

【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25年1月11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」または「当ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（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/>

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

- ・ 計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：パ国内株）

(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25年1月12日から平成26年1月15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/>

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、買付代金を販売会社に支払うものとします。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經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

(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/>

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

(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。

当ファンドは契約型の追加型株式投資信託に属します。

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

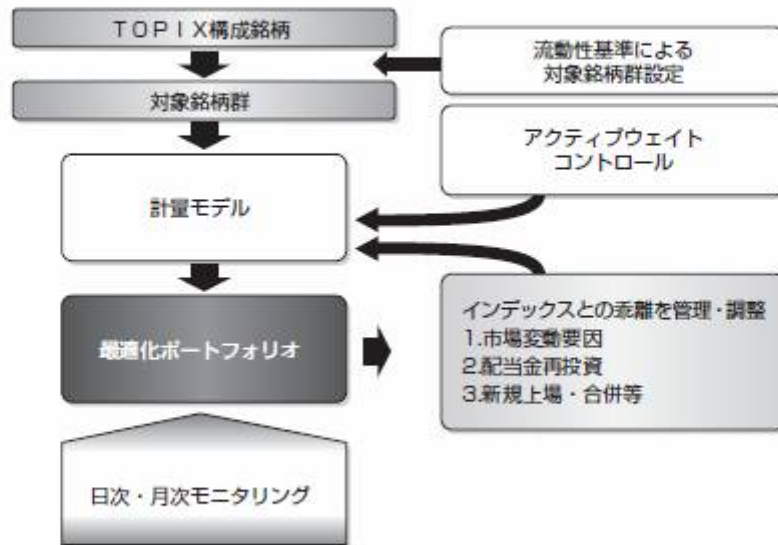
- ① 主に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」に投資を行い、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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、東京証券取引所第1部に上場されている全ての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」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㈱東京証券取引所が有しています。

㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、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、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。㈱東京証券取引所は、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。㈱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、㈱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。

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



- ③ 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。
 ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
 ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

補足分類

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、以下の方法でご確認ください。

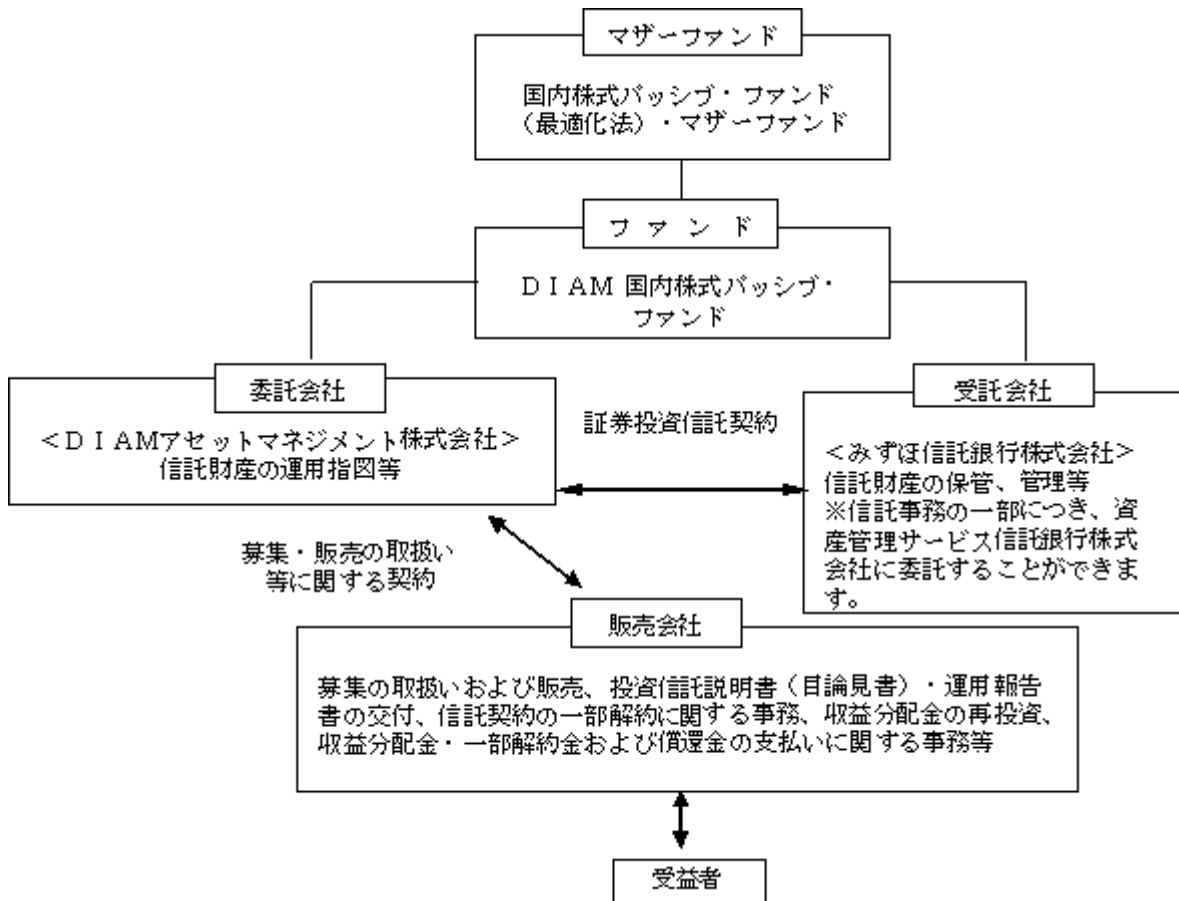
・投資信託協会への照会

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

(2)【ファンドの沿革】

平成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

(3)【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

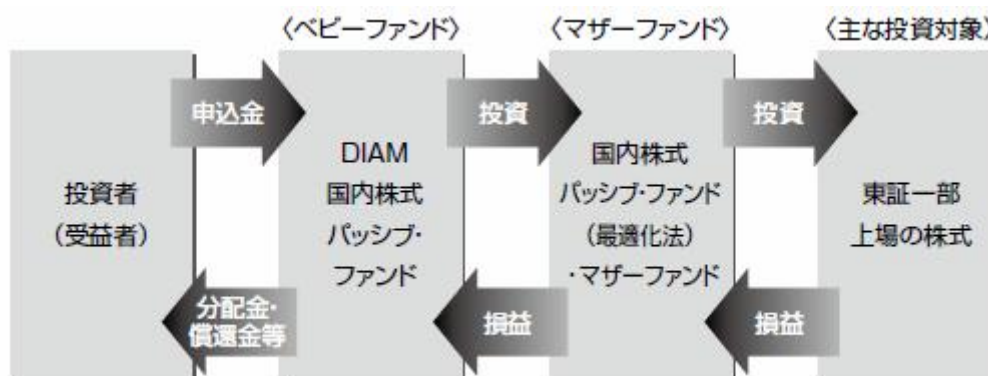
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

・「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。

ファミリーファンド方式とは

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成24年10月31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24年10月31日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、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。

<投資対象>

この投資信託は、「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ます。

< 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】

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。

1. 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、)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

1．株券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、1.~12.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22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.ならびに18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

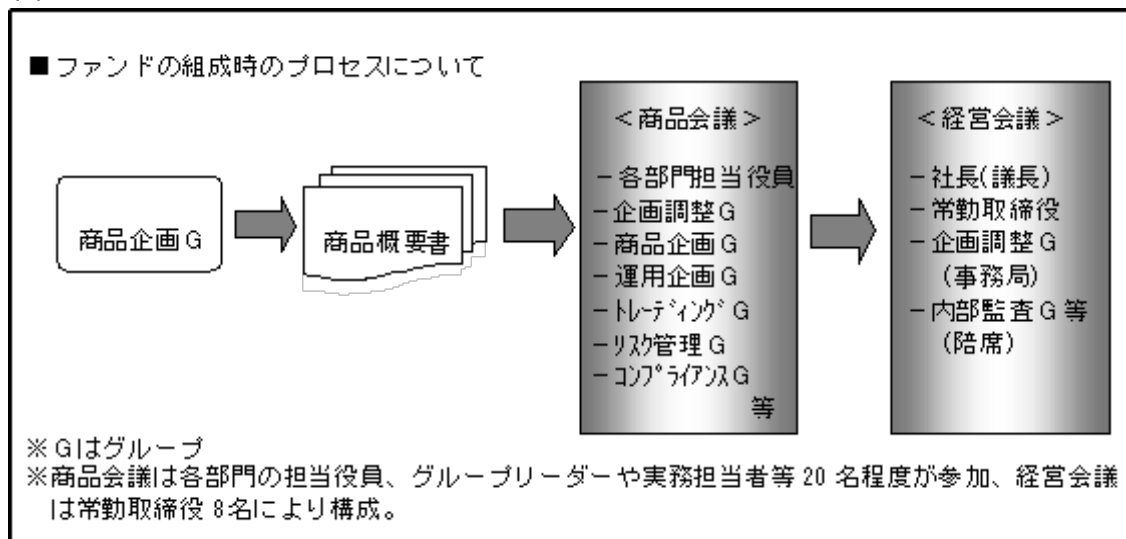
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

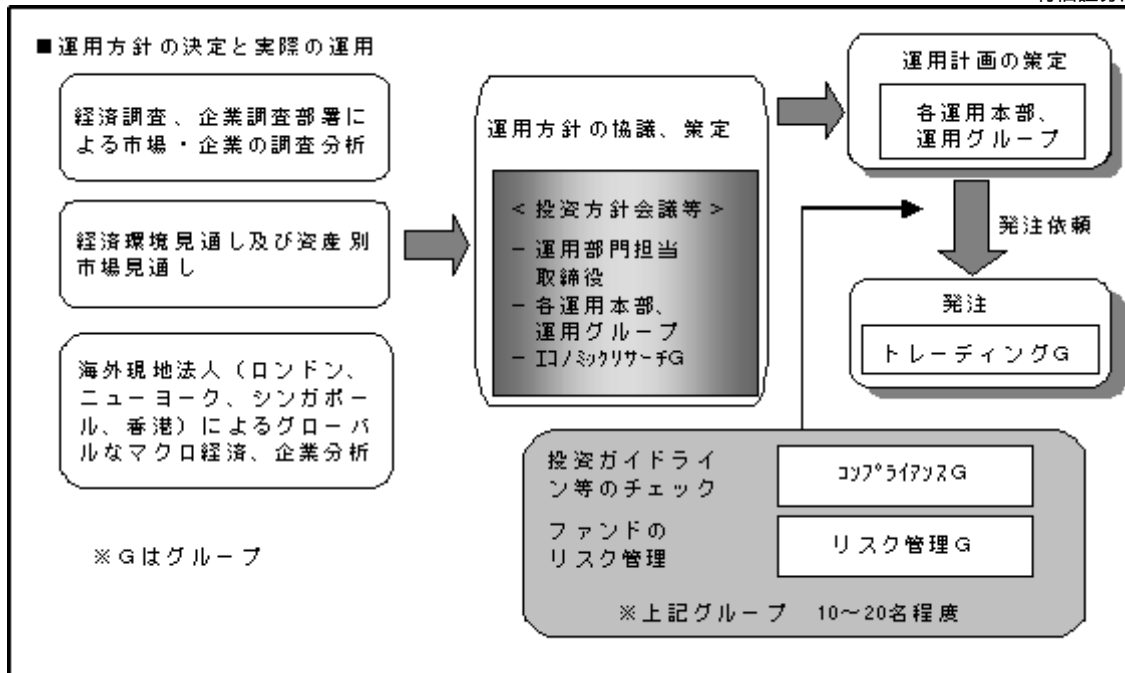
（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 6. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、有価証券先物取引等を行うことがあります。
主な投資制限	1. 株式への投資割合には、制限を設けません。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】





運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

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

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。

なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等から得られた情報も参考にされます。

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

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

上記体制は平成24年10月31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) 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に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ます。）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。

「分配金自動引き落とし投資コース」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. 上記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. 上記a.の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.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(5.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1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a. 1)～2)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 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き等により影響を受けますが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(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。当ファンドは実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

(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。

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

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

<その他の留意点>

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、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およぼす場合があります。

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

資金動向、市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。

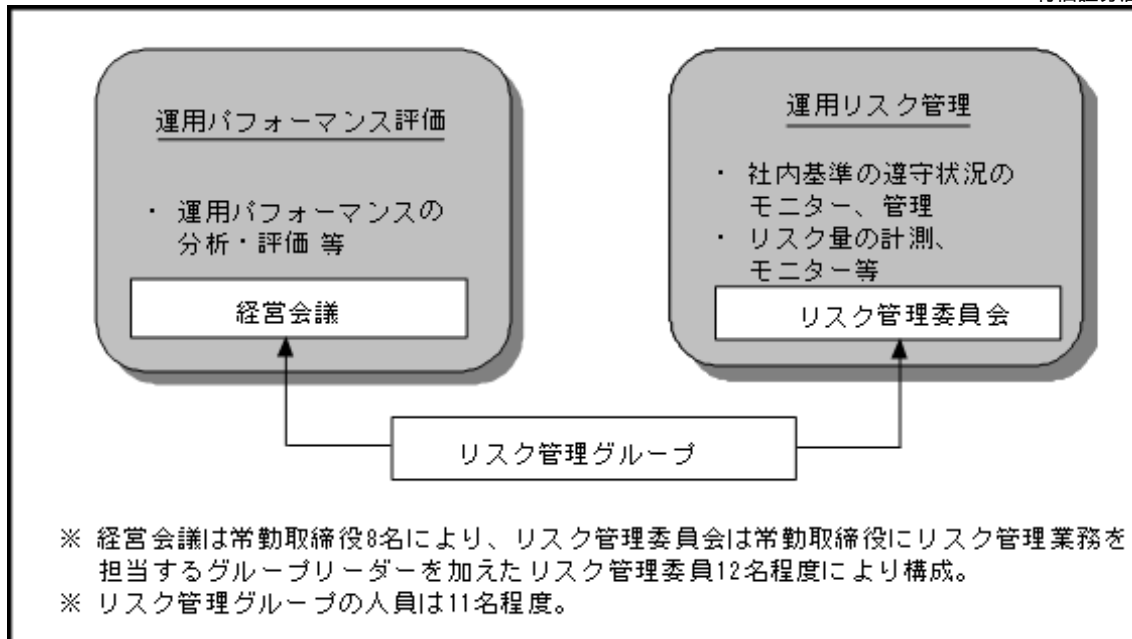
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができます。

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

<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

上記体制は平成24年10月31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%）

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、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ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

上記10.147%の税率は平成26年1月1日以降、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

平成25年12月31日までの間は、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）の税率での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、10.147%の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

上記10.147%の税率は平成26年1月1日以降、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）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

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得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25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

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

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。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成25年1月1日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動引き落とし投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権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。

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成24年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,223,002,926	100.03
内 日本	1,223,002,926	100.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	402,999	0.03
純資産総額	1,222,599,927	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成24年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	250,371,761,980	97.15
内 日本	250,371,761,980	97.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,342,050,317	2.85
純資産総額	257,713,812,297	100.00

その他資産の投資状況

平成24年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,402,590,000	2.87
内 日本	7,402,590,000	2.87

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成24年10月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ ファンド（最適化 法）・マザーファン ド 日本	親投資信 託受益証 券	1,207,069,608	0.9805 1,183,534,668	1.0132 1,223,002,926	- -	100.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成24年10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.03%
合計	100.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）マザーファンドの投資資産
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
投資有価証券の主要銘柄

平成24年10月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	3,146,500	3,000.38 9,440,698,660	3,065.00 9,644,022,500	- -	3.74%
2	三菱UFJフィナン シャルG 日本	株式 銀行業	18,303,500	377.47 6,909,193,119	361.00 6,607,563,500	- -	2.56%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	2,066,300	2,744.47 5,670,908,165	2,390.00 4,938,457,000	- -	1.92%
4	三井住友フィナン シャルG 日本	株式 銀行業	1,828,000	2,528.10 4,621,382,864	2,444.00 4,467,632,000	- -	1.73%
5	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,521,400	3,362.57 5,115,817,185	2,578.00 3,922,169,200	- -	1.52%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	31,098,500	121.06 3,764,919,246	125.00 3,887,312,500	- -	1.51%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,017,700	3,757.56 3,824,075,157	3,635.00 3,699,339,500	- -	1.44%
8	武田薬品 日本	株式 医薬品	960,900	3,355.63 3,224,431,990	3,710.00 3,564,939,000	- -	1.38%
9	ファナック 日本	株式 電気機器	255,000	13,001.45 3,315,370,866	12,710.00 3,241,050,000	- -	1.26%
10	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,101,700	2,209.03 2,433,696,936	2,527.00 2,783,995,900	- -	1.08%
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,886,200	1,741.22 3,284,292,362	1,425.00 2,687,835,000	- -	1.04%
12	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,216,700	2,055.80 2,501,292,036	2,206.00 2,684,040,200	- -	1.04%
13	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,692,000	1,275.65 2,158,416,640	1,579.00 2,671,668,000	- -	1.04%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	456,200	4,949.91 2,258,150,088	5,480.00 2,499,976,000	- -	0.97%
15	セブン&アイ・HL DGS 日本	株式 小売業	1,011,100	2,193.96 2,218,315,868	2,462.00 2,489,328,200	- -	0.97%
16	日立 日本	株式 電気機器	5,731,000	433.31 2,483,306,780	423.00 2,424,213,000	- -	0.94%
17	三井物産 日本	株式 卸売業	2,086,600	1,301.10 2,714,891,262	1,125.00 2,347,425,000	- -	0.91%
18	エヌ・ティ・ティ・ ドコモ 日本	株式 情報・通信業	19,917	136,264.94 2,713,988,924	117,300.00 2,336,264,100	- -	0.91%
19	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	569,400	3,234.96 1,841,987,742	3,965.00 2,257,671,000	- -	0.88%
20	KDDI 日本	株式 情報・通信業	341,000	4,834.72 1,648,639,762	6,200.00 2,114,200,000	- -	0.82%
21	信越化学 日本	株式 化学	460,000	4,160.63 1,913,890,233	4,500.00 2,070,000,000	- -	0.80%

22	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	3,094,000	756.85 2,341,703,299	668.00 2,066,792,000	- -	0.80%
23	小松製作所 日本	株式 機械	1,196,100	2,162.94 2,587,094,221	1,672.00 1,999,879,200	- -	0.78%
24	東京海上HD 日本	株式 保険業	936,200	2,000.46 1,872,837,592	2,113.00 1,978,190,600	- -	0.77%
25	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	10,840,000	190.00 2,059,672,953	176.00 1,907,840,000	- -	0.74%
26	三井不動産 日本	株式 不動産業	1,140,000	1,322.61 1,507,785,400	1,613.00 1,838,820,000	- -	0.71%
27	住友商事 日本	株式 卸売業	1,426,800	1,143.19 1,631,106,370	1,088.00 1,552,358,400	- -	0.60%
28	伊藤忠 日本	株式 卸売業	1,928,600	880.81 1,698,736,497	799.00 1,540,951,400	- -	0.60%
29	花王 日本	株式 化学	680,300	2,020.98 1,374,877,959	2,242.00 1,525,232,600	- -	0.59%
30	国際石油開発帝石 日本	株式 鉱業	3,336	501,080.89 1,671,605,859	455,000.00 1,517,880,000	- -	0.59%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成24年10月31日現在

種類	投資比率
株式	97.15%
合計	97.15%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成24年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.59%
輸送用機器		9.86%
銀行業		9.63%
情報・通信業		6.30%
化学		5.62%
医薬品		5.34%
卸売業		5.27%
機械		4.73%
小売業		4.43%
陸運業		4.34%
食料品		4.08%
不動産業		2.98%
建設業		2.61%
保険業		2.32%
電気・ガス業		2.24%
サービス業		2.13%
鉄鋼		1.52%
その他製品		1.50%
精密機器		1.42%
証券、商品先物取引業		1.09%
非鉄金属		1.05%
その他金融業		0.94%
ガラス・土石製品		0.94%
繊維製品		0.84%

ゴム製品	0.79%
石油・石炭製品	0.76%
金属製品	0.69%
鉱業	0.66%
空運業	0.62%
海運業	0.27%
パルプ・紙	0.26%
倉庫・運輸関連業	0.23%
水産・農林業	0.09%
合計	97.15%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成24年10月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 2412月	買建	999	7,461,355,415	7,402,590,000	2.87%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成24年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成21年10月13日)	408	408	1.1504	1.1504
第2計算期間末 (平成22年10月12日)	974	974	1.0661	1.0661
第3計算期間末 (平成23年10月12日)	1,130	1,130	0.9904	0.9904
第4計算期間末 (平成24年10月12日)	1,188	1,188	0.9615	0.9615
平成23年10月末日	1,134	-	1.0037	-
11月末日	1,056	-	0.9569	-
12月末日	1,033	-	0.9578	-
平成24年1月末日	1,052	-	0.9925	-
2月末日	1,137	-	1.0982	-
3月末日	1,155	-	1.1339	-
4月末日	1,017	-	1.0668	-
5月末日	922	-	0.9542	-
6月末日	1,022	-	1.0217	-
7月末日	1,202	-	0.9763	-
8月末日	1,192	-	0.9699	-
9月末日	1,216	-	0.9871	-
10月末日	1,222	-	0.9932	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	15.0
第2計算期間	7.3
第3計算期間	7.1
第4計算期間	2.9

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

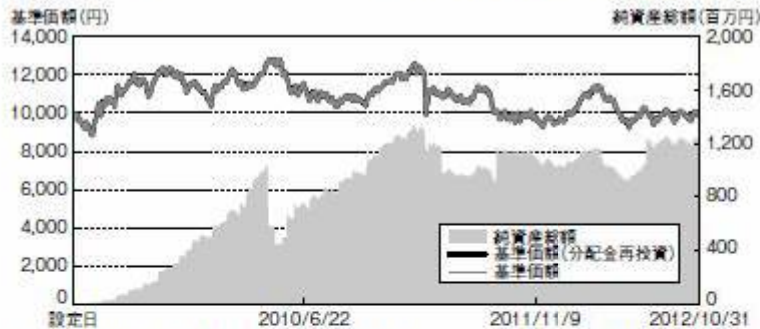
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

<< 参考情報 >>

データの基準日: 2012年10月31日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2009年1月30日)~2012年10月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日: 2009年1月30日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第1期(2009.10.13)	0円
第2期(2010.10.12)	0円
第3期(2011.10.12)	0円
第4期(2012.10.12)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.03%

■国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.15
内 日本	97.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.85
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.87

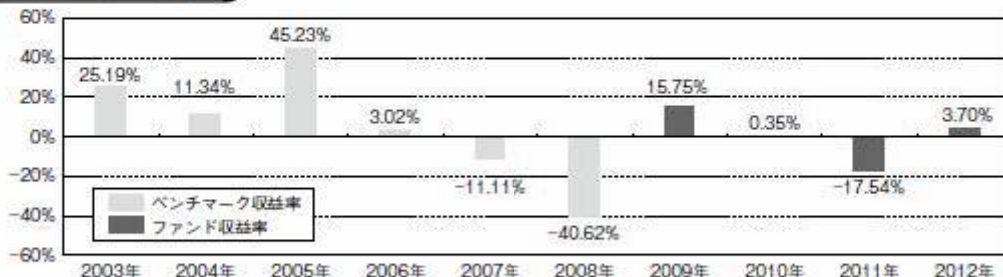
組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.59%
2	輸送用機器	9.86%
3	銀行業	9.63%
4	情報・通信業	6.30%
5	化学	5.62%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.74%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.56%
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.92%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.73%
5	キャノン	株式	日本	電気機器	1.52%
6	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.51%
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.44%
8	武田薬品	株式	日本	医薬品	1.38%
9	ファナック	株式	日本	電気機器	1.26%
10	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.08%

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出してあります。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2009年は設定日から年末までの収益率、および2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※2008年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」です。

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

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	360,818,552	5,842,198
第2計算期間	1,096,784,678	537,244,271
第3計算期間	530,173,605	303,610,533
第4計算期間	330,350,174	235,209,696

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

- ・お申込みに際しては、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。

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1万口当たり換算した基準価額で表示す

ることがあります。)

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・お申込単位

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、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、振替受益権をもって行うものとし、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、

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。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・解約単位

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。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

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

(3)【信託期間】

信託期間は、平成21年1日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．上記a．の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日

のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(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、上記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発送します。
- c. 上記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. 上記b.の書面決議は議決権を行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. 上記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、上記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、下記「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、委託会社は下記「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、上記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、
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあっては、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. 上記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. 上記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. 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. 上記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. 上記a. からf. 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であっても、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、上記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、上記b. に規定する書面に付記します。
- j. 上記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。

平成25年4月1日より、公告の方法は以下の通り変更される予定です。

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

ます。

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

ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告による公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行います。

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、当該信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。(URL <http://www.diam.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

(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3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（平成23年10月13日から平成24年10月12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3期 平成23年10月12日現在	第4期 平成24年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,631,600	4,797,333
親投資信託受益証券	1,129,940,481	1,188,066,601
未収入金	2,500,000	-
流動資産合計	1,137,072,081	1,192,863,934
資産合計		
	1,137,072,081	1,192,863,934
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,661,485	796,329
未払受託者報酬	163,215	173,731
未払委託者報酬	3,101,833	3,301,743
その他未払費用	25,761	27,417
流動負債合計	6,952,294	4,299,220
負債合計		
	6,952,294	4,299,220
純資産の部		
元本等		
元本	₁ 1,141,079,833	₁ 1,236,220,311
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	₂ 10,960,046	₂ 47,655,597
（分配準備積立金）	28,493,117	43,448,705
元本等合計	1,130,119,787	1,188,564,714
純資産合計		
	1,130,119,787	1,188,564,714
負債純資産合計		
	1,137,072,081	1,192,863,934

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自 平成22年10月13日 至 平成23年10月12日		自 平成23年10月13日 至 平成24年10月12日	
営業収益				
受取利息		772		646
有価証券売買等損益		69,548,640		22,182,880
営業収益合計		69,547,868		22,182,234
営業費用				
受託者報酬		348,242		344,905
委託者報酬		6,618,175		6,554,872
その他費用		54,979		54,441
営業費用合計		7,021,396		6,954,218
営業利益又は営業損失（ ）		76,569,264		29,136,452
経常利益又は経常損失（ ）		76,569,264		29,136,452
当期純利益又は当期純損失（ ）		76,569,264		29,136,452
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		8,488,041		11,234,686
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		60,467,786		10,960,046
剰余金増加額又は欠損金減少額		36,556,198		3,675,587
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,119,814
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		36,556,198		1,555,773
剰余金減少額又は欠損金増加額		22,926,725		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		22,926,725		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,960,046		47,655,597

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目		第3期 平成23年10月12日現在	第4期 平成24年10月12日現在
1.	1 期首元本額	914,516,761円	1,141,079,833円
	期中追加設定元本額	530,173,605円	330,350,174円
	期中一部解約元本額	303,610,533円	235,209,696円
2.	受益権の総数	1,141,079,833口	1,236,220,311口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は10,960,046円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は47,655,597円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目		第3期 自平成22年10月13日 至平成23年10月12日	第4期 自平成23年10月13日 至平成24年10月12日
1.	1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,309,143円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（13,902,856円）及び分配準備積立金（10,183,974円）より分配対象収益は42,395,973円（1万口当たり371.54円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（20,606,618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（23,170,020円）及び分配準備積立金（22,842,087円）より分配対象収益は66,618,725円（1万口当たり538.89円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目		第3期 自平成22年10月13日 至平成23年10月12日	第4期 自平成23年10月13日 至平成24年10月12日
1.	金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2 . 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成23年10月12日現在	第4期 平成24年10月12日現在
1 . 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 平成23年10月12日現在	第4期 平成24年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	78,254,995	34,087,394
合計	78,254,995	34,087,394

(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3期 平成23年10月12日現在	第4期 平成24年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9904円 (9,904円)	0.9615円 (9,615円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成24年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1,211,694,647	1,188,066,601	
親投資信託受益証券 合計		1,211,694,647	1,188,066,601	
合計		1,211,694,647	1,188,066,601	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科目	注記番号	平成23年10月12日現在	平成24年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,440,385,889	8,548,031,254
株式	3	237,893,978,350	237,467,178,455
派生商品評価勘定		66,594,818	117,467
未収入金		809,259	-
未収配当金		2,385,406,434	2,570,194,724
前払金		-	421,452,000
流動資産合計		244,787,174,750	249,006,973,900
資産合計		244,787,174,750	249,006,973,900
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		953,266	345,139,403
前受金		75,758,000	-
未払解約金		71,624,000	117,585,000
流動負債合計		148,335,266	462,724,403
負債合計		148,335,266	462,724,403
純資産の部			
元本等			

元本	1	243,685,819,114	253,488,354,092
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	953,020,370	4,944,104,595
元本等合計		244,638,839,484	248,544,249,497
純資産合計		244,638,839,484	248,544,249,497
負債純資産合計		244,787,174,750	249,006,973,900

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成23年10月12日現在	平成24年10月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	245,582,777,942円	243,685,819,114円
同期中追加設定元本額	56,332,602,472円	59,991,567,230円
同期中一部解約元本額	58,229,561,300円	50,189,032,252円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,972,507,879円	3,422,692,205円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,125,550,833円	1,211,694,647円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	33,255,361,388円	36,627,779,149円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	866,473,127円	986,930,604円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	3,097,941,914円	3,615,680,147円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,149,521,774円	3,657,071,994円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	494,057,835円	520,326,986円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,476,815,331円	1,609,796,400円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,117,897,517円	1,233,108,804円

マネックス資産設計 ファンド<隔月分配型 >	139,337,238円	128,611,362円
マネックス資産設計 ファンド<育成型>	1,436,245,811円	1,562,661,789円
マネックス資産設計 ファンド エボリュー ション	19,534,845円	18,927,232円
D I A M D C 8資産 バランスファンド（新 興国10）	- 円	50,323円
D I A M D C 8資産 バランスファンド（新 興国20）	- 円	75,484円
D I A M D C 8資産 バランスファンド（新 興国30）	- 円	100,645円
D I A Mワールドバラ ンス25VA（適格機 関投資家限定）	271,100,703円	243,007,130円
D I A Mグローバル・ バランスファンド25 VA（適格機関投資家 限定）	10,892,836,639円	10,658,287,731円
D I A Mグローバル・ バランスファンド50 VA（適格機関投資家 限定）	1,784,818,847円	1,817,888,685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）	215,048,202円	220,606,951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）	799,180,496円	835,974,669円
D I A M国内重視バラ ンスファンド30VA （適格機関投資家限 定）	224,433,658円	220,272,624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）	296,445,132円	308,173,330円
D I A M世界バランス ファンド40VA（適 格機関投資家限定）	20,269,683,091円	20,858,039,949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）	6,647,412,055円	6,934,963,888円
D I A Mバランスファ ンド25VA（適格機 関投資家限定）	5,339,007,181円	5,290,121,141円
D I A Mバランスファ ンド37.5VA（適 格機関投資家限定）	3,506,310,627円	3,423,908,820円
D I A Mバランスファ ンド50VA（適格機 関投資家限定）	8,015,448,053円	7,894,154,562円
D I A Mグローバル・ アセット・バランスV A（適格機関投資家限 定）	1,212,576,788円	1,246,286,050円
D I A Mグローバル・ アセット・バランスV A2（適格機関投資家 限定）	2,688,465,381円	2,694,985,933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）	2,757,566,778円	2,673,709,298円
D I A M世界アセット バランスファンドVA （適格機関投資家向 け）	15,290,358,139円	15,501,680,578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)	222,287,324円	200,292,399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)	4,904,171,769円	5,107,956,302円
	D I A Mアイエヌジ 世界バランスファンド 35VA(適格機関投 資家限定)	9,654,648,720円	9,552,563,866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)	488,514,372円	492,516,839円
	D I A M世界アセット バランスファンド2V A(適格機関投資家限 定)	42,362,726,724円	43,496,502,870円
	D I A M世界アセット バランスファンド40 VA(適格機関投資家 限定)	2,763,369,144円	2,742,360,071円
	D I A M世界アセット バランスファンド25 VA(適格機関投資家 限定)	5,224,348,797円	5,305,336,678円
	D I A M世界アセット バランスファンド3V A(適格機関投資家限 定)	26,003,502,540円	26,600,326,493円
	D I A Mバランス30 VA(適格機関投資家 限定)	302,248,950円	304,791,246円
	D I A Mバランス50 VA(適格機関投資家 限定)	99,608円	111,872円
	D I A Mバランス70 VA(適格機関投資家 限定)	151,434円	173,918円
	D I A M世界アセット バランスファンド4V A(適格機関投資家限 定)	22,813,064,310円	23,326,568,212円
	D I A M世界バランス 25VA(適格機関投 資家限定)	262,450,397円	308,053,535円
	D I A M国内バランス 30VA(適格機関投 資家限定)	90,123,060円	96,611,688円
	D I A Mバランス20 VA(適格機関投資家 限定)	231,937,599円	233,957,799円
	D I A Mバランス40 VA(適格機関投資家 限定)	95,097円	104,341円
	D I A Mバランス60 VA(適格機関投資家 限定)	142,007円	159,553円
	D I A M世界アセット バランスファンド7V A(1212)(適格 機関投資家限定)	-円	302,397,300円
	計	243,685,819,114円	253,488,354,092円
2.	受益権の総数	243,685,819,114口	253,488,354,092口
3.	2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 4,944,104,595円であります。
4.	3 差入代用有価証券	株式 1,291,000,000円	株式 1,467,000,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年10月13日 至 平成23年10月12日	自 平成23年10月13日 至 平成24年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成23年10月12日現在	平成24年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成23年10月12日現在	平成24年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	54,302,042,845	17,084,846,840
合計	54,302,042,845	17,084,846,840

(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期末日までの期間（平成23年2月8日から平成23年10月12日まで及び平成24年2月8日から平成24年10月12日まで）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)

株式関連

種類	平成23年10月12日 現在				平成24年10月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買建	6,611,786,000	-	6,677,760,000	65,974,000	11,454,027,000	-	11,109,600,000	344,427,000
合計	6,611,786,000	-	6,677,760,000	65,974,000	11,454,027,000	-	11,109,600,000	344,427,000

- (注) 1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成23年10月12日現在	平成24年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0039円 (10,039円)	0.9805円 (9,805円)

[次へ](#)

附属明細表
第1 有価証券明細表
(1) 株式

平成24年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極 洋	110,000	174	19,140,000	
日本水産	313,500	154	48,279,000	
マルハニチロホールディングス	537,000	123	66,051,000	
ハウスイ	21,000	96	2,016,000	
サカタのタネ	40,500	1,018	41,229,000	
ホクト	27,900	1,580	44,082,000	
ショーボンドHD	24,200	2,617	63,331,400	
ミライト・ホールディングス	77,900	653	50,868,700	
住石ホールディングス	80,500	67	5,393,500	
日鉄鉱業	69,000	301	20,769,000	
三井松島	177,000	109	19,293,000	
国際石油開発帝石	3,295	466,500	1,537,117,500	
日本海洋掘削	6,800	2,299	15,633,200	
関東天然瓦斯	28,000	420	11,760,000	
石油資源開発	38,600	3,285	126,801,000	
ダイセキ環境ソリューション	23	115,100	2,647,300	
間組	97,800	156	15,256,800	
東急建設	96,190	137	13,178,030	
コムシスホールディングス	132,200	1,083	143,172,600	
ミサワホーム	26,200	1,072	28,086,400	
高松コンストラクションGP	20,600	1,361	28,036,600	
東建コーポレーション	10,150	3,485	35,372,750	
ヤマウラ	8,500	220	1,870,000	
大成建設	1,373,000	219	300,687,000	
大林組	814,000	353	287,342,000	
清水建設	830,000	258	214,140,000	
飛鳥建設	168,100	71	11,935,100	
長谷工コーポレーション	1,692,500	50	84,625,000	
松井建設	2,000	292	584,000	
鹿島建設	1,272,000	215	273,480,000	
不動テトラ	192,500	101	19,442,500	
大末建設	106,000	42	4,452,000	
鉄建建設	154,000	99	15,246,000	
安藤建設	91,000	80	7,280,000	
太平工業	48,000	312	14,976,000	
西松建設	355,000	119	42,245,000	
三井住友建設	203,300	50	10,165,000	
大豊建設	72,000	86	6,192,000	
前田建設	167,000	363	60,621,000	
佐田建設	94,000	50	4,700,000	
ナカノフドー建設	22,000	135	2,970,000	
奥村組	259,000	236	61,124,000	
大和小田急建設	15,000	159	2,385,000	
東鉄工業	35,600	951	33,855,600	
イチケン	31,000	144	4,464,000	
淺沼組	84,000	54	4,536,000	
戸田建設	292,000	226	65,992,000	
熊谷組	196,000	65	12,740,000	
青木あすなる建設	19,500	409	7,975,500	
北野建設	53,000	183	9,699,000	
植木組	35,000	128	4,480,000	
三井ホーム	36,000	409	14,724,000	
矢作建設	34,300	302	10,358,600	

ピーエス三菱	17,400	310	5,394,000
大東建託	102,900	7,940	817,026,000
新日本建設	32,900	170	5,593,000
N I P P O	63,000	885	55,755,000
東亜道路	52,000	175	9,100,000
前田道路	78,000	995	77,610,000
日本道路	81,000	271	21,951,000
東亜建設	239,000	107	25,573,000
若築建設	148,000	66	9,768,000
東洋建設	84,200	205	17,261,000
五洋建設	344,500	180	62,010,000
大林道路	34,000	171	5,814,000
世紀東急	73,000	48	3,504,000
福 田 組	41,000	298	12,218,000
住友林業	186,800	657	122,727,600
日本基礎技術	31,300	240	7,512,000
日成ビルド工業	80,000	147	11,760,000
エス・バイ・エル	138,000	118	16,284,000
バコーボレーション	35,500	254	9,017,000
パナホーム	102,000	488	49,776,000
大和ハウス	676,000	1,172	792,272,000
ライト工業	57,300	336	19,252,800
積水ハウス	763,000	801	611,163,000
日特建設	17,000	229	3,893,000
北陸電気工事	15,000	227	3,405,000
ユアテック	38,000	248	9,424,000
西部電気工業	1,000	333	333,000
四電工	6,000	275	1,650,000
中電工	40,000	684	27,360,000
関 電 工	125,000	368	46,000,000
きんでん	181,000	474	85,794,000
東京エネシス	28,000	341	9,548,000
トーエネック	36,000	406	14,616,000
住友電設	19,400	654	12,687,600
日本電設工業	50,000	707	35,350,000
協和エクシオ	89,200	885	78,942,000
新日本空調	22,200	404	8,968,800
日本工営	86,000	261	22,446,000
N D S	44,000	238	10,472,000
九電工	51,000	345	17,595,000
三機工業	63,000	366	23,058,000
日 揮	253,000	2,686	679,558,000
中外炉工業	88,000	202	17,776,000
ヤマト	16,000	300	4,800,000
太平電業	34,000	537	18,258,000
高砂熱学	78,600	627	49,282,200
三晃金属	31,000	189	5,859,000
N E C ネットズエスアイ	22,900	1,416	32,426,400
朝日工業社	28,000	274	7,672,000
アタカ大機	16,000	351	5,616,000
大 気 社	41,800	1,667	69,680,600
ダイダン	25,000	449	11,225,000
日比谷総合設	33,800	970	32,786,000
東芝プラントシステム	44,000	1,041	45,804,000
日本製粉	168,000	328	55,104,000
日清製粉G本社	246,000	979	240,834,000
日東富士製粉	8,000	288	2,304,000
昭和産業	114,000	258	29,412,000
鳥越製粉	22,500	610	13,725,000
協同飼料	97,000	88	8,536,000
中部飼料	24,300	505	12,271,500
日本配合飼料	84,000	98	8,232,000

東洋精糖	44,000	81	3,564,000
日本甜菜糖	152,000	146	22,192,000
三井製糖	97,000	258	25,026,000
ネクスト	9,900	549	5,435,100
日本M&Aセンター	10,000	2,325	23,250,000
ノバレーゼ	67	52,000	3,484,000
アコーディア・ゴルフ	1,026	56,000	57,456,000
タケエイ	1,800	1,618	2,912,400
パソナグループ	251	46,000	11,546,000
リンクアンドモチベーション	103	31,250	3,218,750
エス・エム・エス	46	165,800	7,626,800
テンプホールディングス	34,500	944	32,568,000
クックパッド	5,000	2,213	11,065,000
森永製菓	269,000	174	46,806,000
中村屋	64,000	386	24,704,000
江崎グリコ	98,000	887	86,926,000
名糖産業	12,500	994	12,425,000
不二家	155,000	186	28,830,000
山崎製パン	199,000	1,001	199,199,000
第一屋製パン	40,000	75	3,000,000
モロゾフ	45,000	271	12,195,000
亀田製菓	15,300	1,923	29,421,900
カルビー	19,600	6,840	134,064,000
森永乳業	230,000	267	61,410,000
ヤクルト	145,300	3,625	526,712,500
明治ホールディングス	80,400	3,670	295,068,000
雪印メグミルク	58,600	1,309	76,707,400
プリマハム	152,000	133	20,216,000
日本ハム	206,000	1,008	207,648,000
伊藤ハム	150,000	324	48,600,000
林兼産業	90,000	61	5,490,000
丸大食品	131,000	274	35,894,000
米久	24,100	650	15,665,000
S Foods	17,500	718	12,565,000
学情	8,600	272	2,339,200
スタジオアリス	11,700	1,240	14,508,000
シミックホールディングス	9,600	1,243	11,932,800
システナ	255	64,400	16,422,000
NECフィールディング	20,600	903	18,601,800
新日鉄住金SOL	15,800	1,553	24,537,400
総合警備保障	91,900	1,109	101,917,100
日本駐車場開発	2,654	4,410	11,704,140
コア	9,300	699	6,500,700
カカクコム	39,300	2,798	109,961,400
アイロムホールディングス	542	2,330	1,262,860
ルネサンス	11,600	512	5,939,200
新日本科学	16,200	189	3,061,800
ツクイ	9,000	1,696	15,264,000
エムスリー	597	141,300	84,356,100
ベストプライダル	74	84,400	6,245,600
ディー・エヌ・エー	113,200	2,527	286,056,400
博報堂DYHLDGS	32,070	4,745	152,172,150
ぐるなび	17,600	892	15,699,200
一休	184	38,050	7,001,200
ジャパンベストレスキューS	33	77,000	2,541,000
ジェイコムホールディングス	4,600	728	3,348,800
PGMホールディングス	357	60,200	21,491,400
サッポロホールディングス	445,000	220	97,900,000
アサヒグループホールディング	544,900	1,902	1,036,399,800

キリンHD	1,160,000	1,032	1,197,120,000
宝ホールディングス	230,000	573	131,790,000
オエノンホールディングス	72,000	190	13,680,000
養命酒	3,000	695	2,085,000
三国コカ・コ・ラ	29,500	670	19,765,000
コカ・コーラウエスト	92,100	1,258	115,861,800
コカコーラセントラルジャ パン	34,600	979	33,873,400
ダイドードリンコ	12,600	3,490	43,974,000
伊藤園	75,500	1,521	114,835,500
キーコーヒー	24,100	1,515	36,511,500
ユニカフェ	6,100	402	2,452,200
ジャパンフーズ	4,200	845	3,549,000
日清オイリオグループ	106,000	292	30,952,000
不二製油	66,000	1,068	70,488,000
J・オイルミルズ	103,000	206	21,218,000
ローソン	75,300	5,750	432,975,000
サンエー	8,100	3,075	24,907,500
キリン堂	10,500	513	5,386,500
ダイユーエイト	4,400	533	2,345,200
カワチ薬品	16,600	1,509	25,049,400
エービーシー・マート	33,900	3,310	112,209,000
ハードオフコーポレーショ ン	11,700	531	6,212,700
高千穂交易	10,400	833	8,663,200
アスクル	16,300	1,280	20,864,000
ゲオホールディングス	367	88,600	32,516,200
ポイント	20,140	2,901	58,426,140
シー・ヴィ・エス・バイエ リア	31,000	66	2,046,000
伊藤忠食品	6,100	2,851	17,391,100
くらコーポレーション	14,000	1,102	15,428,000
キャンドウ	129	105,800	13,648,200
エレマテック	16,000	1,057	16,912,000
パル	6,950	3,845	26,722,750
JALUX	7,500	800	6,000,000
エディオン	94,900	352	33,404,800
あらた	54,000	359	19,386,000
サーラコーポレーション	20,800	504	10,483,200
トーメンデバイス	3,300	1,625	5,362,500
J Pホールディングス	7,600	991	7,531,600
あみやき亭	36	194,200	6,991,200
東京エレクトロンデバイス	51	129,500	6,604,500
ひらまつ	83	71,400	5,926,200
双日	1,600,600	96	153,657,600
ゲンキー	2,300	1,703	3,916,900
アルフレッサホールディン グス	62,500	3,600	225,000,000
大黒天物産	4,100	2,174	8,913,400
ハニーズ	20,880	1,193	24,909,840
キッコーマン	222,000	1,049	232,878,000
味の素	714,000	1,203	858,942,000
キュービー	138,100	1,305	180,220,500
ハウス食品	96,500	1,278	123,327,000
カゴメ	105,100	1,717	180,456,700
焼津水産化工	13,600	717	9,751,200
アリアケジャパン	24,900	1,747	43,500,300
ニチレイ	305,000	430	131,150,000
横浜冷凍	60,200	547	32,929,400
東洋水産	117,000	1,985	232,245,000
日清食品HD	106,000	2,987	316,622,000
永谷園	7,000	770	5,390,000
フジッコ	30,000	1,008	30,240,000

ロックフィールド	14,600	1,460	21,316,000
日本たばこ産業	1,201,600	2,318	2,785,308,800
ケンコーマヨネーズ	8,500	721	6,128,500
わらべや日洋	15,100	1,573	23,752,300
なとり	13,500	849	11,461,500
片倉工業	32,000	679	21,728,000
グンゼ	190,000	192	36,480,000
ヒューリック	281,300	526	147,963,800
神栄	31,000	97	3,007,000
山下医科器械	2,300	998	2,295,400
ラサ商事	11,100	351	3,896,100
アルペン	18,200	1,423	25,898,600
アルコニックス	6,300	1,302	8,202,600
ピックカメラ	904	39,050	35,301,200
DCMホールディングス	123,300	512	63,129,600
MonotaRO	15,800	2,087	32,974,600
あいホールディングス	38,300	484	18,537,200
J. フロントリテイリング	564,000	422	238,008,000
ドトール・日レスHD	38,200	966	36,901,200
マツモトキヨシHLDGS	44,200	1,886	83,361,200
スタートトゥデイ	43,200	960	41,472,000
物語コーポレーション	3,100	1,624	5,034,400
ココカラファイン	24,800	2,544	63,091,200
三越伊勢丹HD	474,200	786	372,721,200
東洋紡	1,070,000	84	89,880,000
ユニチカ	565,000	35	19,775,000
富士紡ホールディングス	105,000	269	28,245,000
日清紡ホールディングス	161,000	465	74,865,000
倉敷紡績	261,000	122	31,842,000
ダイワボウHD	231,000	137	31,647,000
シキボウ	164,000	90	14,760,000
日東紡績	186,000	247	45,942,000
トヨタ紡織	84,500	759	64,135,500
ウエルシアHD	8,300	2,424	20,119,200
クリエイトSDH	10,000	2,080	20,800,000
バイタルKSKHD	44,900	787	35,336,300
八洲電機	16,900	330	5,577,000
UKCホールディングス	14,200	1,506	21,385,200
丸善CHIHD	7,100	210	1,491,000
TOKAIホールディングス	116,400	329	38,295,600
日本毛織	80,000	559	44,720,000
大東紡織	40,000	56	2,240,000
トーア紡コーポレーション	116,000	53	6,148,000
ダイドーリミテッド	31,800	449	14,278,200
東京建物不動産販	13,200	255	3,366,000
野村不動産HLDGS	114,300	1,403	160,362,900
常和ホールディングス	4,600	1,397	6,426,200
帝国繊維	27,000	599	16,173,000
ブックオフコーポレーション	13,200	658	8,685,600
日本コークス工業	204,500	92	18,814,000
ミタチ産業	3,800	352	1,337,600
あさひ	13,700	1,274	17,453,800
日本調剤	3,000	1,999	5,997,000
コスモス薬品	10,500	7,170	75,285,000
シップヘルスケアHD	31,000	2,595	80,445,000
ソフトクリエイトHD	2,700	1,252	3,380,400
セブン&アイ・HLDGS	998,500	2,283	2,279,575,500
ツルハホールディングス	19,700	5,790	114,063,000
サンマルクホールディングス	6,800	2,919	19,849,200

フェリシモ	6,900	1,030	7,107,000
トリドール	20,600	1,194	24,596,400
クスリのアオキ	3,500	3,655	12,792,500
帝人	1,035,000	173	179,055,000
東レ	1,838,000	426	782,988,000
クラレ	402,800	864	348,019,200
旭化成	1,475,000	413	609,175,000
サカイオーベックス	71,000	103	7,313,000
稲葉製作所	11,000	974	10,714,000
宮地エンジニアリングG	79,000	116	9,164,000
三協・立山HLDGS	341,000	152	51,832,000
トーカロ	14,300	1,128	16,130,400
アルファCO	8,700	842	7,325,400
SUMCO	155,000	518	80,290,000
川田テクノロジーズ	5,900	1,125	6,637,500
住江織物	64,000	147	9,408,000
日本フェルト	15,200	398	6,049,600
イチカワ	14,000	143	2,002,000
日本バイリン	33,000	331	10,923,000
エコナックホールディングス	78,000	33	2,574,000
日東製網	29,000	104	3,016,000
芦森工業	61,000	96	5,856,000
アツギ	198,000	90	17,820,000
ダイニック	49,000	140	6,860,000
共和レザー	13,400	241	3,229,400
セーレン	63,300	514	32,536,200
東海染工	37,000	78	2,886,000
小松精練	39,000	354	13,806,000
ワコールホールディングス	151,000	888	134,088,000
ホギメディカル	16,000	3,995	63,920,000
レナウン	54,500	115	6,267,500
クラウディア	2,600	985	2,561,000
TSIホールディングス	113,000	493	55,709,000
デジタルハーツ	5,200	687	3,572,400
ITホールディングス	72,400	984	71,241,600
ネオス	54	46,400	2,505,600

[次へ](#)

平成24年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
グリー	123,100	1,400	172,340,000	
コーエーテクモHD	47,300	616	29,136,800	
三菱総合研究所	9,300	1,585	14,740,500	
ボルテージ	3,700	1,040	3,848,000	
K L a b	7,000	576	4,032,000	
ネクソン	195,300	999	195,104,700	
特種東海製紙	160,000	193	30,880,000	
ドワンゴ	123	112,100	13,788,300	
ベリサーブ	13	125,700	1,634,100	
マクロミル	23,300	940	21,902,000	
ティーガイア	23,600	729	17,204,400	
GMOペイメントゲートウェイ	7,800	1,250	9,750,000	
ザッパラス	134	69,200	9,272,800	
インターネットイニシアティブ	28,000	1,952	54,656,000	
S R Aホールディングス	12,700	850	10,795,000	
朝日ネット	21,000	404	8,484,000	
王子ホールディングス	1,119,000	214	239,466,000	
三菱製紙	363,000	64	23,232,000	
北越紀州製紙	157,000	357	56,049,000	
中越パルプ	98,000	131	12,838,000	
巴川製紙	41,000	135	5,535,000	
大王製紙	107,000	427	45,689,000	
日本製紙G本社	122,200	831	101,548,200	
レンゴー	203,000	314	63,742,000	
トーモク	80,000	214	17,120,000	
ザ・バック	18,100	1,343	24,308,300	
コ・プケミカル	40,000	86	3,440,000	
昭和電工	1,575,000	114	179,550,000	
住友化学	1,741,000	191	332,531,000	
日本化成	50,000	92	4,600,000	
住友精化	48,000	282	13,536,000	
日産化学	192,800	896	172,748,800	
ラサ工業	101,000	66	6,666,000	
クレハ	165,000	268	44,220,000	
テイカ	44,000	218	9,592,000	
石原産業	426,000	57	24,282,000	
片倉チツカリン	13,000	182	2,366,000	
日本曹達	151,000	336	50,736,000	
東ソー	677,000	152	102,904,000	
トクヤマ	394,000	151	59,494,000	
セントラル硝子	242,000	209	50,578,000	
東亜合成	298,000	311	92,678,000	
ダイソー	103,000	196	20,188,000	
関東電化	57,000	122	6,954,000	
電気化学	507,000	236	119,652,000	
イビデン	158,500	991	157,073,500	
信越化学	454,300	4,485	2,037,535,500	
日本カ-バイド	81,000	107	8,667,000	
堺化学	80,000	196	15,680,000	
エア・ウォーター	209,000	943	197,087,000	
大陽日酸	333,000	384	127,872,000	
日本化学工業	103,000	93	9,579,000	
日本パ-カラijing	60,000	1,140	68,400,000	
高压ガス	36,000	419	15,084,000	
チタン工業	28,000	223	6,244,000	
四国化成	35,000	421	14,735,000	
戸田工業	33,000	232	7,656,000	

ステラ ケミファ	12,100	1,377	16,661,700
保土谷化学	51,000	138	7,038,000
日本触媒	184,000	770	141,680,000
大日精化	92,000	327	30,084,000
カネカ	316,000	382	120,712,000
協和発酵キリン	303,000	925	280,275,000
三菱瓦斯化学	436,000	369	160,884,000
三井化学	1,075,000	146	156,950,000
J S R	230,700	1,240	286,068,000
東京応化工業	45,500	1,608	73,164,000
大阪有機化学	17,600	328	5,772,800
三菱ケミカルH L D G S	1,584,000	281	445,104,000
日本合成化学	52,000	489	25,428,000
ダイセル	329,000	449	147,721,000
住友ベークライト	218,000	267	58,206,000
積水化学	520,000	602	313,040,000
日本ゼオン	236,000	536	126,496,000
アイカ工業	66,300	1,353	89,703,900
宇部興産	1,061,000	164	174,004,000
積水樹脂	37,000	771	28,527,000
タキロン	60,000	286	17,160,000
旭有機材	92,000	175	16,100,000
日立化成	109,500	1,009	110,485,500
ニチバン	22,000	250	5,500,000
リケンテクノス	40,000	200	8,000,000
大倉工業	61,000	196	11,956,000
積水化成成品	65,000	168	10,920,000
群栄化学	71,000	201	14,271,000
タイガース ポリマー	12,700	264	3,352,800
日本カ・リット	21,000	374	7,854,000
日本化薬	179,000	841	150,539,000
イーピーエス	149	214,900	32,020,100
パナソニック インフォシス	5,600	1,805	10,108,000
フェイス	821	7,950	6,526,950
アミューズ	7,200	1,371	9,871,200
野村総合研究所	135,000	1,605	216,675,000
ドリームインキュベータ	80	64,000	5,120,000
サイバネットシステム	188	21,220	3,989,360
T A C	14,200	129	1,831,800
ケネディクス	2,409	9,310	22,427,790
電通	229,700	1,820	418,054,000
インテージ	7,100	1,530	10,863,000
テイクアンドギヴニーズ	1,079	6,370	6,873,230
ぴあ	7,600	1,006	7,645,600
シンプレクスホールディング	398	24,410	9,715,180
イオンファンタジー	8,300	1,080	8,964,000
ソースネクスト	6,000	324	1,944,000
ネクシィーズ	952	1,898	1,806,896
メディカルシステムネット	14,500	555	8,047,500
日本精化	21,700	526	11,414,200
A D E K A	109,500	605	66,247,500
日油	198,000	370	73,260,000
ミヨシ油脂	91,000	94	8,554,000
ハリマ化成グループ	21,700	340	7,378,000
花王	671,900	2,263	1,520,509,700
第一工業製薬	47,000	187	8,789,000
三洋化成	80,000	432	34,560,000
武田薬品	949,000	3,535	3,354,715,000
アステラス製薬	562,400	3,845	2,162,428,000
大日本住友製薬	179,700	844	151,666,800
塩野義製薬	395,700	1,238	489,876,600

田辺三菱製薬	253,000	1,127	285,131,000
わかもと製薬	7,000	193	1,351,000
あすか製薬	28,000	402	11,256,000
日本新薬	53,000	918	48,654,000
中外製薬	294,300	1,588	467,348,400
科研製薬	100,000	1,176	117,600,000
エーザイ	311,900	3,415	1,065,138,500
ロート製薬	106,000	1,132	119,992,000
小野薬品	124,000	4,710	584,040,000
久光製薬	78,600	4,120	323,832,000
有機合成薬品	18,000	206	3,708,000
持田製薬	87,000	968	84,216,000
参天製薬	85,100	3,445	293,169,500
扶桑薬品	86,000	243	20,898,000
日本ケミファ	39,000	472	18,408,000
ツムラ	69,100	2,410	166,531,000
日医工	39,800	1,700	67,660,000
テルモ	171,100	3,205	548,375,500
みらかホールディングス	66,000	3,380	223,080,000
キッセイ薬品工業	47,200	1,306	61,643,200
生化学工業	48,600	890	43,254,000
栄研化学	19,900	1,040	20,696,000
日水製薬	11,000	811	8,921,000
鳥居薬品	17,500	1,666	29,155,000
東和薬品	12,900	5,030	64,887,000
富士製薬工業	6,500	1,227	7,975,500
沢井製薬	16,700	8,800	146,960,000
ゼリア新薬工業	36,000	1,252	45,072,000
第一三共	852,200	1,197	1,020,083,400
キョーリン製薬HD	62,000	1,780	110,360,000
大幸薬品	11,800	719	8,484,200
ダイト	7,100	1,355	9,620,500
大塚ホールディングス	502,700	2,406	1,209,496,200
大正製薬HD	60,900	6,050	368,445,000
大日本塗料	147,000	81	11,907,000
日本ペイント	239,000	635	151,765,000
関西ペイント	287,000	873	250,551,000
トウベ	24,000	70	1,680,000
中国塗料	78,000	339	26,442,000
日本特殊塗料	20,500	324	6,642,000
藤倉化成	32,500	306	9,945,000
太陽ホールディングス	20,900	2,185	45,666,500
D I C	967,000	131	126,677,000
サカティンクス	48,000	374	17,952,000
東洋インキSCホールディングン	229,000	284	65,036,000
アルプス技研	10,900	619	6,747,100
サニックス	36,600	229	8,381,400
ダイオーズ	5,600	507	2,839,200
日本空調サービス	7,100	714	5,069,400
オリエンタルランド	68,300	10,370	708,271,000
ダスキン	74,700	1,492	111,452,400
パーク24	124,200	1,306	162,205,200
明光ネットワークジャパン	23,300	818	19,059,400
ファルコSDホールディングス	13,800	908	12,530,400
クレスコ	5,600	516	2,889,600
フジ・メディア・HD	2,485	109,800	272,853,000
秀英予備校	5,000	298	1,490,000
田谷	4,300	677	2,911,100
ラウンドワン	79,000	366	28,914,000
リゾートトラスト	38,900	1,494	58,116,600
オービック	7,470	15,920	118,922,400

TDCソフトウェアエンジニア	4,700	730	3,431,000
ヤフー	17,484	27,360	478,362,240
ピー・エム・エル	16,600	2,113	35,075,800
ワタベウェディング	7,900	655	5,174,500
トレンドマイクロ	94,800	2,137	202,587,600
もしもしホットライン	41,700	1,132	47,204,400
東急コミュニティー	6,600	2,825	18,645,000
リソー教育	2,592	6,230	16,148,160
日本オラクル	47,700	3,620	172,674,000
アルファシステムズ	7,900	1,001	7,907,900
フューチャーアーキテクト	291	29,440	8,567,040
ウェアハウス	5,100	225	1,147,500
シーエーシー	14,800	670	9,916,000
ソフトバンク・テクノ	5,600	693	3,880,800
トーセ	6,000	498	2,988,000
ユー・エス・エス	32,940	8,000	263,520,000
オービックビジネスC	6,050	4,555	27,557,750
伊藤忠テクノソリューションズ	28,100	3,940	110,714,000
アイティフォー	27,100	277	7,506,700
東京個別指導学院	13,900	140	1,946,000
東計電算	4,500	1,102	4,959,000
エクスネット	18	114,400	2,059,200
テー・オー・ダブリュー	9,400	503	4,728,200
大塚商会	21,400	6,560	140,384,000
総合メディカル	5,800	2,751	15,955,800
サイボウズ	436	24,250	10,573,000
ソフトブレーン	354	8,170	2,892,180
アグレックス	6,800	744	5,059,200
セントラルスポーツ	8,000	1,123	8,984,000
電通国際情報S	14,700	738	10,848,600
ウェザーニューズ	6,200	2,649	16,423,800
C I J	24,100	311	7,495,100
WOWOW	73	174,700	12,753,100
フルキャストホールディングス	235	13,680	3,214,800
富士フイルムHLDGS	541,000	1,306	706,546,000
コニカミノルタHLDGS	638,500	561	358,198,500
資生堂	420,600	979	411,767,400
ライオン	293,000	448	131,264,000
高砂香料	84,000	388	32,592,000
マンダム	25,400	2,057	52,247,800
ミルボン	12,500	2,649	33,112,500
ファンケル	64,000	877	56,128,000
コーセー	41,000	1,807	74,087,000
ドクターシーラボ	171	261,200	44,665,200
ポーラ・オルビスHD	30,100	2,430	73,143,000
ノエビアホールディングス	14,700	1,134	16,669,800
エステー	16,000	878	14,048,000
コニシ	18,500	1,148	21,238,000
長谷川香料	32,300	990	31,977,000
小林製薬	35,100	4,155	145,840,500
荒川化学工業	20,400	599	12,219,600
メック	18,900	214	4,044,600
日本高純度化学	74	179,500	13,283,000
JCU	3,500	2,818	9,863,000
アース製薬	18,300	2,929	53,600,700
イハラケミカル	43,000	371	15,953,000
北興化学	11,000	217	2,387,000
大成ラミック	7,200	2,320	16,704,000
クミアイ化学	52,000	372	19,344,000
日本農薬	58,000	352	20,416,000
昭和シエル石油	227,100	443	100,605,300

コスモ石油	700,000	144	100,800,000
富士興産	8,600	431	3,706,600
ニチレキ	35,000	351	12,285,000
東燃ゼネラル石油	382,000	693	264,726,000
ユシロ化学	13,900	721	10,021,900
ビーピー・カストロール	9,800	340	3,332,000
AOCホールディングス	58,800	223	13,112,400
MORESCO	5,900	719	4,242,100
出光興産	30,000	6,800	204,000,000
JXホールディングス	2,811,000	446	1,253,706,000
横浜ゴム	283,000	530	149,990,000
東洋ゴム	191,000	190	36,290,000
ブリヂストン	793,800	1,730	1,373,274,000
住友ゴム	197,400	884	174,501,600
藤倉ゴム	15,100	258	3,895,800
オカモト	91,000	310	28,210,000
アキレス	207,000	100	20,700,000
フコク	10,700	692	7,404,400
ニッタ	25,000	1,183	29,575,000
クリエートメディック	7,000	796	5,572,000
東海ゴム工業	46,800	690	32,292,000
三ツ星ベルト	64,000	409	26,176,000
バンドー化学	87,000	241	20,967,000
鬼怒川ゴム	56,000	400	22,400,000
旭硝子	1,248,000	526	656,448,000
日本板硝子	1,087,000	60	65,220,000
石塚硝子	31,000	128	3,968,000
有沢製作所	41,900	182	7,625,800
日本山村硝子	101,000	163	16,463,000
日本電気硝子	486,000	427	207,522,000
オハラ	9,700	634	6,149,800
住友大阪セメント	514,000	265	136,210,000
太平洋セメント	1,488,000	161	239,568,000
デイ・シイ	24,100	217	5,229,700
リゾートソリューション	22,000	157	3,454,000
日本ヒューム	26,000	374	9,724,000
日本コンクリート	40,000	237	9,480,000
東海カーボン	219,000	237	51,903,000
日本カーボン	134,000	121	16,214,000
東洋炭素	12,400	1,498	18,575,200
ノリタケ	132,000	186	24,552,000
TOTO	391,000	574	224,434,000
日本碍子	330,000	862	284,460,000
日本特殊陶業	218,000	811	176,798,000
ダントーホールディングス	40,000	75	3,000,000
MARUWA	7,400	2,381	17,619,400
品川リフラクトリーズ	64,000	161	10,304,000
黒崎播磨	54,000	177	9,558,000
東京窯業	31,000	146	4,526,000
ニッカトー	9,000	437	3,933,000
フジインコーポレーテッド	23,100	1,092	25,225,200
エーアンドエーマテリアル	54,000	63	3,402,000
ニチアス	113,000	395	44,635,000
新日鐵住金	10,093,620	168	1,695,728,160
神戸製鋼所	3,510,000	60	210,600,000
中山製鋼所	128,000	37	4,736,000
合同製鐵	141,000	107	15,087,000
JFEホールディングス	642,519	1,003	644,446,557
日新製鋼HD	100,576	542	54,512,192
東京製鐵	128,100	242	31,000,200
共英製鋼	27,000	1,159	31,293,000
大和工業	57,600	2,140	123,264,000

東京鐵鋼	49,000	262	12,838,000
大阪製鐵	15,900	1,214	19,302,600
淀川製鋼所	180,000	253	45,540,000
東洋鋼鈹	61,000	179	10,919,000
住友鋼管	14,800	578	8,554,400
丸一鋼管	77,700	1,645	127,816,500
モリ工業	39,000	223	8,697,000
大同特殊鋼	424,000	323	136,952,000
日本高周波	101,000	72	7,272,000
日本冶金工	185,500	63	11,686,500
山陽特殊製鋼	125,000	221	27,625,000
愛知製鋼	134,000	284	38,056,000
日立金属	165,000	676	111,540,000
日本金属	60,000	106	6,360,000
大平洋金属	176,000	254	44,704,000
日本電工	99,000	182	18,018,000
栗本鉄工所	121,000	238	28,798,000
日本鑄鉄管	28,000	156	4,368,000
日本製鋼所	391,000	424	165,784,000
三菱製鋼	152,000	140	21,280,000
日亜鋼業	40,000	178	7,120,000
日本精線	17,000	299	5,083,000
大紀アルミニウム	39,000	191	7,449,000
日本軽金属HD	573,000	69	39,537,000
三井金属	689,000	159	109,551,000
東邦亜鉛	143,000	260	37,180,000
三菱マテリアル	1,580,000	224	353,920,000
住友鋳山	655,000	1,045	684,475,000
DOWAホールディングス	303,000	541	163,923,000
古河機金	428,000	67	28,676,000
大阪チタニウム	24,800	1,523	37,770,400
東邦チタニウム	41,000	674	27,634,000
住友軽金属	610,000	62	37,820,000
古河スカイ	102,000	174	17,748,000
古河電工	797,000	151	120,347,000
住友電工	894,400	796	711,942,400
フジクラ	381,000	230	87,630,000
昭和電線HLDGS	330,000	56	18,480,000
東京特殊電線	34,000	68	2,312,000
タツタ電線	48,000	700	33,600,000
日立電線	198,000	97	19,206,000
沖電線	29,000	111	3,219,000
カナレ電気	3,900	1,269	4,949,100
平河ヒューテック	4,400	628	2,763,200
リョービ	141,000	156	21,996,000
アサヒHD	35,400	1,281	45,347,400
東洋製罐	179,000	796	142,484,000
ホッカンホールディングス	61,000	228	13,908,000
コロナ	11,600	982	11,391,200
横河ブリッジHLDGS	52,000	555	28,860,000
日本橋梁	9,650	235	2,267,750
駒井ハルテック	50,000	190	9,500,000
サクラダ	290,000	11	3,190,000
高田機工	23,000	149	3,427,000
三和ホールディングス	252,000	295	74,340,000
文化シャツタ-	66,000	336	22,176,000
東洋シャツタ-	7,200	430	3,096,000
LIXILグループ	329,200	1,740	572,808,000
日本フィルコン	19,200	373	7,161,600
ノーリツ	49,700	1,291	64,162,700
長府製作所	24,400	1,696	41,382,400
リンナイ	40,700	5,530	225,071,000

ユニプレス	38,800	1,688	65,494,400
-------	--------	-------	------------

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ダイニチ工業	13,000	783	10,179,000	
日東精工	31,000	201	6,231,000	
三洋工業	33,000	143	4,719,000	
岡部	50,300	491	24,697,300	
日立ツール	14,700	675	9,922,500	
中国工業	41,000	78	3,198,000	
東プレ	48,700	635	30,924,500	
高周波熱錬	33,700	451	15,198,700	
東京製綱	161,000	79	12,719,000	
パイオラックス	10,800	1,594	17,215,200	
日本発条	183,100	615	112,606,500	
中央発條	28,000	273	7,644,000	
アドバネクス	51,000	70	3,570,000	
三浦工業	37,700	1,777	66,992,900	
タクマ	86,000	393	33,798,000	
ツガミ	67,000	470	31,490,000	
オークマ	152,000	462	70,224,000	
東芝機械	138,000	303	41,814,000	
アマダ	357,000	343	122,451,000	
アイダエンジニア	65,500	516	33,798,000	
牧野フライス	126,000	331	41,706,000	
オーエスジー	104,100	1,048	109,096,800	
ダイジェット	30,000	137	4,110,000	
旭ダイヤモンド	62,200	798	49,635,600	
森精機製作所	133,400	486	64,832,400	
ディスコ	25,600	3,535	90,496,000	
日東工器	14,800	1,780	26,344,000	
豊田自動織機	220,200	2,156	474,751,200	
豊和工業	132,000	69	9,108,000	
大阪機工	99,000	86	8,514,000	
石川製作所	55,000	61	3,355,000	
東洋機械金属	19,300	178	3,435,400	
津田駒工業	62,000	95	5,890,000	
エンシュウ	62,000	61	3,782,000	
島精機製作所	33,200	1,039	34,494,800	
日阪製作所	32,000	537	17,184,000	
やまびこ	10,000	985	9,850,000	
ペガサスミシン製造	23,300	174	4,054,200	
ナプテスコ	105,900	1,447	153,237,300	
三井海洋開発	20,900	1,560	32,604,000	
レオン自動機	21,000	173	3,633,000	
S M C	75,600	11,860	896,616,000	
新川	20,700	339	7,017,300	
ホソカワミクロン	42,000	396	16,632,000	
ユニオンツール	14,000	1,218	17,052,000	
オイレス工業	26,500	1,542	40,863,000	
サト - ホールディングス	26,500	1,165	30,872,500	
日本エアテック	6,800	333	2,264,400	
日精樹脂工業	20,200	297	5,999,400	
ワイエイシイ	10,500	467	4,903,500	
小松製作所	1,181,300	1,545	1,825,108,500	
住友重機械	646,000	270	174,420,000	
日立建機	129,100	1,259	162,536,900	
日工	33,000	286	9,438,000	
巴工業	9,500	1,375	13,062,500	
井関農機	260,000	173	44,980,000	
T O W A	22,600	425	9,605,000	
丸山製作所	58,000	140	8,120,000	
北川鉄工所	116,000	120	13,920,000	

シンニッタン	21,900	307	6,723,300
クボタ	1,159,000	792	917,928,000
荏原実業	6,500	1,202	7,813,000
東洋エンジニア	145,000	336	48,720,000
三菱化工機	79,000	122	9,638,000
月島機械	38,000	645	24,510,000
帝国電機製作所	8,500	1,002	8,517,000
東京機械	86,000	42	3,612,000
新東工業	55,200	524	28,924,800
渋谷工業	16,000	876	14,016,000
アイチ コーポレーション	42,700	313	13,365,100
小森コーポレーション	72,100	371	26,749,100
鶴見製作所	14,000	555	7,770,000
住友精密	36,000	305	10,980,000
酒井重工業	48,000	185	8,880,000
荏原製作所	413,000	304	125,552,000
石井鉄工所	38,000	121	4,598,000
西島製作所	29,200	515	15,038,000
千代田化工建	215,000	1,172	251,980,000
ダイキン工業	308,200	1,954	602,222,800
オルガノ	48,000	448	21,504,000
ト・ヨ・カネツ	136,000	147	19,992,000
栗田工業	139,600	1,705	238,018,000
椿本チエイン	129,000	396	51,084,000
大同工業	47,000	124	5,828,000
日本コンベヤ	83,000	69	5,727,000
日機装	78,000	919	71,682,000
木村化工機	23,300	243	5,661,900
新興プランテック	55,600	629	34,972,400
アネスト岩田	39,000	303	11,817,000
ダイフク	111,000	406	45,066,000
加藤製作所	57,000	181	10,317,000
油研工業	45,000	129	5,805,000
タダノ	117,000	597	69,849,000
フジテック	71,000	434	30,814,000
C K D	67,800	372	25,221,600
キトー	104	65,900	6,853,600
平和	52,400	1,223	64,085,200
理想科学工業	17,400	1,253	21,802,200
S A N K Y O	73,300	3,355	245,921,500
日本金銭機械	22,300	628	14,004,400
マースエンジニアリング	13,700	2,004	27,454,800
福島工業	6,700	1,219	8,167,300
オーイズミ	8,800	282	2,481,600
ダイコク電機	11,100	2,028	22,510,800
ア マ ノ	73,400	637	46,755,800
J U K I	156,000	91	14,196,000
サンデン	126,000	226	28,476,000
蛇の目ミシン	234,000	54	12,636,000
ブラザー工業	312,400	708	221,179,200
マックス	38,000	877	33,326,000
モリタホールディングス	39,000	635	24,765,000
グローリー	72,200	1,776	128,227,200
大和冷機工業	39,000	343	13,377,000
セガサミーホールディングス	259,900	1,395	362,560,500
日本ピストンリング	88,000	122	10,736,000
リケン	88,000	271	23,848,000
T P R	26,800	847	22,699,600
ホシザキ電機	52,800	2,178	114,998,400
大豊工業	17,100	703	12,021,300
日本精工	538,000	438	235,644,000
N T N	560,000	141	78,960,000

ジェイテクト	231,200	615	142,188,000
不二越	224,000	220	49,280,000
ミネベア	360,000	243	87,480,000
日本トムソン	77,000	235	18,095,000
T H K	160,700	1,225	196,857,500
ユーシン精機	12,100	1,395	16,879,500
前澤給装工業	9,500	1,045	9,927,500
イーグル工業	30,000	449	13,470,000
前澤工業	18,100	168	3,040,800
日本ピラ - 工業	24,000	460	11,040,000
キッツ	99,600	320	31,872,000
日立	5,573,000	404	2,251,492,000
東芝	5,091,000	256	1,303,296,000
三菱電機	2,419,000	575	1,390,925,000
富士電機	729,000	161	117,369,000
東洋電機製造	48,000	223	10,704,000
安川電機	284,000	512	145,408,000
シンフォニア テクノロ ジー	146,000	137	20,002,000
明電舎	240,000	261	62,640,000
オリジン電気	35,000	273	9,555,000
デンヨー	22,100	777	17,171,700
日立工機	64,900	550	35,695,000
三桜工業	30,900	451	13,935,900
マキタ	157,700	3,000	473,100,000
東芝テック	151,000	348	52,548,000
芝浦メカトロニクス	44,000	120	5,280,000
マブチモーター	35,900	3,485	125,111,500
日本電産	134,576	5,100	686,337,600
東光高岳HD	12,720	1,208	15,365,760
宮越ホールディングス	8,300	261	2,166,300
ダイヘン	143,000	202	28,886,000
ヤーマン	2,000	1,181	2,362,000
JVCケンウッド	145,800	260	37,908,000
第一精工	7,500	980	7,350,000
日新電機	49,000	425	20,825,000
大崎電気	35,000	370	12,950,000
オムロン	269,300	1,521	409,605,300
日東工業	35,600	1,191	42,399,600
I D E C	32,100	611	19,613,100
ジーエス・ユアサ コーポ	466,000	332	154,712,000
サクサホールディングス	61,000	119	7,259,000
メルコホールディングス	13,300	1,489	19,803,700
テクノメディカ	13	439,500	5,713,500
日本電気	3,325,000	125	415,625,000
富士通	2,331,000	284	662,004,000
沖電気	933,000	77	71,841,000
岩崎通信機	108,000	54	5,832,000
電気興業	74,000	311	23,014,000
サンケン電気	123,000	240	29,520,000
ナカヨ通信機	24,000	243	5,832,000
アイホン	14,100	1,400	19,740,000
ルネサスエレクトロニクス	62,800	264	16,579,200
セイコーエプソン	164,900	449	74,040,100
ワコム	476	185,700	88,393,200
アルバック	48,100	495	23,809,500
アクセル	11,300	1,892	21,379,600
ピクセラ	10,300	141	1,452,300
ナナオ	20,500	1,372	28,126,000
日本信号	56,600	426	24,111,600
京三製作所	52,000	252	13,104,000
能美防災	32,000	503	16,096,000
ホーチキ	19,000	381	7,239,000

日本無線	52,000	164	8,528,000
パナソニック	2,763,400	483	1,334,722,200
シャープ	1,168,000	153	178,704,000
アンリツ	125,000	981	122,625,000
富士通ゼネラル	57,000	627	35,739,000
日立国際電気	55,000	453	24,915,000
ソニー	1,509,000	908	1,370,172,000
T D K	126,500	2,847	360,145,500
帝国通信工業	59,000	120	7,080,000
ミツミ電機	85,500	409	34,969,500
タムラ製作所	81,000	171	13,851,000
アルプス電気	190,800	379	72,313,200
池上通信機	77,000	44	3,388,000
パイオニア	342,500	166	56,855,000
日本電波工業	18,700	838	15,670,600
日本トリム	2,850	2,247	6,403,950
ローランド ディー・ ジー	10,800	899	9,709,200
日本コロムビア	240,000	22	5,280,000
フォスタ - 電機	22,900	1,127	25,808,300
クラリオン	148,000	114	16,872,000
S M K	77,000	202	15,554,000
ヨコオ	19,100	393	7,506,300
東光	122,000	181	22,082,000
ティアック	134,000	24	3,216,000
ホシデン	65,800	440	28,952,000
ヒロセ電機	42,100	8,560	360,376,000
日本航空電子	55,000	613	33,715,000
T O A	27,000	550	14,850,000
ユニデン	71,000	167	11,857,000
アルパイン	47,100	632	29,767,200
スミダコーポレーション	15,100	361	5,451,100
アイコム	13,400	1,671	22,391,400
リオン	5,500	536	2,948,000
船井電機	21,700	998	21,656,600
横河電機	262,300	867	227,414,100
新電元工業	85,000	150	12,750,000
アズビル	62,200	1,532	95,290,400
日本光電工業	48,100	2,784	133,910,400
チノール	42,000	199	8,358,000
共和電業	27,000	230	6,210,000
日本電子材料	10,600	371	3,932,600
堀場製作所	47,900	2,110	101,069,000
アドバンテスト	179,900	900	161,910,000
小野測器	29,000	341	9,889,000
エスベック	25,000	638	15,950,000
パナソニックデバイス	21,700	302	6,553,400
キーエンス	59,400	19,040	1,130,976,000
日置電機	12,800	1,282	16,409,600
シスメックス	85,200	3,610	307,572,000
メガチップス	19,900	1,777	35,362,300
O B A R A G R O U P	17,300	902	15,604,600
日本電産コパル電子	25,300	370	9,361,000
ミヤチテクノス	10,900	485	5,286,500
東京電波	7,300	415	3,029,500
澤藤電機	13,000	181	2,353,000
デンソー	597,600	2,388	1,427,068,800
コーセル	35,300	989	34,911,700
日立メディコ	18,000	850	15,300,000
新日本無線	15,000	144	2,160,000
オブテックス	15,600	854	13,322,400
千代田インテグレ	11,900	798	9,496,200
スタンレー電気	161,300	1,101	177,591,300

岩崎電気	89,000	104	9,256,000	
ウシオ電機	146,700	866	127,042,200	
岡谷電機	13,900	298	4,142,200	
ヘリオステクノH	21,200	144	3,052,800	
日本セラミック	15,900	859	13,658,100	
日本デジタル研究所	20,300	810	16,443,000	
古河電池	17,000	336	5,712,000	
双信電機	12,200	286	3,489,200	
山一電機	25,100	115	2,886,500	
図研	16,000	508	8,128,000	
日本電子	90,000	156	14,040,000	
カシオ	230,500	537	123,778,500	
ファナック	251,800	12,170	3,064,406,000	
日本シイエムケイ	52,000	241	12,532,000	
エンプラス	12,200	2,692	32,842,400	
ローム	119,200	2,490	296,808,000	
浜松ホトニクス	94,300	2,592	244,425,600	
三井ハイテック	32,000	502	16,064,000	
新光電気工業	81,500	484	39,446,000	
京セラ	201,100	6,490	1,305,139,000	
協栄産業	30,000	129	3,870,000	
太陽誘電	108,500	613	66,510,500	
村田製作所	253,700	3,805	965,328,500	
ユーシン	33,500	339	11,356,500	
双葉電子工業	41,400	1,022	42,310,800	
日東電工	208,800	3,350	699,480,000	
北陸電気工業	99,000	80	7,920,000	
東海理化電機	56,600	932	52,751,200	
ニチコン	76,100	493	37,517,300	
日本ケミコン	139,000	105	14,595,000	
K O A	30,500	620	18,910,000	
三井造船	936,000	90	84,240,000	
日立造船	957,000	86	82,302,000	
佐世保重工業	158,000	66	10,428,000	
三菱重工業	4,054,000	344	1,394,576,000	
川崎重工業	1,757,000	157	275,849,000	
I H I	1,652,000	177	292,404,000	
日本車輛	89,000	266	23,674,000	
日本輸送機	30,000	210	6,300,000	
近畿車輛	37,000	243	8,991,000	
島根銀行	5,700	1,029	5,865,300	
日産自動車	3,077,200	666	2,049,415,200	
いすゞ自動車	1,529,000	381	582,549,000	
トヨタ自動車	3,136,500	2,934	9,202,491,000	*
日野自動車	345,000	552	190,440,000	
三菱自動車工業	5,408,000	68	367,744,000	
エフテック	8,400	1,210	10,164,000	
武蔵精密工業	23,400	1,504	35,193,600	
日産車体	71,000	840	59,640,000	
新明和工業	108,000	391	42,228,000	
極東開発工業	41,700	605	25,228,500	
日信工業	44,300	1,005	44,521,500	
トビー工業	181,000	145	26,245,000	
ティラド	88,000	162	14,256,000	
曙ブレーキ	122,700	319	39,141,300	
タチエス	31,500	1,280	40,320,000	
N O K	116,900	1,136	132,798,400	
フタバ産業	68,600	287	19,688,200	
カヤバ工業	167,000	260	43,420,000	
シロキ工業	54,000	169	9,126,000	
市光工業	58,000	107	6,206,000	
大同メタル工業	37,000	497	18,389,000	

プレス工業	111,000	285	31,635,000
カルソニックカンセイ	143,000	285	40,755,000
太平洋工業	49,400	427	21,093,800
ケーヒン	50,000	924	46,200,000
河西工業	30,000	294	8,820,000
アイシン精機	199,100	2,190	436,029,000
富士機工	28,000	192	5,376,000
マ ッ ダ	3,245,000	90	292,050,000
ダイハツ	224,000	1,368	306,432,000
今仙電機製作所	17,700	877	15,522,900
本田技研	2,040,700	2,338	4,771,156,600
スズキ	505,600	1,624	821,094,400
富士重工業	764,000	694	530,216,000
ヤマハ発動機	367,700	734	269,891,800
ショーワ	51,400	708	36,391,200
小糸製作所	121,000	887	107,327,000
T B K	24,000	356	8,544,000
エクセディ	32,800	1,441	47,264,800
ミツバ	45,000	453	20,385,000
豊田合成	68,300	1,505	102,791,500
愛三工業	25,100	604	15,160,400
ヨロズ	14,500	1,144	16,588,000
エフ・シー・シー	39,500	1,248	49,296,000
新家工業	57,000	106	6,042,000
シマノ	97,500	5,350	521,625,000
タカタ	43,700	1,366	59,694,200
テイ・エス テック	51,000	1,190	60,690,000
小野建	20,900	626	13,083,400
はるやま商事	10,000	390	3,900,000
佐島電機	18,000	413	7,434,000
カップ・クリエイトHD	17,650	1,700	30,005,000
エコートレーディング	6,400	677	4,332,800
伯東	14,800	685	10,138,000
コンドーテック	17,000	463	7,871,000
中山福	14,500	612	8,874,000
ライトオン	17,800	687	12,228,600
ナガイレーベン	31,700	1,190	37,723,000
ジーンズメイト	7,600	302	2,295,200
三菱食品	21,900	1,893	41,456,700
良品計画	25,300	4,930	124,729,000
三城ホールディングス	29,600	417	12,343,200
松田産業	17,700	1,056	18,691,200
メディバルHD	257,000	1,018	261,626,000
アドヴァン	14,600	794	11,592,400
S P K	6,000	1,300	7,800,000
アズワン	15,600	1,659	25,880,400
スズデン	8,000	435	3,480,000
尾家産業	6,800	824	5,603,200
シモジマ	14,700	948	13,935,600
ドウシシャ	11,500	2,132	24,518,000
コナカ	27,900	687	19,167,300
高速	14,400	647	9,316,800
ハウス ローゼ	2,900	1,245	3,610,500
G - 7ホールディングス	6,000	400	2,400,000
イオン北海道	14,900	366	5,453,400
コジマ	31,700	204	6,466,800
ヒマラヤ	6,900	640	4,416,000
コーナン商事	25,800	956	24,664,800

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
黒田電気	29,500	917	27,051,500	
ネットワンシステムズ	107,700	860	92,622,000	
エコス	8,600	500	4,300,000	
ワタミ	28,300	1,754	49,638,200	
マルシェ	6,600	715	4,719,000	
ドン・キホーテ	63,600	2,866	182,277,600	
丸文	19,500	322	6,279,000	
メガネトップ	34,100	858	29,257,800	
西松屋チェーン	52,200	619	32,311,800	
ゼンショーホールディングス	90,900	957	86,991,300	
ハビネット	12,700	646	8,204,200	
幸楽苑	15,000	1,173	17,595,000	
トーマンエレクトロニクス	11,100	915	10,156,500	
ハークスレイ	5,900	599	3,534,100	
サイゼリヤ	35,300	1,116	39,394,800	
エクセル	11,200	674	7,548,800	
マルカキカイ	7,800	922	7,191,600	
アルゴグラフィックス	9,000	988	8,892,000	
ガリバーインターナショナル	7,280	2,706	19,699,680	
日本エム・ディ・エム	20,400	243	4,957,200	
ポブラ	6,900	504	3,477,600	
ユナイテッドアローズ	25,700	1,906	48,984,200	
進和	14,400	861	12,398,400	
エスケイジャパン	5,500	241	1,325,500	
ダイトエレクトロン	11,400	317	3,613,800	
ハイデイ日高	12,700	1,243	15,786,100	
シークス	15,100	1,110	16,761,000	
京都きもの友禅	16,000	957	15,312,000	
コロワイド	79,500	667	53,026,500	
田中商事	7,900	411	3,246,900	
オーハシテクニカ	13,800	544	7,507,200	
壱番屋	9,700	2,481	24,065,700	
マクニカ	12,300	1,563	19,224,900	
白銅	8,100	724	5,864,400	
トップカルチャー	9,200	374	3,440,800	
スギホールディングス	42,800	2,697	115,431,600	
島津製作所	289,000	521	150,569,000	
J M S	37,000	248	9,176,000	
クボテック	52	14,480	752,960	
モリテックス	5,300	206	1,091,800	
長野計器	17,100	629	10,755,900	
プイ・テクノロジー	43	136,900	5,886,700	
スター精密	39,000	652	25,428,000	
東京計器	84,000	115	9,660,000	
愛知時計	26,000	272	7,072,000	
日本電産トーソク	11,800	493	5,817,400	
東京精密	43,400	1,002	43,486,800	
ニコン	421,400	1,913	806,138,200	
トプコン	55,600	358	19,904,800	
オリンパス	285,200	1,481	422,381,200	
理研計器	19,800	509	10,078,200	
大日本スクリーン	229,000	393	89,997,000	
キヤノン電子	22,200	1,663	36,918,600	
タムロン	18,600	2,161	40,194,600	
H O Y A	588,000	1,635	961,380,000	
ノーリツ鋼機	22,500	323	7,267,500	
エー・アンド・デイ	23,800	250	5,950,000	

キヤノン	1,502,500	2,457	3,691,642,500
リコー	727,000	690	501,630,000
日本電産コパル	18,900	590	11,151,000
シチズンホールディングス	289,300	355	102,701,500
リズム時計	109,000	151	16,459,000
大研医器	3,000	1,160	3,480,000
パラマウントベッドHD	20,800	2,570	53,456,000
SHOBI	5,300	392	2,077,600
永大産業	32,000	334	10,688,000
ダンロップスポーツ	13,300	996	13,246,800
バンダイナムコHLDGS	250,000	1,252	313,000,000
共立印刷	28,300	269	7,612,700
フランスベッドHLDGS	152,000	164	24,928,000
パイロットコーポレーション	211	140,900	29,729,900
エイベックス・グループHD	45,000	1,465	65,925,000
トッパン・フォームズ	51,900	749	38,873,100
フジシールインターナショナル	27,100	1,569	42,519,900
タカラトミー	79,500	428	34,026,000
廣済堂	20,500	234	4,797,000
アーケ	81,400	147	11,965,800
レック	7,600	963	7,318,800
タカノ	10,000	380	3,800,000
プロネクサス	25,700	475	12,207,500
ホクシン	17,600	198	3,484,800
ウッドワン	41,000	223	9,143,000
大建工業	100,000	167	16,700,000
きもと	20,700	400	8,280,000
凸版印刷	735,000	420	308,700,000
大日本印刷	737,000	517	381,029,000
図書印刷	39,000	119	4,641,000
共同印刷	82,000	165	13,530,000
日本写真印刷	40,600	580	23,548,000
光村印刷	3,000	237	711,000
藤森工業	18,200	1,791	32,596,200
宝印刷	14,200	569	8,079,800
前澤化成工業	18,100	832	15,059,200
アシックス	225,200	1,084	244,116,800
ツツミ	12,100	1,850	22,385,000
ジェイエスピー	16,500	998	16,467,000
ニチハ	28,200	907	25,577,400
ローランド	25,100	511	12,826,100
エフピコ	11,200	6,070	67,984,000
小松ウオール工業	9,100	1,098	9,991,800
ヤマハ	177,900	723	128,621,700
河合楽器	90,000	157	14,130,000
クリナップ	28,300	491	13,895,300
ピジョン	21,300	3,475	74,017,500
天馬	20,200	780	15,756,000
兼松日産農林	38,000	122	4,636,000
キングジム	20,500	620	12,710,000
リンテック	46,000	1,363	62,698,000
TASAKI	5,100	273	1,392,300
信越ポリマー	50,000	263	13,150,000
東リ	67,000	172	11,524,000
イトーキ	50,700	475	24,082,500
任天堂	138,300	10,220	1,413,426,000
三菱鉛筆	20,000	1,409	28,180,000
松風	12,200	820	10,004,000
タカラスタンダ-ド	112,000	613	68,656,000
コクヨ	125,900	625	78,687,500

ナカバヤシ	52,000	167	8,684,000
ニフコ	56,500	1,703	96,219,500
グロープライド	119,000	86	10,234,000
岡村製作所	84,000	593	49,812,000
日本バルカー	99,000	208	20,592,000
MUTOHホールディングス	25,000	162	4,050,000
伊藤忠	1,904,700	758	1,443,762,600
丸紅	2,089,000	487	1,017,343,000
スクロール	31,200	274	8,548,800
高島	41,000	254	10,414,000
F & A アクアホールディングス	18,200	921	16,762,200
三陽商会	133,000	233	30,989,000
長瀬産業	135,200	831	112,351,200
ナイガイ	72,000	46	3,312,000
蝶理	15,100	824	12,442,400
豊田通商	266,100	1,645	437,734,500
オンワードホールディングス	156,000	592	92,352,000
三共生興	41,100	262	10,768,200
兼松	509,000	87	44,283,000
美津濃	120,000	380	45,600,000
ツカモトコーポレーション	42,000	122	5,124,000
ファミリーマート	73,300	3,745	274,508,500
ルック	39,000	384	14,976,000
三井物産	2,060,800	1,090	2,246,272,000
日本紙パルプ	125,000	229	28,625,000
東京エレクトロン	203,500	3,435	699,022,500
日立ハイテクノロジーズ	72,300	1,772	128,115,600
カメイ	31,000	706	21,886,000
東都水産	41,000	116	4,756,000
スターゼン	82,000	228	18,696,000
セイコーHD	140,000	201	28,140,000
山善	92,200	451	41,582,200
椿本興業	23,000	215	4,945,000
住友商事	1,409,200	1,043	1,469,795,600
日本ユニシス	57,500	537	30,877,500
内田洋行	51,000	213	10,863,000
三菱商事	1,738,700	1,343	2,335,074,100
第一実業	51,000	308	15,708,000
キヤノンマーケティングJPN	79,400	1,048	83,211,200
西華産業	86,000	210	18,060,000
佐藤商事	21,500	471	10,126,500
菱洋エレクトロ	26,400	766	20,222,400
東京産業	25,000	243	6,075,000
ユアサ商事	246,000	124	30,504,000
神鋼商事	62,000	138	8,556,000
阪和興業	239,000	263	62,857,000
カナデン	2,000	487	974,000
菱電商事	36,000	452	16,272,000
ニプロ	125,400	519	65,082,600
フルサト工業	14,300	690	9,867,000
岩谷産業	266,000	280	74,480,000
すてきナイスグループ	105,000	156	16,380,000
昭光通商	90,000	114	10,260,000
二チモウ	35,000	154	5,390,000
極東貿易	29,000	118	3,422,000
イワキ	37,000	161	5,957,000
兼松エレクトロニクス	15,500	861	13,345,500
三愛石油	57,000	342	19,494,000
稲畑産業	64,000	474	30,336,000

G S Iクレオス	58,000	98	5,684,000
明和産業	18,900	286	5,405,400
ゴ-ルドウイン	57,000	462	26,334,000
ユニ・チャ-ム	139,800	4,365	610,227,000
デサント	63,000	452	28,476,000
ヤマトインタ-ナショナル	16,300	360	5,868,000
東邦ホールディングス	76,400	1,608	122,851,200
サンゲツ	42,400	2,076	88,022,400
ミツウロコグループ	38,700	513	19,853,100
シナネン	53,000	333	17,649,000
伊藤忠エネクス	53,000	403	21,359,000
サンリオ	60,200	2,610	157,122,000
サンワ テクノス	11,600	562	6,519,200
リョ-サン	39,100	1,364	53,332,400
新光商事	26,400	671	17,714,400
トーホ-	53,000	301	15,953,000
三信電気	34,200	578	19,767,600
東陽テクニカ	34,900	806	28,129,400
モスフード サービス	31,400	1,525	47,885,000
加賀電子	26,100	718	18,739,800
三益半導体	21,800	612	13,341,600
ソーダニツカ	2,000	334	668,000
立花エレテック	14,700	615	9,040,500
木曽路	27,400	1,620	44,388,000
千趣会	43,200	496	21,427,200
タカキユー	18,000	224	4,032,000
ケーヨー	45,000	415	18,675,000
アデランス	30,300	1,107	33,542,100
上新電機	52,000	862	44,824,000
日本瓦斯	22,800	1,218	27,770,400
ベスト電器	74,500	121	9,014,500
マルエツ	49,000	253	12,397,000
ロイヤルホールディングス	40,200	959	38,551,800
東天紅	17,000	205	3,485,000
いなげや	26,900	944	25,393,600
島忠	53,900	1,535	82,736,500
チヨダ	31,200	2,129	66,424,800
ライフコーポレーション	15,000	1,185	17,775,000
カスミ	49,200	507	24,944,400
リンガーハット	21,900	1,018	22,294,200
さが美	19,000	103	1,957,000
MR MAX	24,100	304	7,326,400
テンアライド	19,300	266	5,133,800
A O K Iホールディングス	21,000	1,659	34,839,000
オークワ	34,000	1,060	36,040,000
コメリ	32,600	1,906	62,135,600
青山商事	65,700	1,531	100,586,700
しまむら	27,700	8,070	223,539,000
C F Sコーポレーション	16,100	354	5,699,400
高島屋	323,000	510	164,730,000
松屋	48,000	844	40,512,000
エイチ・ツー・オーリテイ リング	124,000	832	103,168,000
丸栄	40,000	78	3,120,000
ニッセンHD	42,700	313	13,365,100
パルコ	43,200	797	34,430,400
丸井グループ	311,300	537	167,168,100
クレディセゾン	195,000	1,782	347,490,000
原信ナルスH L D G S	13,300	1,444	19,205,200
井筒屋	129,000	47	6,063,000
ダイエー	147,300	144	21,211,200
イズミヤ	83,000	384	31,872,000
イオン	841,300	871	732,772,300

ユニー	205,700	536	110,255,200	
イズミ	60,600	1,951	118,230,600	
東武ストア	33,000	252	8,316,000	
平和堂	43,900	1,047	45,963,300	

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
フジ	26,700	1,749	46,698,300	
ヤオコー	10,500	3,020	31,710,000	
ゼビオ	28,700	1,511	43,365,700	
ケーズホールディングス	59,500	1,914	113,883,000	
P a l t a c	25,000	1,148	28,700,000	
O L Y M P I C	15,900	630	10,017,000	
日産東京販売HD	35,000	308	10,780,000	
新生銀行	1,858,000	105	195,090,000	
あおぞら銀行	743,000	234	173,862,000	
三菱UFJフィナンシャルG	18,076,800	357	6,453,417,600	
りそなホールディングス	2,076,700	342	710,231,400	
三井住友トラストHD	4,679,000	220	1,029,380,000	
三井住友フィナンシャルG	1,812,500	2,355	4,268,437,500	
第四銀行	307,000	248	76,136,000	
北越銀行	247,000	149	36,803,000	
西日本シティ銀行	837,000	173	144,801,000	
千葉銀行	942,000	455	428,610,000	
横浜銀行	1,519,000	365	554,435,000	
常陽銀行	913,000	374	341,462,000	
群馬銀行	539,000	374	201,586,000	
武蔵野銀行	38,500	2,310	88,935,000	
千葉興業銀行	45,200	410	18,532,000	
筑波銀行	99,300	254	25,222,200	
東京都民銀行	45,300	671	30,396,300	
七十七銀行	374,000	302	112,948,000	
青森銀行	179,000	238	42,602,000	
秋田銀行	164,000	210	34,440,000	
山形銀行	146,000	332	48,472,000	
岩手銀行	16,100	3,715	59,811,500	
東邦銀行	202,000	252	50,904,000	
東北銀行	131,000	112	14,672,000	
みちのく銀行	120,000	150	18,000,000	
ふくおかフィナンシャルG	969,000	307	297,483,000	
静岡銀行	700,000	789	552,300,000	
十六銀行	299,000	255	76,245,000	
スルガ銀行	233,000	919	214,127,000	
八十二銀行	440,000	416	183,040,000	
山梨中央銀行	146,000	307	44,822,000	
大垣共立銀行	319,000	273	87,087,000	
福井銀行	206,000	176	36,256,000	
北國銀行	277,000	279	77,283,000	
清水銀行	8,100	2,281	18,476,100	
滋賀銀行	224,000	484	108,416,000	
南都銀行	222,000	377	83,694,000	
百五銀行	216,000	334	72,144,000	
京都銀行	427,000	643	274,561,000	
三重銀行	100,000	167	16,700,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,671,000	116	193,836,000	
広島銀行	704,000	262	184,448,000	
山陰合同銀行	140,000	532	74,480,000	
中国銀行	184,000	1,069	196,696,000	
鳥取銀行	77,000	151	11,627,000	
伊予銀行	255,000	619	157,845,000	
百十四銀行	262,000	298	78,076,000	
四国銀行	172,000	187	32,164,000	
阿波銀行	210,000	475	99,750,000	

鹿児島銀行	154,000	489	75,306,000
大分銀行	155,000	245	37,975,000
宮崎銀行	159,000	191	30,369,000
肥後銀行	183,000	476	87,108,000
佐賀銀行	145,000	176	25,520,000
十八銀行	153,000	196	29,988,000
沖縄銀行	18,100	3,300	59,730,000
琉球銀行	50,400	994	50,097,600
八千代銀行	12,300	1,445	17,773,500
セブン銀行	895,600	234	209,570,400
みずほフィナンシャルG	30,711,100	121	3,716,043,100
紀陽ホールディングス	953,000	109	103,877,000
山口フィナンシャルG	238,000	630	149,940,000
アクリーティブ	131	8,520	1,116,120
芙蓉総合リース	22,700	2,136	48,487,200
興銀リース	33,200	1,895	62,914,000
東京センチュリーリース	64,000	1,487	95,168,000
S B Iホールディングス	252,790	520	131,450,800
日本証券金融	98,800	337	33,295,600
大阪証券金融	29,300	157	4,600,100
アイフル	217,100	156	33,867,600
日本アジア投資	173,000	44	7,612,000
ポケットカード	24,200	315	7,623,000
長野銀行	79,000	151	11,929,000
名古屋銀行	216,000	251	54,216,000
北洋銀行	358,600	180	64,548,000
愛知銀行	8,600	3,960	34,056,000
第三銀行	136,000	138	18,768,000
中京銀行	99,000	163	16,137,000
東日本銀行	116,000	162	18,792,000
大光銀行	85,000	200	17,000,000
愛媛銀行	151,000	200	30,200,000
トマト銀行	94,000	136	12,784,000
みなと銀行	217,000	151	32,767,000
京葉銀行	196,000	349	68,404,000
関西アーバン銀行	333,000	98	32,634,000
栃木銀行	120,000	262	31,440,000
北日本銀行	7,500	2,165	16,237,500
東和銀行	238,000	73	17,374,000
福島銀行	275,000	49	13,475,000
大東銀行	152,000	65	9,880,000
リコーリース	16,500	1,833	30,244,500
イオン クレジットサービ ス	97,800	1,703	166,553,400
アコム	47,910	2,122	101,665,020
ジャックス	145,000	286	41,470,000
オリコ	460,000	137	63,020,000
日立キャピタル	46,900	1,455	68,239,500
オリックス	124,180	7,930	984,747,400
三菱UFJリース	60,510	3,410	206,339,100
ジャフコ	29,000	1,623	47,067,000
トモニホールディングス	183,000	315	57,645,000
大和証券G本社	2,365,000	294	695,310,000
野村ホールディングス	5,166,700	267	1,379,508,900
岡三証券グループ	203,000	275	55,825,000
丸三証券	80,700	216	17,431,200
東洋証券	89,000	128	11,392,000
東海東京HD	274,000	258	70,692,000
光世証券	58,000	69	4,002,000
水戸証券	70,000	139	9,730,000
いちよし証券	53,800	367	19,744,600
松井証券	141,800	492	69,765,600

N K S Jホールディングス	499,200	1,507	752,294,400
だいこう証券ピジ	15,100	287	4,333,700
マネックスG	1,795	12,670	22,742,650
カブドットコム証券	97,500	218	21,255,000
極東証券	32,200	520	16,744,000
岩井コスモホールディング	23,000	265	6,095,000
フィデアホール	136,900	155	21,219,500
池田泉州HD	196,900	465	91,558,500
M S & A D	713,500	1,349	962,511,500
S O N Y F H	228,700	1,372	313,776,400
小林洋行	5,200	173	899,600
第一生命	12,764	88,600	1,130,890,400
東京海上HD	866,800	2,051	1,777,806,800
アサクス	34	74,400	2,529,600
N E Cキャピタルソ リューション	8,100	1,066	8,634,600
T & Dホールディングス	869,900	827	719,407,300
三井不動産	1,059,000	1,588	1,681,692,000
三菱地所	1,671,000	1,530	2,556,630,000
平和不動産	45,400	909	41,268,600
東京建物	455,000	326	148,330,000
ダイビル	70,300	565	39,719,500
東急不動産	481,000	426	204,906,000
京阪神ビルディング	29,100	357	10,388,700
住友不動産	572,000	2,110	1,206,920,000
東宝不動産	25,900	413	10,696,700
太平洋興発	83,000	68	5,644,000
大京	367,000	194	71,198,000
テーオーシー	92,900	378	35,116,200
東京楽天地	27,000	287	7,749,000
レオパレス21	188,500	246	46,371,000
フジ住宅	30,700	420	12,894,000
空港施設	25,400	362	9,194,800
明和地所	12,200	347	4,233,400
住友不動産販売	8,620	3,715	32,023,300
ゴールドクレスト	21,570	1,176	25,366,320
東栄住宅	16,300	832	13,561,600
リロ・ホールディング	7,800	2,576	20,092,800
日本エスリード	9,500	648	6,156,000
東急リバブル	21,700	1,048	22,741,600
飯田産業	22,500	719	16,177,500
日神不動産	14,000	438	6,132,000
アーネストワン	39,500	1,161	45,859,500
タカラレーベン	27,500	918	25,245,000
サンヨーハウジ名古屋	126	81,000	10,206,000
イオンモール	108,800	2,007	218,361,600
フージャースコーポレー ション	366	53,100	19,434,600
タクトホーム	126	92,600	11,667,600
ランド	39,400	9	354,600
トーセイ	310	29,340	9,095,400
エヌ・ティ・ティ都市開 発	1,483	62,000	91,946,000
サンフロンティア不動産	197	17,150	3,378,550
ランドビジネス	160	14,010	2,241,600
グランディハウス	5,400	568	3,067,200
東武鉄道	1,374,000	414	568,836,000
相鉄ホールディングス	389,000	259	100,751,000
東京急行	1,424,000	385	548,240,000
京浜急行	622,000	729	453,438,000
小田急電鉄	776,000	819	635,544,000
京王電鉄	677,000	588	398,076,000

京成電鉄	389,000	677	263,353,000
富士急行	67,000	477	31,959,000
新京成電鉄	23,000	351	8,073,000
東日本旅客鉄道	420,600	5,350	2,250,210,000
西日本旅客鉄道	210,400	3,300	694,320,000
東海旅客鉄道	201,100	6,900	1,387,590,000
西日本鉄道	314,000	336	105,504,000
ハマキョウレックス	6,900	2,453	16,925,700
サカイ引越センター	4,500	1,690	7,605,000
近畿日本鉄道	2,185,000	310	677,350,000
阪急阪神HLDGS	1,623,000	420	681,660,000
南海電鉄	505,000	347	175,235,000
京阪電鉄	543,000	370	200,910,000
名糖運輸	10,400	578	6,011,200
名古屋鉄道	846,000	210	177,660,000
日本通運	958,000	290	277,820,000
ヤマトホールディングス	492,100	1,201	591,012,100
山九	294,000	277	81,438,000
日新	92,000	192	17,664,000
丸運	12,500	185	2,312,500
丸全昭和運輸	82,000	224	18,368,000
センコー	97,000	307	29,779,000
トナミホールディングス	50,000	183	9,150,000
日本梱包運輸	72,500	945	68,512,500
日石輸送	28,000	179	5,012,000
福山通運	147,000	416	61,152,000
セイノーホールディングス	187,000	461	86,207,000
神奈川中央交通	25,000	449	11,225,000
日立物流	50,300	1,285	64,635,500
日本郵船	1,915,000	146	279,590,000
商船三井	1,268,000	180	228,240,000
川崎汽船	916,000	97	88,852,000
NSユナイテッド海運	104,000	82	8,528,000
乾汽船	26,300	177	4,655,100
明治海運	21,800	281	6,125,800
飯野海運	117,000	226	26,442,000
共栄タンカー	20,000	154	3,080,000
第一中央汽船	156,000	64	9,984,000
全日本空輸	4,392,000	157	689,544,000
パスコ	22,000	220	4,840,000
三菱倉庫	172,000	932	160,304,000
三井倉庫	113,000	244	27,572,000
住友倉庫	177,000	326	57,702,000
渋沢倉庫	58,000	223	12,934,000
ヤマタネ	120,000	99	11,880,000
東陽倉庫	38,000	169	6,422,000
日本トランスシティ	51,000	271	13,821,000
ケイヒン	46,000	86	3,956,000
安田倉庫	19,600	491	9,623,600
東洋埠頭	72,000	121	8,712,000
宇徳	16,300	219	3,569,700
上組	268,000	634	169,912,000
サンリツ	1,700	504	856,800
キムラユニティー	5,900	722	4,259,800
キューソー流通システム	7,300	899	6,562,700
郵船ロジスティクス	18,900	638	12,058,200
近鉄エクスプレス	21,600	2,267	48,967,200
東海運	15,400	204	3,141,600
エーアイティー	2,200	1,169	2,571,800
東京放送HD	143,100	703	100,599,300
日本テレビHLD S	209,500	989	207,195,500
テレビ朝日	60,500	1,022	61,831,000

スカパーJ S A T H D	1,817	35,100	63,776,700
テレビ東京H D	15,500	879	13,624,500
アイ・ティー・シーネット ワーク	20,800	620	12,896,000
イー・アクセス	1,817	39,600	71,953,200
N E Cモバイリング	8,700	3,025	26,317,500
日本電信電話	1,099,400	3,815	4,194,211,000
K D D I	370,500	5,910	2,189,655,000
光通信	21,900	4,040	88,476,000
エヌ・ティ・ティ・ドコ モ	19,672	122,700	2,413,754,400
G M Oインターネット	79,600	511	40,675,600
学研ホールディングス	72,000	204	14,688,000
ゼンリン	34,500	999	34,465,500
昭文社	13,700	516	7,069,200
角川グループH L D G S	22,600	2,361	53,358,600
インプレスホールディン グス	20,000	122	2,440,000
東京電力	1,931,100	126	243,318,600
中部電力	797,100	949	756,447,900
関西電力	987,200	597	589,358,400
中国電力	334,400	968	323,699,200
北陸電力	236,900	892	211,314,800
東北電力	604,300	632	381,917,600
四国電力	217,800	824	179,467,200
九州電力	534,300	652	348,363,600
北海道電力	226,500	683	154,699,500
沖縄電力	14,500	2,670	38,715,000
電源開発	150,100	2,056	308,605,600
東京瓦斯	2,904,000	423	1,228,392,000
大阪瓦斯	2,347,000	336	788,592,000
東邦瓦斯	615,000	503	309,345,000
北海道瓦斯	44,000	228	10,032,000
西部瓦斯	273,000	209	57,057,000
静岡瓦斯	63,000	584	36,792,000
アイネット	10,600	571	6,052,600
松竹	157,000	756	118,692,000
東宝	170,600	1,368	233,380,800
エイチ・アイ・エス	20,600	2,493	51,355,800
東映	100,000	423	42,300,000
A O I P r o .	7,500	535	4,012,500
N T Tデータ	1,474	248,000	365,552,000
共立メンテナンス	12,600	1,662	20,941,200
イチネンホールディン グス	27,000	442	11,934,000
建設技術研究所	14,100	468	6,598,800
インファーマシーズ	13,200	5,350	70,620,000
燦ホールディングス	5,700	1,307	7,449,900
スバル興業	3,000	245	735,000
東京テアトル	100,000	100	10,000,000
よみうりランド	50,000	246	12,300,000
東京都競馬	197,000	113	22,261,000
常盤興産	81,000	101	8,181,000
カナモト	30,000	957	28,710,000
東京ドーム	202,000	258	52,116,000
D T S	24,700	1,063	26,256,100
スクウェア・エニックス ・H D	77,900	1,078	83,976,200
シーイーシー	14,600	432	6,307,200
カブコン	45,700	1,499	68,504,300
アゴーラ・ホスピタリ ティーG	105,000	16	1,680,000
日本空港ビルデング	76,200	898	68,427,600
トランス・コスモス	32,900	892	29,346,800

乃村工藝社	50,000	244	12,200,000
ジャステック	14,900	532	7,926,800
S C S K	48,500	1,335	64,747,500
藤田観光	65,000	259	16,835,000
近畿日本ツーリスト	80,000	95	7,600,000
日本管財	9,500	1,454	13,813,000
トーカイ	10,200	2,020	20,604,000
白洋舎	5,000	208	1,040,000
セコム	245,300	3,985	977,520,500
日本システムウエア	7,800	305	2,379,000
セントラル警備保障	11,900	779	9,270,100
アイネス	28,800	466	13,420,800
丹青社	24,000	229	5,496,000
メイテック	39,200	1,684	66,012,800
T K C	22,100	1,550	34,255,000
アサツー ディ・ケイ	41,700	1,848	77,061,600
富士ソフト	31,300	1,592	49,829,600
応用地質	26,600	905	24,073,000
船井総合研究所	26,900	523	14,068,700
N S D	43,500	729	31,711,500
進学会	12,900	296	3,818,400
丸紅建材リース	24,000	110	2,640,000
コナミ	107,700	1,695	182,551,500
ベネッセホールディングス	76,900	3,615	277,993,500
イオンディライト	28,500	1,520	43,320,000
ナック	6,400	1,771	11,334,400
福井コンピュータH L D S	1,500	405	607,500
ニチイ学館	49,300	721	35,545,300
ダイセキ	40,700	1,110	45,177,000
日鐵商事	53,000	176	9,328,000
元気寿司	7,600	997	7,577,200
トラスコ中山	30,100	1,359	40,905,900
ヤマダ電機	116,050	3,350	388,767,500
オートバックスセブン	27,000	3,235	87,345,000
アークランドサカモト	15,500	1,091	16,910,500
ニトリホールディングス	47,250	6,900	326,025,000
グルメ杵屋	17,000	504	8,568,000
愛眼	19,400	287	5,567,800
吉野家ホールディングス	649	99,900	64,835,100
加藤産業	34,600	1,416	48,993,600
イノテック	19,400	322	6,246,800
イエローハット	22,400	1,056	23,654,400
富士エレクトロニクス	12,700	1,060	13,462,000
松屋フーズ	11,600	1,439	16,692,400
J B C Cホールディングス	19,200	517	9,926,400
J Kホールディングス	20,100	389	7,818,900
サガミチェーン	28,000	606	16,968,000
日伝	10,000	2,106	21,060,000
北沢産業	11,000	151	1,661,000
杉本商事	13,300	732	9,735,600
因幡電機産業	28,300	2,073	58,665,900
住金物産	113,000	183	20,679,000
プレナス	26,700	1,309	34,950,300
ミニストップ	17,800	1,263	22,481,400
アークス	34,800	1,676	58,324,800
パロー	47,400	1,294	61,335,600
ミスミグループ本社	88,600	1,845	163,467,000
江守商事	5,100	792	4,039,200
アルテック	12,100	153	1,851,300
ベルク	11,800	1,159	13,676,200

大 庄	11,400	1,004	11,445,600
タキヒヨー	36,000	424	15,264,000
ファーストリテイリング	47,800	16,040	766,712,000
ソフトバンク	1,081,500	2,395	2,590,192,500
スズケン	91,800	2,549	233,998,200
サンドラッグ	45,400	2,734	124,123,600
東京デリカ	7,800	1,136	8,860,800
ジェコス	16,700	466	7,782,200
ヤマザワ	6,300	1,323	8,334,900
やまや	4,000	1,119	4,476,000
ペルーナ	29,650	572	16,959,800
合計	372,133,221		237,467,178,455

* 担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成24年10月31日現在

資産総額	1,223,865,103円
負債総額	1,265,176円
純資産総額（ - ）	1,222,599,927円
発行済数量	1,230,988,505口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9932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24年10月31日現在

資産総額	264,665,899,737円
負債総額	6,952,087,440円
純資産総額（ - ）	257,713,812,297円
発行済数量	254,358,489,986口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0132円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等におい

て、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託者と協議のうえ、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。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動
該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

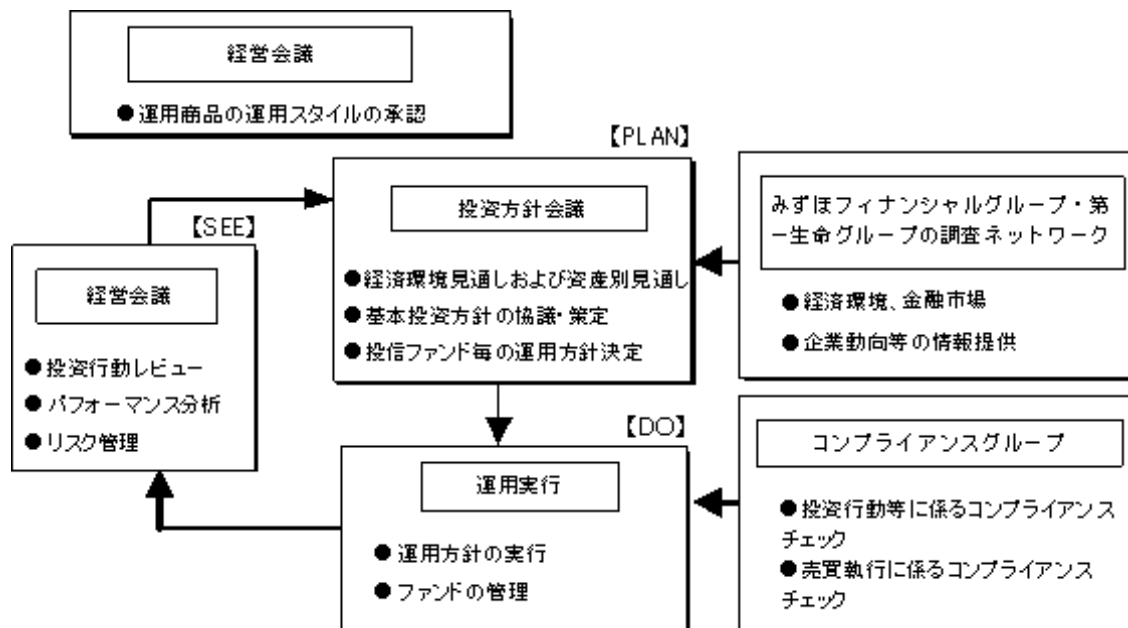
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成24年10月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行う

とともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。平成24年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は283本(親投資信託を除く)あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位:円)
単位型株式投資信託	13	52,594,425,775
追加型株式投資信託	261	3,979,056,524,755
単位型公社債投資信託	8	74,506,897,396
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	135,500,379
合計	283	4,106,293,348,305

3【委託会社等の経理状況】

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

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

3．委託会社は、第27期事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	120,910	132,805
未払金	1,479,756	1,460,128
未払収益分配金	3,223	670
未払償還金	98,362	86,391
未払手数料	1,134,992	1,088,348
その他未払金	243,178	284,718
未払費用	2 1,226,658	2 1,105,512
未払法人税等	1,706,391	1,195,056
未払消費税等	143,728	92,354
賞与引当金	575,326	574,646
その他	10,000	-
流動負債計	5,262,771	4,560,503
固定負債		
退職給付引当金	579,063	680,768
役員退職慰労引当金	100,260	56,690
固定負債計	679,324	737,458
負債合計	5,942,095	5,297,962
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	18,512,674	19,716,594
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	13,430,000	15,630,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,459,380	3,463,300
株主資本計	22,941,152	24,145,072
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216,534	136,143
評価・換算差額等計	216,534	136,143
純資産合計	23,157,686	24,281,215
負債・純資産合計	29,099,782	29,579,177

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

[次へ](#)

重要な会計方針

項目	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

追加情報

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 役員報酬の限度額

（千円）

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

3. 過年度損益修正益の内訳

第26期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

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

第27期(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

該当事項はありません。

4. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日
----------------------	----------	-----------	--------	------------	-----------

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

（リース取引関係）

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

（千円）

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

未経過リース料期末残高相当額

（千円）

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

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

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

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

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

（千円）

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

合計	1,475	-
----	-------	---

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第26期（平成23年3月31日現在）

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

第27期（平成24年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

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

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日現在）

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

第27期（平成24年3月31日現在）

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

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

（千円）

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

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

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却した其他有価証券
第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（千円）

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

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

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託
第26期（平成23年3月31日現在）

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

第27期（平成24年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（千円）

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

3. 退職給付費用に関する事項

（千円）

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

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

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税率の変更等による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	1,538,792	未払 手数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	536,163	未払 手数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
								信託報酬の 支払	3,163		

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
1株当たり純資産額	964,903円60銭	1,011,717円32銭
1株当たり当期純利益金額	185,611円60銭	142,163円33銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

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

	第28期中間会計期間末 （平成24年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	90,304
未払金	1,586,848
未払収益分配金	670
未払償還金	84,932
未払手数料	1,045,061
その他未払金	456,184
未払費用	1,144,835
未払法人税等	1,153,892
未払消費税等	94,807
前受収益	4,645
賞与引当金	592,564
流動負債計	4,667,898
固定負債	
退職給付引当金	745,286
役員退職慰労引当金	83,600
固定負債計	828,887
負債合計	5,496,785
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	18,754,087
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	16,330,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,800,793
株主資本計	23,182,565
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	73,136
評価・換算差額等計	73,136
純資産合計	23,255,702
負債・純資産合計	28,752,487

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

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

[前へ](#) [次へ](#)

重要な会計方針

項目	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。 (2) 無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 (4) 役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。

6. 外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第28期中間会計期間(自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
2. 子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。
3. その他有価証券

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

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

（金銭の信託関係）

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

1. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）	
1株当たり純資産額	968,987円 59銭
1株当たり中間純利益金額	72,895円 54銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
中間純利益	1,749,493千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,749,493千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- a . 名称
みずほ信託銀行株式会社
- b . 資本金の額
平成24年3月末日現在 247,369百万円
- c . 事業の内容
日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

（平成24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) 目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2) 目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3) 請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4) ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
（委託会社の略称： D I A M 、当ファンドの略称：パ国内株）

独立監査人の監査報告書

平成24年11月21日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式パッシブ・ファンドの平成23年10月13日から平成24年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M国内株式パッシブ・ファンドの平成24年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(中間\)へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月7日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)