

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成21年12月28日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M国内株式パッシブ・ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

D I A M国内株式パッシブ・ファンド  
(以下「ファンド」といいます。)

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）  
格付けは取得していません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### (3) 【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### (4) 【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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

### (5) 【申込手数料】

ありません。

### (6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。当初元本は1口当たり1円です。

**(7) 【申込期間】**

継続申込期間：平成22年1月14日から平成23年1月12日まで

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**(8) 【申込取扱場所】**

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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

**(9) 【払込期日】**

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、買付代金を販売会社に支払うものとします。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。

**(10) 【払込取扱場所】**

取得申込者は、販売会社所定の方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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

**(11) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

**(12) 【その他】**

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再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、受益者と販売会社との間で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。販売会社までお問い合わせください。

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2時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前10時）までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続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、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

#### 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

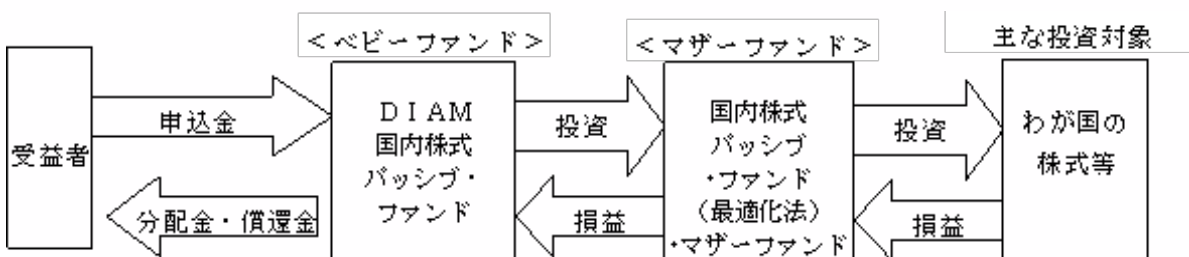
東証株価指数（TOPIX）とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株式指数で、東京証券取引所第1部に上場されている全ての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。

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「株東京証券取引所」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株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。株東京証券取引所は、TOPIXの指数値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。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。D I A M国内株式パッシブ・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、D I A M国内株式パッシブ・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。D I A M国内株式パッシブ・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、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。株東京証券取引所は、D I A M国内株式パッシブ・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、D I A M国内株式パッシブ・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。株東京証券取引所は、当社又はD I A M国内株式パッシブ・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、株東京証券取引所はD I A M国内株式パッシブ・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。

当ファンドは契約型の追加型株式投資信託に属します。

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド（「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」）の受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。なお、当該マザーファンドは主に国内の株式に投資を行います。



当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。

## 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  追加型投信	国内  海外  内外	株式  債券  不動産投信  その他資産 ( )  資産複合	インデックス型    特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

## 単位型投信・追加型投信

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

## 投資対象地域

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

## 投資対象資産

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

## 補足分類

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

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

## 投資対象資産

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

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

## 決算頻度

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

## 投資対象地域

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

## 投資形態

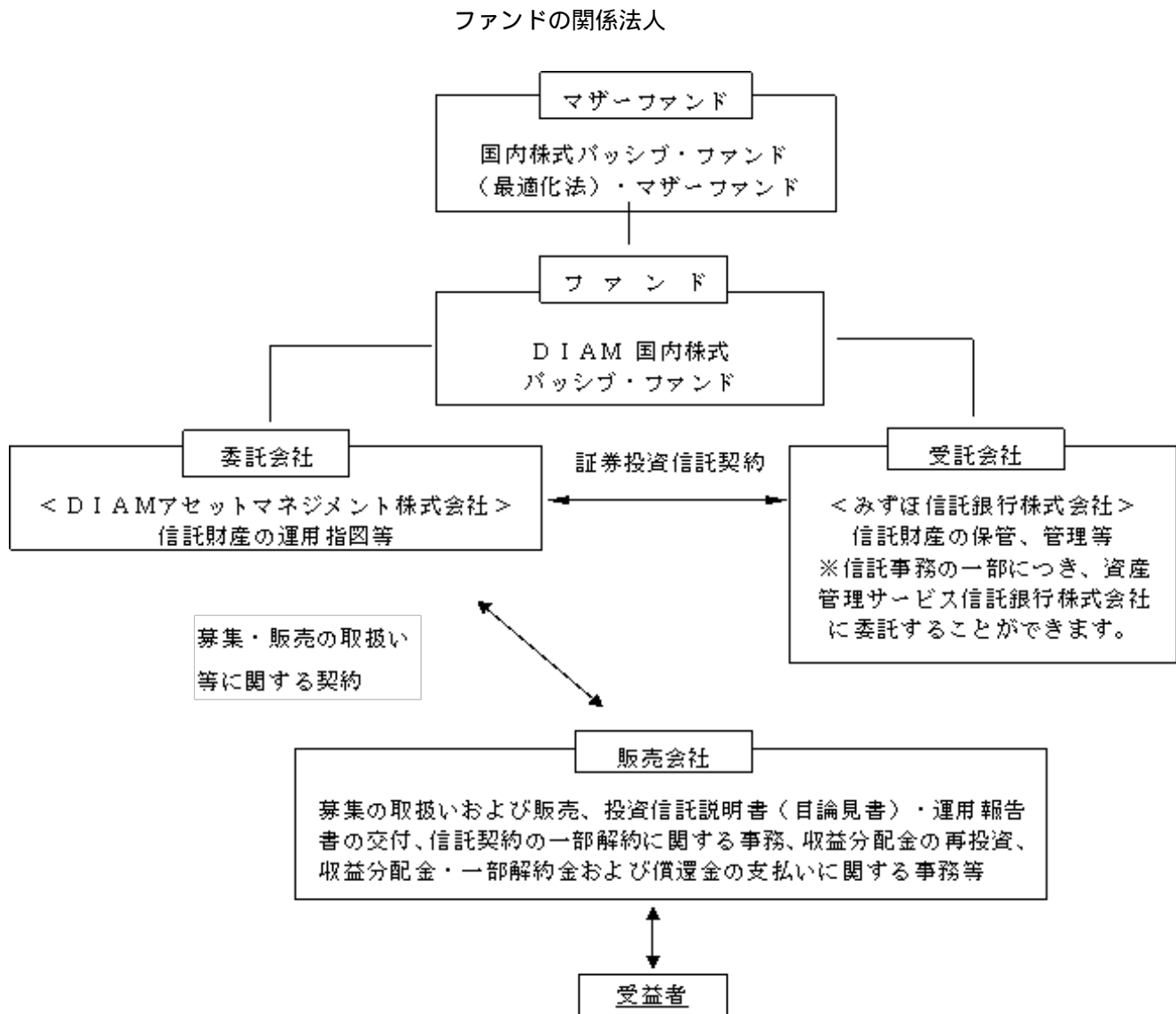
「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズ）にのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

上記の分類は、社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、以下の方法でご確認ください。

・投資信託協会への照会

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

## (2)【ファンドの仕組み】



## ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

## ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

## 委託会社の概況

## 資本金の額

20億円（平成21年10月30日現在）

## 委託会社の沿革

昭和60年7月1日 会社設立

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

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

平成11年10月1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマ



ネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

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

## 大株主の状況

（平成21年10月30日現在）

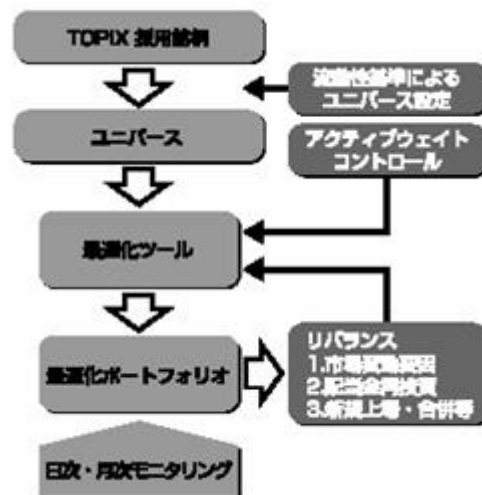
株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険相互会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

## 2【投資方針】

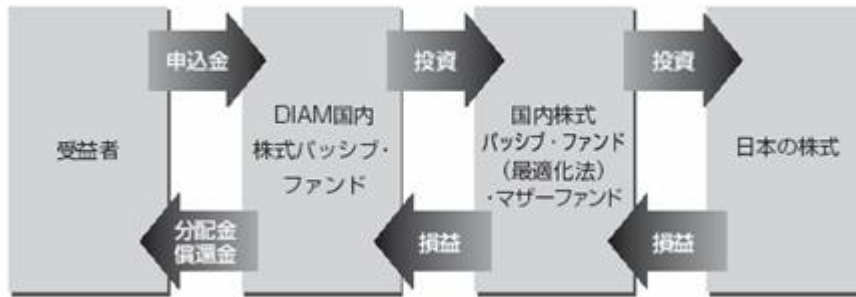
### （1）【投資方針】

#### <ファンドの特色>

- 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」受益証券に投資を行い、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」の動き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、東証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。東証株価指数（TOPIX）は東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所はTOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止、またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。
- 流動性を基準に投資ユニバースを設定し、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、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。



- 当ファンドの運用はファミリーファンド方式で行います。ファミリーファンド方式とは、皆様からご投資いただいた資金をまとめてベビーファンド（D I A M国内株式パッシブ・ファンド）とし、その資金をマザーファンド（国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド）に投資して、その実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。



#### <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）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

#### （２）【投資対象】

##### 1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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21条、第22条および第23条に定めるものに限りません。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

##### 2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証書

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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。）

8. 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。）

9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（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。）

10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（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。）

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(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。)
17. 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。)
18. 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。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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。)
21. 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。)
22. 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
23. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの  
なお、第1号の証券または証書、第13号ならびに第18号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第7号までの証券および第13号ならびに第18号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号の証券および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

### 3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

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

**(参考)国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの投資方針****<基本方針>**

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数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. 運用プロセス****1)流動性基準によるユニバース設定**

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

**2)最適化法によるポートフォリオの構築**

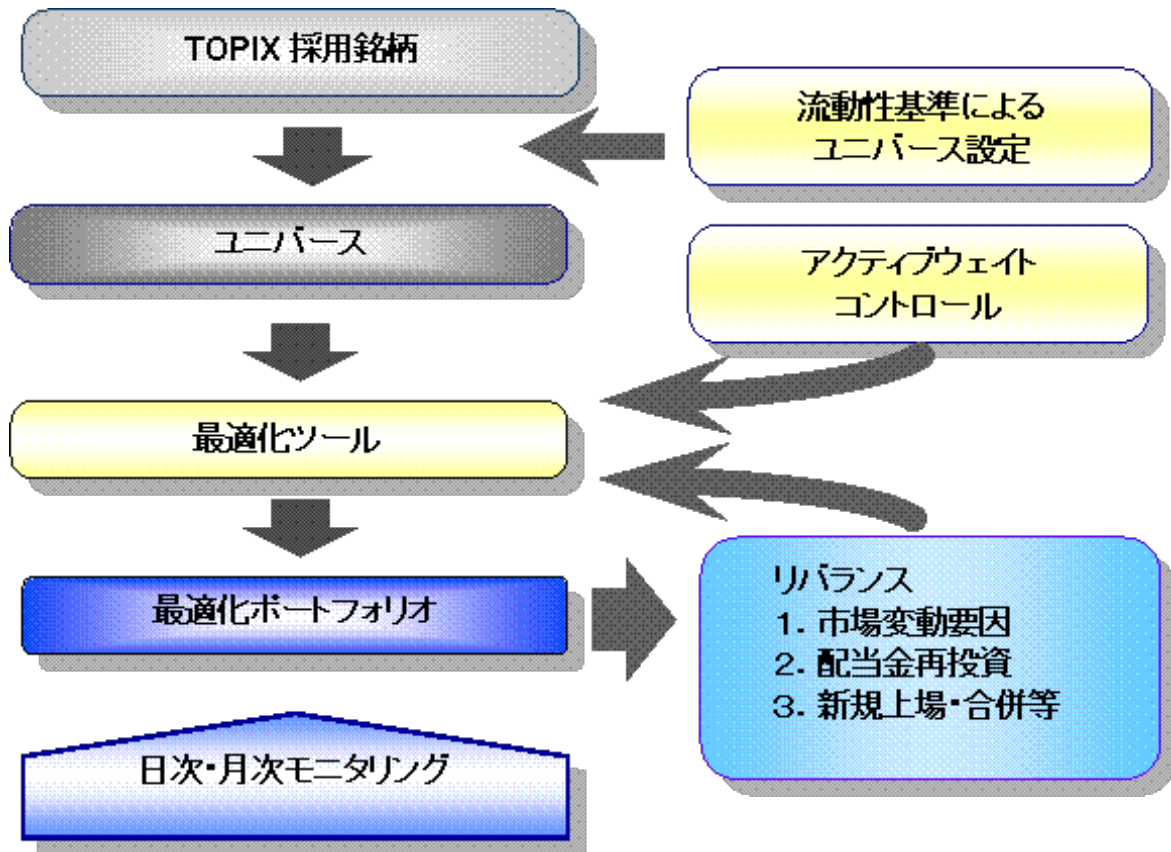
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

**3)リバランス**

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

リバランス要因には以下のものがあります。

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

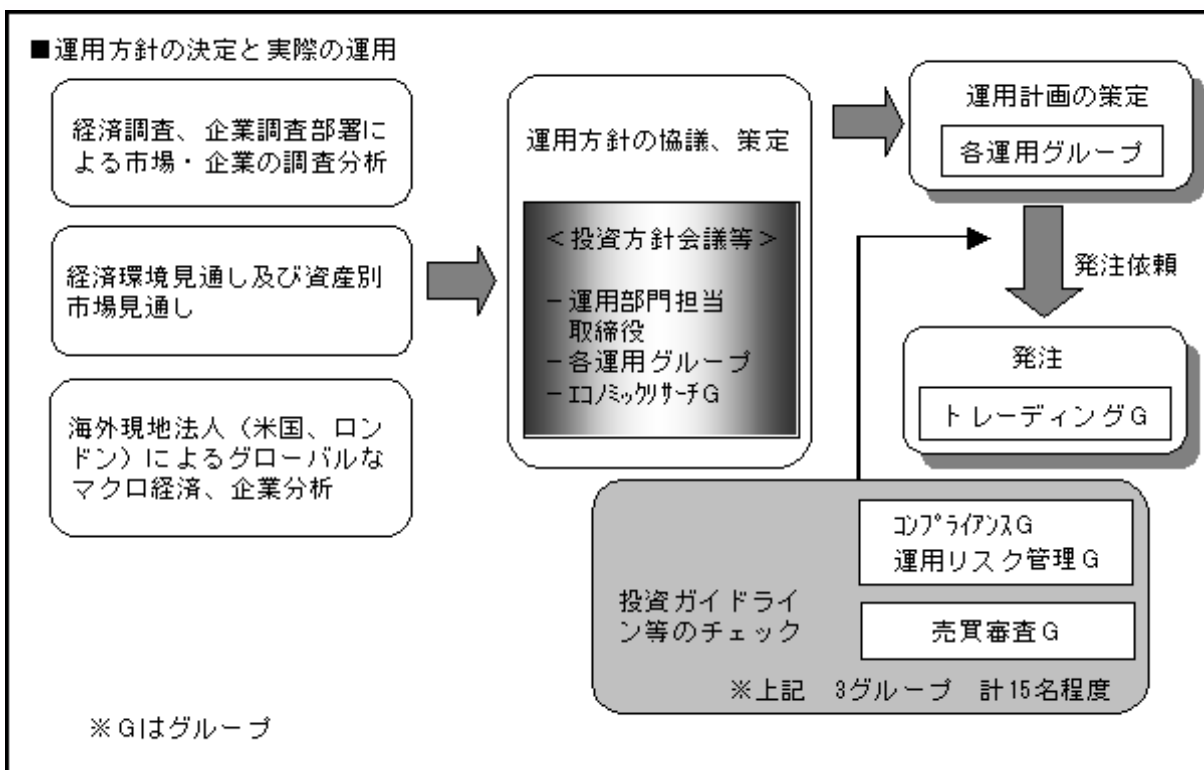
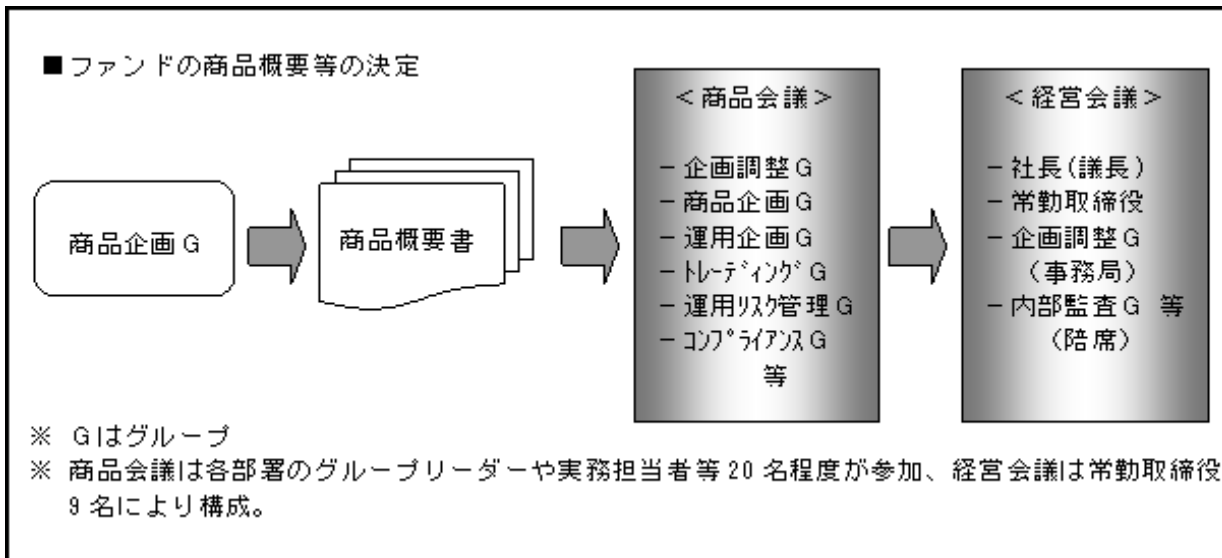


3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
5. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

< 主な投資制限 >

株式への投資割合には、制限を設けません。

## (3) 【運用体制】



#### < ファンドの商品概要等の決定 >

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

#### < 運用方針の決定と実際の運用 >

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

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

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

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループ、運用リスク管理グループにて行われ、有価証券の売買執行等については売買審査グループにてチェックが行われます。

前記体制は平成21年10月30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10月12日、休業日の場合は翌営業日。）に、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場合があります。

##### 3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

##### 収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料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、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、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」といいます。）は、諸経費、監査報酬および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、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、次期以降の分配金にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

3) 前記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係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。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。



## 収益分配金の支払い

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、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引後無手数料で再投資されますが、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) マザーファンド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）
- 2) 株式への実質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）
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。（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19条）
  - a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずるものとして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、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - b. 前a.の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場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20条）
  - a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - b. 前記a.の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号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および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    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. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）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21条）
  - a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、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。）、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。）および外国の取引所におけるわが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし



ます（以下同じ。）。

- b. 委託会社は、信託財産に属する効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### 7) スワップ取引の運用指図（約款第22条）

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 8) 金利先渡取引の運用指図（約款第23条）

- a. 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、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める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、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 9) 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各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
  - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - 2) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 前記a. 各号に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、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 10) 資金の借入れ（約款第30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に資す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、資金借入れ額は借入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、資金借入れ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。

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

12) 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】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

##### (1) 株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは実質株式組入比率を高位に維持することを原則とするため、株式市場の変動により基準価額が上下します。これにより投資元本を割り込むことがあります。

##### (2) 信用リスク

実質的に投資する有価証券等の発行者が経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。またこうした状況に陥ると予想される場合等には、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。これにより投資元本を割り込むことがあります。

#### < その他の留意点 >

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。当該インデックス構成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。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、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ます。

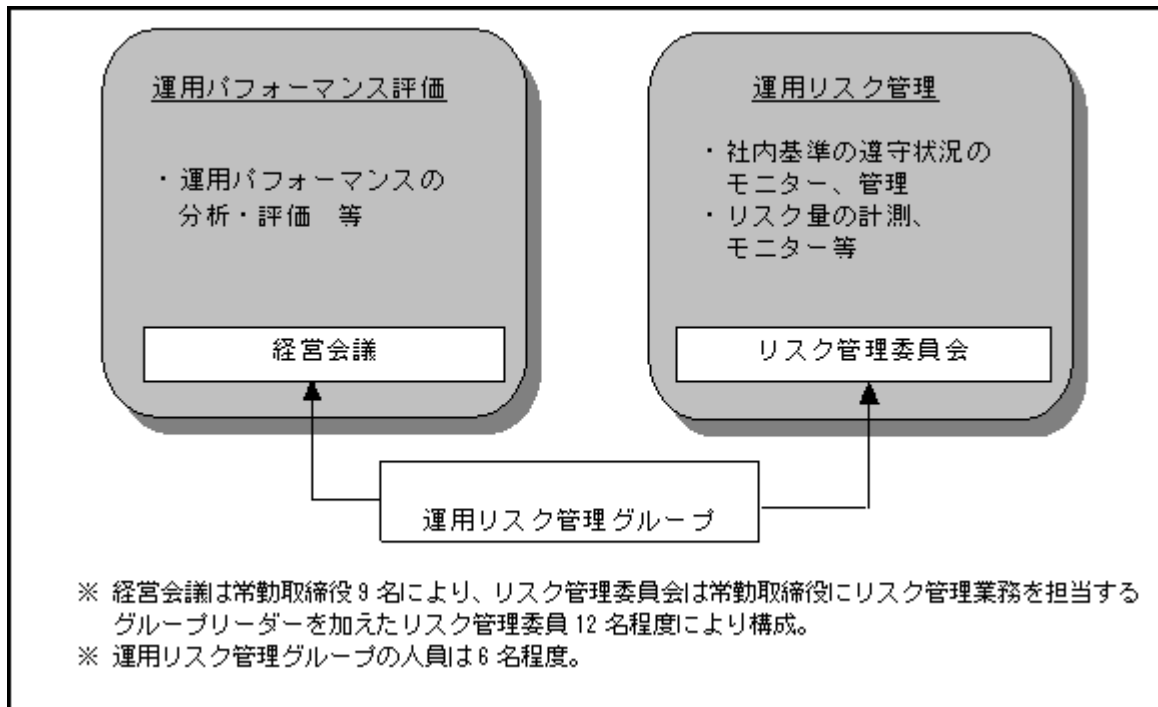
当ファンドは、受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情がある場合等、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

#### 注意事項

イ．当ファンドは、実質的に株式等の値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。したがって元本が保証されているものではありません。

- ロ．投資信託は、預金、金融債、保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．投資信託は、金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります。これによる損失は購入者が負担することとなります。

< 運用評価・運用リスク管理体制 >



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

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

上記体制は平成21年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

時期	項目	費用		
		総額	信託財産の純資産総額に対して 年率0.63%（税抜0.60%）	
毎日	信託報酬	配分	委託会社	年率0.5775%（税抜0.55%）
			販売会社	年率0.021%（税抜0.02%）
			受託会社	年率0.0315%（税抜0.03%）

信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（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に信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、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】

### 個人の受益者に対する課税

#### 収益分配時

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で、原則として源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

#### 一部解約時および償還時

平成23年12月31日までの間は、一部解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率により源泉徴収が行われ、原則として申告は不要です。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 損益通算について

一部解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

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（お申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、「分配金受取コース」および「分配金自動引き落とし投資コース」の両コースを取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に特別分配金が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、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 >

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

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

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

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成21年11月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	513,302,751	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		183,585	0.04
合 計（純資産総額）		513,119,166	100.00

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

## (参考) マザーファンドの投資状況

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成21年11月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	238,743,724,257	96.39
新株予約権証券	日本	1,475,000	0.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		8,939,441,964	3.61
合 計（純資産総額）		247,684,641,221	100.00

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成21年11月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法） ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	459,413,543	11,487.67	527,759,335	11,173.00	513,302,751	100.04

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は1銘柄のみです。

## 種類別業種別投資比率

平成21年11月5日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。



(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年11月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	2,859,300	3,340.85	9,552,497,346	3,580.00	10,236,294,000	4.13
2	三菱UFJフィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	12,878,600	496.46	6,393,706,880	486.00	6,258,999,600	2.53
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,775,100	2,402.26	4,264,250,318	2,785.00	4,943,653,500	2.00
4	キヤノン	株式	日本	電気機 器	1,290,300	2,811.82	3,628,093,108	3,350.00	4,322,505,000	1.75
5	三井住友フィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,125,200	3,568.70	4,015,502,219	3,170.00	3,566,884,000	1.44
6	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	865,400	4,078.55	3,529,574,619	3,760.00	3,253,904,000	1.31
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,640,900	1,496.65	2,455,857,843	1,975.00	3,240,777,500	1.31
8	みずほフィナン シャルG	株式	日本	銀行業	17,831,400	208.96	3,726,020,535	181.00	3,227,483,400	1.30
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	818,500	3,872.00	3,169,230,019	3,610.00	2,954,785,000	1.19
10	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	1,308,900	2,612.35	3,419,308,600	2,230.00	2,918,847,000	1.18
11	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,110,600	2,027.23	2,251,440,468	2,550.00	2,832,030,000	1.14
12	任天堂	株式	日本	その他 製品	117,500	26,314.44	3,091,946,541	23,920.00	2,810,600,000	1.13
13	野村ホールディ ングス	株式	日本	証券、 商品先 物取引 業	4,016,000	570.67	2,291,794,568	630.00	2,530,080,000	1.02
14	パナソニック	株式	日本	電気機 器	2,034,200	1,178.54	2,397,389,543	1,230.00	2,502,066,000	1.01
15	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	18,223	146,570.07	2,670,946,426	130,100.00	2,370,812,300	0.96
16	東芝	株式	日本	電気機 器	4,685,000	347.06	1,625,959,926	502.00	2,351,870,000	0.95
17	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	387,000	5,579.50	2,159,266,142	5,890.00	2,279,430,000	0.92

18	三井物産	株式	日本	卸売業	1,769,400	1,066.32	1,886,738,262	1,190.00	2,105,586,000	0.85
19	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	6,114,000	300.81	1,839,180,260	336.00	2,054,304,000	0.83
20	東京海上HD	株式	日本	保険業	833,800	2,437.56	2,032,434,896	2,340.00	1,951,092,000	0.79
21	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,441,000	1,256.86	1,811,134,133	1,352.00	1,948,232,000	0.79
22	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	897,600	1,582.17	1,420,157,691	2,130.00	1,911,888,000	0.77
23	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	876,800	2,217.32	1,944,148,633	2,005.00	1,757,984,000	0.71
24	小松製作所	株式	日本	機械	966,100	1,195.74	1,155,204,737	1,796.00	1,735,115,600	0.70
25	関西電力	株式	日本	電気・ガス業	857,800	2,218.06	1,902,651,913	1,983.00	1,701,017,400	0.69
26	信越化学	株式	日本	化学	358,300	4,541.14	1,627,091,886	4,710.00	1,687,593,000	0.68
27	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	2,498,900	360.23	900,178,290	663.00	1,656,770,700	0.67
28	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3,409	499,110.60	1,701,468,033	473,000.00	1,612,457,000	0.65
29	ファナック	株式	日本	電気機器	215,100	6,661.72	1,432,935,088	7,380.00	1,587,438,000	0.64
30	アステラス製薬	株式	日本	医薬品	460,500	3,450.01	1,588,730,721	3,290.00	1,515,045,000	0.61

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

## 種類別業種別投資比率

平成21年11月5日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	13.53
	輸送用機器	9.78
	銀行業	9.34
	化学	5.52
	情報・通信業	5.45
	電気・ガス業	4.93
	卸売業	4.71
	機械	4.43
	医薬品	4.20
	陸運業	3.84
	小売業	3.53
	食料品	3.31
	鉄鋼	2.51
	不動産業	2.26
	その他製品	2.23
	保険業	2.04
	建設業	1.95
	証券、商品先物取引業	1.81
	サービス業	1.56
	精密機器	1.49
	非鉄金属	1.22
	ガラス・土石製品	1.13
	繊維製品	0.90
	その他金融業	0.72
	石油・石炭製品	0.69
	金属製品	0.65
	ゴム製品	0.57
海運業	0.50	
鉱業	0.47	
空運業	0.43	
パルプ・紙	0.39	
倉庫・運輸関連業	0.23	
水産・農林業	0.11	
株式 計		96.39
新株予約権証券		0.00
合計		96.39

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成21年11月5日）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成21年10月13日現在）	408	408	1.1504	1.1504
平成21年1月末	1		1.0000	
2月末	0		0.9538	
3月末	9		0.9847	
4月末	27		1.0655	
5月末	69		1.1407	
6月末	114		1.1808	
7月末	169		1.2073	
8月末	266		1.2256	
9月末	350		1.1621	
10月末	466		1.1417	
11月5日	513		1.1161	

【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1期	15.04

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

## 6【手続等の概要】

### 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、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再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、受益者と販売会社との間で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。販売会社までお問い合わせください。

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2時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前10時）までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

#### お申込価額

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

## お申込手数料

ありません。

## 払込期日

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

## 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、委託会社に対し、解約の請求をすることができます。

原則として、販売会社の毎営業日の午後2時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前10時）までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続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、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。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

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

### 解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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

### 解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

## 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4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。

## 7【管理及び運営の概要】

### (1)資産の評価

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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

### (2)信託期間

信託期間は、平成21年1月30日から原則として無期限です。

ただし、下記「(4)償還規定」により、信託を終了する場合があります。

### (3)計算期間

計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。

各計算期間の終了日が休業日の場合には翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

### (4)償還規定

委託会社は、次のいずれかに該当する場合等には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、信託を終了する場合があります。

受益権口数が10億口を下回ることとなった場合。

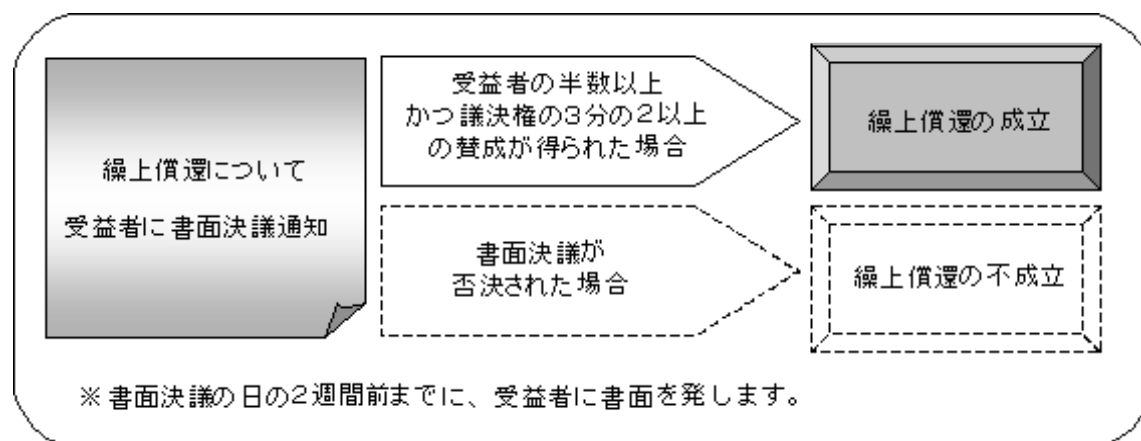
受益者のために有利であると認めるとき。

対象インデックスが改廃された場合。

やむを得ない事情が発生したとき。

この場合において、委託会社は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届出ます。

委託会社は前記によって信託を終了させる場合は、以下の手続きにより行います。



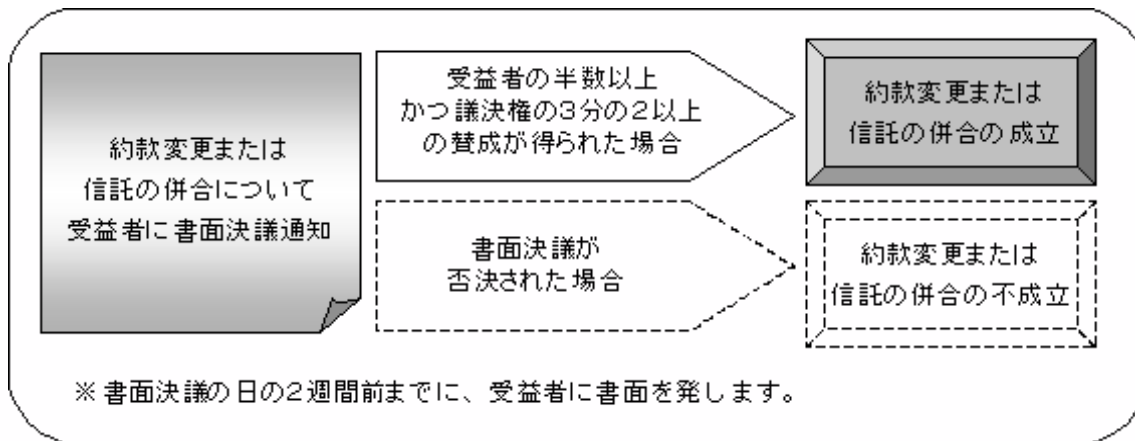
### (5)信託約款の変更等

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またはこの信託と他の信託を併合することができるものとし、あらかじめ、信託約款の変更または他の信託と併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

なお、信託約款の変更または他の信託と併合を行った場合、運用報告書にてお知らせします。

委託会社は信託約款の変更事項のうち、その内容が重大なものに該当する場合または他の信託と併合する場合は、以下の手順により行います。



#### (6) 書面決議等

委託会社は、信託契約を解約し信託を終了する場合および重大な約款変更等を行う場合、書面による決議（「書面決議」）を行います。

この場合に委託会社は、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由または重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。なお、この信託契約にかかるすべての受益者が書面等により同意の意思表示をしたときには書面決議による手続きを行いません。

書面決議において信託契約の解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、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取るべき旨を請求することができます。

#### (7) 運用報告書

委託会社は、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。なお、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/>）

#### (8) 保管

該当事項はありません。



## 第2【財務ハイライト情報】

- (1) 当財務ハイライト情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「1 財務諸表」（以下「財務諸表」という。）より抜粋しております。
- (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1期計算期間（平成21年1月30日から平成21年10月13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。  
その監査報告書は、当該財務諸表に添付しております。

【D I A M国内株式パッシブ・ファンド】  
1【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		平成21年10月13日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		444,627
親投資信託受益証券		408,312,670
流動資産合計		408,757,297
資産合計		408,757,297
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		19,587
未払委託者報酬		372,446
その他未払費用		3,225
流動負債合計		395,258
負債合計		395,258
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		354,976,354
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		53,385,685
（分配準備積立金）		1,796,750
元本等合計		408,362,039
純資産合計		408,362,039
負債純資産合計		408,757,297

## 2【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 平成21年1月30日 至 平成21年10月13日
<b>営業収益</b>	
受取利息	42
有価証券売買等損益	3,081,330
営業収益合計	3,081,288
<b>営業費用</b>	
受託者報酬	28,412
委託者報酬	540,665
その他費用	4,611
営業費用合計	573,688
営業損失( )	3,654,976
経常損失( )	3,654,976
当期純損失( )	3,654,976
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	245,932
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	57,754,017
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	57,754,017
剰余金減少額又は欠損金増加額	467,424
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	467,424
分配金	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	53,385,685

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成21年1月30日から平成21年10月13日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 1 期 平成21年10月13日現在
*1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	359,818,552円
期中解約元本額	5,842,198円
*2 計算期間末日における受益権の総数	354,976,354口

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
*1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,796,750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（51,588,935円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は53,385,685円（1万口当たり1,503.92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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	408,312,670	3,176,753
合計	408,312,670	3,176,753

## （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 1 期 平成21年10月13日現在
1口当たり純資産額	1.1504円
（1万口当たり純資産額）	（11,504円）

### 第3【内国投資信託受益証券事務の概要】

#### (1) 受益権の名義書換

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) 受益者集会

該当事項はありません。

#### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

#### (4) 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。

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

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

#### (5) 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。

#### (6) 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、受託者と協議のうえ、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。

#### (7) 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4【ファンドの詳細情報の項目】

### 第1 ファンドの沿革

### 第2 手続等

- 1 申込（販売）手続等
- 2 換金（解約）手続等

### 第3 管理及び運営

- 1 資産管理等の概要
  - （1）資産の評価
  - （2）保管
  - （3）信託期間
  - （4）計算期間
  - （5）その他
- 2 受益者の権利等

### 第4 ファンドの経理状況

- 1 財務諸表
  - （1）貸借対照表
  - （2）損益及び剰余金計算書
  - （3）注記表
  - （4）附属明細表
- 2 ファンドの現況
  - 純資産額計算書
    - 資産総額
    - 負債総額
    - 純資産総額（ - ）
    - 発行済数量
    - 1単位当たり純資産額（ / ）

### 第5 設定及び解約の実績

## 第三部【ファンドの詳細情報】

### 第1【ファンドの沿革】

平成21年1月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

### 第2【手続等】

#### 1【申込（販売）手続等】

- ・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、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再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、

また、受益者と販売会社との間で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2時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前10時）までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

- ・お申込価額

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額となります。

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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



## ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。

お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

## ・お申込手数料

ありません。

## ・払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、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、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。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後2時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前10時）までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

## ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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

## ・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・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4営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

### 第3【管理及び運営】

#### 1【資産管理等の概要】

##### (1)【資産の評価】

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

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

##### (2)【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

##### (3)【信託期間】

信託期間は、平成21年1月30日から原則として無期限です。

ただし、下記「(5)その他 イ.償還規定」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10月13日から翌年10月12日までとします。

b. 前記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ます。

##### (5)【その他】

###### イ.償還規定

a. 委託会社は、受益権総口数が10億口を下回ることとなった場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、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場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

b. 委託会社は、前記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

c. 前記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d. 前記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

- e. 前記b. からd. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記b. からd. までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- 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継ぐことを命じたときは、後記「ロ. 信託約款の変更等b.」の書面決議が否決された場合を除き、その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違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、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、前記b. に規定する書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更等

- 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またはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、前記a. の事項（前記a. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 前記b. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 前記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であつて、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 前記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、前記a. からg. の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、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取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、前記b. に規定する書面に付記します。
- j. 前記b. に該当しない場合の約款変更については、「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、日本経済新聞に掲載します。

## ホ．運用報告書

委託会社は、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日。）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/>）

## 2【受益者の権利等】

### （1）収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者は、分配金支払開始日から5年間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。

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計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了後の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。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。

### （2）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します。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

### （3）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。

### （4）帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

#### 第4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「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) 当ファンドの第1期計算期間は、信託約款第33条により、平成21年1月30日から平成21年10月13日までとなっております。
- (3) 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1期計算期間（平成21年1月30日から平成21年10月13日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【D I A M国内株式パッシブ・ファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期
		平成21年10月13日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		444,627
親投資信託受益証券		408,312,670
流動資産合計		408,757,297
資産合計		408,757,297
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		19,587
未払委託者報酬		372,446
その他未払費用		3,225
流動負債合計		395,258
負債合計		395,258
純資産の部		
元本等		
元本		354,976,354
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		53,385,685
(分配準備積立金)		1,796,750
元本等合計		408,362,039
純資産合計		408,362,039
負債純資産合計		408,757,297

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 1 期 自 平成21年 1 月30日 至 平成21年10月13日
営業収益	
受取利息	42
有価証券売買等損益	3,081,330
営業収益合計	3,081,288
営業費用	
受託者報酬	28,412
委託者報酬	540,665
その他費用	4,611
営業費用合計	573,688
営業損失（ ）	3,654,976
経常損失（ ）	3,654,976
当期純損失（ ）	3,654,976
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	245,932
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	57,754,017
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	57,754,017
剰余金減少額又は欠損金増加額	467,424
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	467,424
分配金	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	53,385,685

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成21年1月30日から平成21年10月13日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 1 期 平成21年10月13日現在
*1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	359,818,552円
期中解約元本額	5,842,198円
*2 計算期間末日における受益権の総数	354,976,354口



## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
*1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,796,750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（51,588,935円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は53,385,685円（1万口当たり1,503.92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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	408,312,670	3,176,753
合計	408,312,670	3,176,753

## （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 1 期 平成21年10月13日現在
1口当たり純資産額	1.1504円
（1万口当たり純資産額）	（11,504円）

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法） ・マザーファンド	354,684,391	408,312,670	
合計		354,684,391	408,312,670	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成21年10月13日現在
		金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		14,470,261,674
株式		241,939,750,438
新株予約権証券		1,711,000
派生商品評価勘定		35,502,013
未収入金		377,388,240
未収配当金		1,538,029,846
差入委託証拠金		609,279,166
流動資産合計		258,971,922,377
資産合計		258,971,922,377
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定		185,824
前受金		47,421,166
未払金		13,282,861,461
未払解約金		20,505,000
流動負債合計		13,350,973,451
負債合計		13,350,973,451
純資産の部		
元本等		
元本		213,354,928,471
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		32,266,020,455
元本等合計		245,620,948,926
純資産合計		245,620,948,926
負債純資産合計		258,971,922,377

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 等における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準 ずる価額）、又は金融商品取引業 者等から提示される気配相場に 基づいて評価しております。
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. その他財務諸表作成のための基本と なる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成21年2 月10日から平成22年2月8日まで となっております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成21年10月13日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における	
当該親投資信託の元本額	155,273,022,573円
同期中追加設定元本額	83,386,527,287円
同期中解約元本額	25,304,621,389円
同期末における元本の内訳	
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,212,056,806円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	354,684,391円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	26,862,663,934円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	624,019,862円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,375,607,666円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,548,290,047円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	418,549,855円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,240,314,619円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	950,115,263円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	170,711,340円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,259,501,017円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	232,319,106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）	11,973,631,337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）	1,916,785,645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）	220,164,594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）	814,714,434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）	233,954,333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）	309,426,686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）	21,053,588,742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）	6,863,815,169円
D I A Mバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	5,600,702,726円
D I A Mバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	3,796,542,048円
D I A Mバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	8,876,614,867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）	1,276,832,767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）	2,737,105,010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）	2,860,321,502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）	14,580,016,374円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	347,614,138円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	533,863,253円
D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	4,860,464,212円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	9,679,819,634円
D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定）	461,320,181円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	41,320,776,030円

D I A M世界アセットバランス ファンド40VA（適格機関投資 家限定）	2,946,659,892円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA（適格機関投資 家限定）	4,961,539,647円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA（適格機関投資家 限定）	25,258,663,405円
D I A Mバランス30VA（適格 機関投資家限定）	235,268,611円
D I A Mバランス50VA（適格 機関投資家限定）	90,887円
D I A Mバランス70VA（適格 機関投資家限定）	138,272円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA（適格機関投資家 限定）	1,385,660,169円
（合 計）	213,354,928,471円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日に おける受益権の総数	213,354,928,471口

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	自平成21年1月30日 至平成21年10月13日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	241,939,750,438	23,717,708,835
新株予約権証券	1,711,000	1,711,000
合計	241,941,461,438	23,719,419,835

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間  
末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

区分	自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
----	-----------------------------

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

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成21年10月13日現在					
区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	3,528,403,000	-	3,564,000,000	35,316,189
合計		3,528,403,000	-	3,564,000,000	35,316,189

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	平成21年10月13日現在
1口当たり純資産額	1.1512円
( 1万口当たり純資産額 )	( 11,512円 )

[次へ](#)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	103,000	189	19,467,000	
日本水産	270,500	273	73,846,500	
マルハニチロホールディングス	432,000	141	60,912,000	
ハウスイ	18,000	120	2,160,000	
サカタのタネ	43,300	1,360	58,888,000	
ホクト	21,700	2,090	45,353,000	
ショーボンドHD	21,000	1,609	33,789,000	
住石ホールディングス	65,600	102	6,691,200	
日鉄鉱業	60,000	527	31,620,000	
三井松島	75,000	146	10,950,000	
国際石油開発帝石	1,067	757,000	807,719,000	
関東天然瓦斯	24,000	583	13,992,000	
石油資源開発	33,200	4,620	153,384,000	
ダイセキ環境ソリューション	24	133,900	3,213,600	
間組	100,400	88	8,835,200	
東急建設	84,280	251	21,154,280	
コムシスホールディングス	113,700	923	104,945,100	
ミサワホーム	27,800	350	9,730,000	
高松コンストラクシヨンGP	17,800	1,381	24,581,800	
東建コーポレーション	8,710	2,825	24,605,750	
ヤマウラ	8,500	185	1,572,500	
大成建設	1,059,700	170	180,149,000	
大 林 組	654,000	363	237,402,000	
清水建設	663,000	359	238,017,000	
飛島建設	604,500	30	18,135,000	
長谷工コーポレーション	1,142,000	79	90,218,000	
松井建設	2,000	333	666,000	
鹿島建設	958,000	221	211,718,000	
不動テトラ	168,600	63	10,621,800	
大末建設	81,000	39	3,159,000	
鉄建建設	115,000	81	9,315,000	
安藤建設	82,000	122	10,004,000	
太平工業	21,000	273	5,733,000	
西松建設	269,000	140	37,660,000	
三井住友建設	126,700	79	10,009,300	
大豊建設	62,000	74	4,588,000	
前田建設	145,000	259	37,555,000	

佐田建設	87,000	38	3,306,000
ナカノフドー建設	19,500	173	3,373,500
奥村組	223,000	325	72,475,000
大和小田急建設	13,500	249	3,361,500
東鉄工業	29,000	620	17,980,000
イチケン	24,000	114	2,736,000
浅沼組	67,000	67	4,489,000
戸田建設	251,000	305	76,555,000
熊谷組	152,000	67	10,184,000
青木あすなる建設	15,500	458	7,099,000
北野建設	54,000	222	11,988,000
植木組	30,000	120	3,600,000
三井ホーム	31,000	487	15,097,000
矢作建設	29,000	585	16,965,000
ピーエス三菱	15,600	331	5,163,600
大東建託	101,300	3,690	373,797,000
新日本建設	32,400	159	5,151,600
N I P P O	47,000	726	34,122,000
東亜道路	45,000	137	6,165,000
前田道路	68,000	740	50,320,000
日本道路	77,000	185	14,245,000
東亜建設	208,000	100	20,800,000
若築建設	126,000	50	6,300,000
東洋建設	320,000	49	15,680,000
五洋建設	274,500	110	30,195,000
大林道路	32,000	160	5,120,000
世紀東急	62,000	48	2,976,000
福田組	34,000	171	5,814,000
東北ミサワホーム	12,300	218	2,681,400
住友林業	161,100	708	114,058,800
日本基礎技術	33,800	221	7,469,800
日成ビルド工業	70,000	57	3,990,000
エス・バイ・エル	125,000	54	6,750,000
巴コーポレーション	33,400	224	7,481,600
パナホーム	88,000	522	45,936,000
大和ハウス	582,000	899	523,218,000
ライト工業	52,100	196	10,211,600
積水ハウス	656,000	754	494,624,000
日特建設	63,000	48	3,024,000
北陸電気工事	2,000	285	570,000
コミュニチュア	17,000	606	10,302,000
ユアテック	38,000	570	21,660,000

西部電気工業	1,000	394	394,000	
四電工	2,000	468	936,000	
中電工	34,400	1,435	49,364,000	
関電工	107,000	580	62,060,000	
大明	32,800	773	25,354,400	
きんでん	138,000	723	99,774,000	
東京エネシス	27,000	714	19,278,000	
トーエネック	34,000	537	18,258,000	
住友電設	20,200	459	9,271,800	
日本電設工業	47,000	782	36,754,000	
協和エクシオ	84,500	849	71,740,500	
新日本空調	19,500	603	11,758,500	
日本工営	74,000	286	21,164,000	
東電通	32,000	163	5,216,000	
日本電話施設	39,000	282	10,998,000	
九電工	44,000	562	24,728,000	
三機工業	56,000	722	40,432,000	
日揮	234,000	1,837	429,858,000	
中外炉工業	81,000	272	22,032,000	
ヤマト	16,000	316	5,056,000	
太平電業	33,000	1,044	34,452,000	
高砂熱学	67,000	769	51,523,000	
三晃金属	27,000	291	7,857,000	
NEC ネットエスアイ	19,900	1,157	23,024,300	
朝日工業社	8,000	363	2,904,000	
アタカ大機	4,000	223	892,000	
大気社	33,600	1,165	39,144,000	
ダイダン	25,000	482	12,050,000	
日比谷総合設	31,600	778	24,584,800	
東芝プラントシステム	38,000	1,187	45,106,000	
日本製粉	147,000	463	68,061,000	
日清製粉G本社	211,500	1,216	257,184,000	
日東富士製粉	8,000	315	2,520,000	
昭和産業	108,000	299	32,292,000	
鳥越製粉	21,500	778	16,727,000	
協同飼料	84,000	121	10,164,000	
中部飼料	23,000	749	17,227,000	
日本配合飼料	68,000	114	7,752,000	
ユニ・チャーム ペットケア	13,400	3,130	41,942,000	
東洋精糖	40,000	130	5,200,000	
日本甜菜糖	131,000	228	29,868,000	
三井製糖	92,000	328	30,176,000	

日本M & Aセンター	33	428,000	14,124,000	
アコーディア・ゴルフ	542	82,500	44,715,000	
パソナグループ	214	65,800	14,081,200	
リンクアンドモチベーション	42	45,950	1,929,900	
テンプホールディングス	25,400	911	23,139,400	
森永製菓	251,000	191	47,941,000	
中村屋	56,000	497	27,832,000	
江崎グリコ	85,000	964	81,940,000	
名糖産業	9,700	1,250	12,125,000	
不二家	127,000	164	20,828,000	
山崎製パン	171,000	1,206	206,226,000	
第一屋製パン	36,000	106	3,816,000	
モロゾフ	30,000	305	9,150,000	
森永乳業	197,000	423	83,331,000	
ヤクルト	125,000	2,195	274,375,000	
明治ホールディングス	66,200	3,670	242,954,000	
雪印メグミルク	51,100	1,643	83,957,300	
プリマハム	134,000	104	13,936,000	
日本ハム	177,000	1,094	193,638,000	
伊藤ハム	177,000	327	57,879,000	
林兼産業	75,000	140	10,500,000	
丸大食品	95,000	293	27,835,000	
米久	23,000	893	20,539,000	
S Foods	13,000	822	10,686,000	
学情	8,200	326	2,673,200	
スタジオアリス	10,000	940	9,400,000	
シミック	350	23,090	8,081,500	
システムプロ	147	44,350	6,519,450	
NECフィールディング	17,800	1,364	24,279,200	
新日鉄ソリューションズ	13,700	1,728	23,673,600	
総合警備保障	72,600	1,051	76,302,600	
日本駐車場開発	2,249	4,350	9,783,150	
コア	7,300	633	4,620,900	
カカクコム	167	308,000	51,436,000	
アイロムホールディングス	489	4,900	2,396,100	
ルネサンス	11,000	322	3,542,000	
セキュアードキャピタルJ	63	98,900	6,230,700	
新日本科学	10,900	740	8,066,000	
ソネット・エムスリー	102	311,000	31,722,000	
ディー・エヌ・エー	282	251,000	70,782,000	
博報堂DYHLDGS	30,140	4,620	139,246,800	
ぐるなび	114	216,900	24,726,600	

一休	155	40,950	6,347,250	
ジャパンベストレスキューS	34	46,400	1,577,600	
ジェイコム	19	99,600	1,892,400	
パシフィックゴルフGRP	457	63,100	28,836,700	
サッポロホールディングス	331,000	456	150,936,000	
アサヒビール	406,500	1,609	654,058,500	
キリンHD	955,000	1,376	1,314,080,000	
宝ホールディングス	198,000	564	111,672,000	
オエノンホールディングス	61,000	195	11,895,000	
メルシャン	71,000	208	14,768,000	
養命酒	3,000	884	2,652,000	
三国コカ・コ・ラ	28,900	763	22,050,700	
コカ・コーラウエスト	57,600	1,747	100,627,200	
コカコーラセントラルジャパン	26,900	1,184	31,849,600	
ダイドードリンコ	10,900	2,890	31,501,000	
伊藤園	65,000	1,601	104,065,000	
キーコーヒー	19,500	1,579	30,790,500	
ユニカフェ	7,000	989	6,923,000	
ジャパンフーズ	3,100	801	2,483,100	
日清オイリオグループ	101,000	463	46,763,000	
不二製油	62,500	1,255	78,437,500	
J・オイルミルズ	87,000	306	26,622,000	
ローソン	64,300	3,990	256,557,000	
インターニックス	7,100	348	2,470,800	
サンエー	7,900	3,070	24,253,000	
キリン堂	8,800	461	4,056,800	
ダイユーエイト	1,900	620	1,178,000	
カワチ薬品	14,300	1,894	27,084,200	
エービーシー・マート	21,600	2,670	57,672,000	
ハードオフコーポレーション	9,400	485	4,559,000	
高千穂交易	9,500	958	9,101,000	
アスクル	17,300	1,785	30,880,500	
ゲオ	377	91,800	34,608,600	
ポイント	18,470	5,760	106,387,200	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	124	620,000	
伊藤忠食品	5,200	3,120	16,224,000	
くらコーポレーション	53	287,300	15,226,900	
キャンドゥ	103	98,100	10,104,300	
エレマテック	15,300	945	14,458,500	
パル	5,250	1,835	9,633,750	
JALUX	6,600	1,239	8,177,400	
エディオン	81,700	755	61,683,500	

サーラコーポレーション	21,000	584	12,264,000
トーメンデバイス	2,700	1,620	4,374,000
バルス	107	72,300	7,736,100
あみやき亭	37	163,500	6,049,500
双日	1,275,900	182	232,213,800
アルフレッサホールディングス	48,800	3,600	175,680,000
ハニーズ	14,350	657	9,427,950
キッコーマン	204,000	1,025	209,100,000
味の素	634,000	842	533,828,000
キューピー	121,100	1,037	125,580,700
ハウス食品	86,300	1,416	122,200,800
カゴメ	90,400	1,699	153,589,600
焼津水産化工	12,400	1,181	14,644,400
アリアケジャパン	19,400	1,401	27,179,400
ニチレイ	263,000	342	89,946,000
横浜冷凍	45,000	635	28,575,000
東洋水産	93,000	2,330	216,690,000
日清食品HD	74,100	3,330	246,753,000
永谷園	2,000	858	1,716,000
フジッコ	26,000	1,004	26,104,000
ロックフィールド	11,900	1,226	14,589,400
日本たばこ産業	5,170	267,400	1,382,458,000
わらべや日洋	12,200	1,140	13,908,000
なとり	12,200	790	9,638,000
片倉工業	25,200	1,066	26,863,200
グンゼ	149,000	380	56,620,000
昭栄	34,800	745	25,926,000
神栄	22,000	130	2,860,000
川島織物セルコン	81,000	76	6,156,000
山下医科器械	400	1,233	493,200
ラサ商事	8,600	335	2,881,000
アルペン	15,700	1,583	24,853,100
ビックカメラ	494	32,950	16,277,300
DCM JAPAN HLDGS	102,800	607	62,399,600
あいホールディングス	47,200	320	15,104,000
ユニバース	2,800	1,505	4,214,000
J. フロントリテイリング	520,000	496	257,920,000
ドトール・日レスHD	29,500	1,307	38,556,500
マツモトキヨシHLDGS	38,100	2,110	80,391,000
ココカラファインHD	11,600	2,110	24,476,000
三越伊勢丹HD	382,500	966	369,495,000
東洋紡績	777,000	149	115,773,000

ユニチカ	495,000	75	37,125,000	
富士紡ホールディングス	90,000	146	13,140,000	
日清紡ホールディングス	155,000	894	138,570,000	
倉敷紡績	224,000	168	37,632,000	
ダイワボウHD	152,000	367	55,784,000	
シキボウ	140,000	210	29,400,000	
日東紡績	211,000	169	35,659,000	
トヨタ紡織	72,700	1,926	140,020,200	
クリエイトSDH	7,200	2,190	15,768,000	
バイタルKSKHD	25,800	530	13,674,000	
UKCホールディングス	8,100	1,281	10,376,100	
日本毛織	75,000	621	46,575,000	
大東紡織	34,000	84	2,856,000	
トーア紡コーポレーション	79,000	68	5,372,000	
ダイドーリミテッド	29,600	667	19,743,200	
東京建物不動産販	9,700	304	2,948,800	
野村不動産HLDS	73,700	1,506	110,992,200	
ヒューリック	56,700	615	34,870,500	
帝国繊維	23,000	528	12,144,000	
ブックオフコーポレーション	11,300	1,230	13,899,000	
日本コークス工業	131,500	110	14,465,000	
ミタチ産業	3,800	450	1,710,000	
JFE商事HLDS	138,000	363	50,094,000	
あさひ	6,800	1,612	10,961,600	
サークルKサンクス	50,100	1,285	64,378,500	
日本調剤	3,620	1,933	6,997,460	
コスモス薬品	7,700	2,405	18,518,500	
シップヘルスケアHD	239	55,700	13,312,300	
セブン&アイ・HLDS	820,100	2,115	1,734,511,500	
ツルハホールディングス	15,300	3,600	55,080,000	
サンマルクホールディングス	6,600	2,695	17,787,000	
フェリシモ	6,000	1,514	9,084,000	
トリドール	50	189,000	9,450,000	
帝人	891,000	286	254,826,000	
東レ	1,449,000	535	775,215,000	
三菱レイヨン	543,000	323	175,389,000	
クラレ	322,000	967	311,374,000	
旭化成	1,360,000	444	603,840,000	
サカイオーベックス	64,000	94	6,016,000	
稲葉製作所	11,200	915	10,248,000	
宮地エンジニアリングG	75,000	80	6,000,000	
三協・立山HLDS	274,000	89	24,386,000	

トーカロ	13,300	1,701	22,623,300
アルファCO	8,000	524	4,192,000
SUMCO	116,600	2,055	239,613,000
川田テクノロジーズ	5,600	1,526	8,545,600
住江織物	56,000	129	7,224,000
日本フェルト	11,400	415	4,731,000
イチカワ	14,000	195	2,730,000
日本パイリ-ン	30,000	467	14,010,000
エコナック	62,000	46	2,852,000
日東製網	25,000	123	3,075,000
芦森工業	53,000	148	7,844,000
アツギ	202,000	119	24,038,000
ダイニック	41,000	144	5,904,000
共和レザー	14,900	366	5,453,400
セーレン	54,400	574	31,225,600
東海染工	30,000	132	3,960,000
小松精練	37,000	354	13,098,000
ワコールホールディングス	130,000	1,111	144,430,000
ホギメディカル	10,600	4,970	52,682,000
サンエー・インターナショナル	10,200	966	9,853,200
レナウン	36,800	175	6,440,000
クラウディア	2,200	1,505	3,311,000
ITホールディングス	66,800	1,223	81,696,400
コーエーテクモHD	31,600	771	24,363,600
特種東海HLDS	149,000	229	34,121,000
ドワンゴ	115	208,000	23,920,000
ベリサーブ	9	192,000	1,728,000
マクロミル	117	134,500	15,736,500
ティーガイア	165	151,000	24,915,000
GMOペイメントゲートウェイ	45	121,600	5,472,000
ザッパラス	65	160,000	10,400,000
インターネットイニシアティブ	120	217,800	26,136,000
ソネットエンタテインメント	116	186,500	21,634,000
SRAホールディングス	9,800	747	7,320,600
JBSホールディングス	25,500	365	9,307,500
朝日ネット	17,000	282	4,794,000
王子製紙	894,000	407	363,858,000
三菱製紙	312,000	121	37,752,000
北越紀州製紙	138,870	471	65,407,770
中越パルプ	84,000	192	16,128,000
巴川製紙	35,000	236	8,260,000
大王製紙	92,000	784	72,128,000



日本製紙G本社	105,166	2,555	268,699,130
レンゴー	170,000	542	92,140,000
トーモク	72,000	206	14,832,000
ザ・パック	14,300	1,332	19,047,600
コ・ブケミカル	31,000	167	5,177,000
昭和電工	1,130,000	182	205,660,000
住友化学	1,605,000	388	622,740,000
日本化成	41,000	200	8,200,000
住友精化	42,000	365	15,330,000
日産化学	146,000	1,265	184,690,000
ラサ工業	93,000	112	10,416,000
クレハ	141,000	519	73,179,000
テイカ	38,000	282	10,716,000
石原産業	339,000	80	27,120,000
片倉チツカリン	13,000	304	3,952,000
日本曹達	130,000	378	49,140,000
東ソー	583,000	227	132,341,000
トクヤマ	339,000	610	206,790,000
セントラル硝子	222,000	403	89,466,000
東亜合成	240,000	303	72,720,000
ダイソー	88,000	263	23,144,000
関東電化	48,000	711	34,128,000
電気化学	458,000	383	175,414,000
イビデン	146,200	3,420	500,004,000
信越化学	363,100	5,530	2,007,943,000
日本カ - バイド	51,000	112	5,712,000
堺化学	75,000	384	28,800,000
エア・ウォーター	156,000	1,102	171,912,000
大陽日酸	339,000	1,094	370,866,000
日本化学工業	75,000	229	17,175,000
日本パ - カライジング	52,000	1,028	53,456,000
高圧ガス	30,000	551	16,530,000
チタン工業	28,000	250	7,000,000
四国化成	32,000	552	17,664,000
戸田工業	34,000	792	26,928,000
ステラ ケミファ	10,300	4,900	50,470,000
保土谷化学	56,000	248	13,888,000
日本触媒	145,000	803	116,435,000
大日精化	79,000	294	23,226,000
カネカ	272,000	632	171,904,000
協和発酵キリン	298,000	1,050	312,900,000
三菱瓦斯化学	375,000	444	166,500,000

三井化学	666,000	327	217,782,000	
J S R	198,400	1,920	380,928,000	
東京応化工業	42,200	1,999	84,357,800	
三菱ケミカルH L D G S	1,266,000	359	454,494,000	
日本合成化学	57,000	606	34,542,000	
ダイセル化学	283,000	565	159,895,000	
住友ベークライト	221,000	473	104,533,000	
積水化学	488,000	490	239,120,000	
日本ゼオン	188,000	399	75,012,000	
アイカ工業	68,400	892	61,012,800	
宇部興産	913,000	240	219,120,000	
積水樹脂	32,000	722	23,104,000	
タキロン	54,000	249	13,446,000	
旭有機材	81,000	229	18,549,000	
日立化成	94,200	1,902	179,168,400	
ニチバン	26,000	314	8,164,000	
リケンテクノス	43,000	208	8,944,000	
大倉工業	53,000	272	14,416,000	
積水化成品	58,000	326	18,908,000	
群栄化学	62,000	206	12,772,000	
タイガース ポリマー	9,100	369	3,357,900	
日本カクリット	18,200	438	7,971,600	
日本化薬	154,000	829	127,666,000	
イーピーエス	59	346,000	20,414,000	
パナソニック電工 I S	4,200	2,355	9,891,000	
フェイス	847	12,390	10,494,330	
アミューズ	5,900	1,000	5,900,000	
野村総合研究所	101,700	2,060	209,502,000	
ドリームインキュベータ	70	60,000	4,200,000	
サイバネットシステム	184	35,550	6,541,200	
T A C	12,100	391	4,731,100	
ケネディクス	532	36,450	19,391,400	
電通	215,800	1,964	423,831,200	
インテージ	5,200	1,520	7,904,000	
テイクアンドグヴィニーズ	577	11,810	6,814,370	
ぴあ	5,300	1,201	6,365,300	
シンプレクス・テクノロジー	344	44,100	15,170,400	
イオンファンタジー	7,000	1,105	7,735,000	
ソースネクスト	31	23,800	737,800	
ネクシィーズ	958	3,260	3,123,080	
日本精化	18,100	867	15,692,700	
A D E K A	93,900	868	81,505,200	

[次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日油	190,000	465	88,350,000	
ミヨシ油脂	81,000	142	11,502,000	
ハリマ化成	9,000	485	4,365,000	
花王	558,500	2,105	1,175,642,500	
第一工業製薬	38,000	269	10,222,000	
三洋化成	69,000	505	34,845,000	
武田薬品	765,500	3,650	2,794,075,000	
アステラス製薬	461,400	3,580	1,651,812,000	
大日本住友製薬	154,500	946	146,157,000	
塩野義製薬	317,800	2,035	646,723,000	
田辺三菱製薬	218,000	1,210	263,780,000	
わかもと製薬	4,000	345	1,380,000	
あすか製薬	24,000	830	19,920,000	
日本新薬	55,000	1,181	64,955,000	
中外製薬	217,200	1,757	381,620,400	
科研製薬	93,000	816	75,888,000	
エーザイ	268,400	3,260	874,984,000	
ロート製薬	99,000	1,139	112,761,000	
小野薬品	109,400	4,360	476,984,000	
久光製薬	67,700	3,220	217,994,000	
有機合成薬品	17,000	269	4,573,000	
持田製薬	90,000	892	80,280,000	
大正製薬	194,000	1,700	329,800,000	
参天製薬	67,500	3,070	207,225,000	
エスエス製薬	48,000	489	23,472,000	
扶桑薬品	75,000	265	19,875,000	
日本ケミファ	36,000	301	10,836,000	
ツムラ	64,100	3,130	200,633,000	
テルモ	149,900	4,510	676,049,000	
みらかホールディングス	41,500	2,840	117,860,000	
キッセイ薬品工業	44,000	2,120	93,280,000	
生化学工業	41,800	1,214	50,745,200	
栄研化学	14,100	1,062	14,974,200	
日水製薬	9,900	734	7,266,600	
鳥居薬品	13,300	1,722	22,902,600	
東和薬品	8,900	4,250	37,825,000	
沢井製薬	14,300	4,900	70,070,000	
ゼリア新薬工業	32,000	965	30,880,000	
第一三共	641,600	1,695	1,087,512,000	

キョーリン	53,000	1,507	79,871,000
大日本塗料	128,000	105	13,440,000
日本ペイント	241,000	457	110,137,000
関西ペイント	247,000	704	173,888,000
トウペ	21,000	100	2,100,000
中国塗料	63,000	591	37,233,000
日本特殊塗料	15,800	321	5,071,800
藤倉化成	25,900	495	12,820,500
太陽インキ製造	16,100	2,270	36,547,000
D I C	718,000	127	91,186,000
サカタインクス	46,000	372	17,112,000
東洋インキ	216,000	335	72,360,000
アルプス技研	9,400	533	5,010,200
サニックス	31,000	179	5,549,000
ダイオーズ	1,400	475	665,000
日本空調サービス	5,900	711	4,194,900
オリエンタルランド	58,800	6,150	361,620,000
ダスキン	65,600	1,611	105,681,600
パーク24	114,700	1,041	119,402,700
明光ネットワークジャパン	18,500	562	10,397,000
ファルコバイオシステムズ	11,500	1,013	11,649,500
クレスコ	5,400	423	2,284,200
フジ・メディア・HD	2,139	139,600	298,604,400
秀英予備校	4,600	556	2,557,600
田谷	900	701	630,900
ラウンドワン	36,400	751	27,336,400
リゾートトラスト	37,000	1,076	39,812,000
オービック	6,440	14,240	91,705,600
ティーディーシーソフトウェア	300	726	217,800
ヤフー	15,020	29,670	445,643,400
ビー・エム・エル	11,500	2,480	28,520,000
ワタベウェディング	6,500	1,180	7,670,000
トレンドマイクロ	81,600	3,100	252,960,000
もしもしホットライン	15,750	1,635	25,751,250
東急コミュニティー	5,700	1,944	11,080,800
リソー教育	2,215	5,550	12,293,250
日本オラクル	32,800	3,870	126,936,000
アルファシステムズ	5,700	1,765	10,060,500
フューチャーアーキテクト	222	36,050	8,003,100
ウェアハウス	5,300	422	2,236,600
シーエーシー	13,200	665	8,778,000
ソフトバンク・テクノ	5,000	654	3,270,000

トーセ	4,100	613	2,513,300
ユー・エス・エス	29,570	5,320	157,312,400
オービックビジネスC	6,550	4,480	29,344,000
日立ビジネスソリューション	6,400	699	4,473,600
伊藤忠テクノソリューション	25,000	2,665	66,625,000
アイティフォー	23,200	323	7,493,600
東京個別指導学院	16,600	193	3,203,800
東計電算	4,500	1,153	5,188,500
カルチュア・コンビニエンス	99,700	571	56,928,700
エクスネット	18	134,500	2,421,000
テー・オー・ダブリュー	6,400	531	3,398,400
大塚商会	16,300	4,940	80,522,000
総合メディカル	5,100	2,365	12,061,500
サイボウズ	306	31,200	9,547,200
ソフトブレーン	260	5,480	1,424,800
アグレックス	4,700	773	3,633,100
セントラルスポーツ	6,900	819	5,651,100
電通国際情報S	15,200	633	9,621,600
ウェザーニューズ	5,400	1,287	6,949,800
C I J	22,100	305	6,740,500
フルキャストホールディングス	186	7,040	1,309,440
富士フイルムHLDGS	532,200	2,590	1,378,398,000
コニカミノルタHLDGS	549,500	890	489,055,000
資生堂	370,900	1,497	555,237,300
ライオン	252,000	451	113,652,000
高砂香料	79,000	472	37,288,000
マンダム	21,800	2,280	49,704,000
ミルボン	9,800	2,155	21,119,000
ファンケル	37,900	1,474	55,864,600
コーセー	35,200	2,040	71,808,000
ドクターシーラボ	145	191,300	27,738,500
エステー	15,600	1,022	15,943,200
コニシ	17,700	847	14,991,900
長谷川香料	27,800	1,375	38,225,000
小林製薬	30,200	3,860	116,572,000
荒川化学工業	18,500	1,030	19,055,000
メック	14,600	705	10,293,000
日本高純度化学	57	317,000	18,069,000
荏原ユージライト	2,000	1,779	3,558,000
アース製薬	15,700	2,865	44,980,500
イハラケミカル	41,000	321	13,161,000
北興化学	11,000	319	3,509,000

大成ラミック	6,400	2,195	14,048,000
クミアイ化学	45,000	353	15,885,000
日本農薬	45,000	652	29,340,000
新日本石油	1,515,000	484	733,260,000
昭和シエル石油	195,100	931	181,638,100
コスモ石油	602,000	250	150,500,000
富士興産	80,000	78	6,240,000
ニチレキ	30,000	361	10,830,000
東燃ゼネラル石油	292,000	827	241,484,000
ユシロ化学	10,900	1,411	15,379,900
ビーピー・カストロール	11,000	332	3,652,000
新日鉱ホールディングス	900,000	439	395,100,000
AOCホールディングス	50,300	640	32,192,000
出光興産	25,800	7,040	181,632,000
横浜ゴム	266,000	420	111,720,000
東洋ゴム	223,000	193	43,039,000
ブリヂストン	630,600	1,595	1,005,807,000
住友ゴム	152,900	817	124,919,300
藤倉ゴム	15,500	376	5,828,000
オカモト	92,000	344	31,648,000
アキレス	179,000	137	24,523,000
フコク	11,000	520	5,720,000
ニッタ	19,700	1,371	27,008,700
クリエートメディック	7,500	894	6,705,000
東海ゴム	40,300	1,011	40,743,300
三ツ星ベルト	68,000	342	23,256,000
バンドー化学	78,000	228	17,784,000
鬼怒川ゴム	52,000	166	8,632,000
旭硝子	997,000	778	775,666,000
日本板硝子	693,000	302	209,286,000
石塚硝子	31,000	214	6,634,000
有沢製作所	29,400	686	20,168,400
日本山村硝子	102,000	285	29,070,000
日本電気硝子	354,000	962	340,548,000
オハラ	8,200	1,413	11,586,600
住友大阪セメント	415,000	168	69,720,000
太平洋セメント	860,000	118	101,480,000
デイ・シイ	20,000	275	5,500,000
リゾートソリューション	21,000	143	3,003,000
日本ヒューム	22,000	271	5,962,000
日本コンクリート	35,000	159	5,565,000
東海カーボン	204,000	447	91,188,000

日本カーボン	107,000	316	33,812,000	
東洋炭素	9,400	4,850	45,590,000	
ノリタケ	114,000	286	32,604,000	
TOTO	337,000	527	177,599,000	
日本碍子	262,000	2,130	558,060,000	
日本特殊陶業	193,000	1,062	204,966,000	
ダントーホールディングス	33,000	104	3,432,000	
MARUWA	6,500	2,280	14,820,000	
日本セラテック	17	29,410	499,970	
品川リフラクトリーズ	61,000	200	12,200,000	
黒崎播磨	54,000	155	8,370,000	
東京窯業	13,000	210	2,730,000	
ニッカトー	8,900	396	3,524,400	
フジミインコーポレーテッド	21,900	1,484	32,499,600	
エーアンドエーマテリアル	49,000	74	3,626,000	
ニチアス	105,000	336	35,280,000	
新日本製鐵	5,719,000	353	2,018,807,000	
住友金属工業	3,727,000	235	875,845,000	
神戸製鋼所	3,020,000	167	504,340,000	
日新製鋼	835,000	164	136,940,000	
中山製鋼所	119,000	169	20,111,000	
合同製鐵	132,000	205	27,060,000	
JFEホールディングス	555,900	3,270	1,817,793,000	
東京製鐵	90,000	1,180	106,200,000	
共英製鋼	17,400	2,125	36,975,000	
大和工業	51,100	2,690	137,459,000	
東京鐵鋼	43,000	313	13,459,000	
大阪製鐵	13,700	1,545	21,166,500	
淀川製鋼所	167,000	389	64,963,000	
東洋鋼鈹	46,000	409	18,814,000	
住友鋼管	15,800	522	8,247,600	
丸一鋼管	60,800	1,806	109,804,800	
モリ工業	40,000	194	7,760,000	
大同特殊鋼	337,000	330	111,210,000	
日本高周波	91,000	93	8,463,000	
日本金属工業	149,000	184	27,416,000	
日本冶金工	120,000	500	60,000,000	
山陽特殊鋼	108,000	342	36,936,000	
愛知製鋼	116,000	399	46,284,000	
日立金属	142,000	1,004	142,568,000	
日本金属	56,000	177	9,912,000	
大平洋金属	152,000	755	114,760,000	



日本電工	92,000	683	62,836,000
栗本鉄工所	97,000	95	9,215,000
旭テック	82,000	29	2,378,000
日本鑄鉄管	20,000	127	2,540,000
日本製鋼所	312,000	1,085	338,520,000
三菱製鋼	131,000	196	25,676,000
日亜鋼業	35,000	322	11,270,000
日本精線	17,000	280	4,760,000
日本軽金属	531,000	87	46,197,000
大紀アルミニウム	35,000	215	7,525,000
三井金属	630,000	240	151,200,000
東邦亜鉛	114,000	469	53,466,000
三菱マテリアル	1,323,000	264	349,272,000
住友鋳山	564,000	1,567	883,788,000
DOWAホールディングス	275,000	583	160,325,000
古河機金	368,000	122	44,896,000
大阪チタニウム	21,400	2,760	59,064,000
東邦チタニウム	35,300	1,241	43,807,300
住友軽金属	365,000	85	31,025,000
古河スカイ	104,000	156	16,224,000
古河電工	685,000	378	258,930,000
住友電工	718,500	1,184	850,704,000
フジクラ	327,000	473	154,671,000
三菱電線工業	146,000	89	12,994,000
昭和電線HLDGS	262,000	96	25,152,000
東京特殊電線	31,000	101	3,131,000
タツタ電線	55,000	219	12,045,000
日立電線	170,000	272	46,240,000
沖電線	26,000	127	3,302,000
カナレ電気	3,100	1,014	3,143,400
平河ヒューテック	5,500	696	3,828,000
リョービ	133,000	248	32,984,000
アサヒHD	30,500	1,531	46,695,500
東洋製罐	168,100	1,618	271,985,800
ホッカンホールディングス	57,000	237	13,509,000
コロナ	10,000	1,170	11,700,000
横河ブリッジHLDGS	42,000	664	27,888,000
日本橋梁	8,700	170	1,479,000
駒井鉄工	32,000	196	6,272,000
ハルテック	20,000	97	1,940,000
サクラダ	90,000	27	2,430,000
高田機工	17,000	195	3,315,000

三和ホールディングス	218,000	297	64,746,000	
文化シャツタ -	58,000	302	17,516,000	
東洋シャツタ -	5,300	590	3,127,000	
住生活グループ	263,100	1,465	385,441,500	
日本ファイルコン	15,500	483	7,486,500	
ノーリツ	33,200	1,105	36,686,000	
長府製作所	23,500	1,850	43,475,000	
リンナイ	42,100	3,980	167,558,000	
ユニプレス	28,800	1,339	38,563,200	
ダイニチ工業	13,000	590	7,670,000	
日東精工	30,000	222	6,660,000	
三洋工業	26,000	157	4,082,000	
岡 部	44,100	337	14,861,700	
日立ツール	12,800	829	10,611,200	
中国工業	32,000	92	2,944,000	
東 プ レ	45,600	812	37,027,200	
高周波熱錬	32,300	680	21,964,000	
東京製網	158,000	297	46,926,000	
パイオラックス	9,500	1,564	14,858,000	
日本発条	142,000	723	102,666,000	
中央発條	7,000	265	1,855,000	
アドバネクス	44,000	74	3,256,000	
三浦工業	32,400	2,470	80,028,000	
タ ク マ	86,000	241	20,726,000	
ツ ガ ミ	63,000	188	11,844,000	
オークマ	131,000	431	56,461,000	
東芝機械	119,000	316	37,604,000	
ア マ ダ	333,000	591	196,803,000	
アイダエンジニア	57,400	274	15,727,600	
牧野フライス	101,000	345	34,845,000	
オーエスジー	89,600	883	79,116,800	
ダイジェット	22,000	148	3,256,000	
旭ダイヤモンド	53,000	690	36,570,000	
森精機製作所	93,600	990	92,664,000	
ディスコ	19,700	6,030	118,791,000	
日東工器	12,900	1,806	23,297,400	
豊田自動織機	168,400	2,435	410,054,000	
豊和工業	130,000	56	7,280,000	
大阪機工	76,000	78	5,928,000	
石川製作所	53,000	59	3,127,000	
東洋機械金属	13,100	134	1,755,400	
オ - エム製作所	15,000	300	4,500,000	

津田駒工業	53,000	131	6,943,000
エンシュウ	53,000	84	4,452,000
島精機製作所	26,100	1,952	50,947,200
日本スピンドル	29,000	145	4,205,000
日阪製作所	23,000	1,045	24,035,000
やまびこ	8,200	1,101	9,028,200
ペガサスミシン製造	20,800	166	3,452,800
ナブテスコ	90,000	1,045	94,050,000
三井海洋開発	14,500	1,953	28,318,500
レオン自動機	4,000	261	1,044,000
S M C	65,000	10,500	682,500,000
新川	19,500	1,646	32,097,000
ホソカワミクロン	34,000	364	12,376,000
ユニオンツール	13,500	2,670	36,045,000
オイレス工業	24,300	1,550	37,665,000
サトー	22,700	1,142	25,923,400
日本エアーテック	6,300	658	4,145,400
日精樹脂工業	18,200	271	4,932,200
ワイエイシイ	9,300	828	7,700,400
小松製作所	968,100	1,770	1,713,537,000
住友重機械	548,000	428	234,544,000
日立建機	111,100	2,190	243,309,000
日工	18,000	259	4,662,000
巴工業	8,400	1,411	11,852,400
井関農機	219,000	369	80,811,000
T O W A	19,300	813	15,690,900
丸山製作所	50,000	186	9,300,000
北川鉄工所	104,000	104	10,816,000
シンニッタ	21,300	243	5,175,900
クボタ	997,000	741	738,777,000
荏原実業	5,300	1,327	7,033,100
東洋エンジニア	137,000	328	44,936,000
三菱化工機	67,000	248	16,616,000
月島機械	33,000	584	19,272,000
帝国電機製作所	7,900	1,789	14,133,100
東京機械	67,000	147	9,849,000
新東工業	43,900	644	28,271,600
渋谷工業	13,000	819	10,647,000
アイチ コーポレーション	36,400	434	15,797,600
小森コーポレーション	61,900	1,106	68,461,400
鶴見製作所	14,000	623	8,722,000
住友精密	40,000	310	12,400,000

酒井重工業	44,000	143	6,292,000
荏原製作所	464,000	395	183,280,000
石井鉄工所	34,000	161	5,474,000
西島製作所	19,300	1,489	28,737,700
千代田化工建	185,000	741	137,085,000
ダイキン工業	227,300	3,160	718,268,000
オルガノ	38,000	672	25,536,000
ト・ヨ・カネツ	136,000	162	22,032,000
栗田工業	120,100	2,955	354,895,500
椿本チエイン	111,000	402	44,622,000
大同工業	41,000	158	6,478,000
T C M	56,000	218	12,208,000
日本コンベヤ	81,000	81	6,561,000
日機装	61,000	707	43,127,000
木村化工機	19,900	955	19,004,500
新興プランテック	38,900	899	34,971,100
アネスト岩田	43,000	293	12,599,000
ダイフク	88,000	590	51,920,000
加藤製作所	46,000	193	8,878,000
油研工業	39,000	138	5,382,000
タダノ	101,000	439	44,339,000
フジテック	61,000	474	28,914,000
シーケーディ	58,300	815	47,514,500
キトー	66	90,000	5,940,000
平和	39,000	909	35,451,000
理想科学工業	16,900	1,070	18,083,000
SANKYO	56,800	5,340	303,312,000
日本金銭機械	23,600	817	19,281,200
マースエンジニアリング	10,400	2,895	30,108,000
福島工業	6,900	811	5,595,900
キャノンファインテック	16,600	1,178	19,554,800
アビリット	36,900	113	4,169,700
オーイズミ	2,400	219	525,600
ダイコク電機	8,600	1,839	15,815,400
アマノ	63,200	758	47,905,600
JUKI	108,000	102	11,016,000
サンデン	118,000	250	29,500,000
蛇の目ミシン	203,000	67	13,601,000
ブラザー工業	250,900	1,057	265,201,300
シルバー精工	404,000	6	2,424,000
マックス	36,000	891	32,076,000
モリタホールディングス	34,000	503	17,102,000

グローリー	63,200	2,025	127,980,000
大和冷機工業	28,000	471	13,188,000
セガサミーホールディングス	238,000	1,257	299,166,000
日本ピストンリング	84,000	99	8,316,000
リケン	97,000	308	29,876,000
帝国ピストン	25,300	385	9,740,500
ホシザキ電機	41,900	1,261	52,835,900
大豊工業	16,700	655	10,938,500
日本精工	428,000	566	242,248,000
N T N	413,000	383	158,179,000
ジェイテクト	207,600	1,063	220,678,800
不二越	210,000	197	41,370,000
ミネベア	310,000	413	128,030,000
日本トムソン	67,000	506	33,902,000
T H K	129,700	1,695	219,841,500
ユーシン精機	9,300	1,500	13,950,000
前澤給装工業	8,900	1,385	12,326,500
イーグル工業	26,000	470	12,220,000
前澤工業	17,500	189	3,307,500
日本ピラ - 工業	23,000	433	9,959,000
キッツ	93,000	486	45,198,000
日立	3,483,000	304	1,058,832,000
東芝	4,108,000	492	2,021,136,000
三菱電機	1,943,000	724	1,406,732,000
富士電機HLDGS	483,000	168	81,144,000
東洋電機製造	42,000	880	36,960,000
安川電機	228,000	716	163,248,000
シンフォニアテクノロジー	135,000	235	31,725,000
明電舎	191,000	476	90,916,000
オリジン電気	29,000	244	7,076,000
デンヨー	21,800	632	13,777,600
日立工機	71,600	975	69,810,000
三桜工業	26,700	600	16,020,000
マキタ	126,600	3,130	396,258,000
東芝テック	149,000	406	60,494,000
芝浦メカトロニクス	37,000	302	11,174,000
マブチモーター	28,400	4,540	128,936,000
日本電産	103,100	7,250	747,475,000
高岳製作所	82,000	307	25,174,000
ダイヘン	105,000	347	36,435,000
JVCケンウッドHD	773,200	50	38,660,000
日新電機	42,000	531	22,302,000

大崎電気	32,000	994	31,808,000	
オムロン	247,200	1,570	388,104,000	
日東工業	31,500	875	27,562,500	
I D E C	27,700	721	19,971,700	
エルピーダメモリ	139,600	1,220	170,312,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	374,000	786	293,964,000	
サクサホールディングス	53,000	192	10,176,000	
メルコホールディングス	11,500	1,926	22,149,000	
テクノメディカ	13	284,600	3,699,800	
日本電気	2,099,000	300	629,700,000	
富士通	2,194,000	593	1,301,042,000	
沖電気	664,000	80	53,120,000	
岩崎通信機	95,000	83	7,885,000	
電気興業	56,000	449	25,144,000	
サンケン電気	122,000	299	36,478,000	
ナカヨ通信機	18,000	179	3,222,000	
アイホン	14,900	1,597	23,795,300	

[前へ](#) [次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
NECエレクトロニクス	39,800	810	32,238,000	
セイコーエプソン	157,500	1,507	237,352,500	
ワコム	408	207,200	84,537,600	
アルバック	33,200	2,380	79,016,000	
ピクセラ	7,500	373	2,797,500	
ナナオ	17,700	2,140	37,878,000	
日本信号	52,500	866	45,465,000	
京三製作所	49,000	425	20,825,000	
能美防災	28,000	712	19,936,000	
ホーチキ	19,000	506	9,614,000	
マスプロ電工	16,800	904	15,187,200	
日本無線	81,000	209	16,929,000	
パナソニック	2,219,700	1,243	2,759,087,100	
シャープ	1,005,000	1,018	1,023,090,000	
アンリツ	99,000	302	29,898,000	
富士通ゼネラル	49,000	321	15,729,000	
日立国際電気	61,000	702	42,822,000	
ソニー	1,103,700	2,550	2,814,435,000	
T D K	108,900	5,310	578,259,000	
帝国通信工業	53,000	237	12,561,000	
三洋電機	2,057,000	212	436,084,000	
宮越商事	5,000	600	3,000,000	
ミツミ電機	73,500	1,999	146,926,500	
タムラ製作所	63,000	352	22,176,000	
アルプス電気	175,900	533	93,754,700	
池上通信機	69,000	85	5,865,000	
パイオニア	162,600	244	39,674,400	
日本電波工業	16,100	1,858	29,913,800	
日本トリム	3,200	1,809	5,788,800	
ローランド ディー・ジー	8,200	1,167	9,569,400	
コロムビアミュージックエンタ	143,000	37	5,291,000	
山水電気	957,000	6	5,742,000	
フオスタ - 電機	20,200	2,260	45,652,000	
クラリオン	92,000	89	8,188,000	
S M K	61,000	582	35,502,000	
ヨコオ	18,200	559	10,173,800	
東光	96,000	137	13,152,000	
ティアック	95,000	39	3,705,000	
ホシデン	51,600	1,250	64,500,000	

ヒロセ電機	36,200	9,940	359,828,000
日本航空電子	48,000	529	25,392,000
T O A	26,000	541	14,066,000
ユニデン	61,000	221	13,481,000
アルパイン	45,200	821	37,109,200
スミダコーポレーション	14,500	650	9,425,000
アイコム	11,700	2,235	26,149,500
船井電機	18,600	4,350	80,910,000
横河電機	225,800	792	178,833,600
新電元工業	74,000	255	18,870,000
山武	53,400	2,010	107,334,000
日本光電工業	41,400	1,397	57,835,800
チノー	42,000	244	10,248,000
共和電業	3,000	259	777,000
日本電子材料	8,800	604	5,315,200
堀場製作所	33,000	2,215	73,095,000
アドバンテスト	141,900	2,450	347,655,000
小野測器	23,000	413	9,499,000
エスペック	20,200	560	11,312,000
サンクス	20,000	300	6,000,000
キーエンス	42,900	17,900	767,910,000
日置電機	10,200	1,644	16,768,800
シスメックス	39,800	3,920	156,016,000
メガチップス	19,100	1,921	36,691,100
O B A R A	15,000	874	13,110,000
日本電産コパル電子	22,100	538	11,889,800
ミヤチテクノス	10,200	669	6,823,800
東京電波	6,900	620	4,278,000
澤藤電機	6,000	164	984,000
デンソー	457,100	2,650	1,211,315,000
コーセル	27,800	1,064	29,579,200
日立メディコ	16,000	830	13,280,000
新日本無線	13,000	222	2,886,000
オプテックス	14,500	1,037	15,036,500
千代田インテグレ	11,100	1,126	12,498,600
東光電気	15,000	519	7,785,000
スタンレー電気	145,900	1,982	289,173,800
岩崎電気	71,000	175	12,425,000
ウシオ電機	117,300	1,544	181,111,200
岡谷電機	12,600	237	2,986,200
ヘリオステクノH	15,000	315	4,725,000
日本セラミック	13,900	1,213	16,860,700



新神戸電機	20,000	1,042	20,840,000
日本デジタル研究所	19,900	1,153	22,944,700
古河電池	15,000	754	11,310,000
双信電機	10,500	383	4,021,500
山一電機	18,000	199	3,582,000
図研	14,700	654	9,613,800
日本電子	77,000	380	29,260,000
カシオ	198,200	750	148,650,000
ファナック	201,200	7,640	1,537,168,000
日本シイエムケイ	40,600	730	29,638,000
エンプラス	12,200	1,760	21,472,000
ローム	104,300	6,410	668,563,000
浜松ホトニクス	75,800	2,240	169,792,000
三井ハイテック	27,400	1,088	29,811,200
新光電気工業	61,000	1,671	101,931,000
京セラ	185,500	8,090	1,500,695,000
協栄産業	7,000	195	1,365,000
日本インター	22,400	315	7,056,000
太陽誘電	101,000	1,093	110,393,000
村田製作所	232,900	4,270	994,483,000
ユーシン	23,100	492	11,365,200
双葉電子工業	35,800	1,407	50,370,600
日東電工	190,800	2,730	520,884,000
北陸電気工業	97,000	163	15,811,000
パナソニック電工	340,000	1,145	389,300,000
東海理化電機	54,700	1,778	97,256,600
ニチコン	65,500	1,141	74,735,500
日本ケミコン	106,000	403	42,718,000
K O A	28,900	785	22,686,500
三井造船	752,000	235	176,720,000
日立造船	927,500	112	103,880,000
佐世保重工業	126,000	192	24,192,000
三菱重工業	3,707,000	340	1,260,380,000
川崎重工業	1,726,000	233	402,158,000
I H I	1,422,000	176	250,272,000
日本車輛	95,000	590	56,050,000
日本輸送機	26,000	223	5,798,000
近畿車輛	36,000	821	29,556,000
日産自動車	2,629,400	686	1,803,768,400
いすゞ自動車	986,000	202	199,172,000
トヨタ自動車	2,674,300	3,610	9,654,223,000
日野自動車	297,000	368	109,296,000

三菱自動車工業	4,654,000	147	684,138,000
エフテック	7,400	855	6,327,000
武蔵精密工業	20,100	1,715	34,471,500
トヨタ車体	45,400	1,673	75,954,200
日産車体	71,000	779	55,309,000
関東自動車	31,800	888	28,238,400
新明和工業	93,000	344	31,992,000
極東開発工業	42,300	342	14,466,600
日信工業	38,000	1,295	49,210,000
トピー工業	187,000	201	37,587,000
ティラド	63,000	233	14,679,000
曙ブレーキ	57,400	727	41,729,800
タチエス	27,200	736	20,019,200
N O K	111,800	1,386	154,954,800
フタバ産業	45,400	400	18,160,000
カヤバ工業	144,000	293	42,192,000
シロキ工業	42,000	151	6,342,000
市光工業	52,000	166	8,632,000
大同メタル工業	35,000	269	9,415,000
プレス工業	81,000	200	16,200,000
カルソニックカンセイ	123,000	262	32,226,000
太平洋工業	42,000	411	17,262,000
ケーヒン	47,800	1,440	68,832,000
河西工業	23,000	233	5,359,000
アイシン精機	190,300	2,270	431,981,000
富士機工	18,000	116	2,088,000
マ ッ ダ	825,000	235	193,875,000
ダイハツ	221,000	951	210,171,000
愛知機械	53,000	228	12,084,000
今仙電機製作所	15,100	1,047	15,809,700
本田技研	1,778,800	2,810	4,998,428,000
スズキ	420,900	2,100	883,890,000
富士重工業	708,000	361	255,588,000
ヤマハ発動機	240,700	1,076	258,993,200
ショーワ	44,200	522	23,072,400
小糸製作所	104,000	1,298	134,992,000
T B K	25,000	155	3,875,000
エクセディ	25,100	1,958	49,145,800
ミツバ	39,000	444	17,316,000
豊田合成	58,700	2,690	157,903,000
愛三工業	25,300	651	16,470,300
ヨロズ	14,000	1,186	16,604,000

エフ・シー・シー	30,600	1,531	46,848,600
新家工業	51,000	132	6,732,000
シマノ	80,600	3,610	290,966,000
タカタ	37,000	1,645	60,865,000
テイ・エス テック	43,900	1,754	77,000,600
小野建	16,700	787	13,142,900
はるやま商事	10,200	396	4,039,200
佐島電機	15,400	591	9,101,400
カッパクリエイト	12,150	2,120	25,758,000
エコートレーディング	4,700	1,010	4,747,000
伯東	12,700	828	10,515,600
中山福	14,600	595	8,687,000
ライトオン	15,400	802	12,350,800
ナガイレーベン	12,600	2,010	25,326,000
ジーンズメイト	5,800	517	2,998,600
菱食	20,000	2,380	47,600,000
良品計画	21,700	4,150	90,055,000
三城ホールディングス	29,400	766	22,520,400
松田産業	15,000	1,600	24,000,000
メディパルHD	221,100	1,173	259,350,300
アドヴァン	14,400	569	8,193,600
S P K	4,100	1,200	4,920,000
アズワン	13,600	1,636	22,249,600
スズデン	6,100	490	2,989,000
尾家産業	5,800	800	4,640,000
シモジマ	14,300	1,281	18,318,300
ドウシシャ	11,000	1,785	19,635,000
コナカ	24,600	271	6,666,600
高速	13,100	661	8,659,100
ハウス ローゼ	2,000	1,269	2,538,000
G - 7ホールディングス	6,200	472	2,926,400
イオン北海道	11,300	293	3,310,900
コジマ	27,800	445	12,371,000
コーナン商事	24,100	1,075	25,907,500
黒田電気	29,500	1,176	34,692,000
ネットワンシステムズ	499	127,500	63,622,500
エコス	7,600	621	4,719,600
ワタミ	27,000	1,803	48,681,000
マルシェ	6,200	735	4,557,000
ドン・キホーテ	37,200	2,100	78,120,000
丸文	16,300	511	8,329,300
メガネトップ	11,700	1,525	17,842,500

西松屋チェーン	53,900	923	49,749,700
ゼンショー	69,000	629	43,401,000
ハピネット	5,800	1,217	7,058,600
幸楽苑	13,300	1,190	15,827,000
トーマンエレクトロニクス	6,700	986	6,606,200
ユニマツライフ	8,600	911	7,834,600
ハークスレイ	6,100	823	5,020,300
サイゼリヤ	30,400	1,610	48,944,000
エクセル	8,900	1,090	9,701,000
マルカキカイ	7,400	695	5,143,000
アルゴグラフィックス	8,600	1,024	8,806,400
ガリバーインターナショナル	4,820	6,650	32,053,000
日本エム・ディ・エム	16,900	285	4,816,500
ポプラ	6,800	637	4,331,600
ユナイテッドアローズ	27,600	783	21,610,800
進和	11,500	1,250	14,375,000
エスケイジャパン	5,500	367	2,018,500
ダイトエレクトロン	9,900	469	4,643,100
ハイデイ日高	9,400	1,037	9,747,800
シークス	12,800	823	10,534,400
京都きもの友禅	13,200	921	12,157,200
コロワイド	46,500	583	27,109,500
田中商事	6,400	430	2,752,000
オーハシテクニカ	14,000	512	7,168,000
壱番屋	7,600	2,195	16,682,000
マクニカ	8,300	1,401	11,628,300
白銅	6,800	602	4,093,600
トップカルチャー	6,800	448	3,046,400
スギホールディングス	32,700	1,829	59,808,300
島津製作所	230,000	644	148,120,000
J M S	35,000	399	13,965,000
アロカ	13,100	778	10,191,800
クボテック	57	30,000	1,710,000
モリテックス	4,800	296	1,420,800
長野計器	12,800	594	7,603,200
スター精密	39,700	767	30,449,900
東京計器	73,000	122	8,906,000
愛知時計	7,000	256	1,792,000
日本電産トーソク	7,300	727	5,307,100
東京精密	39,100	1,297	50,712,700
ニコン	362,600	1,736	629,473,600
トプコン	48,000	410	19,680,000

オリンパス	227,900	2,720	619,888,000
理研計器	17,800	654	11,641,200
大日本スクリーン	229,000	358	81,982,000
キヤノン電子	18,800	1,639	30,813,200
タムロン	18,200	1,084	19,728,800
HOYA	477,900	2,080	994,032,000
ノーリツ鋼機	19,000	792	15,048,000
エー・アンド・デイ	17,100	422	7,216,200
キヤノン	1,206,800	3,500	4,223,800,000
リコー	674,000	1,258	847,892,000
日本電産コパル	20,300	1,196	24,278,800
日本電産サンキョー	62,000	580	35,960,000
シチズンホールディングス	270,400	522	141,148,800
リズム時計	102,000	135	13,770,000
SRIスポーツ	113	81,300	9,186,900
バンダイナムコHLDGS	226,200	930	210,366,000
共立印刷	17,100	150	2,565,000
フランスベッドHLDGS	140,000	138	19,320,000
パイロットコーポレーション	183	98,300	17,988,900
エイベックス・グループHD	39,200	825	32,340,000
トッパン・フォームズ	44,600	1,161	51,780,600
フジシールインターナショナル	23,300	1,779	41,450,700
タカラトミー	62,000	726	45,012,000
廣済堂	18,900	210	3,969,000
アーク	61,000	76	4,636,000
レック	5,700	1,488	8,481,600
アロン化成	14,000	343	4,802,000
タカノ	8,700	570	4,959,000
プロネクサス	25,800	661	17,053,800
ホクシン	18,100	159	2,877,900
ウッドワン	43,000	274	11,782,000
大建工業	94,000	210	19,740,000
きもと	17,600	968	17,036,800
凸版印刷	633,000	833	527,289,000
大日本印刷	634,000	1,168	740,512,000
図書印刷	47,000	209	9,823,000
共同印刷	71,000	287	20,377,000
日本写真印刷	32,000	4,350	139,200,000
光村印刷	3,000	325	975,000
藤森工業	14,500	1,324	19,198,000
宝印刷	10,700	780	8,346,000
前澤化成工業	16,200	989	16,021,800

コ ン ビ	13,000	654	8,502,000	
アシックス	206,000	781	160,886,000	
ツ ツ ミ	7,900	2,245	17,735,500	
ジェイ エス ピー	14,300	760	10,868,000	
ニ チ ハ	24,400	567	13,834,800	
ローランド	15,000	960	14,400,000	
エフピコ	10,900	4,580	49,922,000	
小松ウオール工業	8,400	1,125	9,450,000	
ヤマハ	165,700	974	161,391,800	
河合楽器	77,000	108	8,316,000	
クリナップ	22,400	648	14,515,200	
ピジョン	13,100	3,420	44,802,000	
天馬	15,700	1,118	17,552,600	
パラマウントベッド	20,500	1,943	39,831,500	
兼松日産農林	33,000	123	4,059,000	
キングジム	16,700	701	11,706,700	
リンテック	39,500	1,659	65,530,500	
田崎真珠	37,000	106	3,922,000	
信越ポリマー	42,800	608	26,022,400	
東 リ	47,000	183	8,601,000	
イトーキ	45,300	224	10,147,200	
任 天 堂	109,900	23,090	2,537,591,000	
三菱鉛筆	18,200	1,063	19,346,600	
タカラスタンダ - ド	97,000	541	52,477,000	
コ ク ヨ	108,300	806	87,289,800	
ナカバヤシ	50,000	199	9,950,000	
ニ フ コ	45,100	1,820	82,082,000	
グローブライド	107,000	106	11,342,000	
サンウエーブ	33,000	228	7,524,000	
岡村製作所	87,000	434	37,758,000	
日本バルカー	86,000	178	15,308,000	
M U T O Hホールディングス	24,000	140	3,360,000	
伊 藤 忠	1,536,000	623	956,928,000	
丸 紅	1,797,000	467	839,199,000	
スクロール	25,200	378	9,525,600	
高 島	40,000	133	5,320,000	
F & A アクアホールディングス	18,000	1,007	18,126,000	
三陽商会	98,000	297	29,106,000	
長瀬産業	107,000	1,056	112,992,000	
ナイガイ	68,000	46	3,128,000	
蝶 理	140,000	95	13,300,000	
豊田通商	206,000	1,373	282,838,000	

オンワ - ドホールディングス	145,000	582	84,390,000	
三共生興	36,100	227	8,194,700	
兼 松	439,000	80	35,120,000	
美 津 濃	104,000	402	41,808,000	
ツカモトコーポレーション	35,000	83	2,905,000	
ファミリーマート	63,100	2,740	172,894,000	
ルック	35,000	92	3,220,000	
三井物産	1,770,000	1,202	2,127,540,000	
日本紙パルプ	107,000	341	36,487,000	
東京エレクトロン	151,700	5,770	875,309,000	
日立ハイテクノロジーズ	71,200	1,772	126,166,400	
カメイ	22,000	473	10,406,000	
東都水産	34,000	163	5,542,000	
日本マタイ	37,000	103	3,811,000	
スターゼン	72,000	231	16,632,000	
セイコーHD	75,000	203	15,225,000	
山 善	79,500	321	25,519,500	
椿本興業	24,000	199	4,776,000	
住友商事	1,212,600	925	1,121,655,000	
日本ユニシス	49,500	782	38,709,000	
内田洋行	46,000	278	12,788,000	
三菱商事	1,534,700	1,929	2,960,436,300	
第一実業	46,000	258	11,868,000	
キャノンマーケティングJPN	68,300	1,481	101,152,300	
西華産業	90,000	214	19,260,000	
佐藤商事	19,500	469	9,145,500	
菱洋エレクトロ	21,400	766	16,392,400	
東京産業	23,000	269	6,187,000	
ユアサ商事	232,000	98	22,736,000	
神鋼商事	53,000	152	8,056,000	
阪和興業	205,000	339	69,495,000	
カナデン	2,000	504	1,008,000	
菱電商事	31,000	562	17,422,000	
ニプロ	49,600	1,935	95,976,000	
フルサト工業	13,600	637	8,663,200	
岩谷産業	230,000	270	62,100,000	
すてきナイスグループ	85,000	175	14,875,000	
昭光通商	82,000	122	10,004,000	
ニチモウ	35,000	155	5,425,000	
極東貿易	34,000	130	4,420,000	
イワキ	22,000	255	5,610,000	
兼松エレクトロニクス	13,400	868	11,631,200	

三愛石油	50,000	433	21,650,000	
稲畑産業	55,300	355	19,631,500	
G S Iクレオス	54,000	104	5,616,000	
明和産業	16,900	165	2,788,500	
ゴ-ルドウイン	49,000	184	9,016,000	
東京スタイル	73,000	741	54,093,000	
ユニ・チャ-ム	44,500	8,310	369,795,000	
デザート	60,000	405	24,300,000	
ヤマトインタ-ナショナル	13,800	399	5,506,200	
東邦ホールディングス	47,200	1,224	57,772,800	
サンゲツ	35,700	1,965	70,150,500	
ミツウロコ	34,000	642	21,828,000	
シナネン	51,000	468	23,868,000	
伊藤忠エネクス	53,000	489	25,917,000	
ザ・トーカイ	49,000	490	24,010,000	

[前へ](#) [次へ](#)



銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
サンリオ	57,100	720	41,112,000	
サンワ テクノス	8,300	412	3,419,600	
リョーサン	31,400	2,245	70,493,000	
新光商事	21,100	706	14,896,600	
トーヨー	37,000	333	12,321,000	
三信電気	23,700	678	16,068,600	
東陽テクニカ	32,300	859	27,745,700	
モスフード サービス	29,400	1,497	44,011,800	
加賀電子	22,300	933	20,805,900	
三益半導体	16,000	1,269	20,304,000	
ソーダニツカ	2,000	310	620,000	
立花エレテック	14,300	684	9,781,200	
木曽路	23,700	1,991	47,186,700	
千 趣 会	37,400	621	23,225,400	
タカキュー	17,000	155	2,635,000	
ケーヨー	43,000	444	19,092,000	
アデランスホールディングス	23,500	1,072	25,192,000	
上新電機	48,000	619	29,712,000	
日本瓦斯	22,300	1,483	33,070,900	
ベスト電器	64,500	395	25,477,500	
マルエツ	42,000	443	18,606,000	
ロイヤルホールディングス	32,200	1,005	32,361,000	
東 天 紅	14,000	169	2,366,000	
いなげや	18,000	944	16,992,000	
島 忠	46,400	2,200	102,080,000	
チヨダ	29,700	1,149	34,125,300	
鈴 丹	4,600	241	1,108,600	
ライフコーポレーション	13,400	1,537	20,595,800	
カ ス ミ	43,200	445	19,224,000	
リンガーハット	15,900	1,140	18,126,000	
さ が 美	17,000	179	3,043,000	
MR MAX	23,800	463	11,019,400	
テンアライド	12,000	305	3,660,000	
A O K Iホールディングス	22,400	910	20,384,000	
オークワ	29,000	918	26,622,000	
コメリ	28,100	2,460	69,126,000	
青山商事	52,200	1,553	81,066,600	
しまむら	21,500	8,630	185,545,000	
C F Sコーポレーション	20,000	532	10,640,000	

高島屋	278,000	671	186,538,000
丸善	103,000	92	9,476,000
松屋	41,300	677	27,960,100
エイチ・ツー・オーリテイリング	134,000	575	77,050,000
丸栄	23,000	141	3,243,000
ニッセンHD	41,000	301	12,341,000
パルコ	58,700	788	46,255,600
丸井グループ	268,100	575	154,157,500
クレディセゾン	179,700	1,113	200,006,100
原信ナルスHLDGS	12,900	1,009	13,016,100
セディナ	163,800	175	28,665,000
井筒屋	115,000	46	5,290,000
ダイエー	95,000	355	33,725,000
イズミヤ	66,000	471	31,086,000
イオン	827,600	850	703,460,000
ユニー	154,200	635	97,917,000
イズミ	55,700	1,110	61,827,000
東武ストア	28,000	294	8,232,000
平和堂	41,700	1,210	50,457,000
フジ	23,200	1,750	40,600,000
ヤオコー	11,800	3,100	36,580,000
ゼビオ	21,600	1,993	43,048,800
ケーズホールディングス	36,100	2,725	98,372,500
OLYMPIC	15,300	590	9,027,000
東日カーライフグループ	35,000	100	3,500,000
新生銀行	1,199,000	130	155,870,000
あおぞら銀行	748,000	120	89,760,000
三菱UFJフィナンシャルG	12,045,600	501	6,034,845,600
りそなホールディングス	707,000	1,110	784,770,000
中央三井トラストHD	1,051,000	344	361,544,000
三井住友フィナンシャルG	1,118,200	3,430	3,835,426,000
第四銀行	288,000	343	98,784,000
北越銀行	233,000	161	37,513,000
西日本シティ銀行	667,000	212	141,404,000
札幌北洋ホール	309,200	312	96,470,400
千葉銀行	810,000	555	449,550,000
横浜銀行	1,407,000	443	623,301,000
常陽銀行	796,000	402	319,992,000
群馬銀行	479,000	457	218,903,000
武蔵野銀行	31,100	2,565	79,771,500
千葉興業銀行	39,400	722	28,446,800
関東つくば銀行	58,800	306	17,992,800

東京都民銀行	38,800	1,407	54,591,600
七十七銀行	346,000	481	166,426,000
青森銀行	130,000	274	35,620,000
秋田銀行	141,000	337	47,517,000
山形銀行	125,000	437	54,625,000
岩手銀行	13,900	4,890	67,971,000
東邦銀行	160,000	354	56,640,000
東北銀行	111,000	144	15,984,000
みちのく銀行	105,000	198	20,790,000
ふくおかフィナンシャルG	887,000	346	306,902,000
静岡銀行	643,000	881	566,483,000
十六銀行	266,000	301	80,066,000
スルガ銀行	233,000	849	197,817,000
八十二銀行	388,000	493	191,284,000
山梨中央銀行	137,000	418	57,266,000
大垣共立銀行	274,000	312	85,488,000
福井銀行	178,000	285	50,730,000
北國銀行	238,000	349	83,062,000
清水銀行	7,100	3,640	25,844,000
滋賀銀行	192,000	547	105,024,000
南都銀行	204,000	462	94,248,000
百五銀行	203,000	439	89,117,000
京都銀行	359,000	769	276,071,000
三重銀行	92,000	278	25,576,000
ほくほくフィナンシャルG	1,437,000	200	287,400,000
広島銀行	605,000	344	208,120,000
山陰合同銀行	124,000	753	93,372,000
中国銀行	169,000	1,072	181,168,000
鳥取銀行	73,000	244	17,812,000
伊予銀行	234,000	781	182,754,000
百十四銀行	240,000	376	90,240,000
四国銀行	151,000	306	46,206,000
阿波銀行	183,000	482	88,206,000
鹿児島銀行	144,000	666	95,904,000
大分銀行	133,000	353	46,949,000
宮崎銀行	107,000	371	39,697,000
肥後銀行	163,000	518	84,434,000
佐賀銀行	126,000	274	34,524,000
十八銀行	131,000	234	30,654,000
沖縄銀行	16,900	3,100	52,390,000
琉球銀行	43,100	1,043	44,953,300
住友信託	1,949,000	496	966,704,000

みずほ信託銀行	1,952,000	96	187,392,000
八千代銀行	12,400	2,570	31,868,000
みずほフィナンシャルG	15,693,500	186	2,918,991,000
紀陽ホールディングス	813,000	108	87,804,000
山口フィナンシャルG	191,000	888	169,608,000
フィデック	88	9,920	872,960
芙蓉総合リース	21,600	1,968	42,508,800
興銀リース	28,700	1,360	39,032,000
東京センチュリーリース	48,200	1,036	49,935,200
S B Iホールディングス	16,247	17,880	290,496,360
日本証券金融	78,700	713	56,113,100
大阪証券金融	25,500	203	5,176,500
アイフル	106,750	161	17,186,750
日本アジア投資	124,000	63	7,812,000
ポケットカード	20,200	236	4,767,200
長野銀行	78,000	198	15,444,000
名古屋銀行	199,000	363	72,237,000
愛知銀行	7,500	7,390	55,425,000
第三銀行	128,000	206	26,368,000
中京銀行	97,000	265	25,705,000
東日本銀行	107,000	183	19,581,000
愛媛銀行	130,000	243	31,590,000
トマト銀行	84,000	199	16,716,000
みなと銀行	214,000	114	24,396,000
京葉銀行	184,000	454	83,536,000
関西アーバン銀行	286,000	119	34,034,000
栃木銀行	111,000	421	46,731,000
北日本銀行	7,000	2,715	19,005,000
香川銀行	74,000	331	24,494,000
東和銀行	184,000	64	11,776,000
徳島銀行	60,000	344	20,640,000
福島銀行	256,000	55	14,080,000
大東銀行	139,000	73	10,147,000
武富士	130,340	400	52,136,000
リコーリース	14,200	1,942	27,576,400
イオン クレジットサービス	91,300	964	88,013,200
N I Sグループ	126,000	31	3,906,000
アコム	92,750	1,485	137,733,750
プロミス	95,650	726	69,441,900
ロプロ	62,500	24	1,500,000
ジャックス	124,000	225	27,900,000
日立キャピタル	48,400	1,180	57,112,000

オリックス	121,040	6,130	741,975,200	
三菱UFJリース	52,060	2,860	148,891,600	
ジャフコ	31,200	2,855	89,076,000	
大和証券G本社	1,695,000	483	818,685,000	
野村ホールディングス	3,122,100	658	2,054,341,800	
みずほ証券	525,000	320	168,000,000	
みずほインベスタズ証	478,000	100	47,800,000	
岡三証券グループ	175,000	418	73,150,000	
丸三証券	68,600	573	39,307,800	
東洋証券	77,000	200	15,400,000	
東海東京HD	240,000	292	70,080,000	
光世証券	55,000	103	5,665,000	
水戸証券	66,000	224	14,784,000	
いちよし証券	46,500	611	28,411,500	
松井証券	156,900	679	106,535,100	
だいこう証券ビジ	9,100	502	4,568,200	
マネックスG	1,059	34,400	36,429,600	
カブドットコム証券	442	101,100	44,686,200	
極東証券	25,500	664	16,932,000	
岩井証券	21,500	719	15,458,500	
フィデアホール	101,200	140	14,168,000	
池田泉州HD	346,600	320	110,912,000	
三井住友海上HD	490,200	2,305	1,129,911,000	
SONY FH	730	274,400	200,312,000	
小林洋行	5,200	322	1,674,400	
日本興亜損害保険	792,000	531	420,552,000	
損害保険ジャパン	958,000	585	560,430,000	
ニッセイ同和損害保険	227,000	432	98,064,000	
あいおい損害保険	538,000	432	232,416,000	
富士火災	244,000	110	26,840,000	
東京海上HD	883,900	2,445	2,161,135,500	
アサックス	28	76,600	2,144,800	
NECキャピタルソリューション	7,100	1,313	9,322,300	
T&Dホールディングス	300,900	2,395	720,655,500	
三井不動産	911,000	1,516	1,381,076,000	
三菱地所	1,438,000	1,412	2,030,456,000	
平和不動産	146,000	293	42,778,000	
東京建物	287,000	465	133,455,000	
ダイビル	53,100	730	38,763,000	
サンケイビル	30,900	663	20,486,700	
東急不動産	413,000	394	162,722,000	
京阪神不動産	27,700	448	12,409,600	

住友不動産	523,000	1,718	898,514,000
東宝不動産	22,400	491	10,998,400
太平洋興発	67,000	73	4,891,000
有楽土地	24,000	306	7,344,000
大京	222,000	239	53,058,000
テーオーシー	79,700	399	31,800,300
東京楽天地	27,000	371	10,017,000
レオパレス21	144,200	701	101,084,200
フジ住宅	24,300	358	8,699,400
空港施設	22,700	534	12,121,800
明和地所	10,200	551	5,620,200
住友不動産販売	9,220	3,390	31,255,800
ゴールドクレスト	16,170	2,715	43,901,550
東栄住宅	15,500	940	14,570,000
日本エスリード	6,900	953	6,575,700
東急リバブル	21,800	862	18,791,600
飯田産業	10,100	1,556	15,715,600
日神不動産	12,000	484	5,808,000
アーネストワン	33,800	950	32,110,000
タカラレーベン	10,100	454	4,585,400
サンヨーハウジ名古屋	99	76,800	7,603,200
イオンモール	93,600	1,915	179,244,000
フージャースコーポレーション	162	10,050	1,628,100
サンシティ	432	2,580	1,114,560
ゼクス	81	1,184	95,904
タクトホーム	108	78,800	8,510,400
ランド	11,100	64	710,400
リサ・パートナーズ	266	68,200	18,141,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,275	79,700	101,617,500
サンフロンティア不動産	196	24,990	4,898,040
大和システム	9,200	287	2,640,400
ランドビジネス	138	27,840	3,841,920
東武鉄道	890,000	513	456,570,000
相鉄ホールディングス	290,000	391	113,390,000
東京急行	1,144,000	404	462,176,000
京浜急行	536,000	731	391,816,000
小田急電鉄	669,000	753	503,757,000
京王電鉄	542,000	572	310,024,000
京成電鉄	335,000	544	182,240,000
富士急行	59,000	430	25,370,000
新京成電鉄	23,000	343	7,889,000
東日本旅客鉄道	387,800	5,910	2,291,898,000

西日本旅客鉄道	1,941	310,000	601,710,000
東海旅客鉄道	1,667	602,000	1,003,534,000
アートコーポレーション	5,100	1,435	7,318,500
西日本鉄道	274,000	354	96,996,000
ハマキョウレックス	6,500	2,300	14,950,000
サカイ引越センター	4,000	2,225	8,900,000
近畿鉄道	1,880,000	331	622,280,000
阪急阪神HLDGS	1,398,000	401	560,598,000
南海電鉄	438,000	383	167,754,000
京阪電鉄	470,000	380	178,600,000
名糖運輸	7,300	779	5,686,700
名古屋鉄道	732,000	282	206,424,000
日本通運	893,000	351	313,443,000
ヤマトホールディングス	414,200	1,415	586,093,000
山九	253,000	372	94,116,000
日新	80,000	208	16,640,000
丸運	19,100	249	4,755,900
丸全昭和運輸	65,000	302	19,630,000
センコー	73,000	338	24,674,000
トナミホールディングス	49,000	245	12,005,000
日本梱包運輸	58,000	956	55,448,000
日石輸送	12,000	197	2,364,000
福山通運	163,000	477	77,751,000
セイノーホールディングス	161,000	730	117,530,000
神奈川中央交通	5,000	525	2,625,000
日立物流	43,400	1,109	48,130,600
日本郵船	1,113,000	359	399,567,000
商船三井	1,091,000	560	610,960,000
川崎汽船	495,000	370	183,150,000
新和海運	83,000	256	21,248,000
乾汽船	24,700	716	17,685,200
明治海運	18,700	466	8,714,200
飯野海運	100,600	445	44,767,000
太平洋海運	41,000	87	3,567,000
共栄タンカー	18,000	219	3,942,000
第一中央汽船	136,000	231	31,416,000
全日本空輸	2,775,000	244	677,100,000
日本航空	3,003,000	133	399,399,000
パスコ	25,000	164	4,100,000
国際航業HLDGS	12,000	287	3,444,000
三菱倉庫	148,000	1,000	148,000,000
三井倉庫	91,000	312	28,392,000

住友倉庫	165,000	407	67,155,000
渋沢倉庫	65,000	323	20,995,000
ヤマタネ	109,000	139	15,151,000
東陽倉庫	30,000	191	5,730,000
日本トランスシティ	44,000	309	13,596,000
ケイヒン	45,000	115	5,175,000
安田倉庫	15,900	658	10,462,200
東洋埠頭	64,000	167	10,688,000
宇徳	16,800	255	4,284,000
上組	248,000	693	171,864,000
サンリツ	1,700	588	999,600
キムラユニティー	4,300	747	3,212,100
キューソー流通システム	6,900	984	6,789,600
郵船航空サービス	16,400	1,103	18,089,200
近鉄エクスプレス	18,600	1,952	36,307,200
東海運	11,400	233	2,656,200
バンテック	95	122,100	11,599,500
東京放送HD	123,000	1,364	167,772,000
日本テレビ放送網	19,660	12,590	247,519,400
テレビ朝日	521	148,700	77,472,700
テレビ東京	8,100	2,395	19,399,500
スカパーJ S A T H D	1,564	41,000	64,124,000
アイ・ティー・シーネットワーク	47	193,800	9,108,600
イー・アクセス	936	63,800	59,716,800
N E Cモバイリング	7,500	2,250	16,875,000
日本電信電話	944,400	3,830	3,617,052,000
K D D I	3,188	485,000	1,546,180,000
光通信	26,300	1,780	46,814,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,885	134,100	2,666,578,500
インボイス	11,286	1,499	16,917,714
G M Oインターネット	58,400	382	22,308,800
学研ホールディングス	69,000	256	17,664,000
ゼンリン	29,700	1,238	36,768,600
昭文社	11,800	621	7,327,800
角川グループH L D G S	17,700	2,045	36,196,500
インプレスホールディングス	16,100	231	3,719,100
東京電力	1,311,700	2,245	2,944,766,500
中部電力	705,100	2,060	1,452,506,000
関西電力	864,100	2,000	1,728,200,000
中国電力	311,900	1,882	586,995,800
北陸電力	213,700	2,100	448,770,000
東北電力	520,100	1,897	986,629,700



四国電力	215,500	2,605	561,377,500	
九州電力	459,700	1,881	864,695,700	
北海道電力	195,000	1,754	342,030,000	
沖縄電力	14,800	5,060	74,888,000	
電源開発	150,700	2,685	404,629,500	
東京瓦斯	2,635,000	362	953,870,000	
大阪瓦斯	2,233,000	299	667,667,000	
東邦瓦斯	543,000	420	228,060,000	
北海道瓦斯	35,000	240	8,400,000	
西部瓦斯	239,000	249	59,511,000	
静岡瓦斯	59,000	638	37,642,000	
アイネット	8,400	488	4,099,200	
松竹	114,000	764	87,096,000	
東宝	146,800	1,412	207,281,600	
エイチ・アイ・エス	19,900	1,849	36,795,100	
東映	86,000	476	40,936,000	
葵プロモーション	7,500	463	3,472,500	
ベンチャーリンク	84,000	16	1,344,000	
NTTデータ	1,269	267,000	338,823,000	
共立メンテナンス	9,100	1,460	13,286,000	
イチネンホールディングス	21,800	362	7,891,600	
建設技術研究所	11,900	530	6,307,000	
燦ホールディングス	5,400	1,627	8,785,800	
スバル興業	3,000	273	819,000	
東京テアトル	81,000	165	13,365,000	
吉本興業	32,700	1,343	43,916,100	
ホリプロ	8,000	791	6,328,000	
よみうりランド	50,000	312	15,600,000	
東京都競馬	150,000	147	22,050,000	
常磐興産	78,000	154	12,012,000	
カナモト	27,000	405	10,935,000	
東京ドーム	162,000	278	45,036,000	
D T S	19,700	885	17,434,500	
スクウェア・エニックス・HD	52,100	2,290	119,309,000	
シーイーシー	12,800	549	7,027,200	
カプコン	43,600	1,620	70,632,000	
東海観光	81,000	29	2,349,000	
日本空港ビルデング	49,500	1,274	63,063,000	
トランス・コスモス	28,200	910	25,662,000	
乃村工藝社	44,000	255	11,220,000	
ジャステック	13,400	554	7,423,600	
住商情報システム	21,100	1,390	29,329,000	

藤田観光	56,000	359	20,104,000
近畿日本ツーリスト	71,000	84	5,964,000
日本管財	8,000	1,599	12,792,000
白 洋 舎	5,000	265	1,325,000
セコム	211,100	4,250	897,175,000
C S Kホールディングス	61,900	421	26,059,900
日本システムウエア	3,400	305	1,037,000
セントラル警備保障	10,300	894	9,208,200
アイネス	24,900	709	17,654,100
丹青社	5,000	215	1,075,000
メイテック	36,300	1,487	53,978,100
T K C	20,100	1,786	35,898,600
アサツー ディ・ケイ	38,000	1,902	72,276,000
富士ソフト	25,400	1,543	39,192,200
ソラン	21,500	462	9,933,000
応用地質	23,200	879	20,392,800
船井総合研究所	22,700	515	11,690,500
日システム	36,400	895	32,578,000
進学会	11,500	308	3,542,000
丸紅建材リース	17,000	131	2,227,000
コナミ	92,800	1,695	157,296,000
ベネッセホールディングス	75,600	3,910	295,596,000
イオンディライト	16,000	1,264	20,224,000
ナック	6,400	866	5,542,400
福井コンピュータ	1,500	289	433,500
ニチイ学館	51,900	954	49,512,600
ダイセキ	32,100	1,965	63,076,500
元気寿司	7,400	1,187	8,783,800
トラスコ中山	23,900	1,465	35,013,500
ヤマダ電機	99,780	5,600	558,768,000
オートバックスセブン	31,500	3,090	97,335,000
アークランドサカモト	14,800	1,143	16,916,400
ニ ト リ	44,350	7,490	332,181,500
グルメ杵屋	1,000	619	619,000
愛 眼	17,100	541	9,251,100
吉野家ホールディングス	473	105,900	50,090,700
加藤産業	29,900	1,494	44,670,600
イエローハット	20,900	852	17,806,800
富士エレクトロニクス	12,100	791	9,571,100
松屋フーズ	10,500	1,282	13,461,000
J B C Cホールディングス	16,400	608	9,971,200
J Kホールディングス	18,500	390	7,215,000

ユニダックス	6,000	413	2,478,000	
サガミチェーン	22,000	747	16,434,000	
日伝	8,700	2,660	23,142,000	
北沢産業	11,000	197	2,167,000	
杉本商事	11,900	882	10,495,800	
因幡電機産業	19,800	2,190	43,362,000	
住金物産	108,000	196	21,168,000	
プレナス	26,000	1,310	34,060,000	
ミニストップ	15,500	1,346	20,863,000	
イマージュホールディングス	6,700	220	1,474,000	
アークス	24,400	1,381	33,696,400	
バロー	41,100	778	31,975,800	
ミスミグループ本社	69,000	1,720	118,680,000	
江守商事	5,200	651	3,385,200	
アルテック	10,100	185	1,868,500	
ベルク	9,700	836	8,109,200	
大庄	12,800	1,148	14,694,400	
タキヒヨー	37,000	445	16,465,000	
ファーストリテイリング	41,100	13,200	542,520,000	
ソフトバンク	839,500	2,035	1,708,382,500	
スズケン	72,900	3,090	225,261,000	
サンドラッグ	39,000	2,280	88,920,000	
ジェコス	16,700	410	6,847,000	
ヤマザワ	6,000	1,300	7,800,000	
やまや	4,100	795	3,259,500	
ベルーナ	25,800	400	10,320,000	
合計	303,546,287		241,939,750,438	

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	証券数	評価額（円）	備考
新株予約権証券	DOWAホールディングス新株予約権	59,000	1,711,000	
合計		59,000	1,711,000	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#)



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成21年11月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	513,303,024円
負債総額	183,858円
純資産総額（ - ）	513,119,166円
発行済数量	459,758,739口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1161円

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成21年11月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	249,398,298,061円
負債総額	1,713,656,840円
純資産総額（ - ）	247,684,641,221円
発行済数量	221,681,722,446口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1173円

## 第5【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	360,818,552	5,842,198

(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。

## 第四部【特別情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

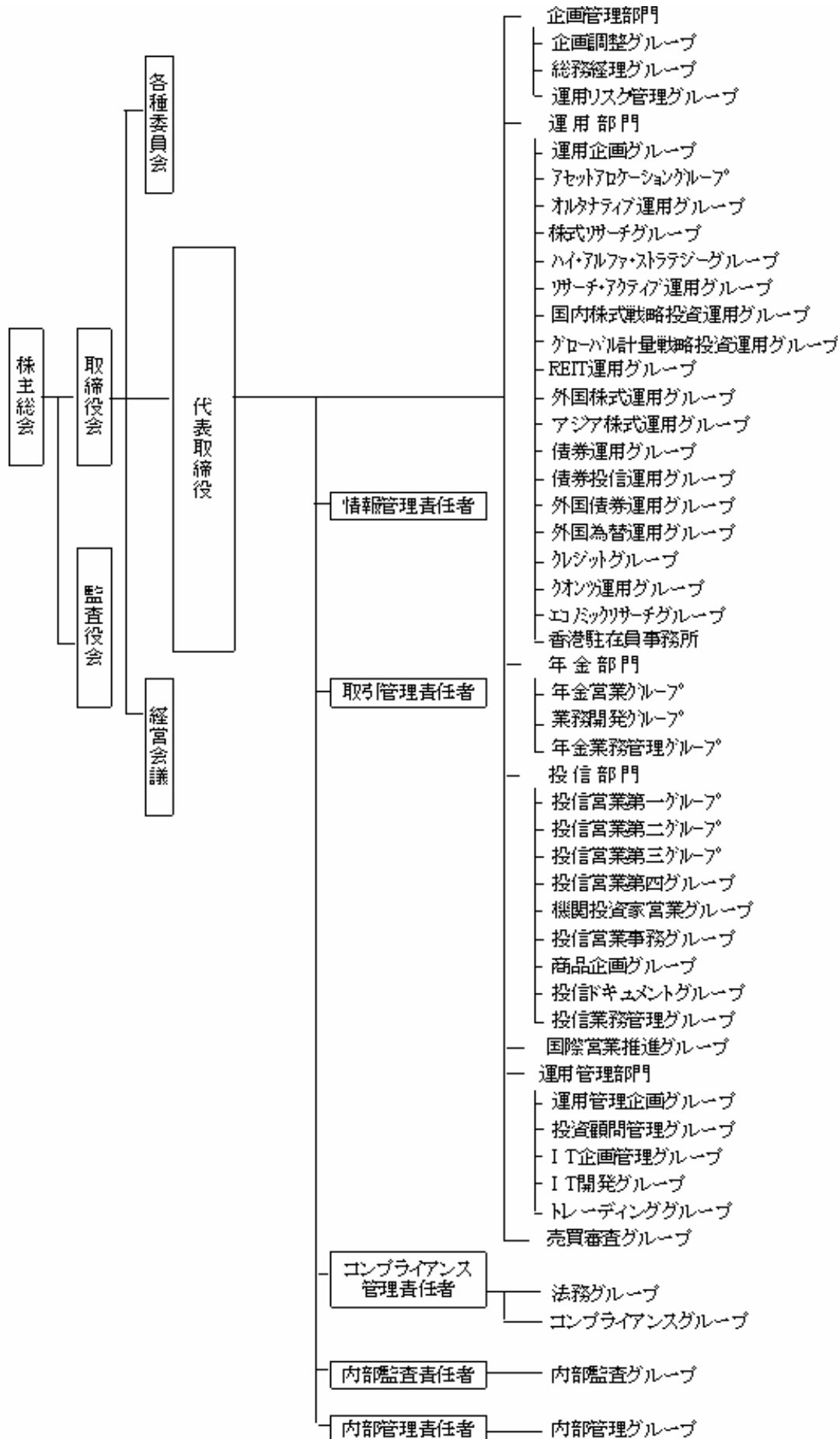
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

##### 直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成21年10月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 会社の意思決定機構

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

取締役会は、代表取締役を選任し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長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、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決します。

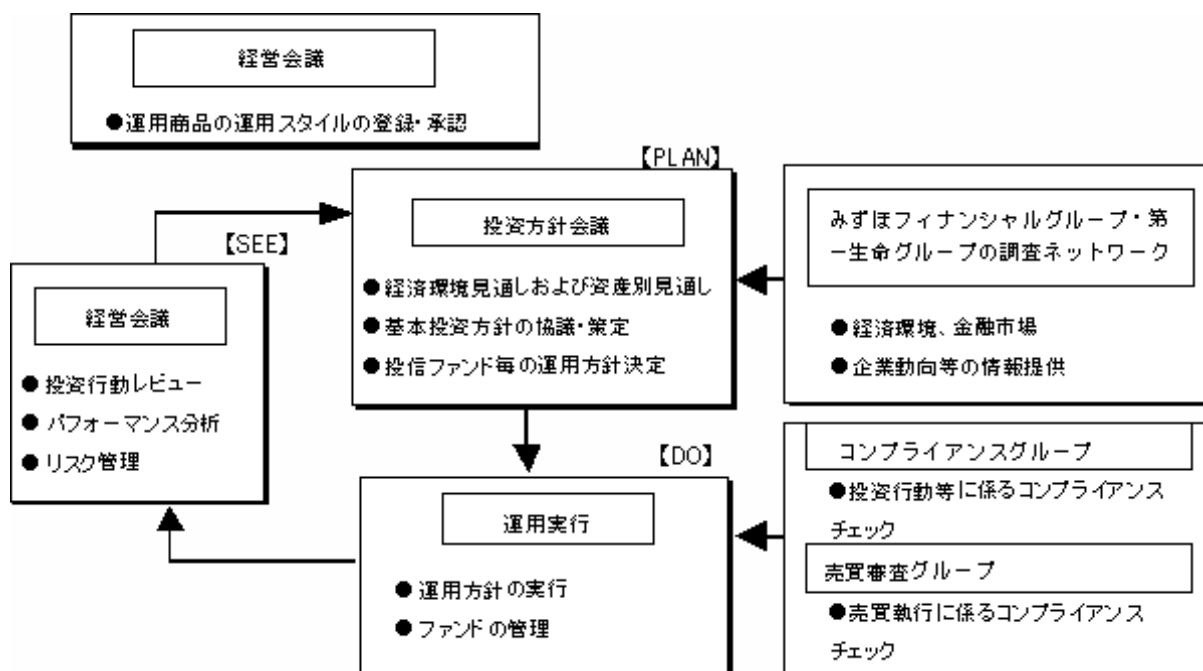
## 投資運用の意思決定機構

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

ファンド全般に係る経済環境見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回の経営会議において、検討・評価されます。



上記体制は平成21年10月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成21年10月30日現在、委託会社の運用する投資信託は262本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	19	107,445,051,535
追加型株式投資信託	228	3,829,006,127,029
単位型公社債投資信託	14	120,567,013,031
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	1,746,219,601
合計	262	4,058,764,411,196

### 3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）または「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成20年8月7日内閣府令第50号）附則第2条により改正前の財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第23期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）の財務諸表について、新日本監査法人の監査を受け、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21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ております。

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第23期 (平成20年3月31日現在)		第24期 (平成21年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金・預金		13,267,152		12,558,999
前払費用		64,301		54,242
未収委託者報酬		3,423,783		2,254,741
未収運用受託報酬		-		1,046,291
未収投資助言報酬		-	2	252,337
未収収益	2	1,933,135		197,045
未収消費税等		-		98,402
繰延税金資産		553,910		369,826
その他		43,115		23,865
流動資産計		19,285,400		16,855,752
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	335,163	1	283,511
器具備品	1	153,323	1	201,169
建設仮勘定		-		16,799
無形固定資産				
商標権	1	2,104	1	1,335
ソフトウェア	1	606,677	1	555,121
ソフトウェア仮勘定		-		157,595
電話加入権		7,148		7,148
電話施設利用権	1	691	1	611
投資その他の資産				
投資有価証券		5,842,772		4,051,090
関係会社株式		3,097,362		498,041
繰延税金資産		1,261,144		1,661,144
長期差入保証金		233,849		442,390
長期差入保証金		1,194,310		1,169,961
その他		83,032		306,478
貸倒引当金		26,925		26,925
固定資産計		6,947,880		5,274,384
資産合計		26,233,280		22,130,137

（単位：千円）

	第23期 （平成20年3月31日現在）	第24期 （平成21年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	162,809	37,445
未払金	2,186,170	1,293,636
未払収益分配金	8,470	8,201
未払償還金	50,930	48,993
未払手数料	1,527,000	931,529
その他未払金	599,769	304,912
未払費用	2 1,653,424	2 1,040,620
未払法人税等	2,575,999	179,557
未払消費税等	316,821	-
賞与引当金	687,832	618,303
その他	-	20,741
流動負債計	7,583,058	3,190,304
固定負債		
役員退職慰労引当金	179,237	145,732
退職給付引当金	334,280	404,437
固定負債計	513,518	550,169
負債合計	8,096,577	3,740,474
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	13,718,238	13,962,732
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	7,040,000	10,040,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	6,054,944	3,299,438
株主資本合計	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	10,012	1,547
評価・換算差額等合計	10,012	1,547
純資産合計	18,136,703	18,389,662
負債・純資産合計	26,233,280	22,130,137

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	32,833,957		24,552,133	
顧問料	6,804,888		-	
運用受託報酬	-		4,509,994	
投資助言報酬	-		1,228,096	
その他営業収益	863,734		697,007	
営業収益計		40,502,581		30,987,232
営業費用				
支払手数料	14,748,737		10,967,681	
広告宣伝費	830,858		488,151	
公告費	3,293		-	
受益証券発行費	2,167		-	
調査費	6,268,709		5,076,631	
調査費	2,415,829		2,506,175	
委託調査費	3,852,880		2,570,455	
委託計算費	345,695		325,174	
営業雑経費	1,143,457		812,013	
通信費	33,290		35,872	
印刷費	1,041,499		732,985	
協会費	22,173		25,313	
諸会費	41		41	
支払販売手数料	46,452		17,800	
営業費用計		23,342,919		17,669,652
一般管理費				
給料	4,082,147		4,587,983	
役員報酬	1 223,147		1 234,353	
給料・手当	3,258,097		3,647,502	
賞与	600,902		706,127	
交際費	44,264		44,085	
寄付金	4,010		4,462	
旅費交通費	309,129		308,237	
租税公課	103,549		82,762	
不動産賃借料	754,728		801,086	
退職給付費用	88,449		106,223	
固定資産減価償却費	337,808		330,412	
福利厚生費	23,757		22,556	
修繕費	16,394		6,755	
賞与引当金繰入	687,832		618,303	
役員退職慰労引当金繰入	60,123		42,570	
役員退職金	528		13,175	
機器リース料	1,207		973	
事務委託費	279,797		247,087	
消耗品費	76,448		84,099	
器具備品費	10,563		6,094	
諸経費	204,099		177,386	
一般管理費計		7,084,837		7,484,253
営業利益		10,074,823		5,833,325

（単位：千円）

	第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）		第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		92,575		4,558
受取利息		59,127		59,458
時効成立分配金		298		164
為替差益		14,223		-
雑収入		7,064		5,482
先物利益		-		180,422
営業外収益計		173,289		250,086
営業外費用				
為替差損		-		24,553
時効成立後支払分配金		557		517
投資信託解約損		109,677		38,254
営業外費用計		110,234		63,325
経常利益		10,137,878		6,020,086
特別利益				
関係会社株式売却益		39,215		-
貸倒引当金戻入益		123		-
特別利益計		39,338		-
特別損失				
固定資産除却損	2	10,466	2	14,476
ゴルフ会員権売却損		5,200		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,000
投資有価証券評価損		-		484,009
退職給付費用		106,395		-
特別損失計		122,062		504,485
税引前当期純利益		10,055,154		5,515,600
法人税、住民税及び事業税		4,252,414		2,301,373
法人税等調整額		172,622		30,266
法人税等合計		4,079,792		2,271,106
当期純利益		5,975,362		3,244,494

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	前期末残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	前期末残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	前期末残高	4,640,000	7,040,000
	当期変動額	2,400,000	3,000,000
	当期末残高	7,040,000	10,040,000
	研究開発積立金		
	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	前期末残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	前期末残高	4,843,582	6,054,944
	当期変動額		
	剰余金の配当	2,364,000	3,000,000
	別途積立金の積立	2,400,000	3,000,000
	当期純利益	5,975,362	3,244,494
	当期末残高	6,054,944	3,299,438
	株主資本合計		
	前期末残高	14,535,353	18,146,716
	当期変動額	3,611,362	244,494
	当期末残高	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	992	10,012
	当期変動額(純額)	11,004	8,464
	当期末残高	10,012	1,547
純資産合計			
	前期末残高	14,536,346	18,136,703
	当期変動額	3,600,357	252,958
	当期末残高	18,136,703	18,389,662

[次へ](#)

## 重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正法人税法に規定する方法により減価償却費を計上しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(追加情報) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年3月31日以前に取得した有形固定資産については、償却可能限度額まで償却が終了した翌事業年度から、残存簿価を5年間で均等償却しております。 なお、これにより営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>(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。</p> <p>(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</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p>



<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更)</p> <p>従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用していましたが、当事業年度末から原則法に変更いたしました。</p> <p>この変更は、従業員数の増加に伴い、退職給付債務の数理計算に用いられる基礎率の推定について一定の有効性が確保されることによって、原則法による計算の結果に一定の高い水準の信頼性が得られたことから、退職給付費用の期間損益計算をより適正化するために行ったものであります。</p> <p>この変更に伴い、当事業年度末における簡便法と原則法により計算した退職給付債務の差額106,395千円を特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法によった場合と比較して、税引前当期純利益は106,395千円減少しております。</p> <p>なお、上記に記載の通り退職給付債務の算定方法の変更が当事業年度末に行われたため、当中間会計期間は従来の方法によっております。したがって、当中間会計期間は、当事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>税抜方式によっております。</p>	<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>(3) 同左</p> <p>(4) 同左</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>同左</p>

## 会計方針の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>

## 表示方法の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
<p>金融商品取引業等に関する内閣府令が制定されたことに伴い、以下のとおり表示方法を変更しております。</p> <p>（貸借対照表） 前事業年度において区分掲記していた「現金」および「預金」は、当事業年度から「現金・預金」として表示しております。なお、当事業年度末における「現金」および「預金」の金額はそれぞれ1,205千円、13,265,946千円であります。</p> <p>（損益計算書） 前事業年度において区分掲記していた「法人税等」は当事業年度から「法人税、住民税及び事業税」として表示しております。</p>	<p>（貸借対照表）</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>前事業年度において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当事業年度から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。</li> <li>前事業年度において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。</li> </ol> <p>（損益計算書） 前事業年度において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。</p>

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第23期（平成20年3月31日現在）			第24期（平成21年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物	373,021千円		建物	426,679千円	
器具備品	229,532千円		器具備品	290,397千円	
商標権	5,582千円		商標権	6,351千円	
ソフトウェア	653,371千円		ソフトウェア	648,713千円	
電話施設利用権	905千円		電話施設利用権	985千円	
2. 関係会社項目 関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			2. 関係会社項目 関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収収益	379,257千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円
流動負債	未払費用	641,087千円	流動負債	未払費用	345,744千円

## （損益計算書関係）

第23期 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	第24期 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
1. 役員報酬の限度額	1. 役員報酬の限度額
取締役 年額250,000千円	同左
監査役 年額 50,000千円	
2. 固定資産除却損の内訳	2. 固定資産除却損の内訳
建物 3,634千円	建物 2,251千円
器具備品 5,271千円	器具備品 9,818千円
ソフトウェア 1,560千円	ソフトウェア 2,406千円

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

## （2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

## 第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

## (リース取引関係)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)				第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)			
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額相当額	29,608千円	-	29,608千円	減価償却累計額相当額	52,335千円	-	52,335千円
期末残高相当額	60,993千円	-	60,993千円	期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	22,595千円	39,602千円	62,197千円	未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額			
支払リース料		25,173千円		支払リース料		24,096千円	
減価償却費相当額		20,191千円		減価償却費相当額		22,727千円	
支払利息相当額		1,754千円		支払利息相当額		1,501千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2.オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2.オペレーティング・リース取引 同左			

（有価証券関係）

## 第23期（平成20年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 4. その他有価証券で時価のあるもの

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

## 7. 時価のない主な有価証券の内容

## 貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 83,246千円

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

該当事項はありません。

## 第24期（平成21年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	146,101	146,101	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	271,802	269,192	2,610
小計	417,904	415,294	2,610
合計	417,904	415,294	2,610

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
3,021,000	20,615	58,869

## 7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 82,746千円

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

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

## 第23期（平成20年3月31日現在）

## 1．取引の状況に関する事項

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 2．取引の時価等に関する事項

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

## （注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。



## 第24期（平成21年3月31日現在）

## 1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引及び株価指数先物取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスク及び株価変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 2. 取引の時価等に関する事項

## (1) 通貨関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	24,432	-	24,960	528
	香港ドル	34,020	-	34,412	392
	豪ドル	77,510	-	78,736	1,226
	シンガポールドル	12,564	-	12,672	107
	合計	148,527	-	150,782	2,255

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (2) 株式関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	212,667	-	230,215	17,547
	合計	212,667	-	230,215	17,547

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## （退職給付関係）

## 第23期（平成20年3月31日現在）

## 1．採用している退職給付制度の概要

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

## 2．退職給付債務に関する事項

当社は、当事業年度末から原則法を適用しております。

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

## 3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## 第24期（平成21年3月31日現在）

## 1．採用している退職給付制度の概要

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

## 2．退職給付債務に関する事項

当社は、原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成21年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		431,448
	未認識数理計算上の差異		27,011
	退職給付引当金		404,437
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		71,958
	確定拠出年金	拠出額	34,264
	退職給付費用		106,223

## 3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

		第24期 (平成21年3月31日)
(1)	割引率(%)	1.5
(2)	退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3)	数理計算上の差異の処理年数(年)	5

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	197,866	19,218
未払事業所税	5,714	6,269
賞与引当金	279,947	251,649
未払法定福利費	27,884	27,146
未払確定拠出年金掛金	2,610	2,667
減価償却超過額	-	7,579
減価償却超過額（一括償却資産）	10,139	8,559
繰延資産償却超過額（税法上）	27,940	46,274
その他（未払金等）	1,807	461
退職給付引当金	136,052	164,605
役員退職慰労引当金	72,949	59,313
ゴルフ会員権評価損	3,135	5,577
投資有価証券評価損	-	196,991
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	6,871	1,062
繰延税金資産合計	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	<u>-</u>	<u>-</u>
差引繰延税金資産の純額	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>

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

第23期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第24期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（関連当事者との取引）

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

## (1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名， 出向3名， 転籍2名	資産の運用および 助言、当社 設定投信の 販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	833,702	未収 収益	219,740
								販売手数料 の支払	46,452	-	-
								保険料の支 払	5,707	-	-

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注2）支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	（所有）直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	1,096,514	未払費用	456,913
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	（所有）直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	466,450	未払費用	184,052

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を助案した個別契約により決定しております。
- （注2）上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
兄弟会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	2,104,660	未払手数料	145,839
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	10,709億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	739,368	未払手数料	137,112
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	-	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払 業務委託料の支払	340,983 16,800	未払費用 -	- -

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## 第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

## （追加情報）

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

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

## (1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名， 出向3名， 転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投資の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	718,870	未収投資助言報酬	172,117
								販売手数料の支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注2) 支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	933,784	未払費用	236,518
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	324,748	未払費用	109,093

## 取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
兄弟会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,531,236	未払手数料	96,917
								預金の引出(純額)	300,370	現金・預金	322,365
								受取利息	894	未収収益	-
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	10,709億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	701,162	未払手数料	91,628
								預金の引出(純額)	1,034,219	現金・預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収収益	4,158
みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	-	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	299,054	未払費用	117,438	
							業務委託料の支払	17,550	未払費用	2,677	

## 取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

## （1株当たり情報）

第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）
1株当たり純資産額 755,695円99銭 1株当たり当期純利益金額 248,973円42銭  なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25銭  なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）
当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

## （重要な後発事象）

第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）
平成20年3月28日開催の取締役会の決議により、平成20年4月1日付にて100%出資の子会社DIAM SINGAPORE PTE.LTD.を設立し、その後、平成20年4月14日付にて株主割当増資を実施いたしました。 （出資の総額400,000千円、資本金400,000千円）	平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management (HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。 当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。  <子会社の概要> 商 号：DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容：資産運用業務 設 立 年 月 日：平成21年3月19日 資 本 金：500,000千円 発行済株式総数：500,000株 出 資 の 総 額：500,000千円 出 資 比 率：当社100%

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更  
当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

- a. 名称  
みずほ信託銀行株式会社
- b. 資本金の額  
平成21年3月末日現在 247,231百万円
- c. 事業の内容  
日本において信託銀行業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

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

(平成21年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。



## 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、収益分配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【その他】

- (1) 交付目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載するほか、届出書本文第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」の主要内容を要約し、「ファンドの概要」として、冒頭に記載します。また、目論見書の表紙裏に金融商品の販売等に関する法律に係る重要事項を記載することがあります。
- (2) 交付目論見書の巻末に用語説明を掲載します。  
なお、交付目論見書の巻末に信託約款を掲載し、届出書本文第二部「ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」の詳細な内容については、当該約款を参照することで、届出書の内容の記載とすることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成21年11月11日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式パッシブ・ファンドの平成21年1月30日から平成21年10月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M国内株式パッシブ・ファンドの平成21年10月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成21年6月29日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山本禎良 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山内正彦 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成20年6月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印  
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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