,834,000	
カナレ電気	3,600	1,319	4,748,400	
平河ヒューテック	5,700	745	4,246,500	
リョービ	132,000	258	34,056,000	
アサヒHD	35,600	1,762	62,727,200	
東洋製罐	167,500	1,315	220,262,500	
ホッカンホールディングス	57,000	275	15,675,000	
コロナ	10,800	1,102	11,901,600	
横河ブリッジHLDGS	45,000	849	38,205,000	
日本橋梁	17,450	419	7,311,550	
駒井ハルテック	50,000	252	12,600,000	
高田機工	20,000	205	4,100,000	
三和ホールディングス	217,000	436	94,612,000	
文化シャッター -	61,000	452	27,572,000	
三協立山	31,800	1,834	58,321,200	
東洋シャッター -	6,800	511	3,474,800	
LIXILグループ	328,700	1,935	636,034,500	
日本フィルコン	17,800	373	6,639,400	
ノーリツ	46,400	1,624	75,353,600	
長府製作所	22,800	1,879	42,841,200	
リンナイ	38,000	6,280	238,640,000	
ユニプレス	39,500	2,116	83,582,000	
ダイニチ工業	12,100	844	10,212,400	
日東精工	31,000	300	9,300,000	
三洋工業	31,000	175	5,425,000	
岡 部	46,800	665	31,122,000	
中国工業	38,000	92	3,496,000	
東 プ レ	45,400	876	39,770,400	
高周波熱錬	31,400	707	22,199,800	
東京製綱	161,000	131	21,091,000	
パイオラックス	10,100	2,504	25,290,400	
日本発条	170,600	824	140,574,400	
中央発條	28,000	315	8,820,000	
アドパネクス	48,000	92	4,416,000	
三浦工業	35,100	2,275	79,852,500	
タ ク マ	80,000	557	44,560,000	
リブセンス	1,800	3,650	6,570,000	
ツ ガ ミ	63,000	528	33,264,000	
オークマ	153,000	686	104,958,000	
東芝機械	117,000	450	52,650,000	
ア マ ダ	361,000	586	211,546,000	
アイダエンジニア	55,400	729	40,386,600	
牧野フライス	109,000	623	67,907,000	
オーエスジー	96,900	1,230	119,187,000	
ダイジェット	28,000	157	4,396,000	
旭ダイヤモンド	58,000	871	50,518,000	
森精機製作所	124,300	1,006	125,045,800	
ディスコ	26,200	5,100	133,620,000	
日東工器	13,800	1,836	25,336,800	
豊田自動織機	205,100	3,290	674,779,000	

豊和工業	132,000	123	16,236,000	
大阪機工	92,000	141	12,972,000	
石川製作所	55,000	102	5,610,000	
東洋機械金属	17,800	226	4,022,800	
津田駒工業	57,000	177	10,089,000	
エンシュウ	58,000	146	8,468,000	
島精機製作所	30,800	1,868	57,534,400	
日阪製作所	30,000	838	25,140,000	
やまびこ	9,300	1,631	15,168,300	
ペガサスミシン製造	22,000	202	4,444,000	
ナブテスコ	116,600	1,839	214,427,400	
三井海洋開発	19,500	2,023	39,448,500	
レオン自動機	21,000	205	4,305,000	
S M C	70,400	15,680	1,103,872,000	
新川	20,000	483	9,660,000	
ホソカワミクロン	39,000	751	29,289,000	
ユニオンツール	13,000	1,889	24,557,000	
オイレス工業	24,600	1,821	44,796,600	
サト - ホールディングス	24,700	1,431	35,345,700	
日本エアータック	6,800	435	2,958,000	
日精樹脂工業	17,100	429	7,335,900	
ワイエイシイ	9,000	518	4,662,000	
小松製作所	1,100,700	2,458	2,705,520,600	
住友重機械	645,000	398	256,710,000	
日立建機	120,400	2,181	262,592,400	
日 工	33,000	377	12,441,000	
巴工業	8,900	1,759	15,655,100	
井関農機	225,000	260	58,500,000	
T O W A	21,000	617	12,957,000	
丸山製作所	54,000	189	10,206,000	
北川鉄工所	102,000	156	15,912,000	
シンニッタン	18,500	410	7,585,000	
クボタ	1,260,000	1,071	1,349,460,000	
荏原実業	5,900	1,262	7,445,800	
東洋エンジニア	135,000	422	56,970,000	
三菱化工機	73,000	160	11,680,000	
月島機械	38,000	802	30,476,000	
帝国電機製作所	7,300	1,717	12,534,100	
東京機械	84,000	78	6,552,000	
新東工業	47,500	705	33,487,500	
渋谷工業	14,900	860	12,814,000	
アイチ コーポレーション	39,100	487	19,041,700	
小森コーポレーション	57,400	946	54,300,400	
鶴見製作所	14,000	724	10,136,000	
住友精密	37,000	412	15,244,000	
酒井重工業	45,000	296	13,320,000	
荏原製作所	444,000	364	161,616,000	
石井鉄工所	35,000	198	6,930,000	
西島製作所	27,200	781	21,243,200	
千代田化工建	182,000	1,083	197,106,000	
ダイキン工業	307,600	3,705	1,139,658,000	

オルガノ	41,000	502	20,582,000	
ト - ヨ - カネツ	127,000	224	28,448,000	
栗田工業	130,100	1,814	236,001,400	
椿本チエイン	120,000	489	58,680,000	
大同工業	47,000	154	7,238,000	
日本コンベヤ	75,000	87	6,525,000	
日 機 装	79,000	1,059	83,661,000	
木村化工機	21,600	358	7,732,800	
新興プランテック	51,900	734	38,094,600	
アネスト岩田	37,000	384	14,208,000	
ダイフク	103,500	578	59,823,000	
加藤製作所	54,000	305	16,470,000	
油研工業	45,000	165	7,425,000	
タダノ	109,000	911	99,299,000	
フジテック	66,000	647	42,702,000	
C K D	63,100	619	39,058,900	
キトー	144	81,600	11,750,400	
平和	48,900	1,566	76,577,400	
理想科学工業	16,200	1,955	31,671,000	
S A N K Y O	68,300	3,620	247,246,000	
日本金銭機械	20,800	800	16,640,000	
マースエンジニアリング	12,700	1,857	23,583,900	
福島工業	6,200	2,300	14,260,000	
オーイズミ	8,000	433	3,464,000	
ダイコク電機	9,300	2,201	20,469,300	
ア マ ノ	68,400	849	58,071,600	
J U K I	145,000	168	24,360,000	
サンデン	128,000	413	52,864,000	
蛇の目ミシン	218,000	96	20,928,000	
ブラザー工業	291,200	993	289,161,600	
マックス	35,000	1,112	38,920,000	
モリタホールディングス	40,000	785	31,400,000	
グローリー	67,200	2,113	141,993,600	
大和冷機工業	36,000	528	19,008,000	
セガサミーホールディングス	242,100	1,591	385,181,100	
日本ピストンリング	82,000	202	16,564,000	
リ ケ ン	82,000	354	29,028,000	
T P R	25,000	1,332	33,300,000	
ホシザキ電機	49,200	2,731	134,365,200	
大豊工業	16,000	1,246	19,936,000	
日本精工	501,000	706	353,706,000	
N T N	484,000	289	139,876,000	
ジェイテクト	239,400	974	233,175,600	
不 二 越	209,000	390	81,510,000	
ミネベア	307,000	302	92,714,000	
日本トムソン	77,000	406	31,262,000	
T H K	149,800	1,555	232,939,000	
ユーシン精機	11,200	1,628	18,233,600	
前澤給装工業	8,900	1,295	11,525,500	
イーグル工業	28,000	826	23,128,000	
前澤工業	16,700	241	4,024,700	

日本ピラ - 工業	23,000	718	16,514,000	
キッツ	92,600	431	39,910,600	
日 立	5,314,000	537	2,853,618,000	
東 芝	4,448,000	414	1,841,472,000	
三菱電機	2,254,000	812	1,830,248,000	
富士電機	679,000	263	178,577,000	
東洋電機製造	44,000	254	11,176,000	
安川電機	247,000	869	214,643,000	
シンフォニア テクノロジー	136,000	170	23,120,000	
明 電 舎	223,000	287	64,001,000	
オリジン電気	33,000	421	13,893,000	
デンヨー	22,200	1,124	24,952,800	
日立工機	60,300	794	47,878,200	
三桜工業	28,700	653	18,741,100	
マキタ	137,100	4,160	570,336,000	
東芝テック	141,000	530	74,730,000	
芝浦メカトロニクス	40,000	218	8,720,000	
マブチモーター	33,500	4,225	141,537,500	
日本電産	121,800	5,270	641,886,000	
東光高岳H D	11,400	1,625	18,525,000	
宮越ホールディングス	7,800	334	2,605,200	
ダイヘン	123,000	287	35,301,000	
ヤーマン	1,900	1,258	2,390,200	
J V C ケンウッド	135,800	275	37,345,000	
第一精工	7,000	1,397	9,779,000	
日新電機	45,000	485	21,825,000	
大崎電気	30,000	471	14,130,000	
オムロン	250,900	2,186	548,467,400	
日東工業	33,200	1,369	45,450,800	
I D E C	29,600	823	24,360,800	
ジーエス・ユアサ コーポ	434,000	335	145,390,000	
サクサホールディングス	57,000	176	10,032,000	
メルコホールディングス	14,000	1,644	23,016,000	
テクノメディカ	17	519,000	8,823,000	
日本電気	2,916,000	257	749,412,000	
富 士 通	2,172,000	413	897,036,000	
沖 電 気	819,000	115	94,185,000	
岩崎通信機	100,000	82	8,200,000	
電気興業	59,000	376	22,184,000	
サンケン電気	114,000	370	42,180,000	
ナカヨ通信機	22,000	275	6,050,000	
アイホン	13,100	1,542	20,200,200	
ルネサスエレクトロニクス	58,500	295	17,257,500	
セイコーエプソン	153,800	992	152,569,600	
ワコム	414	310,000	128,340,000	
アルバック	44,900	831	37,311,900	
アクセル	11,400	2,097	23,905,800	
ピクセラ	9,500	193	1,833,500	
ナナオ	19,100	1,558	29,757,800	
日本信号	56,800	652	37,033,600	
京三製作所	49,000	303	14,847,000	

能美防災	30,000	642	19,260,000	
ホーチキ	19,000	443	8,417,000	
日本無線	48,000	285	13,680,000	
パナソニック	2,574,800	757	1,949,123,600	
シャープ	1,166,000	336	391,776,000	
アンリツ	121,000	1,218	147,378,000	
富士通ゼネラル	53,000	791	41,923,000	
日立国際電気	52,000	800	41,600,000	
ソ ニ ー	1,416,200	1,519	2,151,207,800	
T D K	126,900	3,270	414,963,000	
帝国通信工業	55,000	177	9,735,000	
ミツミ電機	85,800	503	43,157,400	
タムラ製作所	87,000	196	17,052,000	
アルプス電気	165,100	672	110,947,200	
池上通信機	72,000	75	5,400,000	
パイオニア	273,600	249	68,126,400	
日本電波工業	18,900	1,027	19,410,300	
日本トリム	2,950	2,875	8,481,250	
ローランド ディー・ジー・	10,000	1,249	12,490,000	
日本コロムビア	221,000	46	10,166,000	
フオスタ - 電機	23,000	1,472	33,856,000	
クラリオン	118,000	141	16,638,000	
S M K	67,000	290	19,430,000	
ヨコオ	17,800	422	7,511,600	
東 光	114,000	228	25,992,000	
ティアック	121,000	56	6,776,000	
ホシデン	61,200	512	31,334,400	
ヒロセ電機	39,200	10,810	423,752,000	
日本航空電子	51,000	739	37,689,000	
T O A	25,000	680	17,000,000	
ユニデン	66,000	247	16,302,000	
アルパイン	43,900	859	37,710,100	
スミダコーポレーション	14,000	566	7,924,000	
アイコム	12,500	1,976	24,700,000	
リオン	5,100	753	3,840,300	
船井電機	22,800	1,505	34,314,000	
横河電機	225,500	1,003	226,176,500	
新電元工業	72,000	347	24,984,000	
アズビル	63,100	1,939	122,350,900	
日本光電工業	44,800	3,110	139,328,000	
チ ノ ー	41,000	219	8,979,000	
共和電業	26,000	281	7,306,000	
日本電子材料	10,500	390	4,095,000	
堀場製作所	44,600	2,731	121,802,600	
アドバンテスト	153,600	1,201	184,473,600	
小野測器	26,000	399	10,374,000	
エスベック	23,300	723	16,845,900	
パナソニックデバイス	20,300	402	8,160,600	
キーエンス	55,300	26,160	1,446,648,000	
日置電機	11,800	1,379	16,272,200	
シスメックス	79,400	4,805	381,517,000	

メガチップス	18,500	1,393	25,770,500	
O B A R A G R O U P	16,100	1,318	21,219,800	
日本電産コパル電子	23,600	436	10,289,600	
ミヤチテクノス	10,200	686	6,997,200	
東京電波	6,700	498	3,336,600	
澤藤電機	13,000	260	3,380,000	
デンソー	556,700	3,700	2,059,790,000	
コーセル	32,800	1,078	35,358,400	
日立メディコ	17,000	1,294	21,998,000	
新日本無線	17,000	216	3,672,000	
オブテックス	14,500	1,062	15,399,000	
千代田インテグレ	11,100	1,047	11,621,700	
スタンレー電気	175,300	1,555	272,591,500	
岩崎電気	82,000	205	16,810,000	
ウシオ電機	136,700	1,038	141,894,600	
岡谷電機	13,000	344	4,472,000	
ヘリオステクノH	19,500	203	3,958,500	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年2月7日現在

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備 考
		単 価	金 額	
日本セラミック	14,800	1,372	20,305,600	
日本デジタル研究所	19,000	1,069	20,311,000	
古河電池	16,000	535	8,560,000	
双信電機	11,500	335	3,852,500	
山一電機	24,800	164	4,067,200	
図 研	13,200	576	7,603,200	
日本電子	83,000	345	28,635,000	
カ シ オ	214,700	775	166,392,500	
ファナック	234,600	14,790	3,469,734,000	
日本シイエムケイ	48,500	341	16,538,500	
エンプラス	9,900	3,815	37,768,500	
ロ ー ム	119,000	3,450	410,550,000	
浜松ホトニクス	87,900	3,495	307,210,500	
三井ハイテック	32,700	659	21,549,300	
新光電気工業	75,700	727	55,033,900	
京 セ ラ	187,400	8,250	1,546,050,000	
協栄産業	28,000	162	4,536,000	
太陽誘電	109,600	921	100,941,600	
村田製作所	236,400	6,040	1,427,856,000	
ユーシン	31,300	771	24,132,300	
双葉電子工業	41,800	995	41,591,000	
日東電工	194,500	5,730	1,114,485,000	
北陸電気工業	92,000	121	11,132,000	
東海理化電機	52,700	1,627	85,742,900	
ニチコン	71,000	843	59,853,000	
日本ケミコン	130,000	262	34,060,000	
K O A	28,400	918	26,071,200	
三井造船	873,000	178	155,394,000	
日立造船	891,500	146	130,159,000	
佐世保重工業	148,000	126	18,648,000	
三菱重工業	3,777,000	522	1,971,594,000	
川崎重工業	1,755,000	301	528,255,000	
I H I	1,540,000	252	388,080,000	
日本車輛	82,000	343	28,126,000	
日本輸送機	30,000	428	12,840,000	
近畿車輛	39,000	310	12,090,000	
島根銀行	5,200	1,280	6,656,000	
じもとホールディングス	159,600	204	32,558,400	
全国保証	17,300	2,688	46,502,400	
日産自動車	2,847,000	993	2,827,071,000	
いすゞ自動車	1,306,000	633	826,698,000	
トヨタ自動車	2,895,300	4,815	13,940,869,500	*
日野自動車	281,000	968	272,008,000	
三菱自動車工業	5,465,000	115	628,475,000	
エフテック	7,800	1,415	11,037,000	
武蔵精密工業	24,000	1,965	47,160,000	

日産車体	77,000	1,171	90,167,000
新明和工業	91,000	609	55,419,000
極東開発工業	41,900	1,007	42,193,300
日信工業	45,800	1,516	69,432,800
トピー工業	168,000	232	38,976,000
ティラド	76,000	255	19,380,000
曙ブレーキ	104,900	442	46,365,800
タチエス	30,300	1,724	52,237,200
N O K	109,000	1,380	150,420,000
フタバ産業	68,800	403	27,726,400
カヤバ工業	172,000	411	70,692,000
シロキ工業	50,000	239	11,950,000
市光工業	54,000	159	8,586,000
大同メタル工業	31,000	867	26,877,000
プレス工業	96,000	457	43,872,000
カルソニックカンセイ	153,000	413	63,189,000
太平洋工業	46,000	547	25,162,000
ケーヒン	46,600	1,427	66,498,200
河西工業	28,000	460	12,880,000
アイシン精機	206,100	3,455	712,075,500
富士機工	26,000	327	8,502,000
マ ッ ダ	3,568,000	317	1,131,056,000
ダイハツ	239,000	1,926	460,314,000
今仙電機製作所	16,500	1,199	19,783,500
本田技研	1,901,300	3,580	6,806,654,000
スズキ	471,100	2,410	1,135,351,000
富士重工業	712,000	1,390	989,680,000
ヤマハ発動機	342,500	1,142	391,135,000
ショーワ	53,200	1,011	53,785,200
小糸製作所	112,000	1,565	175,280,000
T B K	23,000	532	12,236,000
エクセディ	30,600	1,992	60,955,200
ミツバ	41,000	715	29,315,000
豊田合成	63,600	2,249	143,036,400
愛三工業	23,400	879	20,568,600
ヨ ロ ズ	16,500	1,555	25,657,500
エフ・シー・シー	36,800	2,076	76,396,800
新家工業	53,000	131	6,943,000
シマノ	90,800	6,190	562,052,000
タカタ	40,700	1,970	80,179,000
テイ・エス テック	47,600	2,121	100,959,600
小 野 建	19,400	892	17,304,800
はるやま商事	9,400	503	4,728,200
佐島電機	16,700	463	7,732,100
カップ・クリエイトH D	16,350	2,114	34,563,900
エコートレーディング	6,100	846	5,160,600
伯東	13,800	870	12,006,000
コンドーテック	18,500	537	9,934,500
中山福	13,400	694	9,299,600
ライトオン	16,600	709	11,769,400
ナガイレベン	29,500	1,190	35,105,000

ジーンズメイト	7,100	351	2,492,100
三菱食品	24,500	2,680	65,660,000
良品計画	23,600	5,160	121,776,000
三城ホールディングス	27,700	477	13,212,900
松田産業	16,500	1,185	19,552,500
メディバルHD	222,300	1,146	254,755,800
アドヴァン	11,600	908	10,532,800
S P K	5,600	1,569	8,786,400
アズワン	14,500	1,852	26,854,000
スズデン	8,000	479	3,832,000
尾家産業	6,800	844	5,739,200
シモジマ	13,800	989	13,648,200
ドウシシャ	12,000	2,476	29,712,000
コナカ	26,100	815	21,271,500
高速	13,400	787	10,545,800
ハウス ローゼ	2,700	1,359	3,669,300
G - 7ホールディングス	6,000	524	3,144,000
イオン北海道	13,900	496	6,894,400
コジマ	32,600	315	10,269,000
ヒマラヤ	6,500	777	5,050,500
コーナン商事	28,900	1,106	31,963,400
黒田電気	29,700	1,103	32,759,100
ネットワンシステムズ	81,000	930	75,330,000
エコス	7,900	601	4,747,900
ワタミ	26,300	1,733	45,577,900
マルシェ	5,800	802	4,651,600
ドン・キホーテ	64,800	3,730	241,704,000
丸文	19,800	431	8,533,800
メガネトップ	38,200	1,053	40,224,600
西松屋チェーン	43,700	768	33,561,600
ゼンショーホールディングス	84,600	1,092	92,383,200
ハビネット	13,500	721	9,733,500
幸楽苑	13,900	1,292	17,958,800
トーメンエレクトロニクス	11,400	1,159	13,212,600
ハークスレイ	6,300	722	4,548,600
サイゼリヤ	32,900	1,186	39,019,400
エクセル	9,700	856	8,303,200
マルカキカイ	7,300	1,212	8,847,600
アルゴグラフィックス	8,200	1,349	11,061,800
ガリバーインターナショナル	7,500	3,560	26,700,000
日本エム・ディ・エム	20,800	249	5,179,200
ポブラ	6,300	575	3,622,500
ユナイテッドアローズ	23,800	2,419	57,572,200
進和	13,300	1,093	14,536,900
エスケイジャパン	5,500	287	1,578,500
ダイトエレクトロン	10,600	366	3,879,600
ハイデイ日高	11,700	2,055	24,043,500
シークス	14,100	997	14,057,700
京都きもの友禅	15,000	1,044	15,660,000
コロワイド	74,000	992	73,408,000
田中商事	8,100	502	4,066,200

オーハシテクニカ	12,500	695	8,687,500
壱番屋	8,900	3,000	26,700,000
マクニカ	11,400	1,800	20,520,000
白銅	7,500	826	6,195,000
トップカルチャー	8,500	400	3,400,000
スギホールディングス	35,400	3,165	112,041,000
島津製作所	269,000	623	167,587,000
J M S	34,000	366	12,444,000
クボテック	49	27,430	1,344,070
モリテックス	4,800	294	1,411,200
長野計器	15,900	665	10,573,500
ブイ・テクノロジー	46	255,800	11,766,800
スター精密	39,500	934	36,893,000
東京計器	72,000	204	14,688,000
愛知時計	26,000	284	7,384,000
日本電産トーソク	10,900	650	7,085,000
東京精密	40,400	1,639	66,215,600
マニー	6,900	3,255	22,459,500
ニコン	420,700	2,139	899,877,300
トプコン	45,300	850	38,505,000
オリンパス	265,800	2,146	570,406,800
理研計器	18,300	558	10,211,400
大日本スクリーン	231,000	440	101,640,000
キヤノン電子	20,700	1,852	38,336,400
タムロン	17,300	2,115	36,589,500
H O Y A	547,800	1,776	972,892,800
ノーリツ鋼機	20,400	409	8,343,600
エー・アンド・デイ	20,500	407	8,343,500
キヤノン	1,399,900	3,310	4,633,669,000
リコー	678,000	1,018	690,204,000
日本電産コバル	17,600	650	11,440,000
シチズンホールディングス	254,200	518	131,675,600
リズム時計	102,000	181	18,462,000
大研医器	2,800	2,134	5,975,200
パラマウントベッドHD	19,300	2,970	57,321,000
S H O - B I	5,200	412	2,142,400
永大産業	30,000	377	11,310,000
ダンロップスポーツ	12,400	1,048	12,995,200
パンダイナムコH L D G S	232,900	1,445	336,540,500
共立印刷	29,500	238	7,021,000
フランスベッドH L D G S	142,000	196	27,832,000
マーベラスA Q L	253	41,650	10,537,450
パイロットコーポレーション	197	241,500	47,575,500
エイベックス・グループHD	42,000	2,546	106,932,000
トッパン・フォームズ	40,300	861	34,698,300
フジシールインターナショナル	27,300	2,045	55,828,500
タカラトミー	74,200	532	39,474,400
廣済堂	19,200	329	6,316,800
アーク	75,900	182	13,813,800
レック	7,600	1,135	8,626,000
タカノ	10,100	440	4,444,000

プロネクサス	26,800	520	13,936,000	
ホクシン	16,800	187	3,141,600	
ウッドワン	38,000	299	11,362,000	
大建工業	93,000	254	23,622,000	
き も と	21,100	822	17,344,200	
凸版印刷	636,000	590	375,240,000	
大日本印刷	686,000	772	529,592,000	
図書印刷	37,000	146	5,402,000	
共同印刷	70,000	234	16,380,000	
日本写真印刷	34,700	1,559	54,097,300	
光村印刷	3,000	266	798,000	
藤森工業	18,200	2,171	39,512,200	
宝印刷	13,300	626	8,325,800	
前澤化成工業	16,900	893	15,091,700	
アシックス	209,800	1,265	265,397,000	
ツ ツ ミ	11,200	2,249	25,188,800	
ジェイ エス ピー	15,400	1,381	21,267,400	
ニ チ ハ	26,300	1,285	33,795,500	
ローランド	21,600	885	19,116,000	
エフピコ	11,600	5,770	66,932,000	
小松ウオール工業	8,500	1,606	13,651,000	
ヤマハ	165,600	866	143,409,600	
河合楽器	78,000	177	13,806,000	
クリナップ	23,300	654	15,238,200	
ピジヨン	17,000	4,985	84,745,000	
天馬	18,900	938	17,728,200	
兼松日産農林	36,000	167	6,012,000	
キングジム	19,000	649	12,331,000	
リンテック	48,200	1,673	80,638,600	
T A S A K I	4,700	411	1,931,700	
信越ポリマー	46,500	370	17,205,000	
東 リ	62,000	225	13,950,000	
イトーキ	47,400	476	22,562,400	
任 天 堂	128,900	8,920	1,149,788,000	
三菱鉛筆	18,600	1,599	29,741,400	
松 風	11,200	833	9,329,600	
タカラスタンダ - ド	104,000	654	68,016,000	
コ ク ヨ	117,200	627	73,484,400	
ナカバヤシ	48,000	192	9,216,000	
ニ フ コ	52,600	2,015	105,989,000	
グローブライド	109,000	119	12,971,000	
岡村製作所	87,000	574	49,938,000	
日本バルカー	99,000	232	22,968,000	
M U T O Hホールディングス	31,000	238	7,378,000	
伊 藤 忠	1,774,600	1,100	1,952,060,000	
丸 紅	1,824,000	693	1,264,032,000	
スクロール	29,000	274	7,946,000	
高 島	42,000	294	12,348,000	
F & Aアクアホールディングス	16,900	1,066	18,015,400	
三陽商会	123,000	247	30,381,000	
長瀬産業	125,900	1,007	126,781,300	

ナイガイ	88,000	70	6,160,000	
蝶 理	14,200	992	14,086,400	
豊田通商	247,800	2,298	569,444,400	
オンワ - ドホールディングス	157,000	718	112,726,000	
三共生興	38,200	317	12,109,400	
兼 松	473,000	139	65,747,000	
美 津 濃	112,000	418	46,816,000	
ツカモトコーポレーション	37,000	168	6,216,000	
フアミリーマート	68,300	3,780	258,174,000	
ルック	39,000	439	17,121,000	
三井物産	1,920,000	1,406	2,699,520,000	
日本紙パルプ	116,000	300	34,800,000	
東京エレクトロン	189,600	3,905	740,388,000	
日立ハイテクノロジーズ	67,300	1,952	131,369,600	
カメイ	26,000	860	22,360,000	
東都水産	41,000	142	5,822,000	
スターゼン	77,000	259	19,943,000	
セイコーHD	144,000	306	44,064,000	
山 善	85,600	641	54,869,600	
椿本興業	23,000	264	6,072,000	
住友商事	1,312,900	1,151	1,511,147,900	
日本ユニシス	61,300	702	43,032,600	
内田洋行	48,000	266	12,768,000	
三菱商事	1,735,600	1,953	3,389,626,800	
第一実業	51,000	453	23,103,000	
キャノンマーケティングJPN	73,900	1,264	93,409,600	
西華産業	80,000	258	20,640,000	
佐藤商事	20,000	608	12,160,000	
菱洋エレクトロ	26,500	823	21,809,500	
東京産業	23,000	286	6,578,000	
ユアサ商事	229,000	179	40,991,000	
神鋼商事	57,000	187	10,659,000	
阪和興業	223,000	368	82,064,000	
カナデン	2,000	551	1,102,000	
菱電商事	33,000	580	19,140,000	
ニプロ	119,900	693	83,090,700	
フルサト工業	12,300	799	9,827,700	
岩谷産業	247,000	354	87,438,000	
すてきナイスグループ	88,000	234	20,592,000	
昭光通商	83,000	141	11,703,000	
ニチモウ	33,000	212	6,996,000	
極東貿易	27,000	182	4,914,000	
イ ワ キ	35,000	187	6,545,000	
兼松エレクトロニクス	14,200	1,071	15,208,200	
三愛石油	52,000	393	20,436,000	
稲畑産業	55,100	624	34,382,400	
G S Iクレオス	59,000	146	8,614,000	
明和産業	17,700	438	7,752,600	
ゴ - ルドウィン	54,000	557	30,078,000	
ユニ・チャ - ム	130,300	5,070	660,621,000	
デサント	59,000	569	33,571,000	

ヤマトインタ - ナショナル	15,100	415	6,266,500	
東邦ホールディングス	71,200	1,814	129,156,800	
サンゲツ	39,500	2,244	88,638,000	
ミツウロコグループ	36,100	501	18,086,100	
シナネン	49,000	387	18,963,000	
伊藤忠エネクス	49,400	499	24,650,600	
サンリオ	56,100	3,485	195,508,500	
サンワ テクノス	10,900	682	7,433,800	
リョーサン	36,200	1,988	71,965,600	
新光商事	24,600	836	20,565,600	
トーヨー	49,000	325	15,925,000	
三信電気	31,900	653	20,830,700	
東陽テクニカ	32,300	1,096	35,400,800	
モスフード サービス	29,200	1,745	50,954,000	
加賀電子	22,300	774	17,260,200	
三益半導体	20,000	781	15,620,000	
ソーダニツカ	2,000	392	784,000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年2月7日現在

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備 考
		単 価	金 額	
立花エレテック	13,600	875	11,900,000	
木曽路	27,300	1,802	49,194,600	
千 趣 会	40,100	568	22,776,800	
タカキユー	17,000	307	5,219,000	
ケーヨー	37,600	496	18,649,600	
アデランス	28,200	1,277	36,011,400	
上新電機	48,000	920	44,160,000	
日本瓦斯	30,600	1,113	34,057,800	
ベスト電器	69,000	134	9,246,000	
マルエツ	46,000	296	13,616,000	
ロイヤルホールディングス	37,200	1,098	40,845,600	
東 天 紅	17,000	201	3,417,000	
いなげや	24,900	1,000	24,900,000	
島 忠	50,300	1,874	94,262,200	
チヨダ	26,200	2,051	53,736,200	
ライフコーポレーション	14,000	1,285	17,990,000	
カ ス ミ	45,800	581	26,609,800	
リンガーハット	20,200	1,244	25,128,800	
さ が 美	18,000	130	2,340,000	
MR M A X	22,500	321	7,222,500	
テンアライド	17,400	308	5,359,200	
A O K Iホールディングス	19,100	2,218	42,363,800	
オークワ	35,000	1,055	36,925,000	
コメリ	34,200	2,505	85,671,000	
青山商事	61,200	1,956	119,707,200	
しまむら	25,800	9,200	237,360,000	
C F S コーポレーション	14,900	435	6,481,500	
高 島 屋	301,000	677	203,777,000	
松 屋	44,700	811	36,251,700	
エイチ・ツー・オーリテイリング	145,000	769	111,505,000	
丸 栄	37,000	106	3,922,000	
ニッセンHD	39,900	329	13,127,100	
パ ル コ	42,600	941	40,086,600	
丸井グループ	290,000	732	212,280,000	
クレディセゾン	194,700	1,926	374,992,200	
原信ナルスH L D G S	12,400	1,605	19,902,000	
井 筒 屋	120,000	102	12,240,000	
ダイエー	128,700	206	26,512,200	
イズミヤ	84,000	500	42,000,000	
イオン	784,000	1,056	827,904,000	
ユ ニ ー	212,900	676	143,920,400	
イ ズ ミ	55,100	1,922	105,902,200	
東武ストア	30,000	287	8,610,000	
平 和 堂	45,000	1,309	58,905,000	
フ ジ	24,800	1,842	45,681,600	
ヤオコー	11,200	3,650	40,880,000	

ゼビオ	30,100	1,722	51,832,200	
ケーズホールディングス	55,500	2,276	126,318,000	
P a l t a c	24,900	1,177	29,307,300	
O L Y M P I C	13,300	731	9,722,300	
日産東京販売HD	33,000	340	11,220,000	
新生銀行	1,925,000	183	352,275,000	
あおぞら銀行	809,000	264	213,576,000	
三菱UFJフィナンシャルG	16,842,800	538	9,061,426,400	
りそなホールディングス	2,287,700	422	965,409,400	
三井住友トラストHD	4,651,000	337	1,567,387,000	
三井住友フィナンシャルG	1,682,100	3,790	6,375,159,000	
第四銀行	286,000	329	94,094,000	
北越銀行	228,000	214	48,792,000	
西日本シティ銀行	780,000	264	205,920,000	
千葉銀行	858,000	583	500,214,000	
横浜銀行	1,415,000	448	633,920,000	
常陽銀行	838,000	436	365,368,000	
群馬銀行	502,000	443	222,386,000	
武蔵野銀行	35,800	3,105	111,159,000	
千葉興業銀行	42,500	739	31,407,500	
筑波銀行	92,500	361	33,392,500	
東京都民銀行	42,100	895	37,679,500	
七十七銀行	348,000	423	147,204,000	
青森銀行	167,000	275	45,925,000	
秋田銀行	153,000	257	39,321,000	
山形銀行	136,000	403	54,808,000	
岩手銀行	16,000	3,865	61,840,000	
東邦銀行	188,000	287	53,956,000	
東北銀行	115,000	156	17,940,000	
みちのく銀行	112,000	206	23,072,000	
ふくおかフィナンシャルG	903,000	396	357,588,000	
静岡銀行	652,000	898	585,496,000	
十六銀行	279,000	325	90,675,000	
スルガ銀行	217,000	1,260	273,420,000	
八十二銀行	410,000	459	188,190,000	
山梨中央銀行	136,000	381	51,816,000	
大垣共立銀行	297,000	301	89,397,000	
福井銀行	192,000	181	34,752,000	
北國銀行	258,000	377	97,266,000	
清水銀行	7,600	2,712	20,611,200	
滋賀銀行	209,000	514	107,426,000	
南都銀行	222,000	407	90,354,000	
百五銀行	201,000	395	79,395,000	
京都銀行	398,000	796	316,808,000	
三重銀行	93,000	213	19,809,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,558,000	151	235,258,000	
広島銀行	656,000	391	256,496,000	
山陰合同銀行	130,000	732	95,160,000	
中国銀行	172,000	1,328	228,416,000	
鳥取銀行	71,000	183	12,993,000	
伊予銀行	238,000	741	176,358,000	

百十四銀行	244,000	363	88,572,000
四国銀行	160,000	232	37,120,000
阿波銀行	183,000	558	102,114,000
鹿児島銀行	154,000	605	93,170,000
大分銀行	131,000	332	43,492,000
宮崎銀行	148,000	237	35,076,000
肥後銀行	183,000	554	101,382,000
佐賀銀行	135,000	214	28,890,000
十八銀行	143,000	246	35,178,000
沖縄銀行	16,600	3,680	61,088,000
琉球銀行	46,400	1,195	55,448,000
八千代銀行	11,400	2,292	26,128,800
セブン銀行	751,200	245	184,044,000
みずほフィナンシャルG	28,661,900	209	5,990,337,100
紀陽ホールディングス	887,000	136	120,632,000
山口フィナンシャルG	222,000	870	193,140,000
アクリーティブ	126	12,730	1,603,980
芙蓉総合リース	21,200	3,365	71,338,000
興銀リース	33,600	2,340	78,624,000
東京センチュリーリース	52,300	2,110	110,353,000
S B Iホールディングス	282,800	801	226,522,800
日本証券金融	85,400	654	55,851,600
大阪証券金融	29,200	252	7,358,400
アイフル	185,400	601	111,425,400
日本アジア投資	153,000	102	15,606,000
ポケットカード	22,400	482	10,796,800
長野銀行	79,000	179	14,141,000
名古屋銀行	201,000	327	65,727,000
北洋銀行	334,400	312	104,332,800
愛知銀行	8,000	4,785	38,280,000
第三銀行	127,000	178	22,606,000
中京銀行	92,000	201	18,492,000
東日本銀行	98,000	226	22,148,000
大光銀行	79,000	230	18,170,000
愛媛銀行	131,000	235	30,785,000
トマト銀行	87,000	182	15,834,000
みなと銀行	202,000	163	32,926,000
京葉銀行	183,000	451	82,533,000
関西アーバン銀行	310,000	118	36,580,000
栃木銀行	112,000	375	42,000,000
北日本銀行	6,600	2,492	16,447,200
東和銀行	239,000	110	26,290,000
福島銀行	274,000	98	26,852,000
大東銀行	142,000	103	14,626,000
リコーリース	15,400	2,485	38,269,000
イオン クレジットサービス	81,100	1,964	159,280,400
アコム	44,710	2,264	101,223,440
ジャックス	123,000	421	51,783,000
オリコ	429,500	315	135,292,500
日立キャピタル	43,800	1,724	75,511,200
オリックス	115,720	10,850	1,255,562,000

三菱ＵＦＪリース	56,450	4,285	241,888,250
ジャフコ	30,400	3,160	96,064,000
トモニホールディングス	170,800	385	65,758,000
大和証券Ｇ本社	2,203,000	559	1,231,477,000
野村ホールディングス	4,547,100	531	2,414,510,100
岡三証券グループ	189,000	684	129,276,000
丸三証券	68,000	666	45,288,000
東洋証券	83,000	277	22,991,000
東海東京ＨＤ	255,000	511	130,305,000
光世証券	53,000	179	9,487,000
水戸証券	65,000	376	24,440,000
いちよし証券	49,900	781	38,971,900
松井証券	131,900	857	113,038,300
ＮＫＳＪホールディングス	494,200	1,979	978,021,800
だいこう証券ビジ	13,000	686	8,918,000
マネックスＧ	2,515	28,810	72,457,150
カブドットコム証券	90,600	460	41,676,000
極東証券	29,900	1,184	35,401,600
岩井コスモホールディング	21,100	566	11,942,600
フィデアホール	128,100	224	28,694,400
池田泉州ＨＤ	183,600	511	93,819,600
ＭＳ＆ＡＤ	664,800	1,953	1,298,354,400
ＳＯＮＹＦＨ	213,100	1,530	326,043,000
小林洋行	5,200	239	1,242,800
第一生命	11,894	133,400	1,586,659,600
東京海上ＨＤ	861,500	2,713	2,337,249,500
アサックス	40	145,700	5,828,000
ＮＥＣキャピタルソリューショ ン	9,300	1,629	15,149,700
Ｔ＆Ｄホールディングス	762,800	1,132	863,489,600
三井不動産	1,049,000	2,095	2,197,655,000
三菱地所	1,557,000	2,143	3,336,651,000
平和不動産	42,300	1,304	55,159,200
東京建物	424,000	431	182,744,000
ダイビル	57,300	881	50,481,300
東急不動産	485,000	640	310,400,000
京阪神ビルディング	29,300	498	14,591,400
住友不動産	533,000	2,755	1,468,415,000
東宝不動産	19,800	737	14,592,600
太平洋興発	82,000	100	8,200,000
大京	343,000	226	77,518,000
テーオーシー	76,800	582	44,697,600
東京楽天地	27,000	369	9,963,000
レオパレス２１	178,400	378	67,435,200
フジ住宅	28,800	493	14,198,400
空港施設	27,500	468	12,870,000
明和地所	11,200	562	6,294,400
住友不動産販売	8,040	4,495	36,139,800
ゴールドクレスト	17,600	1,603	28,212,800
東栄住宅	15,100	1,239	18,708,900
リロ・ホールディング	8,100	3,715	30,091,500

日本エスリード	9,900	953	9,434,700	
東急リパブル	23,600	1,433	33,818,800	
飯田産業	21,000	1,130	23,730,000	
日神不動産	13,200	601	7,933,200	
アーネストワン	36,800	1,474	54,243,200	
タカラレーベン	23,400	1,078	25,225,200	
サンヨーハウジ 名古屋	117	110,200	12,893,400	
イオンモール	101,400	2,160	219,024,000	
フージャースコーポレーション	297	90,600	26,908,200	
タクトホーム	118	131,600	15,528,800	
ランド	48,600	8	388,800	
トーセイ	288	68,600	19,756,800	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,382	87,300	120,648,600	
サンフロンティア不動産	182	67,500	12,285,000	
ランドビジネス	150	46,150	6,922,500	
グランディハウス	5,100	825	4,207,500	
東武鉄道	1,280,000	494	632,320,000	
相鉄ホールディングス	361,000	307	110,827,000	
東京急行	1,326,000	511	677,586,000	
京浜急行	579,000	766	443,514,000	
小田急電鉄	722,000	921	664,962,000	
京王電鉄	630,000	684	430,920,000	
京成電鉄	338,000	825	278,850,000	
富士急行	62,000	558	34,596,000	
新京成電鉄	30,000	367	11,010,000	
東日本旅客鉄道	415,600	6,440	2,676,464,000	
西日本旅客鉄道	194,300	3,750	728,625,000	
東海旅客鉄道	187,400	8,250	1,546,050,000	
西日本鉄道	292,000	367	107,164,000	
ハマキョウレックス	6,400	3,065	19,616,000	
サカイ引越センター	4,100	2,050	8,405,000	
近畿日本鉄道	2,035,000	383	779,405,000	
阪急阪神H L D G S	1,423,000	502	714,346,000	
南海電鉄	470,000	396	186,120,000	
京阪電鉄	505,000	406	205,030,000	
名糖運輸	9,800	632	6,193,600	
名古屋鉄道	786,000	256	201,216,000	
トランコム	6,000	2,324	13,944,000	
日本通運	892,000	378	337,176,000	
ヤマトホールディングス	425,700	1,476	628,333,200	
山 九	274,000	380	104,120,000	
日 新	86,000	241	20,726,000	
丸 運	13,200	216	2,851,200	
丸全昭和運輸	76,000	267	20,292,000	
センコー	91,000	427	38,857,000	
トナミホールディングス	47,000	195	9,165,000	
日本梱包運輸	72,700	1,283	93,274,100	
日石輸送	28,000	203	5,684,000	
福山通運	137,000	461	63,157,000	
セイノーホールディングス	174,000	627	109,098,000	
神奈川中央交通	27,000	490	13,230,000	

日立物流	39,100	1,310	51,221,000	
日本郵船	1,785,000	226	403,410,000	
商船三井	1,097,000	329	360,913,000	
川崎汽船	986,000	196	193,256,000	
N S ユナイテッド海運	97,000	134	12,998,000	
乾 汽 船	26,700	319	8,517,300	
明治海運	20,400	332	6,772,800	
飯野海運	93,300	423	39,465,900	
共栄タンカー	19,000	213	4,047,000	
第一中央汽船	165,000	88	14,520,000	
日本航空	190,100	4,190	796,519,000	
全日本空輸	4,429,000	184	814,936,000	
パスコ	21,000	301	6,321,000	
三菱倉庫	160,000	1,360	217,600,000	
三井倉庫	105,000	390	40,950,000	
住友倉庫	151,000	482	72,782,000	
渋沢倉庫	59,000	310	18,290,000	
ヤマタネ	104,000	156	16,224,000	
東陽倉庫	37,000	228	8,436,000	
日本トランスシティ	52,000	340	17,680,000	
ケイヒン	42,000	136	5,712,000	
安田倉庫	17,900	664	11,885,600	
東洋埠頭	66,000	153	10,098,000	
宇徳	18,300	305	5,581,500	
上 組	249,000	758	188,742,000	
サンリツ	1,700	578	982,600	
キムラユニティー	5,400	839	4,530,600	
キューソー流通システム	6,400	946	6,054,400	
郵船ロジスティクス	17,700	957	16,938,900	
近鉄エクスプレス	20,100	2,996	60,219,600	
東海運	12,500	257	3,212,500	
エーアイティー	1,900	1,783	3,387,700	
東京放送H D	120,100	1,079	129,587,900	
日本テレビH L D S	203,300	1,346	273,641,800	
テレビ朝日	56,500	1,596	90,174,000	
スカパーJ S A T H D	1,939	44,850	86,964,150	
テレビ東京H D	16,500	1,012	16,698,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	20,200	693	13,998,600	
N E C モバイルリング	8,100	4,165	33,736,500	
日本電信電話	936,400	4,050	3,792,420,000	
K D D I	313,800	6,840	2,146,392,000	
光通信	22,400	4,095	91,728,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,328	136,900	2,509,103,200	
G M O インターネット	74,400	673	50,071,200	
学研ホールディングス	67,000	277	18,559,000	
ゼンリン	29,600	1,068	31,612,800	
昭文社	14,100	591	8,333,100	
角川グループH L D G S	19,200	2,393	45,945,600	
インプレスホールディングス	19,400	137	2,657,800	
東京電力	1,911,700	204	389,986,800	

中部電力	689,600	1,147	790,971,200	
関西電力	919,700	828	761,511,600	
中国電力	311,600	1,179	367,376,400	
北陸電力	220,800	1,021	225,436,800	
東北電力	563,000	699	393,537,000	
四国電力	202,900	1,111	225,421,900	
九州電力	497,700	860	428,022,000	
北海道電力	210,900	793	167,243,700	
沖縄電力	13,500	2,894	39,069,000	
電源開発	139,800	2,043	285,611,400	
東京瓦斯	2,706,000	435	1,177,110,000	
大阪瓦斯	2,187,000	338	739,206,000	
東邦瓦斯	573,000	469	268,737,000	
北海道瓦斯	41,000	246	10,086,000	
西部瓦斯	254,000	212	53,848,000	
静岡瓦斯	58,500	610	35,685,000	
アイネット	9,800	650	6,370,000	
松 竹	146,000	992	144,832,000	
東 宝	158,800	1,735	275,518,000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年2月7日現在

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備 考
		単 価	金 額	
エイチ・アイ・エス	19,200	3,230	62,016,000	
東 映	93,000	507	47,151,000	
A O I P r o .	7,500	593	4,447,500	
N T Tデータ	1,373	267,000	366,591,000	
共立メンテナンス	11,700	2,377	27,810,900	
イチネンホールディングス	24,900	603	15,014,700	
建設技術研究所	13,000	607	7,891,000	
スペース	13,000	672	8,736,000	
アインファーマシーズ	12,300	4,990	61,377,000	
燦ホールディングス	5,300	1,318	6,985,400	
スバル興業	3,000	328	984,000	
東京テアトル	92,000	134	12,328,000	
よみうりランド	47,000	471	22,137,000	
東京都競馬	181,000	219	39,639,000	
常磐興産	73,000	160	11,680,000	
カナモト	28,000	1,391	38,948,000	
東京ドーム	174,000	331	57,594,000	
D T S	21,200	1,195	25,334,000	
スクウェア・エニックス・H D	80,700	1,226	98,938,200	
シーイーシー	14,700	548	8,055,600	
カブコン	42,600	1,570	66,882,000	
アゴーラ・ホスピタリティーG	100,000	38	3,800,000	
日本空港ビルデング	76,900	1,031	79,283,900	
トランス・コスモス	30,600	1,121	34,302,600	
乃村工藝社	51,000	399	20,349,000	
ジャステック	13,500	560	7,560,000	
S C S K	52,800	1,673	88,334,400	
藤田観光	60,000	312	18,720,000	
K N T - C Tホールディングス	74,000	144	10,656,000	
日本管財	8,800	1,604	14,115,200	
トーカイ	10,400	2,605	27,092,000	
白 洋 舎	5,000	212	1,060,000	
セコム	244,900	4,600	1,126,540,000	
日本システムウエア	7,800	385	3,003,000	
セントラル警備保障	11,100	869	9,645,900	
アイネス	30,200	630	19,026,000	
丹青社	21,000	341	7,161,000	
メイテック	36,500	2,350	85,775,000	
T K C	20,600	1,672	34,443,200	
アサツー ディ・ケイ	38,800	2,459	95,409,200	
富士ソフト	31,500	1,933	60,889,500	
応用地質	24,700	1,132	27,960,400	
船井総合研究所	25,100	601	15,085,100	
N S D	43,900	920	40,388,000	
進学会	11,900	332	3,950,800	
丸紅建材リース	20,000	179	3,580,000	

コナミ	100,400	1,867	187,446,800
ベネッセホールディングス	71,700	3,985	285,724,500
イオンディライト	22,800	1,717	39,147,600
ナック	5,400	2,695	14,553,000
福井コンピュータH L D S	1,500	554	831,000
ニチイ学館	46,000	802	36,892,000
ダイセキ	34,700	1,349	46,810,300
ステップ	7,300	736	5,372,800
日鐵商事	49,000	268	13,132,000
元気寿司	7,000	1,134	7,938,000
トラスコ中山	25,600	1,753	44,876,800
ヤマダ電機	101,390	3,425	347,260,750
オートバックスセブン	27,400	3,840	105,216,000
アーランドサカモト	14,400	1,471	21,182,400
ニトリホールディングス	44,000	6,740	296,560,000
グルメ杵屋	16,000	667	10,672,000
愛 眼	18,100	303	5,484,300
吉野家ホールディングス	603	109,100	65,787,300
加藤産業	32,200	1,713	55,158,600
イノテック	19,200	435	8,352,000
イエローハット	20,900	1,402	29,301,800
富士エレクトロニクス	11,600	1,270	14,732,000
松屋フーズ	10,700	1,668	17,847,600
J B C C ホールディングス	18,900	697	13,173,300
J K ホールディングス	18,900	484	9,147,600
サガミチェーン	26,000	747	19,422,000
日 伝	10,100	2,144	21,654,400
ミロク情報サービス	15,000	350	5,250,000
北沢産業	11,000	175	1,925,000
杉本商事	12,300	806	9,913,800
因幡電機産業	26,300	2,918	76,743,400
住金物産	116,000	315	36,540,000
プレナス	24,900	1,509	37,574,100
ミニストップ	16,600	1,546	25,663,600
アークス	37,900	1,757	66,590,300
バ ロ ー	47,900	1,551	74,292,900
ミスミグループ本社	82,600	2,352	194,275,200
江守商事	5,300	999	5,294,700
アルテック	10,900	206	2,245,400
ベ ル ク	11,000	1,399	15,389,000
大 庄	10,400	1,197	12,448,800
タキヒヨー	34,000	469	15,946,000
ファーストリテイリング	44,500	24,710	1,099,595,000
ソフトバンク	1,063,300	3,465	3,684,334,500
スズケン	85,500	2,991	255,730,500
サンドラッグ	42,300	3,470	146,781,000
東京デリカ	7,300	1,019	7,438,700
ジェコス	15,600	660	10,296,000
ヤマザワ	5,900	1,525	8,997,500
や ま や	4,600	1,267	5,828,200
ベルーナ	27,650	672	18,580,800

合計	349,284,629		300,995,330,408	
----	-------------	--	-----------------	--

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘 柄	株 式 数
トヨタ自動車	500,000

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成25年2月28日現在

資産総額	4,647,224,306円
負債総額	33,702,276円
純資産総額（ - ）	4,613,522,030円
発行済数量	6,940,191,323口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6648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25年2月28日現在

資産総額	302,341,957,471円
負債総額	1,475,925,947円
純資産総額（ - ）	300,866,031,524円
発行済数量	225,660,405,679口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3333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係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、当該譲渡に係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係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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

（2）会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

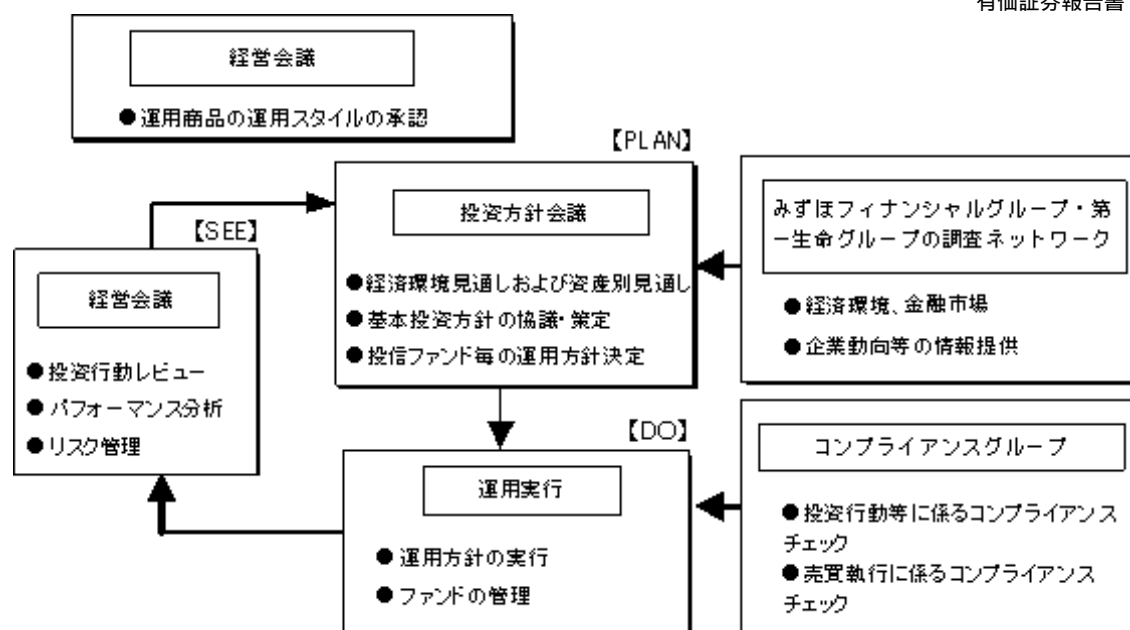
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成25年2月28日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。平成25年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は279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	12	53,375,811,146
追加型株式投資信託	258	4,501,735,081,553
単位型公社債投資信託	8	83,912,051,177
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	169,826,814
合計	279	4,639,192,770,690

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。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第27期事業年度（自平成23年4月1日至平成24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28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24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26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	12,220,759	12,520,748
金銭の信託	5,967,344	6,548,577
前払費用	27,593	25,744
未収委託者報酬	2,942,180	2,780,527
未収運用受託報酬	1,061,935	1,167,998
未収投資助言報酬	2 267,240	2 241,851
未収収益	186,483	212,226
繰延税金資産	403,201	344,793
その他	102,404	22,264
流動資産計	23,179,143	23,864,733
固定資産		
有形固定資産	400,967	470,082
建物	1 183,704	1 167,433
車両運搬具	-	1 4,752
器具備品	1 206,306	1 188,367
建設仮勘定	10,956	109,529
無形固定資産	1,267,273	1,262,102
商標権	1 510	1 383
ソフトウェア	1 780,190	1 1,101,685
ソフトウェア仮勘定	478,971	152,513
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 451	1 371
投資その他の資産	4,252,397	3,982,258
投資有価証券	604,498	450,882
関係会社株式	2,457,319	2,119,074
繰延税金資産	402,191	590,822
長期差入保証金	702,696	731,197
その他	85,690	90,282
固定資産計	5,920,638	5,714,444
資産合計	29,099,782	29,579,177

（単位：千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	120,910	132,805
未払金	1,479,756	1,460,128
未払収益分配金	3,223	670
未払償還金	98,362	86,391
未払手数料	1,134,992	1,088,348
その他未払金	243,178	284,718
未払費用	2 1,226,658	2 1,105,512
未払法人税等	1,706,391	1,195,056
未払消費税等	143,728	92,354
賞与引当金	575,326	574,646
その他	10,000	-
流動負債計	5,262,771	4,560,503
固定負債		
退職給付引当金	579,063	680,768
役員退職慰労引当金	100,260	56,690
固定負債計	679,324	737,458
負債合計	5,942,095	5,297,962
（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	18,512,674	19,716,594
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	13,430,000	15,630,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,459,380	3,463,300
株主資本計	22,941,152	24,145,072
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216,534	136,143
評価・換算差額等計	216,534	136,143
純資産合計	23,157,686	24,281,215
負債・純資産合計	29,099,782	29,579,177

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	24,367,005		23,208,602	
運用受託報酬	4,458,894		4,966,992	
投資助言報酬	1,019,727		943,057	
その他営業収益	789,867		697,063	
営業収益計		30,635,495		29,815,715
営業費用				
支払手数料	10,405,593		10,154,958	
広告宣伝費	272,928		164,286	
公告費	2,297		-	
調査費	4,755,890		4,590,302	
調査費	2,611,173		2,888,013	
委託調査費	2,144,716		1,702,289	
委託計算費	338,206		335,754	
営業雑経費	671,721		496,565	
通信費	30,286		26,941	
印刷費	585,041		399,066	
協会費	23,561		25,014	
諸会費	38		41	
支払販売手数料	32,794		45,500	
営業費用計		16,446,637		15,741,867
一般管理費				
給料	4,576,265		4,630,102	
役員報酬	1 235,289		1 245,224	
給料・手当	3,768,114		3,824,122	
賞与	572,860		560,755	
交際費	38,997		35,987	
寄付金	13,335		3,156	
旅費交通費	255,190		213,642	
租税公課	89,571		84,346	
不動産賃借料	718,929		656,463	
退職給付費用	139,773		164,627	
固定資産減価償却費	486,987		475,556	
福利厚生費	20,476		24,887	
修繕費	20,842		6,721	
賞与引当金繰入	575,326		574,646	
役員退職慰労引当金繰入	42,036		30,048	
役員退職金	13,140		27,503	
機器リース料	1,951		1,510	
事務委託費	331,935		323,740	
消耗品費	70,952		58,739	
器具備品費	575		2,889	
諸経費	124,218		114,695	
一般管理費計		7,520,506		7,429,267
営業利益		6,668,351		6,644,580

（単位：千円）

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）		第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	4	341,775	61,720	
受取利息		9,168	3,921	
時効成立分配金		2,574	11,383	
為替差益		-	1,660	
投資信託解約益		157,213	-	
先物利益		9,816	-	
金銭の信託運用益		69,014	-	
雑収入		8,602	5,992	
営業外収益計		598,165		84,678
営業外費用				
為替差損		755	-	
時効成立後支払分配金		-	36	
金銭の信託運用損		-	417,812	
雑損失		6,089	1,152	
営業外費用計		6,844		419,001
経常利益		7,259,672		6,310,257
特別利益				
ゴルフ会員権売却益		-	1,959	
貸倒引当金戻入益		4,288	-	
過年度損益修正益	3, 4	105,241	-	
特別利益計		109,530		1,959
特別損失				
固定資産除却損	2	31,419	2	36,415
固定資産売却損		1,440		381
関係会社株式評価損		3,825		338,244
特別損失計		36,684		375,042
税引前当期純利益		7,332,518		5,937,173
法人税、住民税及び事業税		2,885,426		2,582,251
法人税等調整額		7,586		56,997
法人税等合計		2,877,839		2,525,253
当期純利益		4,454,678		3,411,920

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	11,650,000	13,430,000
当期変動額	1,780,000	2,200,000
当期末残高	13,430,000	15,630,000
研究開発積立金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
当期首残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	3,464,702	4,459,380
当期変動額		
剰余金の配当	1,680,000	2,208,000
別途積立金の積立	1,780,000	2,200,000
当期純利益	4,454,678	3,411,920
当期末残高	4,459,380	3,463,300
利益剰余金合計		
当期首残高	15,737,995	18,512,674
当期変動額	2,774,678	1,203,920
当期末残高	18,512,674	19,716,594
株主資本合計		
当期首残高	20,166,473	22,941,152

	当期変動額	2,774,678	1,203,920
	当期末残高	22,941,152	24,145,072
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高	231,525	216,534
	当期変動額（純額）	14,991	80,390
	当期末残高	216,534	136,143
純資産合計			
	当期首残高	20,397,999	23,157,686
	当期変動額	2,759,687	1,123,529
	当期末残高	23,157,686	24,281,215

[次へ](#)

重要な会計方針

項目	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産（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
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(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。
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. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

追加情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
建物	484,832	513,080
車両運搬具	-	171
器具備品	499,620	462,449
商標権	2,428	2,555
ソフトウェア	809,403	961,584
電話施設利用権	1,145	1,225

2. 関係会社項目

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

（千円）

		第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	266,194	238,121
流動負債	未払費用	291,628	292,536

（損益計算書関係）

1. 役員報酬の限度額

（千円）

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
取締役（年額）	250,000	250,000
監査役（年額）	50,000	50,000

２．固定資産除却損の内訳

（千円）

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
建物	15,317	1,892
器具備品	3,597	18,917
ソフトウェア	12,503	15,606

３．過年度損益修正益の内訳

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

４．関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。

（千円）

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
受取配当金	331,240	-
過年度損益修正益	105,241	-

（株主資本等変動計算書関係）

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

（１）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
----	-----------	--------------------	---------------------	-----	-------

平成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
----------------------	----------	-----------	--------	------------	-----------

(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23年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成24年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（リース取引関係）

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）			第27期 （平成24年3月31日現在）		
	取得価額 相当額	減価償却累 計額相当額	期末残高 相当額	取得価額 相当額	減価償却累 計額相当額	期末残高 相当額
器具備品	46,681	46,138	543	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-
合計	46,681	46,138	543	-	-	-

未経過リース料期末残高相当額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
一年以内	586	-
一年超	-	-
合計	586	-

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
支払リース料	15,998	588
減価償却費相当額	14,995	543
支払利息相当額	234	1

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期末残高相当額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
一年以内	1,475	-
一年超	-	-

合計	1,475	-
----	-------	---

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第26期（平成23年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	12,220,759	12,220,759	-
(2) 金銭の信託	5,967,344	5,967,344	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	524,252	524,252	-
資産計	18,712,356	18,712,356	-
(1) 未払法人税等	1,706,391	1,706,391	-
負債計	1,706,391	1,706,391	-

第27期（平成24年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）投資有価証券

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

負 債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,457,319	2,119,074
長期差入保証金	702,696	731,197

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）預金	12,220,413	-	-	-
合計	12,220,413	-	-	-

第27期（平成24年3月31日現在）

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

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1．売買目的有価証券

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第26期の貸借対照表計上額2,457,319千円、第27期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

4. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	513,129	146,101	367,027
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,400	3,000	400
小計	516,529	149,101	367,427
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,723	10,000	2,277
小計	7,723	10,000	2,277
合計	524,252	159,101	365,150

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

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

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

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

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

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（千円）

区分	売却額	売却益の合計	売却損の合計
その他（投資信託）	719,016	162,043	4,830

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第26期（平成23年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	5,967,344	119,701

第27期（平成24年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
（１）退職給付債務	636,624	740,560
（２）未認識数理計算上の差異	57,560	59,792
退職給付引当金	579,063	680,768

3．退職給付費用に関する事項

（千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
（１）勤務費用	85,216	102,728
（２）利息費用	7,954	9,549
（３）数理計算上の差異の費用処理額	9,383	13,388
（４）確定拠出年金 拠出額	37,218	38,960
退職給付費用	139,773	164,627

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（１）割引率

第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
1.5%	1.5%

（２）退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

（３）数理計算上の差異の処理年数

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	128,299	87,682
未払事業所税	6,141	5,792
賞与引当金	234,157	218,423
未払法定福利費	28,823	24,791
未払確定拠出年金掛金	2,739	2,607
減価償却超過額（一括償却資産）	3,039	5,496
減価償却超過額	36,256	150,369
繰延資産償却超過額（税法上）	139,027	47,261
退職給付引当金	235,678	243,845
役員退職慰労引当金	40,806	20,204
ゴルフ会員権評価損	5,577	2,138
投資有価証券評価損	763	4,410
関係会社株式評価損	1,556	121,913
その他有価証券評価差額金	-	678
貸倒引当金繰入額	-	-
繰延税金資産合計	862,867	935,615
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	57,474	-
繰延税金負債合計	57,474	-
差引繰延税金資産の純額	805,393	935,615

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

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

3. 法人税率の変更等による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.01%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は98,284千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は108,988千円増加し、その他有価証券評価差額金は10,703千円増加しております。

（セグメント情報等）

１．セグメント情報

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

２．関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（１）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	710,392	未収投資助言報酬	190,149

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	687,972	未収投資助言報酬	177,282

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	646,432	未払 費用	172,736
	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	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接 100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	1,538,792	未払 手数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	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	536,163	未払 手数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	みずほ第 一ファイ ナンス シャル テクノ ロジー株 式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	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)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
								信託報酬の 支払	3,163		

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税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26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
1株当たり純資産額	964,903円60銭	1,011,717円32銭
1株当たり当期純利益金額	185,611円60銭	142,163円33銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
当期純利益	4,454,678千円	3,411,920千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,454,678千円	3,411,920千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

	第28期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,242,702
金銭の信託		7,499,425
前払費用		92,263
未収委託者報酬		2,663,804
未収運用受託報酬		1,676,248
未収投資助言報酬		229,963
未収収益		208,987
繰延税金資産		353,360
その他		20,041
流動資産計		22,986,796
固定資産		
有形固定資産		410,173
建物	1	154,028
車両運搬具	1	3,761
器具備品	1	141,266
建設仮勘定		111,117
無形固定資産		1,414,348
商標権	1	336
ソフトウェア	1	1,104,659
ソフトウェア仮勘定		301,872
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	331
投資その他の資産		3,941,169
投資有価証券		352,985
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		649,103
長期差入保証金		731,564
その他		88,442
固定資産計		5,765,691
資産合計		28,752,487

	第28期中間会計期間末 （平成24年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	90,304
未払金	1,586,848
未払収益分配金	670
未払償還金	84,932
未払手数料	1,045,061
その他未払金	456,184
未払費用	1,144,835
未払法人税等	1,153,892
未払消費税等	94,807
前受収益	4,645
賞与引当金	592,564
流動負債計	4,667,898
固定負債	
退職給付引当金	745,286
役員退職慰労引当金	83,600
固定負債計	828,887
負債合計	5,496,785
（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	18,754,087
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	16,330,000
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	1,800,793
株主資本計	23,182,565
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	73,136
評価・換算差額等計	73,136
純資産合計	23,255,702
負債・純資産合計	28,752,487

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日至平成24年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	11,666,848	
運用受託報酬	2,624,179	
投資助言報酬	432,133	
その他営業収益	323,176	
営業収益計		15,046,337
営業費用		
支払手数料	5,650,162	
広告宣伝費	74,513	
公告費	1,649	
調査費	2,242,409	
調査費	1,509,414	
委託調査費	732,994	
委託計算費	164,548	
営業雑経費	214,207	
通信費	12,777	
印刷費	185,164	
協会費	12,746	
諸会費	18	
支払販売手数料	3,500	
営業費用計		8,347,489
一般管理費		
給料	2,141,911	
役員報酬	120,924	
給料・手当	2,020,987	
交際費	16,251	
寄付金	2,693	
旅費交通費	89,758	
租税公課	49,433	
不動産賃借料	337,699	
退職給付費用	85,485	
固定資産減価償却費	1 250,300	
福利厚生費	9,221	
修繕費	5,343	
賞与引当金繰入	592,564	
役員退職慰労引当金繰入	26,910	
機器リース料	23	
事務委託費	123,542	
消耗品費	30,045	
器具備品費	894	
諸経費	51,882	
一般管理費計		3,813,961
営業利益		2,884,886

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自平成24年4月1日至平成24年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	4,243	
受取利息	1,821	
時効成立分配金	1,459	
為替差益	4,637	
雑収入	4,289	
営業外収益計		16,451
営業外費用		
金銭の信託運用損	48,384	
営業外費用計		48,384
経常利益		2,852,953
特別損失		
固定資産除却損	124	
特別損失計		124
税引前中間純利益		2,852,828
法人税、住民税及び事業税		1,135,292
法人税等調整額		31,957
法人税等合計		1,103,335
中間純利益		1,749,493

(3)中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

		第28期中間会計期間 （自平成24年4月1日至平成24年9月30日）
株主資本	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	15,630,000
	当中間期変動額	700,000
	当中間期末残高	16,330,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	3,463,300
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	2,712,000
	別途積立金の積立	700,000
	中間純利益	1,749,493
	当中間期末残高	1,800,793
	利益剰余金合計	
	当期首残高	19,716,594
	当中間期変動額	962,506
	当中間期末残高	18,754,087
	株主資本合計	
	当期首残高	24,145,072
	当中間期変動額	962,506
	当中間期末残高	23,182,565
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	136,143
	当中間期変動額（純額）	63,006
	当中間期末残高	73,136
純資産合計		

	当期首残高	24,281,215
	当中間期変動額	1,025,513
	当中間期末残高	23,255,702

[前へ](#)[次へ](#)

重要な会計方針

項目	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 （会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更） 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。 (2) 無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5．引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異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．外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第28期中間会計期間末 （平成24年9月30日現在）		
1．固定資産の減価償却累計額	建物	...	526,485千円
	車両運搬具	...	1,162千円
	器具備品	...	509,550千円
	商標権	...	602千円
	ソフトウェア	...	871,599千円
	電話施設利用権	...	1,265千円

（中間損益計算書関係）

項目	第28期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）		
1．減価償却実施額	有形固定資産	...	61,496千円
	無形固定資産	...	188,803千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,242,702	10,242,702	-
(2) 金銭の信託	7,499,425	7,499,425	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	272,739	272,739	-
資産計	18,014,867	18,014,867	-
(1) 未払法人税等	1,153,892	1,153,892	-
負債計	1,153,892	1,153,892	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,119,074
長期差入保証金	731,564

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

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

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式

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

3．その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	262,099	146,101	115,997
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,454	3,000	454
小計	265,553	149,101	116,451
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）	7,186	10,000	2,814
小計	7,186	10,000	2,814
合計	272,739	159,101	113,637

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

（金銭の信託関係）

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

1．満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2．その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

１．セグメント情報

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

２．関連情報

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	11,666,848	3,056,312	323,176	15,046,337

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）		
1株当たり純資産額	968,987円	59銭
1株当たり中間純利益金額	72,895円	54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28期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
中間純利益	1,749,493千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,749,493千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成24年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

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

名 称	資本金の額* (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。

* 平成24年3月末現在

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) 募集販売の取扱い
- (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）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

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24年5月7日
有価証券届出書の訂正届出書	平成24年11月7日
有価証券報告書	平成24年5月7日
半期報告書	平成24年11月7日

独立監査人の監査報告書

平成25年3月21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 D C 国内株式インデックスファンドの平成24年2月8日から平成25年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M D C 国内株式インデックスファンドの平成25年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

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24年6月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注）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24年12月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

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24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24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注）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](#)