

【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27年1月14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 西 惠正
【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】	上野 圭子
【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、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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、公表されません。

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る場合があります。

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27年1月15日から平成28年1月13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経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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）

（ 1 1 ） 【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

（ 1 2 ） 【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>

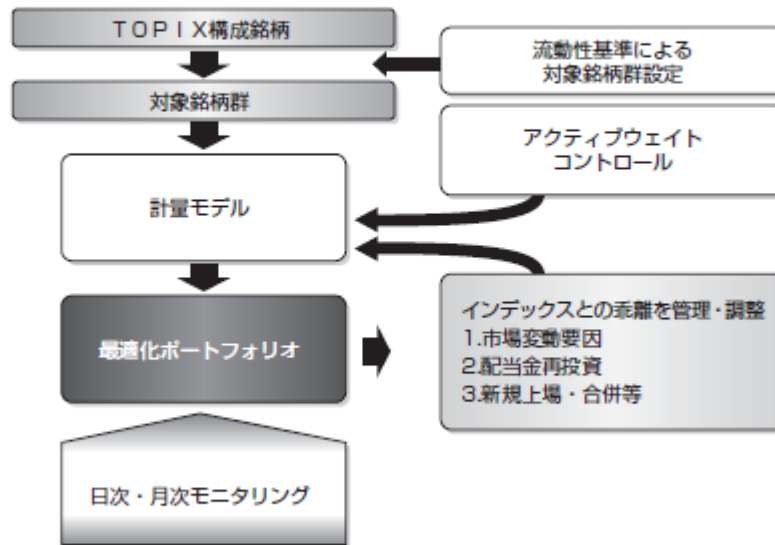
1 主に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」に投資を行い、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

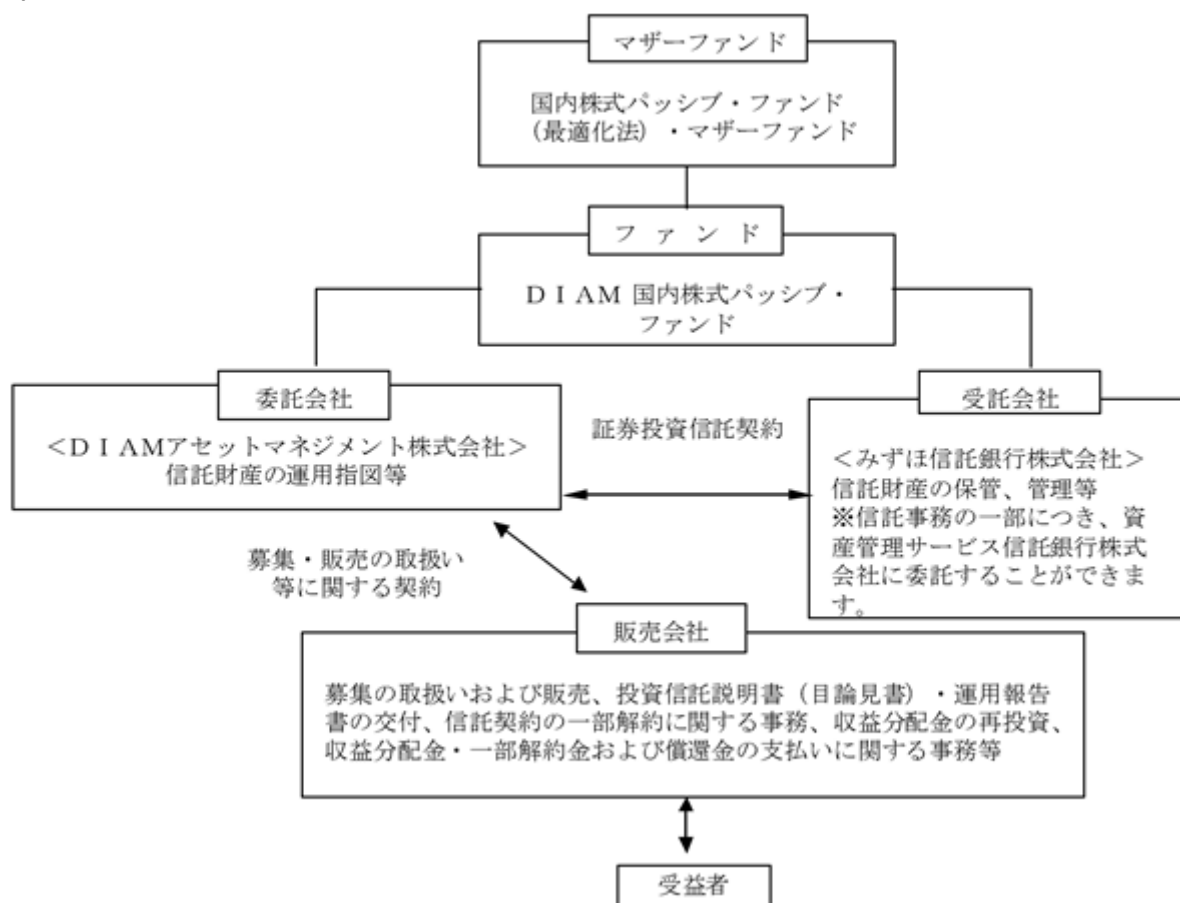
「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

（２）【ファンドの沿革】

平成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

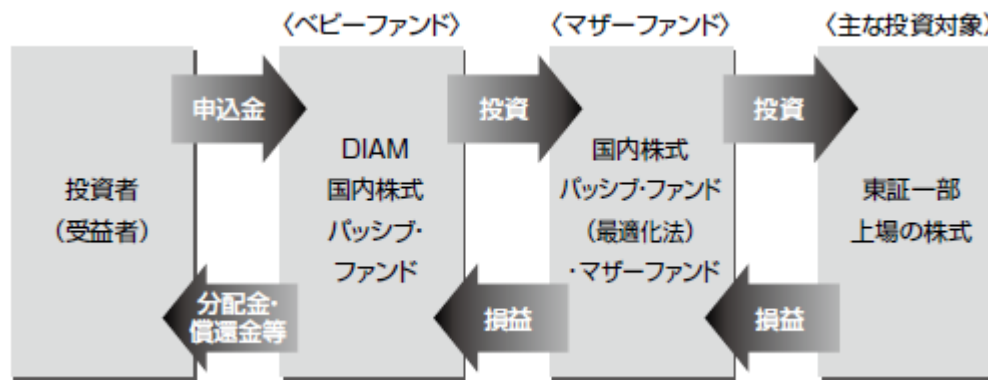
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

- ・「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26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26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	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

<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。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

(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ません。)

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券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。 ）の新株引受権証券を除きます。 ）

6．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せん。）
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せん。）
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

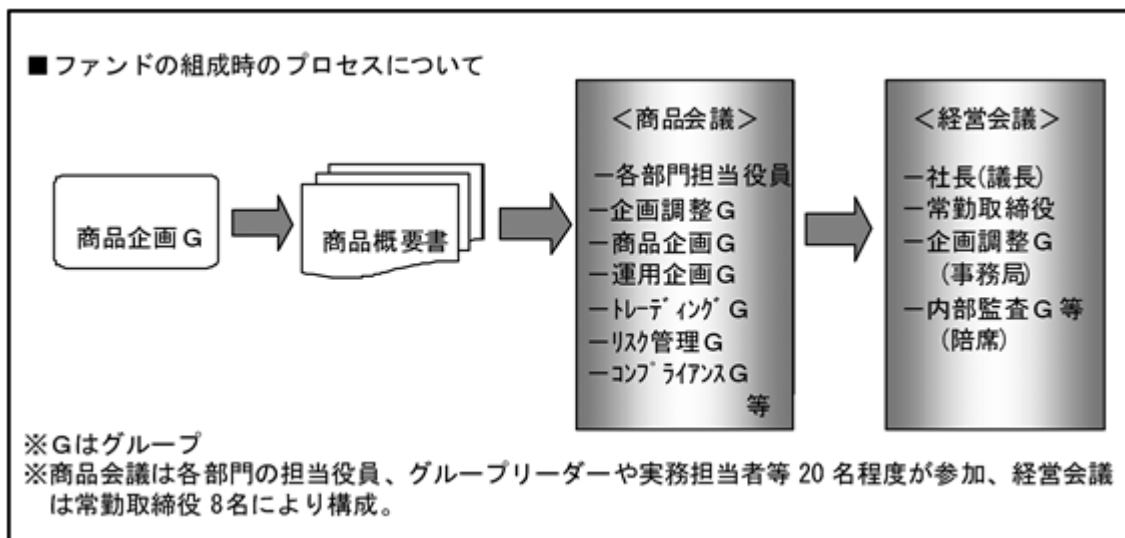
(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

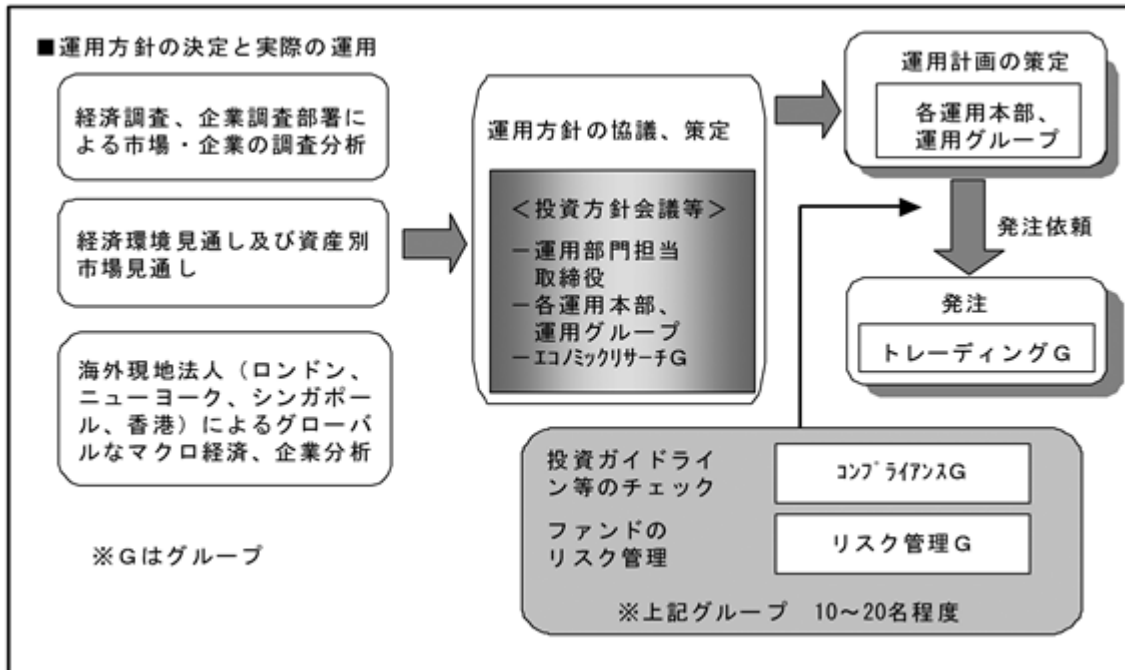
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
-------	-----------------------------

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。
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26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、）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（５）【投資制限】

- 1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」（３）投資制限）
- 2) 株式への実質投資割合には制限を設けません。（約款「運用の基本方針」（３）投資制限）
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。（約款「運用の基本方針」（３）投資制限）
- 4) 投資する株式等の範囲（約款第19条）
 - a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずるものとして市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - b. 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) デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第23条の2）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

10) 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。

11) 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せん。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託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委託会社に指図してはなりません。

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

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

< 分配金に関する留意点 >

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

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

< 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。

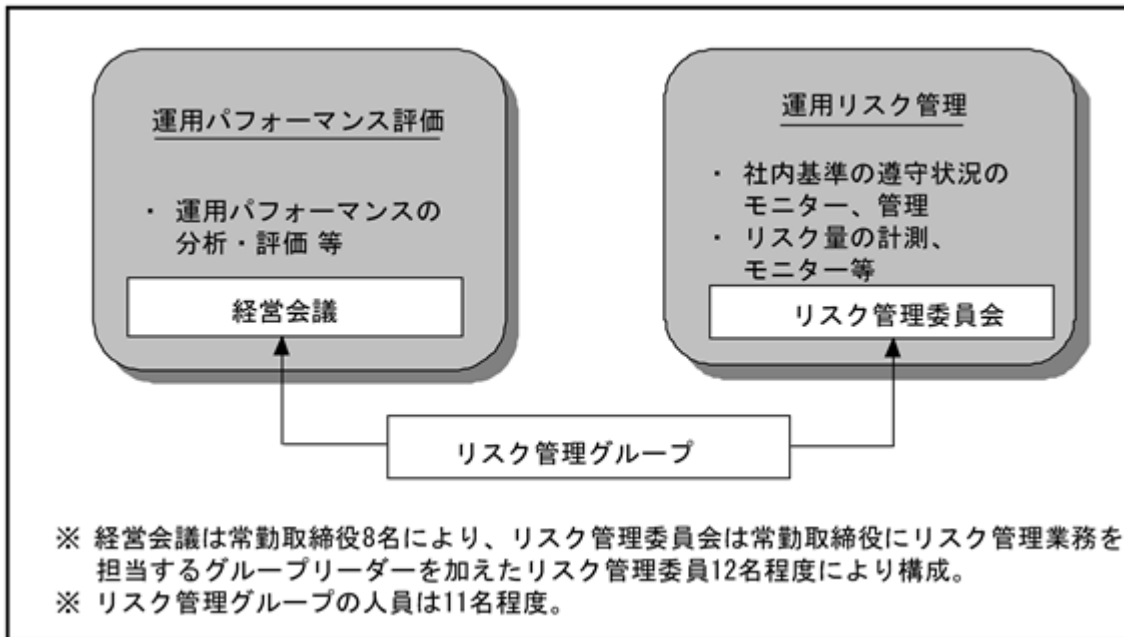
当ファンドは、受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情がある場合、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式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。

二．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。

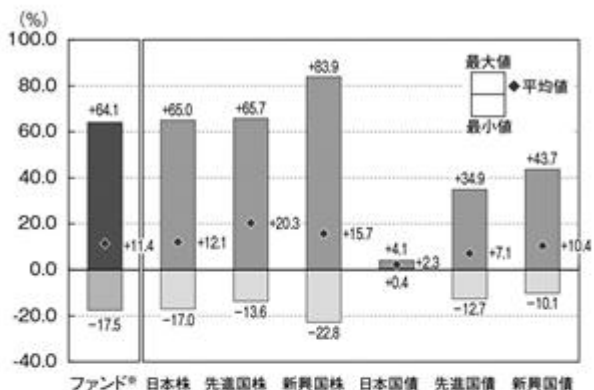
上記体制は平成26年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンド：2009年11月～2014年10月
 (うち2009年11月～2009年12月は対象インデックスのデータ)
 代表的な資産クラス：2009年11月～2014年10月

- *ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。
- *ファンドの対象インデックスは東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。

- *上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- *ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示していますので、ファンドの実績ではありません。
- *全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 - 先進国株……MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 日本国債……NOMURA-BPI国債
 - 先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 - 新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、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、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティー・エルエルシーに帰属します。

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】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.648%（税抜0.60%）

信託報酬の配分（税抜）		主な役務
委託会社	年率0.55%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.02%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、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）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

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等がファンドから支払われます。

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。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、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）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

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、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%）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。

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

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、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%）の税率での申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、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%）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。

買取請求による換金の際の課税については、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。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。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

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、15.315%（所得税15.315%（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。

買取請求による換金の際の課税については、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26年10月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上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「分配金自動けいぞく投資コース」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26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	3,033,402,924	100.03
内 日本	3,033,402,924	100.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	796,911	0.03
純資産総額	3,032,606,013	100.00

（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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	325,060,951,410	97.37
内 日本	325,060,951,410	97.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,775,444,788	2.63
純資産総額	333,836,396,198	100.00

その他資産の投資状況

平成26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）	8,516,690,000	2.55
内 日本	8,516,690,000	2.55

（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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（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26年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/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	1,603,447,999	1.7242 2,764,783,211	1.8918 3,033,402,924	- -	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26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。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成26年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,308,900	5,889.96 13,599,334,256	6,498.00 15,003,232,200	- -	4.49%
2	三菱UFJフィナンシャル G 日本	株式 銀行業	13,251,700	601.46 7,970,466,050	632.20 8,377,724,740	- -	2.51%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	873,500	7,414.96 6,476,972,772	7,939.00 6,934,716,500	- -	2.08%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,249,100	4,745.66 5,927,815,123	4,399.50 5,495,415,450	- -	1.65%
5	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,506,000	3,674.33 5,533,551,574	3,479.00 5,239,374,000	- -	1.57%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	22,813,100	212.46 4,846,893,868	200.00 4,562,620,000	- -	1.37%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	646,300	5,508.47 3,560,127,641	6,892.00 4,454,299,600	- -	1.33%
8	KDDI 日本	株式 情報・通信業	559,300	5,790.62 3,238,698,610	7,225.00 4,040,942,500	- -	1.21%
9	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,039,200	3,190.09 3,315,150,919	3,766.00 3,913,627,200	- -	1.17%
10	日立 日本	株式 電気機器	4,019,000	780.10 3,135,251,700	859.10 3,452,722,900	- -	1.03%

11	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,228,000	2,558.64 3,142,021,500	2,795.50 3,432,874,000	- -	1.03%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,996,200	1,235.97 2,467,246,508	1,699.00 3,391,543,800	- -	1.02%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	174,200	16,408.24 2,858,315,506	19,120.00 3,330,704,000	- -	1.00%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	970,200	2,991.59 2,902,449,922	3,389.00 3,288,007,800	- -	0.98%
15	武田薬品 日本	株式 医薬品	656,600	4,668.72 3,065,482,042	4,804.50 3,154,634,700	- -	0.94%
16	三井不動産 日本	株式 不動産業	876,000	3,258.38 2,854,341,175	3,507.50 3,072,570,000	- -	0.92%
17	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	690,900	3,851.07 2,660,708,010	4,281.00 2,957,742,900	- -	0.89%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,265,900	1,954.88 2,474,692,916	2,163.50 2,738,774,650	- -	0.82%
19	パナソニック 日本	株式 電気機器	2,039,500	1,196.12 2,439,501,067	1,305.00 2,661,547,500	- -	0.80%
20	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	306,700	7,586.98 2,326,927,554	8,645.00 2,651,421,500	- -	0.79%
21	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,360,600	1,608.47 2,188,496,718	1,862.00 2,533,437,200	- -	0.76%
22	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	149,800	10,965.22 1,642,590,540	16,505.00 2,472,449,000	- -	0.74%
23	東京海上HD 日本	株式 保険業	679,600	3,016.70 2,050,153,580	3,513.00 2,387,434,800	- -	0.72%
24	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,349,400	883.96 2,076,778,350	997.90 2,344,466,260	- -	0.70%
25	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,674,000	1,189.87 1,991,858,010	1,396.50 2,337,741,000	- -	0.70%
26	三井物産 日本	株式 卸売業	1,400,300	1,492.64 2,090,144,516	1,665.50 2,332,199,650	- -	0.70%
27	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	3,376,900	691.35 2,334,625,309	674.90 2,279,069,810	- -	0.68%
28	小松製作所 日本	株式 機械	868,400	2,087.78 1,813,035,405	2,609.50 2,266,089,800	- -	0.68%
29	ソニー 日本	株式 電気機器	1,075,300	1,745.04 1,876,448,910	2,072.00 2,228,021,600	- -	0.67%
30	信越化学 日本	株式 化学	314,300	5,707.58 1,793,893,578	7,044.00 2,213,929,200	- -	0.66%

(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26年10月31日現在

種類	投資比率
株式	97.37%
合計	97.37%

(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26年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.41%
輸送用機器		11.08%
銀行業		9.08%
情報・通信業		7.15%
化学		5.62%
機械		5.19%
医薬品		4.59%
卸売業		4.21%
小売業		4.07%
食料品		4.03%
陸運業		3.93%
不動産業		3.27%
建設業		2.69%
サービス業		2.55%
保険業		2.25%
電気・ガス業		2.05%
鉄鋼		1.50%
精密機器		1.39%
証券、商品先物取引業		1.39%
その他製品		1.36%
その他金融業		1.27%
非鉄金属		0.92%
ガラス・土石製品		0.90%
ゴム製品		0.82%
繊維製品		0.68%
金属製品		0.65%
空運業		0.54%
石油・石炭製品		0.50%
鋳業		0.47%
海運業		0.29%
倉庫・運輸関連業		0.22%
パルプ・紙	0.22%	
水産・農林業	0.07%	
合計	97.37%	

(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】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年10月31日現在

種類	取引所	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	大阪取引 所	TOPIX 先物 2612月	買建	637	8,229,333,388	8,516,690,000	2.55%

（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26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
第5計算期間末 (平成25年10月15日)	1,832	1,832	1.6235	1.6235
第6計算期間末 (平成26年10月14日)	2,347	2,347	1.6680	1.6680
平成25年10月末日	2,085	-	1.6188	-
11月末日	2,220	-	1.7054	-
12月末日	2,326	-	1.7648	-
平成26年1月末日	1,884	-	1.6530	-
2月末日	2,305	-	1.6407	-
3月末日	2,331	-	1.6437	-
4月末日	2,319	-	1.5874	-
5月末日	2,429	-	1.6410	-
6月末日	2,238	-	1.7249	-
7月末日	2,358	-	1.7608	-
8月末日	2,355	-	1.7447	-
9月末日	2,488	-	1.8225	-
10月末日	3,032	-	1.8319	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	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
第5計算期間	68.9
第6計算期間	2.7

(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。

(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
第5計算期間	548,351,616	655,828,394
第6計算期間	796,957,698	518,389,663

(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。

参考情報

データの基準日: 2014年10月31日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2009年1月30日)~2014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2期(2010.10.12)	0円
第3期(2011.10.12)	0円
第4期(2012.10.12)	0円
第5期(2013.10.15)	0円
第6期(2014.10.14)	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

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

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

■国内株式バツシブ・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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.37
内 日本	97.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.63
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)	2.55

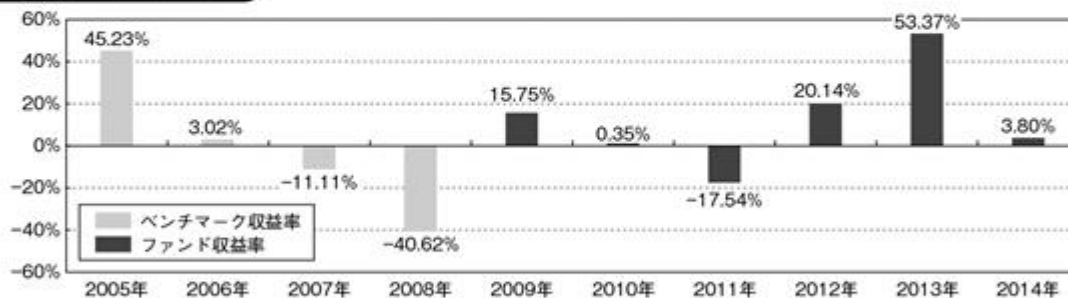
組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.41%
2	輸送用機器	11.08%
3	銀行業	9.08%
4	情報・通信業	7.15%
5	化学	5.62%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.49%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.51%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	2.08%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.65%
5	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.57%
6	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.37%
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.33%
8	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.21%
9	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.17%
10	日立	株式	日本	電気機器	1.03%

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2009年は設定日から年末までの収益率、および2014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暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」です。

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

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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。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きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

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

- ・お申込価額

お申込日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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る場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・お申込手数料

ありません。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を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ます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後2時までに行われ、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。

なお、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。

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。

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の受付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て、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・解約単位

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、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

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、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、平成21年1月30日から原則として無期限です。ただし、下記「(5)その他 イ.償還規定」の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(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. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款は a. から g. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「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にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、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. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合

において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

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、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

(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。

受益者が収益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）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日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、）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、販売会社に対し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6期計算期間（平成25年10月16日から平成26年10月14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5期 平成25年10月15日現在	第6期 平成26年10月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,593,338	10,060,398
親投資信託受益証券	1,832,554,640	2,345,386,672
未収入金	1,350,000	-
流動資産合計	1,843,497,978	2,355,447,070
資産合計	1,843,497,978	2,355,447,070
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,147,190	294,121
未払受託者報酬	287,061	384,403
未払委託者報酬	5,455,037	7,304,479
その他未払費用	45,367	60,777
流動負債合計	10,934,655	8,043,780
負債合計	10,934,655	8,043,780
純資産の部		
元本等		
元本	1,128,743,533	1,407,311,568
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	703,819,790	940,091,722
（分配準備積立金）	469,303,083	365,801,163
元本等合計	1,832,563,323	2,347,403,290
純資産合計	1,832,563,323	2,347,403,290
負債純資産合計	1,843,497,978	2,355,447,070

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	平成24年10月13日 至 平成25年10月15日	自	平成25年10月16日 至 平成26年10月14日
営業収益				
受取利息		2,124		2,676
有価証券売買等損益		809,088,039		107,824,032
営業収益合計		809,090,163		107,826,708
営業費用				
受託者報酬		506,878		731,525
委託者報酬		9,632,223		13,900,622
その他費用		80,083		115,654
営業費用合計		10,219,184		14,747,801
営業利益又は営業損失()		798,870,979		93,078,907
経常利益又は経常損失()		798,870,979		93,078,907
当期純利益又は当期純損失()		798,870,979		93,078,907
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()		245,954,752		44,605,524
期首剰余金又は期首欠損金()		47,655,597		703,819,790
剰余金増加額又は欠損金減少額		220,752,175		510,866,491
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		220,752,175		510,866,491
剰余金減少額又は欠損金増加額		22,193,015		323,067,942
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		22,193,015		323,067,942
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		703,819,790		940,091,722

(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。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成25年10月15日、当計算期間末日を平成26年10月14日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期
	平成25年10月15日現在	平成26年10月14日現在
1 . 1 期首元本額	1,236,220,311円	1,128,743,533円
期中追加設定元本額	548,351,616円	796,957,698円
期中一部解約元本額	655,828,394円	518,389,663円
2 . 受益権の総数	1,128,743,533口	1,407,311,568口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期	第6期
	自 平成24年10月13日 至 平成25年10月15日	自 平成25年10月16日 至 平成26年10月14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(31,365,454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(413,193,176円)、信託約款に規定される収益調整金(234,516,707円)及び分配準備積立金(24,744,453円)より分配対象収益は703,819,790円(1万口当たり6,235.43円)であります。なお、分配を行っておりませんが、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(34,922,864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(13,550,519円)、信託約款に規定される収益調整金(574,290,559円)及び分配準備積立金(317,327,780円)より分配対象収益は940,091,722円(1万口当たり6,680.05円)であります。なお、分配を行っておりませんが、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第5期	第6期
	自 平成24年10月13日 至 平成25年10月15日	自 平成25年10月16日 至 平成26年10月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 平成25年10月15日現在	第6期 平成26年10月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 平成25年10月15日現在	第6期 平成26年10月14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	579,489,491	62,089,682
合計	579,489,491	62,089,682

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 平成25年10月15日現在	第6期 平成26年10月14日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6235円 (16,235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26年10月14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	1,361,934,076	2,345,386,672	
親投資信託受益証券 合計		1,361,934,076	2,345,386,672	
合計		1,361,934,076	2,345,386,672	

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25年10月15日現在	平成26年10月14日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,443,336,050	3,728,552,244
株式	2	318,978,917,600	291,122,195,810
派生商品評価勘定		50,230,634	-
未収入金		1,216,718	-
未収配当金		2,338,066,031	2,340,471,163
前払金		-	390,637,000
流動資産合計		323,811,767,033	297,581,856,217
資産合計		323,811,767,033	297,581,856,217
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		202,588	496,752,320
前受金		56,035,000	-
未払金		-	54,415,104
未払解約金		123,767,000	109,133,000
流動負債合計		180,004,588	660,300,424
負債合計		180,004,588	660,300,424
純資産の部			
元本等			
元本	1	194,304,771,358	172,419,018,706
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		129,326,991,087	124,502,537,087
元本等合計		323,631,762,445	296,921,555,793
純資産合計		323,631,762,445	296,921,555,793
負債純資産合計		323,811,767,033	297,581,856,217

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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年10月15日現在	平成26年10月14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	253,488,354,092円	194,304,771,358円
同期中追加設定元本額	35,217,478,339円	24,603,500,257円
同期中一部解約元本額	94,401,061,073円	46,489,252,909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	3,944,939,019円	4,061,001,025円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,100,236,936円	1,361,934,076円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	37,714,704,769円	37,079,695,951円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	762,054,173円	789,765,436円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,881,377,815円	2,921,108,415円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,064,527,813円	3,124,705,439円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	380,378,411円	408,966,225円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,275,092,180円	1,342,206,708円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,087,505,495円	1,164,438,617円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	115,892,962円	98,455,976円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,482,349,458円	1,304,021,788円

マネックス資産設計ファンド エボ リューション	20,178,190円	25,554,243円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	6,427,370円	14,442,430円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	8,844,068円	29,247,302円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	15,957,275円	69,064,411円
投資のソムリエ	1,622,403円	99,254,112円
クルーズコントロール	3,176,463円	618,305,066円
投資のソムリエ<DC年金>	-円	2,268,819円
D I A M 8資産バランスファンド N<DC年金>	-円	20,247,495円
D I A M D C バランス・F(成 長型)	-円	110,184円
クルーズコントロール<DC年金>	-円	23,779円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	156,687,366円	138,240,011円
D I A Mグローバル・バランスファ ンド25VA(適格機関投資家限 定)	5,793,093,749円	2,960,224,465円
D I A Mグローバル・バランスファ ンド50VA(適格機関投資家限 定)	1,143,052,444円	723,857,783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)	143,705,704円	87,696,282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)	534,127,467円	334,474,001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)	137,336,891円	78,310,132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)	205,682,907円	131,284,555円
D I A M世界バランスファンド40 VA(適格機関投資家限定)	15,361,851,841円	13,146,606,188円
D I A M世界バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	5,099,212,333円	4,312,903,912円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,630,361,203円	3,194,516,772円
D I A Mバランスファンド37.5 VA(適格機関投資家限定)	2,475,310,533円	2,145,037,313円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,894,323,450円	5,267,871,094円
D I A Mグローバル・アセット・バ ランスVA(適格機関投資家限定)	790,894,507円	484,994,727円
D I A Mグローバル・アセット・バ ランスVA2(適格機関投資家限 定)	1,808,119,463円	1,338,831,785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)	1,649,665,011円	1,344,398,395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)	9,029,623,310円	6,402,971,932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)	92,608,020円	93,432,732円
D I A M世界バランスファンド55 V A (適格機関投資家限定)	3,265,990,793円	2,457,352,023円
D I A Mアイエヌジー世界バランス ファンド35V A (適格機関投資家 限定)	7,404,963,886円	6,914,432,913円
D I A Mグローバル分散ファンドV A (適格機関投資家限定)	315,750,645円	232,107,184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)	29,242,167,669円	25,344,463,723円
D I A M世界アセットバランスファ ンド40V A (適格機関投資家限 定)	1,598,531,111円	1,152,284,866円
D I A M世界アセットバランスファ ンド25V A (適格機関投資家限 定)	3,457,777,208円	2,935,040,722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)	17,847,247,842円	15,844,662,933円
D I A Mバランス30V A (適格機 関投資家限定)	42,057,409円	39,763円
D I A Mバランス50V A (適格機 関投資家限定)	183,937,363円	38,730,706円
D I A Mバランス70V A (適格機 関投資家限定)	1,175,260円	54,404,238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)	15,784,568,119円	14,176,369,864円
D I A M世界バランス25V A (適 格機関投資家限定)	200,761,646円	134,326,610円
D I A M国内バランス30V A (適 格機関投資家限定)	65,015,757円	47,729,289円
D I A Mバランス20V A (適格機 関投資家限定)	130,944,520円	36,466,369円
D I A Mバランス40V A (適格機 関投資家限定)	76,790円	90,048,289円
D I A Mバランス60V A (適格機 関投資家限定)	123,084円	124,281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)	1,034,935,394円	900,296,115円
D I A M世界アセットバランスファ ンド7V A (1303) (適格機関 投資家限定)	2,443,408,346円	2,273,472,480円
D I A M世界アセットバランスファ ンド7V A (1306) (適格機関 投資家限定)	3,341,912,869円	2,945,619,832円
D I A M世界アセットバランスファ ンド7V A (1309) (適格機関 投資家限定)	132,504,648円	120,576,930円
計	194,304,771,358円	172,419,018,706円
2. 受益権の総数	194,304,771,358口	172,419,018,706口

3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,195,000,000円	株式 2,989,000,000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24年10月13日 至 平成25年10月15日	自 平成25年10月16日 至 平成26年10月14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25年10月15日現在	平成26年10月14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25年10月15日現在	平成26年10月14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	60,412,345,507	5,827,362,488
合計	60,412,345,507	5,827,362,488

（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25年2月8日から平成25年10月15日まで及び平成26年2月8日から平成26年10月14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25年10月15日 現在				平成26年10月14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	4,621,915,000	-	4,672,200,000	50,285,000	5,703,913,000	-	5,207,300,000	496,613,000
合計	4,621,915,000	-	4,672,200,000	50,285,000	5,703,913,000	-	5,207,300,000	496,613,000

（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25年10月15日現在	平成26年10月14日現在
1口当たり純資産額	1.6656円	1.7221円
（1万口当たり純資産額）	（16,656円）	（17,221円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年10月14日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	76,000	248.00	18,848,000	
日本水産	231,300	311.00	71,934,300	
マルハニチロ	36,400	1,560.00	56,784,000	
ハウスイ	16,000	123.00	1,968,000	
サカタのタネ	28,000	1,415.00	39,620,000	
ホクト	21,000	1,902.00	39,942,000	
ショーボンドHD	16,700	4,030.00	67,301,000	
ミライト・ホールディングス	53,400	1,149.00	61,356,600	
タマホーム	12,700	667.00	8,470,900	
住石ホールディングス	52,200	111.00	5,794,200	
日鉄鉱業	48,000	397.00	19,056,000	
三井松島	123,000	127.00	15,621,000	
国際石油開発帝石	912,900	1,328.50	1,212,787,650	
日本海洋掘削	4,700	4,205.00	19,763,500	
石油資源開発	26,700	3,655.00	97,588,500	
K&Oエナジーグループ	12,700	1,275.00	16,192,500	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,682.00	2,859,400	
安藤・間	125,300	602.00	75,430,600	
東急建設	66,800	483.00	32,264,400	
コムシスホールディングス	91,200	1,693.00	154,401,600	
ミサワホーム	20,200	1,034.00	20,886,800	
高松コンストラクションGP	14,200	1,861.00	26,426,200	
東建コーポレーション	7,000	4,725.00	33,075,000	
ヤマウラ	9,200	369.00	3,394,800	
大成建設	949,000	551.00	522,899,000	
大林組	563,000	669.00	376,647,000	
清水建設	574,000	732.00	420,168,000	
飛島建設	115,500	240.00	27,720,000	
長谷工コーポレーション	250,300	715.00	178,964,500	
松井建設	2,000	503.00	1,006,000	
銭高組	27,000	290.00	7,830,000	
鹿島建設	825,000	463.00	381,975,000	
不動テトラ	132,700	243.00	32,246,100	
大末建設	7,200	825.00	5,940,000	
鉄建建設	114,000	451.00	51,414,000	
日鉄住金テックスエンジ	30,000	531.00	15,930,000	
西松建設	246,000	446.00	109,716,000	
三井住友建設	505,000	117.00	59,085,000	
大豊建設	58,000	443.00	25,694,000	
前田建設	116,000	836.00	96,976,000	
佐田建設	65,000	130.00	8,450,000	
ナカノフドー建設	14,600	335.00	4,891,000	
奥村組	166,000	551.00	91,466,000	

大和小田急建設	10,200	641.00	6,538,200
東鉄工業	22,600	2,306.00	52,115,600
イチケン	21,000	342.00	7,182,000
浅沼組	57,000	150.00	8,550,000
戸田建設	218,000	454.00	98,972,000
熊谷組	275,000	359.00	98,725,000
青木あすなる建設	11,500	719.00	8,268,500
北野建設	39,000	318.00	12,402,000
植木組	23,000	245.00	5,635,000
三井ホーム	25,000	471.00	11,775,000
矢作建設	25,700	691.00	17,758,700
ピーエス三菱	14,900	445.00	6,630,500
東日本ハウス	22,200	501.00	11,122,200
大東建託	71,300	12,270.00	874,851,000
新日本建設	22,700	362.00	8,217,400
N I P P O	43,000	1,873.00	80,539,000
東亜道路	35,000	376.00	13,160,000
前田道路	59,000	1,582.00	93,338,000
日本道路	51,000	561.00	28,611,000
東亜建設	164,000	177.00	29,028,000
若築建設	101,000	188.00	18,988,000
東洋建設	58,500	436.00	25,506,000
五洋建設	223,300	323.00	72,125,900
大林道路	22,000	603.00	13,266,000
世紀東急	21,000	514.00	10,794,000
福田組	28,000	1,011.00	28,308,000
日本ドライケミカル	1,800	2,279.00	4,102,200
住友林業	129,400	1,093.00	141,434,200
日本基礎技術	21,000	351.00	7,371,000
日成ビルド工業	48,000	255.00	12,240,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	86,000	105.00	9,030,000
バコーポレーション	23,600	398.00	9,392,800
パナホーム	70,000	715.00	50,050,000
大和ハウス	515,500	1,885.50	971,975,250
ライト工業	39,100	919.00	35,932,900
積水ハウス	505,400	1,243.50	628,464,900
日特建設	23,000	519.00	11,937,000
北陸電気工事	9,000	548.00	4,932,000
ユアテック	30,000	527.00	15,810,000
西部電気工業	16,000	462.00	7,392,000
四電工	6,000	363.00	2,178,000
中電工	27,200	1,599.00	43,492,800
関電工	86,000	503.00	43,258,000
きんでん	125,000	1,019.00	127,375,000
東京エネシス	19,000	662.00	12,578,000
トーエネック	27,000	532.00	14,364,000
住友電設	13,000	1,286.00	16,718,000
日本電設工業	30,700	1,554.00	47,707,800
協和エクシオ	73,600	1,281.00	94,281,600
新日本空調	16,000	805.00	12,880,000

日本工営	59,000	424.00	25,016,000
N D S	30,000	305.00	9,150,000
九電工	35,000	1,087.00	38,045,000
三機工業	38,300	725.00	27,767,500
日 揮	189,000	2,610.00	493,290,000
中外炉工業	49,000	213.00	10,437,000
ヤマト	16,000	356.00	5,696,000
太平電業	28,000	860.00	24,080,000
高砂熱学	52,400	1,252.00	65,604,800
三晃金属	21,000	239.00	5,019,000
N E C ネットズエスアイ	18,200	2,332.00	42,442,400
朝日工業社	22,000	380.00	8,360,000
明星工業	36,000	609.00	21,924,000
大 気 社	24,900	2,284.00	56,871,600
ダイダン	25,000	598.00	14,950,000
日比谷総合設備	21,100	1,567.00	33,063,700
東芝プラントシステム	30,500	1,709.00	52,124,500
日本製粉	116,000	509.00	59,044,000
日清製粉G本社	206,250	1,027.00	211,818,750
日東富士製粉	8,000	308.00	2,464,000
昭和産業	78,000	384.00	29,952,000
鳥越製粉	15,900	695.00	11,050,500
中部飼料	18,500	666.00	12,321,000
フィード・ワンH L D G S	122,600	110.00	13,486,000
東洋精糖	33,000	97.00	3,201,000
日本甜菜糖	98,000	181.00	17,738,000
三井製糖	74,000	363.00	26,862,000
塩水港精糖	15,200	267.00	4,058,400
ネクスト	14,700	599.00	8,805,300
日本M & A センター	27,100	2,901.00	78,617,100
ノバレーゼ	4,600	856.00	3,937,600
アコーディア・ゴルフ	71,400	1,082.00	77,254,800
タケエイ	12,200	1,006.00	12,273,200
トラスト・テック	3,000	1,703.00	5,109,000
パソナグループ	13,100	536.00	7,021,600
C D S	3,800	936.00	3,556,800
リンクアンドモチベーション	24,000	149.00	3,576,000
G C A サヴィアン	15,000	944.00	14,160,000
エス・エム・エス	9,800	2,632.00	25,793,600
テンブホールディングス	38,300	3,050.00	116,815,000
リニカル	4,600	917.00	4,218,200
クックパッド	8,600	3,200.00	27,520,000
エスクリ	6,100	1,173.00	7,155,300
アイ・ケイ・ケイ	4,100	884.00	3,624,400
森永製菓	186,000	226.00	42,036,000
中 村 屋	45,000	416.00	18,720,000
江崎グリコ	32,500	3,675.00	119,437,500
名糖産業	8,700	1,074.00	9,343,800
不 二 家	109,000	193.00	21,037,000
山崎製パン	138,000	1,411.00	194,718,000

第一屋製パン	27,000	128.00	3,456,000
モロゾフ	30,000	344.00	10,320,000
亀田製菓	10,600	3,025.00	32,065,000
寿スピリッツ	4,100	2,124.00	8,708,400
カルビー	69,500	3,365.00	233,867,500
森永乳業	159,000	350.00	55,650,000
六甲バター	8,800	1,086.00	9,556,800
ヤクルト	109,800	5,390.00	591,822,000
明治ホールディングス	55,600	8,510.00	473,156,000
雪印メグミルク	40,800	1,375.00	56,100,000
プリマハム	94,000	259.00	24,346,000
日本ハム	117,000	2,352.00	275,184,000
伊藤ハム	103,000	520.00	53,560,000
林兼産業	63,000	71.00	4,473,000
丸大食品	90,000	410.00	36,900,000
米 久	6,100	1,332.00	8,125,200
S Foods	11,800	1,728.00	20,390,400
学情	5,800	983.00	5,701,400
スタジオアリス	7,400	1,384.00	10,241,600
シミックホールディングス	6,700	1,760.00	11,792,000
システナ	16,300	777.00	12,665,100
デジタルアーツ	5,900	1,001.00	5,905,900
新日鉄住金S O L	13,800	3,110.00	42,918,000
総合警備保障	63,700	2,288.00	145,745,600
キューブシステム	7,400	507.00	3,751,800
日本駐車場開発	180,800	114.00	20,611,200
コア	6,400	827.00	5,292,800
カカクコム	104,800	1,402.00	146,929,600
アイロムホールディングス	4,000	993.00	3,972,000
ルネサンス	8,000	931.00	7,448,000
ディップ	3,900	4,190.00	16,341,000
S B Sホールディングス	11,200	904.00	10,124,800
オプト	7,800	706.00	5,506,800
新日本科学	14,500	756.00	10,962,000
ツクイ	18,900	994.00	18,786,600
総合臨床H L D G S	8,200	446.00	3,657,200
キャリアデザインセンター	5,200	1,003.00	5,215,600
エムスリー	117,800	1,672.00	196,961,600
ツカダ・グローバルH O L D	10,600	839.00	8,893,400
アウトソーシング	6,600	1,458.00	9,622,800
ディー・エヌ・エー	94,100	1,290.00	121,389,000
博報堂D Y H L D G S	242,600	978.00	237,262,800
ぐるなび	24,400	1,279.00	31,207,600
一休	12,500	1,321.00	16,512,500
ジャパンベストレスキューS	14,500	272.00	3,944,000
ファンコミュニケーションズ	30,100	1,000.00	30,100,000
ジェイコムホールディングス	3,900	764.00	2,979,600
P G Mホールディングス	24,900	1,015.00	25,273,500
W D Bホールディングス	2,100	1,650.00	3,465,000
ティア	4,400	682.00	3,000,800

バリューコマース	14,400	668.00	9,619,200
サッポロホールディングス	308,000	421.00	129,668,000
アサヒグループホールディング	377,400	3,109.00	1,173,336,600
麒麟HD	803,500	1,375.00	1,104,812,500
宝ホールディングス	147,500	773.00	114,017,500
オエノンホールディングス	47,000	231.00	10,857,000
養命酒	3,000	826.00	2,478,000
コカ・コーラウエスト	63,700	1,507.00	95,995,900
コカ・コーライーストジャパン	57,200	1,858.00	106,277,600
サントリー食品インター	112,600	3,655.00	411,553,000
ダイドードリンコ	8,700	4,395.00	38,236,500
伊藤園	51,200	2,161.00	110,643,200
キーコーヒー	18,100	1,583.00	28,652,300
ユニカフェ	5,600	660.00	3,696,000
ジャパンフーズ	2,900	1,103.00	3,198,700
日清オイリオグループ	82,000	373.00	30,586,000
不二製油	45,600	1,651.00	75,285,600
J-オイルミルズ	79,000	360.00	28,440,000
ローソン	67,800	7,220.00	489,516,000
サンエー	12,500	3,315.00	41,437,500
ダイユーエイト	3,700	692.00	2,560,400
カワチ薬品	11,600	1,859.00	21,564,400
エービーシー・マート	23,500	5,820.00	136,770,000
ハードオフコーポレーション	8,200	877.00	7,191,400
高千穂交易	7,100	997.00	7,078,700
アスクル	17,200	2,018.00	34,709,600
ゲオホールディングス	28,400	929.00	26,383,600
アダストリアホールディング	12,700	2,397.00	30,441,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	21,000	157.00	3,297,000
伊藤忠食品	4,200	3,555.00	14,931,000
くらコーポレーション	9,700	2,923.00	28,353,100
キャンドウ	8,000	1,653.00	13,224,000
エレマテック	7,800	1,934.00	15,085,200
バル	9,600	3,270.00	31,392,000
JALUX	4,900	1,253.00	6,139,700
エディオン	75,800	772.00	58,517,600
あらた	37,000	310.00	11,470,000
サーラコーポレーション	14,400	588.00	8,467,200
ワッツ	6,600	868.00	5,728,800
トーメンデバイス	2,600	1,745.00	4,537,000
J Pホールディングス	39,400	381.00	15,011,400
あみやき亭	2,900	3,775.00	10,947,500
東京エレクトロンデバイス	3,400	1,457.00	4,953,800
ひらまつ	20,400	592.00	12,076,800
双日	1,108,400	155.00	171,802,000
ゲンキー	1,600	4,765.00	7,624,000
アルフレッサホールディングス	195,600	1,362.00	266,407,200
大黒天物産	4,000	3,110.00	12,440,000
ハニーズ	13,100	1,027.00	13,453,700
キッコーマン	153,000	2,186.00	334,458,000

味の素	433,000	1,869.50	809,493,500
キューピー	95,600	1,778.00	169,976,800
ハウス食品G本社	64,200	1,820.00	116,844,000
カゴメ	72,800	1,681.00	122,376,800
焼津水産化工	8,800	959.00	8,439,200
アリアケジャパン	17,200	2,326.00	40,007,200
ニチレイ	201,000	427.00	85,827,000
横浜冷凍	41,300	776.00	32,048,800
東洋水産	92,000	3,500.00	322,000,000
イトアンド	1,700	1,651.00	2,806,700
日清食品HD	73,400	5,710.00	419,114,000
永谷園	7,000	1,008.00	7,056,000
フジッコ	18,000	1,502.00	27,036,000
ロックフィールド	10,000	1,878.00	18,780,000
日本たばこ産業	1,040,600	3,391.50	3,529,194,900
ケンコーマヨネーズ	6,400	1,156.00	7,398,400
わらべや日洋	11,200	1,916.00	21,459,200
なとり	9,100	1,106.00	10,064,600
片倉工業	20,800	1,197.00	24,897,600
グンゼ	142,000	287.00	40,754,000
ヒューリック	279,200	1,028.00	287,017,600
神栄	23,000	198.00	4,554,000
山下医科器械	1,400	1,668.00	2,335,200
ラサ商事	8,100	497.00	4,025,700
アルペン	14,700	1,620.00	23,814,000
クオール	12,400	656.00	8,134,400
アルコニックス	10,000	1,337.00	13,370,000
神戸物産	2,400	4,090.00	9,816,000
ジェイアイエヌ	11,200	2,471.00	27,675,200
ビックカメラ	71,700	991.00	71,054,700
DCMホールディングス	80,000	738.00	59,040,000
MonotaRO	32,100	2,449.00	78,612,900
あいホールディングス	26,500	1,849.00	48,998,500
アークランドサービス	2,000	3,250.00	6,500,000
J. フロントリテイリング	195,300	1,289.00	251,741,700
ドトール・日レスHD	29,000	1,660.00	48,140,000
マツモトキヨシHLDS	34,100	2,980.00	101,618,000
ブロンコビリー	2,700	2,959.00	7,989,300
スタートトゥデイ	51,500	2,155.00	110,982,500
物語コーポレーション	4,100	3,330.00	13,653,000
ココカラファイン	17,300	2,776.00	48,024,800
三越伊勢丹HD	328,800	1,322.00	434,673,600
東洋紡	742,000	154.00	114,268,000
ユニチカ	480,000	49.00	23,520,000
富士紡ホールディングス	91,000	296.00	26,936,000
日清紡ホールディングス	112,000	823.00	92,176,000
倉敷紡績	181,000	175.00	31,675,000
ダイワボウHD	150,000	209.00	31,350,000
シキボウ	101,000	130.00	13,130,000
日東紡績	129,000	376.00	48,504,000

トヨタ紡織	58,600	1,062.00	62,233,200
ウエルシアHD	14,900	3,200.00	47,680,000
クリエイトSDH	7,000	3,660.00	25,620,000
バイタルKSKHD	31,200	884.00	27,580,800
八洲電機	13,000	507.00	6,591,000
UKCホールディングス	10,600	1,667.00	17,670,200
丸善CHI HD	14,600	350.00	5,110,000
TOKAIホールディングス	80,900	476.00	38,508,400
エー・ピーカンパニー	2,000	1,706.00	3,412,000
三洋貿易	9,900	1,239.00	12,266,100
チムニー	3,000	2,164.00	6,492,000
ジョイフル本田	9,100	3,665.00	33,351,500
キリン堂ホールディングス	6,300	670.00	4,221,000
日本毛織	55,000	719.00	39,545,000
大東紡織	28,000	74.00	2,072,000
トーア紡コーポレーション	77,000	74.00	5,698,000
ダイドーリミテッド	20,000	507.00	10,140,000
東京建物不動産販	9,200	357.00	3,284,400
三栄建築設計	6,800	842.00	5,725,600
野村不動産HL DGS	109,200	1,739.00	189,898,800
プレゼンスコーポレーション	4,000	2,808.00	11,232,000
常和ホールディングス	5,800	3,510.00	20,358,000
フージャースHD	24,700	458.00	11,312,600
オープンハウス	10,400	1,824.00	18,969,600
東急不動産HD	366,800	664.00	243,555,200
飯田GHD	72,400	1,218.00	88,183,200
帝国繊維	18,400	2,300.00	42,320,000
ブックオフコーポレーション	9,300	802.00	7,458,600
日本コークス工業	142,400	105.00	14,952,000
ミタチ産業	4,000	722.00	2,888,000
あさひ	9,600	1,224.00	11,750,400
日本調剤	2,100	2,850.00	5,985,000
コスモス薬品	9,400	14,730.00	138,462,000
シップヘルスケアHD	23,700	2,525.00	59,842,500
トーエル	8,900	663.00	5,900,700
一六堂	3,600	442.00	1,591,200
ソフトクリエイトHD	5,500	899.00	4,944,500
セブン&アイ・HL DGS	691,800	3,961.00	2,740,219,800
クリエイト・レストランツ・ホール	8,300	1,298.00	10,773,400
ツルハホールディングス	32,600	5,900.00	192,340,000
スターティア	1,400	1,634.00	2,287,600
サンマルクホールディングス	5,300	5,580.00	29,574,000
フェリシモ	4,700	1,058.00	4,972,600
トリドール	14,300	1,220.00	17,446,000
クスリのアオキ	7,300	4,565.00	33,324,500
帝人	717,000	249.00	178,533,000
東レ	1,273,000	684.80	871,750,400
クラレ	279,000	1,229.00	342,891,000
旭化成	1,095,000	871.90	954,730,500

サカイ オーベックス	46,000	146.00	6,716,000
稲葉製作所	7,600	1,278.00	9,712,800
宮地エンジニアリングG	58,000	193.00	11,194,000
トーカロ	10,700	2,107.00	22,544,900
アルファCO	6,300	1,026.00	6,463,800
SUMCO	120,600	1,076.00	129,765,600
川田テクノロジーズ	3,600	4,690.00	16,884,000
住江織物	48,000	316.00	15,168,000
日本フェルト	10,200	463.00	4,722,600
イチカワ	12,000	267.00	3,204,000
日本バイリーン	19,000	633.00	12,027,000
エコナックホールディングス	54,000	44.00	2,376,000
日東製網	21,000	148.00	3,108,000
芦森工業	38,000	183.00	6,954,000
アツギ	147,000	108.00	15,876,000
ダイニック	34,000	168.00	5,712,000
共和レザー	11,600	691.00	8,015,600
セーレン	47,200	939.00	44,320,800
東海染工	26,000	114.00	2,964,000
小松精練	29,300	505.00	14,796,500
ワコールホールディングス	104,000	1,076.00	111,904,000
ホギメディカル	11,000	5,760.00	63,360,000
レナウン	42,200	110.00	4,642,000
クラウドディア	2,200	1,250.00	2,750,000
T S Iホールディングス	84,400	687.00	57,982,800
I Tホールディングス	59,300	1,725.00	102,292,500
ネオス	3,600	726.00	2,613,600
電算システム	5,400	1,480.00	7,992,000
グリー	99,600	795.00	79,182,000
コーエーテクモHD	32,800	1,552.00	50,905,600
三菱総合研究所	6,400	2,488.00	15,923,200
ボルテージ	2,900	1,313.00	3,807,700
電算	1,600	2,135.00	3,416,000
A G S	3,500	866.00	3,031,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,400	1,555.00	3,732,000
ブレインパッド	1,800	1,193.00	2,147,400
K L a b	17,000	1,336.00	22,712,000
ポルトゥウィン・ピットクル	10,000	914.00	9,140,000
イーブックイニシアティブ	3,200	1,131.00	3,619,200
ネクソン	160,400	880.00	141,152,000
アイスタイル	5,500	433.00	2,381,500
エムアップ	4,000	741.00	2,964,000
エイチーム	2,000	4,660.00	9,320,000
e n i s h	3,200	2,069.00	6,620,800
コロブラ	28,900	3,205.00	92,624,500
モバイルクリエイト	7,200	779.00	5,608,800
オルトプラス	3,100	784.00	2,430,400
ブロードリーフ	13,600	1,604.00	21,814,400
ハーツユナイテッドグループ	3,700	1,942.00	7,185,400
特種東海製紙	102,000	229.00	23,358,000

ベリサーブ	2,000	870.00	1,740,000	
ティーガイア	16,500	1,055.00	17,407,500	
豆蔵ホールディングス	12,900	597.00	7,701,300	
テクマトリックス	7,200	603.00	4,341,600	
GMOペイメントゲートウェイ	14,400	2,053.00	29,563,200	
ザッパラス	9,400	567.00	5,329,800	
インターネットイニシアティブ	24,300	1,813.00	44,055,900	
ビットアイル	18,700	520.00	9,724,000	
S R Aホールディングス	8,000	1,502.00	12,016,000	
システムインテグレータ	1,800	622.00	1,119,600	
朝日ネット	15,500	487.00	7,548,500	
コムチュア	2,000	1,825.00	3,650,000	
王子ホールディングス	775,000	370.00	286,750,000	
日本製紙	90,700	1,540.00	139,678,000	
三菱製紙	249,000	85.00	21,165,000	
北越紀州製紙	119,900	412.00	49,398,800	
中越パルプ	67,000	170.00	11,390,000	
巴川製紙	28,000	174.00	4,872,000	
大王製紙	67,000	878.00	58,826,000	
レンゴー	141,000	455.00	64,155,000	
トーモク	56,000	279.00	15,624,000	
ザ・バック	12,500	2,087.00	26,087,500	
コープケミカル	27,000	103.00	2,781,000	
昭和電工	1,169,000	132.00	154,308,000	
住友化学	1,292,000	348.00	449,616,000	
日本化成	34,000	135.00	4,590,000	
住友精化	36,000	585.00	21,060,000	
日産化学	117,300	1,762.00	206,682,600	
ラサ工業	66,000	123.00	8,118,000	
クレハ	123,000	507.00	62,361,000	
多木化学	8,000	723.00	5,784,000	
テイカ	30,000	409.00	12,270,000	
石原産業	316,000	80.00	25,280,000	
片倉チツカリン	13,000	257.00	3,341,000	
日本曹達	113,000	520.00	58,760,000	
東ソー	469,000	396.00	185,724,000	
トクヤマ	273,000	299.00	81,627,000	
セントラル硝子	168,000	336.00	56,448,000	
東亜合成	220,000	427.00	93,940,000	
ダイソー	70,000	332.00	23,240,000	
関東電化	42,000	381.00	16,002,000	
電気化学	340,000	336.00	114,240,000	
イビデン	102,000	1,562.00	159,324,000	
信越化学	314,700	6,572.00	2,068,208,400	
日本カーバイド	51,000	216.00	11,016,000	
堺化学	71,000	313.00	22,223,000	
エア・ウォーター	145,000	1,577.00	228,665,000	
大陽日酸	225,000	921.00	207,225,000	
日本化学工業	66,000	141.00	9,306,000	
日本パーカライジング	41,400	2,256.00	93,398,400	

高圧ガス	26,000	563.00	14,638,000
チタン工業	21,000	228.00	4,788,000
四国化成	26,000	733.00	19,058,000
戸田工業	32,000	330.00	10,560,000
ステラ ケミファ	9,000	1,497.00	13,473,000
保土谷化学	54,000	193.00	10,422,000
日本触媒	149,000	1,106.00	164,794,000
大日精化	68,000	547.00	37,196,000
カネカ	219,000	584.00	127,896,000
協和発酵キリン	210,000	1,252.00	262,920,000
三菱瓦斯化学	277,000	638.00	176,726,000
三井化学	798,000	287.00	229,026,000
J S R	160,900	1,814.00	291,872,600
東京応化工業	33,900	2,710.00	91,869,000
大阪有機化学	12,400	458.00	5,679,200
三菱ケミカルH L D G S	1,097,300	504.80	553,917,040
日本合成化学	36,000	705.00	25,380,000
ダイセル	228,000	1,103.00	251,484,000
住友ベークライト	137,000	412.00	56,444,000
積水化学	360,000	1,173.00	422,280,000
日本ゼオン	138,000	1,003.00	138,414,000
アイカ工業	49,300	2,113.00	104,170,900
宇部興産	884,000	160.00	141,440,000
積水樹脂	24,800	1,383.00	34,298,400
タキロン	41,000	511.00	20,951,000
旭有機材	62,000	233.00	14,446,000
日立化成	75,900	1,754.00	133,128,600
ニチバン	18,000	360.00	6,480,000
リケンテクノス	28,500	453.00	12,910,500
大倉工業	42,000	337.00	14,154,000
積水化成製品	50,000	277.00	13,850,000
群栄化学	47,000	325.00	15,275,000
タイガース ポリマー	8,700	610.00	5,307,000
ミライアル	5,800	1,666.00	9,662,800
ダイキョーニシカワ	4,200	2,660.00	11,172,000
日本化薬	124,000	1,250.00	155,000,000
カーリットホールディングス	14,200	534.00	7,582,800
イーピーエス	20,800	1,312.00	27,289,600
パナソニック インフォシス	3,300	2,859.00	9,434,700
プレステージ・インター	12,100	912.00	11,035,200
フェイス	5,000	973.00	4,865,000
アミューズ	4,900	2,867.00	14,048,300
野村総合研究所	93,600	3,340.00	312,624,000
ドリームインキュベータ	4,700	1,602.00	7,529,400
サイバネットシステム	13,500	469.00	6,331,500
T A C	10,900	243.00	2,648,700
ケネディクス	248,700	409.00	101,718,300
電通	165,100	3,720.00	614,172,000
インテージホールディングス	9,100	1,301.00	11,839,100
テイクアンドギヴニーズ	7,500	1,049.00	7,867,500

東邦システムサイエンス	2,900	908.00	2,633,200
びあ	5,200	1,800.00	9,360,000
イオンファンタジー	5,800	1,398.00	8,108,400
ソースネクスト	8,300	708.00	5,876,400
ネクシィーズ	6,300	541.00	3,408,300
メディカルシステムネットワーク	13,900	334.00	4,642,600
ティール・ワイ・オー	16,400	166.00	2,722,400
日本精化	15,000	723.00	10,845,000
A D E K A	75,600	1,291.00	97,599,600
日油	146,000	648.00	94,608,000
ミヨシ油脂	66,000	131.00	8,646,000
新日本理化	28,000	218.00	6,104,000
ハリマ化成グループ	15,300	500.00	7,650,000
花王	483,200	4,092.00	1,977,254,400
第一工業製薬	32,000	395.00	12,640,000
三洋化成	55,000	642.00	35,310,000
武田薬品	657,400	4,500.00	2,958,300,000
アステラス製薬	1,998,800	1,536.50	3,071,156,200
大日本住友製薬	124,300	1,264.00	157,115,200
塩野義製薬	274,100	2,482.00	680,316,200
田辺三菱製薬	146,100	1,592.00	232,591,200
わかもと製薬	7,000	251.00	1,757,000
あすか製薬	20,700	1,209.00	25,026,300
日本新薬	40,000	3,040.00	121,600,000
ビオフェルミン製薬	2,900	2,714.00	7,870,600
中外製薬	174,700	3,240.00	566,028,000
科研製薬	61,000	2,422.00	147,742,000
エーザイ	216,100	4,238.50	915,939,850
ロート製薬	73,700	1,509.00	111,213,300
小野薬品	79,700	8,990.00	716,503,000
久光製薬	54,500	3,520.00	191,840,000
有機合成薬品	13,000	239.00	3,107,000
持田製薬	12,600	6,920.00	87,192,000
参天製薬	64,500	6,010.00	387,645,000
扶桑薬品	60,000	291.00	17,460,000
日本ケミファ	25,000	566.00	14,150,000
ツムラ	51,600	2,309.00	119,144,400
日医工	41,100	1,753.00	72,048,300
テルモ	256,800	2,464.00	632,755,200
みらかホールディングス	46,100	4,300.00	198,230,000
キッセイ薬品工業	32,600	2,542.00	82,869,200
生化学工業	36,600	1,697.00	62,110,200
栄研化学	13,600	1,992.00	27,091,200
日水製薬	7,300	1,194.00	8,716,200
鳥居薬品	12,000	2,841.00	34,092,000
J C Rファーマ	13,500	2,326.00	31,401,000
東和薬品	9,000	4,625.00	41,625,000
富士製薬工業	5,100	1,904.00	9,710,400
沢井製薬	27,800	6,100.00	169,580,000
ゼリア新薬工業	27,700	2,077.00	57,532,900

第一三共	553,400	1,619.00	895,954,600
キョーリン製薬HD	46,800	2,142.00	100,245,600
大幸薬品	8,400	1,913.00	16,069,200
ダイト	6,000	1,931.00	11,586,000
大塚ホールディングス	348,300	3,735.50	1,301,074,650
大正製薬HD	42,200	7,080.00	298,776,000
大日本塗料	101,000	144.00	14,544,000
日本ペイントHOLD	152,000	2,208.00	335,616,000
関西ペイント	213,000	1,442.00	307,146,000
神東塗料	11,000	201.00	2,211,000
中国塗料	50,000	740.00	37,000,000
日本特殊塗料	13,700	637.00	8,726,900
藤倉化成	22,400	509.00	11,401,600
太陽ホールディングス	14,300	3,320.00	47,476,000
D I C	703,000	220.00	154,660,000
サカタインクス	36,000	1,001.00	36,036,000
東洋インキSCホールディン	158,000	472.00	74,576,000
T & K TOKA	6,400	2,300.00	14,720,000
アルプス技研	7,200	1,206.00	8,683,200
サニックス	25,400	512.00	13,004,800
ダイオーズ	3,400	874.00	2,971,600
日本空調サービス	8,800	742.00	6,529,600
オリエンタルランド	47,300	20,600.00	974,380,000
ダスキン	46,300	1,727.00	79,960,100
パーク24	86,900	1,658.00	144,080,200
明光ネットワークジャパン	17,500	1,148.00	20,090,000
ファルコホールディングス	9,000	1,141.00	10,269,000
クレスコ	3,800	1,320.00	5,016,000
フジ・メディア・HD	159,900	1,448.00	231,535,200
秀英予備校	3,800	312.00	1,185,600
田谷	3,200	761.00	2,435,200
ラウンドワン	49,700	657.00	32,652,900
リゾートトラスト	59,200	2,329.00	137,876,800
オービック	57,000	3,595.00	204,915,000
ジャストシステム	22,500	823.00	18,517,500
TDCソフトウェアエンジニア	3,800	859.00	3,264,200
ヤフー	1,185,100	402.00	476,410,200
ビー・エム・エル	11,500	3,050.00	35,075,000
ワタベウェディング	6,000	553.00	3,318,000
トレンドマイクロ	87,600	3,405.00	298,278,000
もしもしホットライン	32,700	979.00	32,013,300
リソー教育	19,800	224.00	4,435,200
日本オラクル	26,400	4,215.00	111,276,000
早稲田アカデミー	2,900	772.00	2,238,800
アルファシステムズ	5,500	1,483.00	8,156,500
フューチャーアーキテクト	17,500	609.00	10,657,500
CAC HOLDINGS	10,300	1,199.00	12,349,700
ソフトバンク・テクノ	3,900	1,264.00	4,929,600
トーセ	4,300	711.00	3,057,300
ユー・エス・エス	211,900	1,515.00	321,028,500

オービックビジネスC	8,400	3,180.00	26,712,000
伊藤忠テクノソリューションズ	18,700	4,275.00	79,942,500
アイティフォー	18,500	446.00	8,251,000
東京個別指導学院	8,700	399.00	3,471,300
東計電算	3,000	1,574.00	4,722,000
楽天	759,500	1,150.00	873,425,000
エクスネット	1,700	1,385.00	2,354,500
テー・オー・ダブリュー	6,100	706.00	4,306,600
大塚商会	44,500	4,155.00	184,897,500
総合メディカル	4,000	5,090.00	20,360,000
サイボウズ	22,100	332.00	7,337,200
ソフトブレーン	22,700	202.00	4,585,400
アグレックス	4,000	1,055.00	4,220,000
セントラルスポーツ	5,500	1,700.00	9,350,000
バラカ	6,300	763.00	4,806,900
電通国際情報S	10,200	1,154.00	11,770,800
イーエムシステムズ	2,300	1,700.00	3,910,000
ウェザーニューズ	5,000	2,913.00	14,565,000
C I J	14,100	471.00	6,641,100
東洋ビジネスエンジ	1,700	1,333.00	2,266,100
日本エンタープライズ	10,300	390.00	4,017,000
WOWOW	5,100	4,370.00	22,287,000
フルキャストホールディングス	16,400	498.00	8,167,200
富士フイルムHLDGS	401,600	3,348.50	1,344,757,600
コニカミノルタ	425,900	1,097.00	467,212,300
資生堂	312,100	1,726.00	538,684,600
ライオン	202,000	565.00	114,130,000
高砂香料	63,000	476.00	29,988,000
マンダム	17,600	3,495.00	61,512,000
ミルボン	10,400	3,390.00	35,256,000
ファンケル	40,700	1,425.00	57,997,500
コーセー	28,400	4,190.00	118,996,000
コタ	5,100	1,278.00	6,517,800
ドクターシーラボ	11,900	3,545.00	42,185,500
シーボン	1,600	2,282.00	3,651,200
ポーラ・オルビスHD	20,800	4,195.00	87,256,000
ノエビアホールディングス	11,700	1,936.00	22,651,200
アジュバンコスメジャパン	3,000	985.00	2,955,000
エステー	10,900	977.00	10,649,300
コニシ	12,700	1,884.00	23,926,800
長谷川香料	22,300	1,479.00	32,981,700
星光PMC	9,700	928.00	9,001,600
小林製薬	28,700	6,270.00	179,949,000
荒川化学工業	14,800	1,031.00	15,258,800
メック	13,600	1,031.00	14,021,600
日本高純度化学	5,100	2,252.00	11,485,200
JCU	5,200	4,265.00	22,178,000
新田ゼラチン	10,700	833.00	8,913,100
アース製薬	12,600	3,925.00	49,455,000
イハラケミカル	27,100	957.00	25,934,700

北興化学	18,000	359.00	6,462,000
大成ラミック	4,700	2,653.00	12,469,100
クミアイ化学	36,000	622.00	22,392,000
日本農薬	40,100	944.00	37,854,400
昭和シエル石油	156,900	956.00	149,996,400
コスモ石油	485,000	174.00	84,390,000
富士興産	6,200	631.00	3,912,200
ニチレキ	22,000	849.00	18,678,000
東燃ゼネラル石油	265,000	909.00	240,885,000
ユシロ化学	9,600	1,355.00	13,008,000
ビービー・カストロール	7,300	1,033.00	7,540,900
富士石油	44,900	340.00	15,266,000
MORESCO	5,600	1,647.00	9,223,200
出光興産	83,200	2,130.00	177,216,000
JXホールディングス	1,947,400	469.90	915,083,260
横浜ゴム	196,000	892.00	174,832,000
東洋ゴム	79,400	1,627.00	129,183,800
ブリヂストン	550,000	3,358.00	1,846,900,000
住友ゴム	136,900	1,452.00	198,778,800
藤倉ゴム	11,000	753.00	8,283,000
オカモト	60,000	439.00	26,340,000
アキレス	140,000	137.00	19,180,000
フコク	7,400	1,067.00	7,895,800
ニッタ	17,300	2,373.00	41,052,900
クリエートメディック	5,700	988.00	5,631,600
住友理工	32,500	880.00	28,600,000
三ツ星ベルト	45,000	687.00	30,915,000
バンドー化学	64,000	404.00	25,856,000
鬼怒川ゴム	32,000	432.00	13,824,000
旭硝子	864,000	545.30	471,139,200
日本板硝子	846,000	101.00	85,446,000
石塚硝子	23,000	178.00	4,094,000
有沢製作所	29,300	716.00	20,978,800
日本山村硝子	71,000	160.00	11,360,000
日本電気硝子	362,000	470.00	170,140,000
オハラ	6,800	578.00	3,930,400
住友大阪セメント	326,000	326.00	106,276,000
太平洋セメント	1,030,000	378.00	389,340,000
デイ・シイ	18,100	477.00	8,633,700
リゾートソリューション	16,000	220.00	3,520,000
日本ヒューム	16,900	864.00	14,601,600
日本コンクリート	33,000	545.00	17,985,000
三谷セキサン	8,800	1,956.00	17,212,800
ジャパンパイル	21,200	767.00	16,260,400
東海カーボン	152,000	279.00	42,408,000
日本カーボン	93,000	175.00	16,275,000
東洋炭素	9,700	1,913.00	18,556,100
ノリタケ	99,000	241.00	23,859,000
TOTO	258,000	1,115.00	287,670,000
日本碍子	222,000	2,347.00	521,034,000

日本特殊陶業	151,200	2,831.00	428,047,200
ダントーホールディングス	25,000	132.00	3,300,000
MARUWA	4,500	3,115.00	14,017,500
品川リフラクトリーズ	44,000	256.00	11,264,000
黒崎播磨	38,000	224.00	8,512,000
ヨータイ	10,000	360.00	3,600,000
イソライト	7,400	188.00	1,391,200
東京窯業	22,000	196.00	4,312,000
ニッカトー	6,700	398.00	2,666,600
フジミインコーポレーテッド	16,000	1,388.00	22,208,000
エーアンドエーマテリアル	37,000	101.00	3,737,000
ニチアス	85,000	632.00	53,720,000
新日鐵住金	7,416,000	257.00	1,905,912,000
神戸製鋼所	2,798,000	159.00	444,882,000
中山製鋼所	99,000	74.00	7,326,000
合同製鐵	89,000	147.00	13,083,000
JFEホールディングス	447,500	1,973.50	883,141,250
日新製鋼	74,300	840.00	62,412,000
東京製鐵	96,700	545.00	52,701,500
共英製鋼	16,300	1,858.00	30,285,400
大和工業	36,300	3,265.00	118,519,500
東京鐵鋼	37,000	497.00	18,389,000
大阪製鐵	8,800	1,983.00	17,450,400
淀川製鋼所	125,000	395.00	49,375,000
東洋鋼鈹	42,000	512.00	21,504,000
丸一鋼管	58,700	2,461.00	144,460,700
モリ工業	26,000	412.00	10,712,000
大同特殊鋼	294,000	401.00	117,894,000
日本高周波	69,000	99.00	6,831,000
日本冶金工	137,000	241.00	33,017,000
山陽特殊製鋼	96,000	354.00	33,984,000
愛知製鋼	93,000	366.00	34,038,000
日立金属	156,000	1,798.00	280,488,000
日本金属	46,000	137.00	6,302,000
大平洋金属	122,000	348.00	42,456,000
新日本電工	106,800	253.00	27,020,400
栗本鉄工所	91,000	212.00	19,292,000
虹 技	25,000	223.00	5,575,000
日本鑄鉄管	19,000	224.00	4,256,000
日本製鋼所	251,000	390.00	97,890,000
三菱製鋼	106,000	219.00	23,214,000
日亜鋼業	24,000	305.00	7,320,000
日本精線	14,000	686.00	9,604,000
大紀アルミニウム	27,000	289.00	7,803,000
日本軽金属HD	397,300	146.00	58,005,800
三井金属	447,000	279.00	124,713,000
東邦亜鉛	99,000	363.00	35,937,000
三菱マテリアル	1,094,000	325.00	355,550,000
住友鋳山	454,000	1,429.00	648,766,000
DOWAホールディングス	194,000	848.00	164,512,000

古河機金	295,000	199.00	58,705,000
エス・サイエンス	80,000	46.00	3,680,000
大阪チタニウム	19,100	2,099.00	40,090,900
東邦チタニウム	29,700	630.00	18,711,000
U A C J	223,000	377.00	84,071,000
古河電工	552,000	187.00	103,224,000
住友電工	660,900	1,426.00	942,443,400
フジクラ	282,000	464.00	130,848,000
昭和電線H L D G S	225,000	97.00	21,825,000
東京特殊電線	2,500	1,713.00	4,282,500
タツタ電線	25,600	538.00	13,772,800
沖 電 線	18,000	307.00	5,526,000
カナレ電気	2,700	1,636.00	4,417,200
平河ヒューテック	3,900	942.00	3,673,800
リョービ	107,000	291.00	31,137,000
アーレステイ	15,100	639.00	9,648,900
アサヒHD	26,400	1,746.00	46,094,400
東洋製罐グループHD	124,600	1,211.00	150,890,600
ホッカンホールディングス	42,000	272.00	11,424,000
コロナ	9,300	1,101.00	10,239,300
横河ブリッジH L D G S	33,200	1,372.00	45,550,400
O S J B H D	19,200	238.00	4,569,600
駒井ハルテック	34,000	257.00	8,738,000
高田機工	16,000	210.00	3,360,000
三和ホールディングス	143,000	693.00	99,099,000
文化シャツター	41,000	869.00	35,629,000
三協立山	21,400	2,030.00	43,442,000
東洋シャツター	4,900	677.00	3,317,300
L I X I Lグループ	244,300	2,123.00	518,648,900
日本フィルコン	12,100	483.00	5,844,300
ノーリツ	34,400	1,856.00	63,846,400
長府製作所	18,800	2,757.00	51,831,600
リンナイ	27,200	8,830.00	240,176,000
ユニプレス	27,200	1,999.00	54,372,800
ダイニチ工業	9,100	718.00	6,533,800
日東精工	25,000	344.00	8,600,000
三洋工業	23,000	201.00	4,623,000
岡 部	34,600	1,046.00	36,191,600
中国工業	2,900	751.00	2,177,900
東 プ レ	33,800	1,423.00	48,097,400
高周波熱練	25,700	743.00	19,095,100
東京製網	119,000	155.00	18,445,000
モリテックスチル	9,200	316.00	2,907,200
パイオラックス	8,200	4,525.00	37,105,000
日本発条	139,700	916.00	127,965,200
中央発條	23,000	300.00	6,900,000
アドバネクス	35,000	144.00	5,040,000
三浦工業	78,300	1,152.00	90,201,600
タ ク マ	55,000	621.00	34,155,000
リブセンス	8,900	770.00	6,853,000

ジャパンマテリアル	2,000	3,830.00	7,660,000	
サクセスホールディングス	1,100	1,318.00	1,449,800	
アサンテ	3,400	1,311.00	4,457,400	
E R Iホールディングス	4,200	1,099.00	4,615,800	
ツガミ	55,000	551.00	30,305,000	
オークマ	114,000	748.00	85,272,000	
東芝機械	95,000	437.00	41,515,000	
アマダ	261,400	921.00	240,749,400	
アイダエンジニア	38,300	990.00	37,917,000	
滝澤鉄工所	58,000	205.00	11,890,000	
富士機械製造	53,400	940.00	50,196,000	
牧野フライス	87,000	693.00	60,291,000	
オーエスジー	79,800	1,668.00	133,106,400	
ダイジェット	20,000	230.00	4,600,000	
旭ダイヤモンド	45,000	1,322.00	59,490,000	
D M G森精機	103,700	1,166.00	120,914,200	
ディスコ	19,400	6,870.00	133,278,000	
日東工器	10,200	2,088.00	21,297,600	
パンチ工業	2,800	1,378.00	3,858,400	
豊田自動織機	152,600	4,780.00	729,428,000	
豊和工業	9,900	733.00	7,256,700	
大阪機工	68,000	141.00	9,588,000	
石川製作所	40,000	102.00	4,080,000	
東洋機械金属	13,000	456.00	5,928,000	
津田駒工業	43,000	136.00	5,848,000	
エンシュウ	44,000	111.00	4,884,000	
島精機製作所	22,800	1,613.00	36,776,400	
日阪製作所	22,200	924.00	20,512,800	
やまびこ	6,900	3,825.00	26,392,500	
ベガサスミシン製造	16,100	586.00	9,434,600	
ナプテスコ	80,000	2,393.00	191,440,000	
三井海洋開発	17,600	2,555.00	44,968,000	
レオン自動機	16,000	460.00	7,360,000	
S M C	50,200	26,815.00	1,346,113,000	
新川	14,700	518.00	7,614,600	
ホソカワミクロン	29,000	590.00	17,110,000	
ユニオンツール	8,700	2,658.00	23,124,600	
オイレス工業	19,920	1,934.00	38,525,280	
日精エーエスビー	5,600	2,066.00	11,569,600	
サトーホールディングス	19,600	2,617.00	51,293,200	
日本エアテック	5,300	980.00	5,194,000	
日精樹脂工業	12,800	808.00	10,342,400	
ワイエイシイ	7,200	574.00	4,132,800	
小松製作所	818,400	2,348.50	1,922,012,400	
住友重機械	480,000	541.00	259,680,000	
日立建機	89,500	1,962.00	175,599,000	
日工	26,000	387.00	10,062,000	
巴工業	6,200	1,810.00	11,222,000	
井関農機	179,000	239.00	42,781,000	
T O W A	14,400	586.00	8,438,400	

丸山製作所	39,000	226.00	8,814,000
北川鉄工所	81,000	167.00	13,527,000
シンニッタン	16,700	551.00	9,201,700
クボタ	911,000	1,508.00	1,373,788,000
荏原実業	4,900	1,383.00	6,776,700
東洋エンジニア	100,000	498.00	49,800,000
三菱化工機	58,000	387.00	22,446,000
月島機械	28,500	1,121.00	31,948,500
帝国電機製作所	12,600	1,194.00	15,044,400
東京機械	61,000	75.00	4,575,000
新東工業	41,200	710.00	29,252,000
渋谷工業	14,600	2,509.00	36,631,400
アイチ コーポレーション	25,000	467.00	11,675,000
小森コーポレーション	42,600	1,133.00	48,265,800
鶴見製作所	13,000	1,733.00	22,529,000
住友精密	28,000	389.00	10,892,000
酒井重工業	33,000	262.00	8,646,000
荏原製作所	387,000	580.00	224,460,000
石井鉄工所	26,000	224.00	5,824,000
西島製作所	18,600	800.00	14,880,000
北越工業	13,000	962.00	12,506,000
千代田化工建	149,000	1,060.00	157,940,000
ダイキン工業	228,800	6,049.00	1,384,011,200
オルガノ	27,000	474.00	12,798,000
トーヨーカネツ	94,000	235.00	22,090,000
栗田工業	105,400	2,153.00	226,926,200
椿本チエイン	90,000	807.00	72,630,000
大同工業	34,000	249.00	8,466,000
日本コンベヤ	55,000	221.00	12,155,000
日 機 装	54,300	1,077.00	58,481,100
木村化工機	16,100	443.00	7,132,300
新興ブランテック	38,700	772.00	29,876,400
アネスト岩田	28,500	746.00	21,261,000
ダイフク	71,000	1,110.00	78,810,000
サムコ	2,300	992.00	2,281,600
加藤製作所	40,000	730.00	29,200,000
油研工業	33,000	228.00	7,524,000
タダノ	74,000	1,651.00	122,174,000
フジテック	48,800	1,101.00	53,728,800
C K D	46,900	911.00	42,725,900
キトー	19,800	1,218.00	24,116,400
平和	36,500	2,097.00	76,540,500
理想科学工業	13,000	3,065.00	39,845,000
S A N K Y O	50,800	3,715.00	188,722,000
日本金銭機械	15,500	1,878.00	29,109,000
マースエンジニアリング	9,600	1,878.00	18,028,800
福島工業	9,200	1,992.00	18,326,400
オーイズミ	5,900	935.00	5,516,500
ダイコク電機	7,000	1,836.00	12,852,000
ア マ ノ	47,900	1,113.00	53,312,700

JUKI	118,000	327.00	38,586,000
サンデン	95,000	561.00	53,295,000
蛇の目マシン	163,000	164.00	26,732,000
ブラザー工業	216,600	1,727.00	374,068,200
マックス	26,000	1,165.00	30,290,000
モリタホールディングス	29,400	1,043.00	30,664,200
グローリー	50,000	2,636.00	131,800,000
新晃工業	11,800	966.00	11,398,800
大和冷機工業	24,000	789.00	18,936,000
セガサミーホールディングス	180,100	1,564.00	281,676,400
日本ビストンリング	66,000	216.00	14,256,000
リケン	67,000	419.00	28,073,000
TPR	18,700	2,180.00	40,766,000
ホシザキ電機	36,700	4,580.00	168,086,000
大豊工業	12,100	1,040.00	12,584,000
日本精工	373,000	1,304.00	486,392,000
NTN	388,000	433.00	168,004,000
ジェイテクト	178,000	1,583.00	281,774,000
不二越	156,000	635.00	99,060,000
ミネベア	228,000	1,292.00	294,576,000
日本トムソン	54,000	483.00	26,082,000
THK	104,400	2,461.00	256,928,400
ユーシン精機	7,400	2,061.00	15,251,400
前澤給装工業	6,600	1,295.00	8,547,000
イーグル工業	20,700	2,040.00	42,228,000
前澤工業	12,400	311.00	3,856,400
日本ビラー工業	18,300	863.00	15,792,900
キッツ	75,100	487.00	36,573,700
日立	4,033,000	759.20	3,061,853,600
東芝	3,307,000	444.30	1,469,300,100
三菱電機	1,676,000	1,263.00	2,116,788,000
富士電機	466,000	439.00	204,574,000
東洋電機製造	36,000	392.00	14,112,000
安川電機	183,700	1,280.00	235,136,000
シンフォニアテクノロジー	101,000	149.00	15,049,000
明電舎	154,000	387.00	59,598,000
オリジン電気	25,000	416.00	10,400,000
山洋電気	34,000	779.00	26,486,000
デンヨー	16,500	1,349.00	22,258,500
日立工機	44,800	853.00	38,214,400
三桜工業	21,700	671.00	14,560,700
マキタ	109,200	5,390.00	588,588,000
東芝テック	105,000	619.00	64,995,000
芝浦メカトロニクス	30,000	285.00	8,550,000
マブチモーター	25,600	8,500.00	217,600,000
日本電産	183,501	6,573.00	1,206,152,073
東光高岳	9,400	1,418.00	13,329,200
宮越ホールディングス	5,700	565.00	3,220,500
ダイヘン	99,000	355.00	35,145,000
ヤーマン	2,200	1,323.00	2,910,600

JVCケンウッド	115,700	240.00	27,768,000
第一精工	6,100	1,981.00	12,084,100
日新電機	34,000	553.00	18,802,000
大崎電気	26,000	579.00	15,054,000
オムロン	189,000	4,440.00	839,160,000
日東工業	24,600	1,902.00	46,789,200
I D E C	22,000	858.00	18,876,000
ジーエス・ユアサ コーポ	323,000	534.00	172,482,000
サクサホールディングス	43,000	153.00	6,579,000
メルコホールディングス	8,100	1,866.00	15,114,600
テクノメディカ	3,800	2,099.00	7,976,200
日本電気	2,304,000	336.00	774,144,000
富士通	1,615,000	668.80	1,080,112,000
沖電気	748,000	231.00	172,788,000
岩崎通信機	79,000	86.00	6,794,000
電気興業	48,000	553.00	26,544,000
サンケン電気	91,000	810.00	73,710,000
ナカヨ	16,000	394.00	6,304,000
アイホン	9,800	1,719.00	16,846,200
ルネサスエレクトロニクス	86,700	770.00	66,759,000
セイコーエプソン	114,400	4,575.00	523,380,000
ワコム	131,900	419.00	55,266,100
アルバック	30,800	1,215.00	37,422,000
アクセル	8,400	1,512.00	12,700,800
ビクセラ	7,200	128.00	921,600
E I Z O	15,400	2,259.00	34,788,600
ジャパンディスプレイ	281,600	439.00	123,622,400
日本信号	46,300	1,025.00	47,457,500
京三製作所	40,000	330.00	13,200,000
能美防災	22,000	1,526.00	33,572,000
ホーチキ	12,000	846.00	10,152,000
エレコム	6,100	2,292.00	13,981,200
日本無線	43,000	340.00	14,620,000
パナソニック	1,914,400	1,175.50	2,250,377,200
シャープ	1,208,000	274.00	330,992,000
アンリツ	97,300	744.00	72,391,200
富士通ゼネラル	40,000	1,180.00	47,200,000
日立国際電気	33,000	1,369.00	45,177,000
ソニー	960,300	1,822.00	1,749,666,600
T D K	101,100	5,430.00	548,973,000
帝国通信工業	40,000	171.00	6,840,000
ミツミ電機	63,700	669.00	42,615,300
タムラ製作所	65,000	378.00	24,570,000
アルプス電気	122,800	1,695.00	208,146,000
池上通信機	53,000	113.00	5,989,000
パイオニア	232,400	266.00	61,818,400
日本電波工業	15,200	840.00	12,768,000
日本トリム	3,600	2,592.00	9,331,200
ローランド ディー . ジー .	7,400	4,210.00	31,154,000
日本コロムビア	8,400	454.00	3,813,600

フオスター電機	17,100	1,454.00	24,863,400
クラリオン	103,000	394.00	40,582,000
S M K	49,000	456.00	22,344,000
ヨコオ	14,500	538.00	7,801,000
東 光	39,000	287.00	11,193,000
ティアック	91,000	53.00	4,823,000
ホシデン	49,200	527.00	25,928,400
ヒロセ電機	29,100	12,450.00	362,295,000
日本航空電子	43,000	2,000.00	86,000,000
T O A	18,000	1,058.00	19,044,000
日立マクセル	29,200	1,720.00	50,224,000
古野電気	21,600	967.00	20,887,200
ユニデン	52,000	216.00	11,232,000
アルパイン	36,300	1,598.00	58,007,400
スミダコーポレーション	14,200	694.00	9,854,800
アイコム	9,300	2,474.00	23,008,200
リオン	4,800	1,300.00	6,240,000
船井電機	17,000	1,044.00	17,748,000
横河電機	181,600	1,239.00	225,002,400
新電元工業	54,000	579.00	31,266,000
アズビル	50,800	2,454.00	124,663,200
東亜ディーケーケー	6,300	554.00	3,490,200
日本光電工業	35,700	5,260.00	187,782,000
チ ノ ー	6,000	1,274.00	7,644,000
共和電業	21,000	434.00	9,114,000
日本電子材料	7,300	550.00	4,015,000
堀場製作所	31,000	3,580.00	110,980,000
アドバンテスト	114,200	1,235.00	141,037,000
小野測器	8,500	897.00	7,624,500
エスベック	17,400	930.00	16,182,000
パナソニックデバイス	15,000	506.00	7,590,000
キーエンス	38,000	43,950.00	1,670,100,000
日置電機	8,800	1,651.00	14,528,800
シスメックス	140,500	3,980.00	559,190,000
メガチップス	15,000	1,414.00	21,210,000
O B A R A G R O U P	10,900	3,705.00	40,384,500
イマジカ・ロボットHD	8,800	435.00	3,828,000
澤藤電機	11,000	210.00	2,310,000
デンソー	414,000	4,611.00	1,908,954,000
コーセル	24,400	1,206.00	29,426,400
新日本無線	12,000	488.00	5,856,000
オプテックス	10,900	1,831.00	19,957,900
千代田インテグレ	7,400	1,405.00	10,397,000
レーザーテック	17,200	1,268.00	21,809,600
スタンレー電気	120,700	2,047.00	247,072,900
岩崎電気	61,000	222.00	13,542,000
ウシオ電機	101,700	1,064.00	108,208,800
岡谷電機	9,500	367.00	3,486,500
ヘリオステクノH	14,500	313.00	4,538,500
日本セラミック	9,600	1,497.00	14,371,200

遠藤照明	9,300	1,225.00	11,392,500	
日本デジタル研究所	12,400	1,971.00	24,440,400	
古河電池	12,000	939.00	11,268,000	
双信電機	8,500	367.00	3,119,500	
山一電機	18,200	715.00	13,013,000	
函 研	10,900	934.00	10,180,600	
日本電子	64,000	481.00	30,784,000	
カ シ オ	168,000	1,586.00	266,448,000	
ファナック	186,900	18,005.00	3,365,134,500	
日本シイエムケイ	39,600	258.00	10,216,800	
エンプラス	5,700	4,870.00	27,759,000	
大真空	31,000	313.00	9,703,000	
ロ ー ム	88,500	5,830.00	515,955,000	
浜松ホトニクス	69,700	4,540.00	316,438,000	
三井ハイテック	22,200	626.00	13,897,200	
新光電気工業	56,200	683.00	38,384,600	
京 セ ラ	294,700	4,576.50	1,348,694,550	
協栄産業	20,000	205.00	4,100,000	
太陽誘電	81,500	1,039.00	84,678,500	
村田製作所	175,800	10,960.00	1,926,768,000	
ユーシン	23,600	679.00	16,024,400	
双葉電子工業	31,000	1,493.00	46,283,000	
日東電工	144,600	5,479.00	792,263,400	
北陸電気工業	68,000	153.00	10,404,000	
東海理化電機	44,200	2,049.00	90,565,800	
ニチコン	52,800	710.00	37,488,000	
日本ケミコン	117,000	289.00	33,813,000	
K O A	21,100	1,029.00	21,711,900	
三井造船	649,000	227.00	147,323,000	
日立造船	131,700	578.00	76,122,600	
三菱重工業	2,984,000	620.50	1,851,572,000	
川崎重工業	1,305,000	395.00	515,475,000	
I H I	1,207,000	490.00	591,430,000	
名村造船所	47,904	927.00	44,407,008	
サノヤスホールディングス	20,700	211.00	4,367,700	
日本車輛	61,000	334.00	20,374,000	
ニチユ三菱フォークリフト	19,400	711.00	13,793,400	
近畿車輛	29,000	302.00	8,758,000	
F P G	13,200	894.00	11,800,800	
島根銀行	3,800	1,312.00	4,985,600	
じもとホールディングス	119,100	200.00	23,820,000	
全国保証	39,400	3,075.00	121,155,000	
足利ホールディングス	86,700	386.00	33,466,200	
東京TYフィナンシャルG	18,704	3,130.00	58,543,520	
日産自動車	2,352,000	962.70	2,264,270,400	
いすゞ自動車	485,500	1,330.00	645,715,000	
トヨタ自動車	2,311,800	5,978.00	13,819,940,400	*
日野自動車	209,300	1,424.00	298,043,200	
三菱自動車工業	599,600	1,152.00	690,739,200	
エフテック	7,200	1,107.00	7,970,400	

レシップホールディングス	5,600	771.00	4,317,600
GMB	2,300	1,315.00	3,024,500
武蔵精密工業	17,900	1,984.00	35,513,600
日産車体	81,900	1,490.00	122,031,000
新明和工業	68,000	908.00	61,744,000
極東開発工業	28,900	1,423.00	41,124,700
日信工業	34,100	1,573.00	53,639,300
トピー工業	138,000	193.00	26,634,000
ティラド	66,000	256.00	16,896,000
曙ブレーキ	78,200	407.00	31,827,400
タチエス	24,700	1,342.00	33,147,400
N O K	81,100	2,353.00	190,828,300
フタバ産業	51,200	544.00	27,852,800
カヤバ工業	158,000	446.00	70,468,000
シロキ工業	38,000	217.00	8,246,000
市光工業	41,000	220.00	9,020,000
大同メタル工業	23,000	1,218.00	28,014,000
プレス工業	65,000	422.00	27,430,000
カルソニックカンセイ	114,000	530.00	60,420,000
太平洋工業	34,300	754.00	25,862,200
ケーヒン	38,600	1,301.00	50,218,600
河西工業	22,700	928.00	21,065,600
アイシン精機	153,300	3,635.00	557,245,500
富士機工	19,000	543.00	10,317,000
マ ッ ダ	499,300	2,299.00	1,147,890,700
ダイハツ	177,800	1,577.00	280,390,600
今仙電機製作所	12,700	1,858.00	23,596,600
本田技研	1,507,900	3,404.00	5,132,891,600
スズキ	350,300	3,116.00	1,091,534,800
富士重工業	570,200	3,164.50	1,804,397,900
安永	5,700	556.00	3,169,200
ヤマハ発動機	254,800	1,843.00	469,596,400
ショーワ	39,600	1,013.00	40,114,800
小糸製作所	92,000	2,600.00	239,200,000
T B K	19,000	629.00	11,951,000
エクセディ	20,300	2,513.00	51,013,900
ミツバ	30,900	1,576.00	48,698,400
豊田合成	54,200	1,933.00	104,768,600
愛三工業	21,100	780.00	16,458,000
ヨ ロ ズ	14,000	1,754.00	24,556,000
エフ・シー・シー	27,500	1,667.00	45,842,500
新家工業	39,000	166.00	6,474,000
シマノ	72,400	12,160.00	880,384,000
タカタ	30,300	2,154.00	65,266,200
テイ・エス テック	35,400	2,253.00	79,756,200
小 野 建	14,400	1,109.00	15,969,600
はるやま商事	7,000	701.00	4,907,000
佐鳥電機	13,300	672.00	8,937,600
カップ・クリエイトHD	24,400	1,127.00	27,498,800
エコートレーディング	4,600	653.00	3,003,800

伯東	10,200	1,030.00	10,506,000
コンドーテック	13,800	674.00	9,301,200
中山福	9,800	761.00	7,457,800
ライトオン	12,400	698.00	8,655,200
ナガイレーベン	23,900	1,903.00	45,481,700
ジーンズメイト	5,400	205.00	1,107,000
三菱食品	18,300	2,224.00	40,699,200
良品計画	17,500	13,440.00	235,200,000
三城ホールディングス	20,700	460.00	9,522,000
松田産業	12,300	1,161.00	14,280,300
メディパルHD	165,400	1,181.00	195,337,400
アドヴァン	8,600	1,132.00	9,735,200
S P K	4,100	1,875.00	7,687,500
アズワン	10,800	3,295.00	35,586,000
スズデン	6,200	623.00	3,862,600
尾家産業	6,100	816.00	4,977,600
シモジマ	11,500	951.00	10,936,500
ドウシシャ	17,700	1,891.00	33,470,700
小津産業	3,300	1,675.00	5,527,500
コナカ	19,500	570.00	11,115,000
高速	10,000	867.00	8,670,000
ハウス ローゼ	2,100	1,379.00	2,895,900
G - 7ホールディングス	5,000	898.00	4,490,000
イオン北海道	10,300	632.00	6,509,600
コジマ	24,500	297.00	7,276,500
ヒマラヤ	3,900	961.00	3,747,900
コーナン商事	21,700	1,145.00	24,846,500
黒田電気	26,800	1,519.00	40,709,200
ネットワンシステムズ	62,600	602.00	37,685,200
エコス	6,000	764.00	4,584,000
ワタミ	19,600	1,246.00	24,421,600
マルシェ	4,300	838.00	3,603,400
ドンキホーテホールディング	57,100	6,250.00	356,875,000
丸文	14,700	663.00	9,746,100
西松屋チェーン	32,600	917.00	29,894,200
ゼンショーホールディングス	75,900	951.00	72,180,900
ハピネット	10,000	1,605.00	16,050,000
幸楽苑	10,400	1,360.00	14,144,000
ハークスレイ	4,800	855.00	4,104,000
サイゼリヤ	24,500	1,436.00	35,182,000
エクセル	7,600	1,995.00	15,162,000
マルカキカイ	5,400	1,288.00	6,955,200
アルゴグラフィックス	6,200	1,872.00	11,606,400
ガリバーインターナショナル	55,700	827.00	46,063,900
日本エム・ディ・エム	13,800	440.00	6,072,000
ポプラ	4,700	525.00	2,467,500
ユナイテッドアローズ	21,600	3,730.00	80,568,000
進和	9,900	1,201.00	11,889,900
エスケイジャパン	4,400	243.00	1,069,200
ダイトエレクトロン	7,900	457.00	3,610,300

ハイデイ日高	10,500	2,896.00	30,408,000
シークス	10,500	1,779.00	18,679,500
京都きもの友禅	10,600	998.00	10,578,800
コロワイド	54,900	1,238.00	67,966,200
田中商事	5,500	634.00	3,487,000
オーハシテクニカ	8,600	1,233.00	10,603,800
壱番屋	6,700	4,995.00	33,466,500
マクニカ	8,500	3,160.00	26,860,000
白銅	5,500	982.00	5,401,000
トップカルチャー	6,500	520.00	3,380,000
P L A N T	4,300	1,122.00	4,824,600
スギホールディングス	29,700	4,380.00	130,086,000
島津製作所	216,000	912.00	196,992,000
J M S	31,000	286.00	8,866,000
クボテック	4,400	244.00	1,073,600
ショットモリテックス	3,800	261.00	991,800
長野計器	10,800	632.00	6,825,600
ブイ・テクノロジー	3,500	2,452.00	8,582,000
スター精密	31,800	1,616.00	51,388,800
東京計器	58,000	249.00	14,442,000
愛知時計	23,000	306.00	7,038,000
オーバル	12,300	294.00	3,616,200
東京精密	30,000	1,675.00	50,250,000
マニー	4,600	5,750.00	26,450,000
ニコン	312,800	1,452.50	454,342,000
トプコン	45,000	2,294.00	103,230,000
オリンパス	249,600	3,490.00	871,104,000
理研計器	14,800	1,005.00	14,874,000
S C R E E Nホールディングス	159,000	494.00	78,546,000
キヤノン電子	15,400	1,912.00	29,444,800
タムロン	12,900	2,061.00	26,586,900
H O Y A	398,700	3,274.50	1,305,543,150
ノーリツ鋼機	15,200	578.00	8,785,600
エー・アンド・デイ	15,200	474.00	7,204,800
キヤノン	971,500	3,304.50	3,210,321,750
リ コ ー	503,800	1,082.00	545,111,600
シチズンホールディングス	206,300	652.00	134,507,600
リズム時計	76,000	148.00	11,248,000
大研医器	5,800	2,020.00	11,716,000
パラマウントベッドHD	16,100	3,040.00	48,944,000
S H O B I	5,600	399.00	2,234,400
前田工織	16,400	1,194.00	19,581,600
永大産業	22,000	434.00	9,548,000
アートネイチャー	5,400	2,702.00	14,590,800
ダンロップスポーツ	9,400	1,245.00	11,703,000
パンダイナムコH L D G S	184,800	2,607.00	481,773,600
共立印刷	31,000	282.00	8,742,000
フランスベッドH L D G S	106,000	181.00	19,186,000
マーベラス	25,100	1,130.00	28,363,000
パイロットコーポレーション	14,600	5,680.00	82,928,000

萩原工業	2,900	1,590.00	4,611,000	
エイベックス・グループHD	30,400	1,588.00	48,275,200	
トッパン・フォームズ	30,000	1,007.00	30,210,000	
フジシールインターナショナル	20,300	3,135.00	63,640,500	
タカラトミー	55,200	613.00	33,837,600	
廣済堂	15,700	399.00	6,264,300	
アーク	49,600	137.00	6,795,200	
レック	5,600	1,117.00	6,255,200	
タカノ	7,600	592.00	4,499,200	
プロネクサス	17,300	698.00	12,075,400	
ホクシン	13,100	124.00	1,624,400	
ウッドワン	29,000	278.00	8,062,000	
大建工業	69,000	254.00	17,526,000	
きもと	25,800	301.00	7,765,800	
凸版印刷	473,000	717.00	339,141,000	
大日本印刷	510,000	1,002.00	511,020,000	
図書印刷	27,000	487.00	13,149,000	
共同印刷	52,000	375.00	19,500,000	
日本写真印刷	28,100	1,681.00	47,236,100	
光村印刷	3,000	255.00	765,000	
藤森工業	15,000	2,904.00	43,560,000	
宝印刷	9,800	781.00	7,653,800	
前澤化成工業	12,600	1,033.00	13,015,800	
アシックス	166,500	2,326.00	387,279,000	
ツツミ	8,400	2,433.00	20,437,200	
ジェイ エス ピー	11,500	1,796.00	20,654,000	
ニチハ	21,500	919.00	19,758,500	
エフビコ	17,300	2,890.00	49,997,000	
小松ウオール工業	5,700	2,453.00	13,982,100	
ヤマハ	123,200	1,329.00	163,732,800	
河合楽器	5,800	1,977.00	11,466,600	
クリナップ	17,300	886.00	15,327,800	
ビジョン	27,400	6,100.00	167,140,000	
天馬	14,000	1,449.00	20,286,000	
兼松日産農林	27,000	140.00	3,780,000	
キングジム	14,200	743.00	10,550,600	
リンテック	39,800	2,165.00	86,167,000	
T A S A K I	3,200	1,118.00	3,577,600	
信越ポリマー	34,500	506.00	17,457,000	
東リ	46,000	212.00	9,752,000	
イトーキ	35,400	571.00	20,213,400	
任天堂	103,200	11,060.00	1,141,392,000	
三菱鉛筆	13,800	3,235.00	44,643,000	
松風	8,200	1,175.00	9,635,000	
タカラスタンダード	69,000	824.00	56,856,000	
コクヨ	87,200	812.00	70,806,400	
ナカバヤシ	36,000	198.00	7,128,000	
ニフコ	39,200	3,070.00	120,344,000	
グローブライド	88,000	126.00	11,088,000	
岡村製作所	64,500	755.00	48,697,500	

日本バルカー	73,000	287.00	20,951,000
MUTOHホールディングス	23,000	487.00	11,201,000
伊藤忠	1,319,600	1,214.00	1,601,994,400
丸紅	1,447,200	679.60	983,517,120
スクロール	21,900	293.00	6,416,700
高島	31,000	221.00	6,851,000
ヨンドシーホールディングス	12,600	1,924.00	24,242,400
三陽商会	92,000	229.00	21,068,000
長瀬産業	93,600	1,260.00	117,936,000
ナイガイ	64,000	59.00	3,776,000
蝶理	10,700	1,404.00	15,022,800
豊田通商	184,300	2,458.00	453,009,400
オンワードホールディングス	117,000	625.00	73,125,000
三共生興	28,400	374.00	10,621,600
兼松	353,000	157.00	55,421,000
美津濃	83,000	551.00	45,733,000
ツカモトコーポレーション	30,000	125.00	3,750,000
ファミリーマート	55,900	4,125.00	230,587,500
ルック	30,000	222.00	6,660,000
三井物産	1,495,600	1,574.50	2,354,822,200
日本紙パルプ	86,000	311.00	26,746,000
東京エレクトロン	150,300	6,307.00	947,942,100
日立ハイテクノロジーズ	50,100	2,840.00	142,284,000
カメイ	21,700	739.00	16,036,300
東都水産	30,000	184.00	5,520,000
OUGホールディングス	26,000	215.00	5,590,000
スターゼン	60,000	316.00	18,960,000
セイコーHD	108,000	457.00	49,356,000
山善	63,800	788.00	50,274,400
椿本興業	19,000	287.00	5,453,000
住友商事	976,200	1,099.00	1,072,843,800
日本ユニシス	39,900	881.00	35,151,900
内田洋行	41,000	340.00	13,940,000
三菱商事	1,267,500	2,015.00	2,554,012,500
第一実業	38,000	539.00	20,482,000
キヤノンマーケティングJPN	47,200	1,950.00	92,040,000
西華産業	55,000	246.00	13,530,000
佐藤商事	15,000	658.00	9,870,000
菱洋エレクトロ	19,100	1,001.00	19,119,100
東京産業	16,900	371.00	6,269,900
ユアサ商事	17,000	1,970.00	33,490,000
神鋼商事	43,000	251.00	10,793,000
小林産業	11,600	270.00	3,132,000
阪和興業	166,000	371.00	61,586,000
カナデン	2,000	772.00	1,544,000
菱電商事	24,000	749.00	17,976,000
ニプロ	89,200	876.00	78,139,200
フルサト工業	9,100	1,513.00	13,768,300
岩谷産業	183,000	682.00	124,806,000
すてきナイスグループ	71,000	194.00	13,774,000

昭光通商	57,000	148.00	8,436,000
ニチモウ	28,000	177.00	4,956,000
極東貿易	20,000	236.00	4,720,000
イワキ	26,000	225.00	5,850,000
兼松エレクトロニクス	10,600	1,385.00	14,681,000
三愛石油	39,000	661.00	25,779,000
稲畑産業	41,000	977.00	40,057,000
G S Iクレオス	44,000	130.00	5,720,000
明和産業	15,500	378.00	5,859,000
キムラタン	783,000	10.00	7,830,000
ゴールドウイン	40,000	576.00	23,040,000
ユニ・チャーム	322,800	2,401.00	775,042,800
デサント	40,000	894.00	35,760,000
キング	9,000	415.00	3,735,000
ワキタ	32,500	1,102.00	35,815,000
ヤマトインターナショナル	11,900	385.00	4,581,500
東邦ホールディングス	53,000	1,790.00	94,870,000
サンゲツ	29,300	2,615.00	76,619,500
ミツウロコグループ	26,800	505.00	13,534,000
シナネン	36,000	418.00	15,048,000
伊藤忠エネクス	36,700	649.00	23,818,300
サンリオ	41,700	2,894.00	120,679,800
サンワテクノス	9,000	1,073.00	9,657,000
リョーサン	24,600	2,182.00	53,677,200
新光商事	18,300	1,042.00	19,068,600
トーホー	36,000	402.00	14,472,000
三信電気	19,900	744.00	14,805,600
東陽テクニカ	24,300	1,030.00	25,029,000
モスフードサービス	21,700	2,078.00	45,092,600
加賀電子	15,000	1,130.00	16,950,000
三益半導体	14,800	890.00	13,172,000
ソーダニツカ	2,000	441.00	882,000
立花エレテック	10,100	1,308.00	13,210,800
木曽路	20,300	1,870.00	37,961,000
サトレストランシステムズ	15,500	788.00	12,214,000
千趣会	29,900	842.00	25,175,800
タカキュー	13,000	198.00	2,574,000
ケーヨー	28,200	500.00	14,100,000
アデランス	21,000	1,225.00	25,725,000
上新電機	36,000	906.00	32,616,000
日本瓦斯	24,600	2,280.00	56,088,000
ベスト電器	53,600	130.00	6,968,000
マルエツ	34,000	534.00	18,156,000
ロイヤルホールディングス	27,600	1,709.00	47,168,400
東天紅	13,000	176.00	2,288,000
いなげや	18,500	1,064.00	19,684,000
島忠	40,100	2,637.00	105,743,700
チヨダ	19,500	1,993.00	38,863,500
ライフコーポレーション	12,600	1,681.00	21,180,600
カスミ	34,000	1,002.00	34,068,000

リンガーハット	16,100	1,637.00	26,355,700
さが美	14,000	94.00	1,316,000
MR MAX	17,100	305.00	5,215,500
テンアライド	12,800	335.00	4,288,000
AOKIホールディングス	28,500	1,186.00	33,801,000
オークワ	26,000	877.00	22,802,000
コメリ	25,500	2,338.00	59,619,000
青山商事	41,500	2,468.00	102,422,000
しまむら	19,200	9,690.00	186,048,000
CFSコーポレーション	11,100	577.00	6,404,700
はせがわ	5,900	558.00	3,292,200
高島屋	224,000	887.00	198,688,000
松屋	33,300	1,227.00	40,859,100
エイチ・ツー・オーリテイリング	68,000	1,658.00	112,744,000
近鉄百貨店	63,000	293.00	18,459,000
丸栄	27,000	131.00	3,537,000
ニッセンHD	34,100	343.00	11,696,300
パルコ	15,900	882.00	14,023,800
丸井グループ	215,600	846.00	182,397,600
クレディセゾン	135,100	1,976.00	266,957,600
アクシアルリテイリング	9,200	2,244.00	20,644,800
井筒屋	91,000	63.00	5,733,000
ダイエー	204,600	123.00	25,165,800
イオン	660,500	1,068.00	705,414,000
ユニーグループ・HD	158,700	558.00	88,554,600
イズミ	36,900	3,410.00	125,829,000
東武ストア	22,000	280.00	6,160,000
平和堂	33,500	1,911.00	64,018,500
フジ	18,400	1,999.00	36,781,600
ヤオコー	8,300	6,540.00	54,282,000
ゼビオ	19,900	1,658.00	32,994,200
ケーズホールディングス	34,900	3,095.00	108,015,500
Palta	23,100	1,312.00	30,307,200
OLYMPICグループ	9,900	956.00	9,464,400
日産東京販売HD	24,600	270.00	6,642,000
新生銀行	1,431,000	218.00	311,958,000
あおぞら銀行	859,000	367.00	315,253,000
三菱UFJフィナンシャルG	12,531,400	577.40	7,235,630,360
りそなホールディングス	1,572,100	569.30	894,996,530
三井住友トラストHD	3,250,000	415.10	1,349,075,000
三井住友フィナンシャルG	1,250,600	4,023.50	5,031,789,100
第四銀行	209,000	359.00	75,031,000
北越銀行	179,000	200.00	35,800,000
西日本シティ銀行	580,000	264.00	153,120,000
千葉銀行	638,000	703.00	448,514,000
横浜銀行	1,075,000	557.30	599,097,500
常陽銀行	600,000	493.00	295,800,000
群馬銀行	367,000	580.00	212,860,000
武蔵野銀行	26,400	3,225.00	85,140,000
千葉興業銀行	34,300	700.00	24,010,000

筑波銀行	69,000	335.00	23,115,000
七十七銀行	259,000	540.00	139,860,000
青森銀行	122,000	311.00	37,942,000
秋田銀行	114,000	282.00	32,148,000
山形銀行	100,000	473.00	47,300,000
岩手銀行	10,800	4,475.00	48,330,000
東邦銀行	148,000	364.00	53,872,000
東北銀行	86,000	145.00	12,470,000
みちのく銀行	89,000	202.00	17,978,000
ふくおかフィナンシャルG	671,000	481.00	322,751,000
静岡銀行	484,000	1,005.00	486,420,000
十六銀行	207,000	367.00	75,969,000
スルガ銀行	161,100	1,981.00	319,139,100
八十二銀行	305,000	589.00	179,645,000
山梨中央銀行	105,000	435.00	45,675,000
大垣共立銀行	207,000	273.00	56,511,000
福井銀行	142,000	237.00	33,654,000
北國銀行	184,000	342.00	62,928,000
清水銀行	5,700	2,663.00	15,179,100
滋賀銀行	155,000	546.00	84,630,000
南都銀行	160,000	397.00	63,520,000
百五銀行	149,000	416.00	61,984,000
京都銀行	315,000	818.00	257,670,000
紀陽銀行	64,900	1,431.00	92,871,900
三重銀行	69,000	234.00	16,146,000
ほくほくフィナンシャルG	1,124,000	194.00	218,056,000
広島銀行	488,000	483.00	235,704,000
山陰合同銀行	101,000	735.00	74,235,000
中国銀行	118,900	1,436.00	170,740,400
鳥取銀行	53,000	205.00	10,865,000
伊予銀行	176,700	1,012.00	178,820,400
百十四銀行	181,000	319.00	57,739,000
四国銀行	120,000	215.00	25,800,000
阿波銀行	135,000	607.00	81,945,000
鹿児島銀行	115,000	629.00	72,335,000
大分銀行	102,000	373.00	38,046,000
宮崎銀行	110,000	306.00	33,660,000
肥後銀行	135,000	555.00	74,925,000
佐賀銀行	101,000	228.00	23,028,000
十八銀行	103,000	267.00	27,501,000
沖縄銀行	12,300	4,345.00	53,443,500
琉球銀行	32,100	1,587.00	50,942,700
セブン銀行	619,500	406.00	251,517,000
みずほフィナンシャルG	21,483,900	187.00	4,017,489,300
高知銀行	65,000	132.00	8,580,000
山口フィナンシャルG	165,000	945.00	155,925,000
アクリーティブ	11,600	191.00	2,215,600
芙蓉総合リース	17,300	3,910.00	67,643,000
興銀リース	28,900	2,360.00	68,204,000
東京センチュリーリース	38,800	2,578.00	100,026,400

SBIホールディングス	198,600	1,063.00	211,111,800
日本証券金融	72,600	569.00	41,309,400
アイフル	300,800	372.00	111,897,600
日本アジア投資	113,000	68.00	7,684,000
ポケットカード	16,600	604.00	10,026,400
長野銀行	55,000	182.00	10,010,000
名古屋銀行	149,000	375.00	55,875,000
北洋銀行	249,000	393.00	97,857,000
愛知銀行	6,000	4,740.00	28,440,000
第三銀行	94,000	166.00	15,604,000
中京銀行	69,000	190.00	13,110,000
東日本銀行	72,000	247.00	17,784,000
大光銀行	59,000	205.00	12,095,000
愛媛銀行	98,000	229.00	22,442,000
トマト銀行	65,000	167.00	10,855,000
みなと銀行	150,000	197.00	29,550,000
京葉銀行	136,000	507.00	68,952,000
関西アーバン銀行	23,000	1,125.00	25,875,000
栃木銀行	83,000	390.00	32,370,000
北日本銀行	5,200	2,437.00	12,672,400
東和銀行	207,000	91.00	18,837,000
福島銀行	204,000	82.00	16,728,000
大東銀行	107,000	129.00	13,803,000
リコーリース	11,400	2,812.00	32,056,800
イオンフィナンシャルサービス	97,400	2,071.00	201,715,400
アコム	332,200	313.00	103,978,600
ジャックス	100,000	525.00	52,500,000
オリコ	369,200	196.00	72,363,200
日立キャピタル	32,500	2,402.00	78,065,000
アプラスフィナンシャル	79,300	123.00	9,753,900
オリックス	1,032,900	1,355.00	1,399,579,500
三菱UFJリース	419,400	524.00	219,765,600
ジャフコ	22,600	3,630.00	82,038,000
トモニホールディングス	127,000	428.00	54,356,000
大和証券G本社	1,638,000	772.20	1,264,863,600
野村ホールディングス	3,380,700	595.80	2,014,221,060
岡三証券グループ	130,000	728.00	94,640,000
丸三証券	49,200	721.00	35,473,200
東洋証券	67,000	263.00	17,621,000
東海東京HD	175,100	665.00	116,441,500
光世証券	40,000	193.00	7,720,000
水戸証券	48,400	355.00	17,182,000
いちよし証券	32,400	1,179.00	38,199,600
松井証券	84,000	944.00	79,296,000
損保ジャパン興亜HD	367,400	2,426.00	891,312,400
だいこう証券ビジ	8,100	602.00	4,876,200
日本取引所グループ	242,800	2,316.00	562,324,800
マネックスG	179,500	240.00	43,080,000
カブドットコム証券	64,100	495.00	31,729,500
極東証券	20,500	1,659.00	34,009,500

岩井コスモホールディング	15,700	1,000.00	15,700,000
フィデアホール	95,500	205.00	19,577,500
池田泉州HD	124,000	526.00	65,224,000
アニコムホールディングス	6,800	1,214.00	8,255,200
MS&AD	494,200	2,182.00	1,078,344,400
マネースクウェアHD	4,300	1,289.00	5,542,700
SONY FH	158,400	1,662.00	263,260,800
マネーパートナーズGP	17,000	411.00	6,987,000
小林洋行	5,200	249.00	1,294,800
第一生命	986,300	1,452.00	1,432,107,600
東京海上HD	640,500	3,209.00	2,055,364,500
イー・ギャランティ	4,900	1,660.00	8,134,000
アサックス	3,000	1,266.00	3,798,000
NECキャピタルソリューション	5,600	1,862.00	10,427,200
T&Dホールディングス	567,200	1,262.00	715,806,400
三井不動産	868,000	2,940.00	2,551,920,000
三菱地所	1,157,000	2,189.00	2,532,673,000
平和不動産	33,500	1,585.00	53,097,500
東京建物	361,000	788.00	284,468,000
ダイビル	48,700	1,115.00	54,300,500
京阪神ビルディング	27,900	557.00	15,540,300
住友不動産	396,000	3,498.00	1,385,208,000
太平洋興発	70,000	88.00	6,160,000
大京	278,000	183.00	50,874,000
テーオーシー	57,100	644.00	36,772,400
東京楽天地	27,000	481.00	12,987,000
レオパレス21	190,000	542.00	102,980,000
フジ住宅	21,500	573.00	12,319,500
空港施設	20,100	678.00	13,627,800
明和地所	8,300	475.00	3,942,500
住友不動産販売	11,900	2,349.00	27,953,100
ゴールドクレスト	13,000	1,777.00	23,101,000
リロ・ホールディング	6,600	7,050.00	46,530,000
日本エスリード	6,600	946.00	6,243,600
日神不動産	22,300	425.00	9,477,500
タカラレーベン	54,200	380.00	20,596,000
サンヨーハウジ名古屋	9,500	1,104.00	10,488,000
イオンモール	106,700	1,868.00	199,315,600
ファースト住建	6,300	1,314.00	8,278,200
ランド	47,600	12.00	571,200
東祥	3,800	2,172.00	8,253,600
トーセイ	22,700	621.00	14,096,700
穴吹興産	15,000	219.00	3,285,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	102,700	1,023.00	105,062,100
サンフロンティア不動産	15,600	1,119.00	17,456,400
エフ・ジェー・ネクスト	9,100	442.00	4,022,200
ランドビジネス	8,500	387.00	3,289,500
グランディハウス	13,400	299.00	4,006,600
東武鉄道	951,000	507.00	482,157,000
相鉄ホールディングス	287,000	381.00	109,347,000

東京急行	986,000	650.00	640,900,000	
京浜急行	430,000	831.00	357,330,000	
小田急電鉄	537,000	911.00	489,207,000	
京王電鉄	468,000	738.00	345,384,000	
京成電鉄	251,000	1,119.00	280,869,000	
富士急行	46,000	998.00	45,908,000	
新京成電鉄	22,000	376.00	8,272,000	
東日本旅客鉄道	307,100	7,853.00	2,411,656,300	
西日本旅客鉄道	151,200	4,803.00	726,213,600	
東海旅客鉄道	150,000	13,735.00	2,060,250,000	
西武ホールディングス	133,500	1,975.00	263,662,500	
鴻池運輸	11,800	1,905.00	22,479,000	
西日本鉄道	217,000	402.00	87,234,000	
ハマキョウレックス	4,800	3,580.00	17,184,000	
サカイ引越センター	2,800	3,750.00	10,500,000	
近畿日本鉄道	1,686,000	350.00	590,100,000	
阪急阪神HLDGS	1,124,000	588.00	660,912,000	
南海電鉄	349,000	479.00	167,171,000	
京阪電鉄	353,000	444.00	156,732,000	
神戸電鉄	41,000	341.00	13,981,000	
名糖運輸	7,200	655.00	4,716,000	
名古屋鉄道	595,000	409.00	243,355,000	
山陽電鉄	61,000	432.00	26,352,000	
トランコム	4,800	4,370.00	20,976,000	
日本通運	663,000	425.00	281,775,000	
ヤマトホールディングス	307,400	1,984.50	610,035,300	
山 九	204,000	497.00	101,388,000	
日 新	64,000	262.00	16,768,000	
丸 運	11,200	238.00	2,665,600	
丸全昭和運輸	56,000	326.00	18,256,000	
センコー	67,000	462.00	30,954,000	
トナミホールディングス	35,000	230.00	8,050,000	
日本梱包運輸	51,100	1,724.00	88,096,400	
日石輸送	20,000	222.00	4,440,000	
福山通運	101,000	520.00	52,520,000	
セイノーホールディングス	119,000	783.00	93,177,000	
神奈川中央交通	20,000	514.00	10,280,000	
日立物流	34,900	1,341.00	46,800,900	
日本郵船	1,415,000	262.00	370,730,000	
商船三井	941,000	325.00	305,825,000	
川崎汽船	733,000	217.00	159,061,000	
NSユナイテッド海運	72,000	237.00	17,064,000	
明治海運	15,300	360.00	5,508,000	
飯野海運	69,400	560.00	38,864,000	
共栄タンカー	14,000	196.00	2,744,000	
第一中央汽船	124,000	65.00	8,060,000	
日本航空	282,800	2,652.00	749,985,600	
ANAホールディングス	3,293,000	230.10	757,719,300	
スカイマーク	47,500	201.00	9,547,500	
バスコ	16,000	385.00	6,160,000	

三菱倉庫	110,000	1,456.00	160,160,000
三井倉庫HOLD	84,000	382.00	32,088,000
住友倉庫	112,000	548.00	61,376,000
渋沢倉庫	40,000	322.00	12,880,000
ヤマタネ	83,000	164.00	13,612,000
東陽倉庫	29,000	261.00	7,569,000
乾汽船	7,035	919.00	6,465,165
日本トランスシティ	35,000	352.00	12,320,000
ケイヒン	31,000	153.00	4,743,000
中央倉庫	9,800	850.00	8,330,000
安田倉庫	13,200	973.00	12,843,600
東洋埠頭	49,000	195.00	9,555,000
宇徳	13,600	462.00	6,283,200
上組	200,000	966.00	193,200,000
サンリツ	1,700	509.00	865,300
キムラユニティー	4,100	943.00	3,866,300
キューソー流通システム	4,700	1,197.00	5,625,900
郵船ロジスティクス	15,400	1,013.00	15,600,200
近鉄エクスプレス	15,000	4,025.00	60,375,000
東海運	9,700	256.00	2,483,200
エーアイティー	6,400	763.00	4,883,200
東京放送HD	89,100	1,116.00	99,435,600
日本テレビHLD S	164,700	1,584.00	260,884,800
テレビ朝日HD	41,900	1,622.00	67,961,800
スカパーJ S A T H D	125,600	605.00	75,988,000
テレビ東京HD	13,500	2,196.00	29,646,000
コネクシオ	14,700	1,100.00	16,170,000
クロップス	1,400	534.00	747,600
日本電信電話	649,800	6,218.00	4,040,456,400
K D D I	513,300	6,284.00	3,225,577,200
光通信	14,900	6,900.00	102,810,000
N T T ドコモ	1,362,600	1,673.50	2,280,311,100
GMOインターネット	55,200	839.00	46,312,800
K A D O K A W A ・ D W A N G O	38,839	2,066.00	80,241,374
学研ホールディングス	55,000	239.00	13,145,000
ゼンリン	21,900	1,196.00	26,192,400
昭文社	10,100	688.00	6,948,800
インプレスホールディングス	12,200	120.00	1,464,000
東京電力	1,421,100	339.00	481,752,900
中部電力	552,100	1,194.50	659,483,450
関西電力	683,800	904.40	618,428,720
中国電力	231,600	1,306.00	302,469,600
北陸電力	164,100	1,354.00	222,191,400
東北電力	418,600	1,133.00	474,273,800
四国電力	150,800	1,278.00	192,722,400
九州電力	370,000	1,021.00	377,770,000
北海道電力	156,800	791.00	124,028,800
沖縄電力	10,900	3,200.00	34,880,000
電源開発	104,000	3,415.00	355,160,000
東京瓦斯	1,909,000	573.60	1,095,002,400

大阪瓦斯	1,734,000	410.90	712,500,600
東邦瓦斯	426,000	549.00	233,874,000
北海道瓦斯	34,000	286.00	9,724,000
西部瓦斯	189,000	250.00	47,250,000
静岡瓦斯	47,600	663.00	31,558,800
アイネット	7,100	833.00	5,914,300
松竹	109,000	983.00	107,147,000
東宝	118,000	2,404.00	283,672,000
エイチ・アイ・エス	28,500	2,522.00	71,877,000
東映	69,000	541.00	37,329,000
AOI Pro.	7,500	671.00	5,032,500
NTTデータ	116,700	3,785.00	441,709,500
共立メンテナンス	8,700	4,025.00	35,017,500
イチネンホールディングス	18,600	833.00	15,493,800
建設技術研究所	10,300	1,580.00	16,274,000
スペース	8,900	1,227.00	10,920,300
アインファーマシーズ	18,200	2,546.00	46,337,200
燦ホールディングス	3,600	1,506.00	5,421,600
スバル興業	3,000	401.00	1,203,000
東京テアトル	68,000	133.00	9,044,000
よみうりランド	35,000	432.00	15,120,000
東京都競馬	120,000	282.00	33,840,000
常磐興産	61,000	137.00	8,357,000
カナモト	24,400	3,605.00	87,962,000
東京ドーム	130,000	421.00	54,730,000
D T S	15,800	2,082.00	32,895,600
スクウェア・エニックス・HD	60,100	2,086.00	125,368,600
シーイーシー	9,900	977.00	9,672,300
カプコン	42,400	1,614.00	68,433,600
西尾レントオール	14,100	3,710.00	52,311,000
アゴーラ・ホスピタリティーG	73,000	46.00	3,358,000
日本空港ビルデング	57,100	3,620.00	206,702,000
トランス・コスモス	22,800	1,988.00	45,326,400
乃村工藝社	34,400	971.00	33,402,400
ジャステック	9,700	843.00	8,177,100
S C S K	39,300	2,757.00	108,350,100
藤田観光	64,000	339.00	21,696,000
K N T - C Tホールディングス	85,000	157.00	13,345,000
日本管財	7,500	2,607.00	19,552,500
トーカイ	7,800	3,145.00	24,531,000
白洋舎	5,000	243.00	1,215,000
セコム	182,100	6,112.00	1,112,995,200
日本システムウエア	6,300	574.00	3,616,200
セントラル警備保障	7,900	1,132.00	8,942,800
アイネス	22,500	853.00	19,192,500
丹青社	21,900	820.00	17,958,000
メイテック	23,700	2,979.00	70,602,300
T K C	13,900	1,982.00	27,549,800
アサツー ディ・ケイ	32,900	2,601.00	85,572,900
富士ソフト	22,800	2,452.00	55,905,600

応用地質	18,400	1,665.00	30,636,000
船井総研ホールディング	18,600	973.00	18,097,800
NSD	35,100	1,569.00	55,071,900
進学会	7,800	380.00	2,964,000
丸紅建材リース	14,000	279.00	3,906,000
コナミ	74,700	2,086.00	155,824,200
ベネッセホールディングス	58,600	3,350.00	196,310,000
イオンディライト	17,000	2,414.00	41,038,000
ナック	8,800	1,173.00	10,322,400
福井コンピュータHLD S	4,600	734.00	3,376,400
ニチイ学館	38,100	803.00	30,594,300
ダイセキ	25,900	1,791.00	46,386,900
ステップ	6,200	796.00	4,935,200
日鉄住金物産	109,000	368.00	40,112,000
元気寿司	5,100	1,853.00	9,450,300
トラスコ中山	19,000	2,656.00	50,464,000
ヤマダ電機	653,300	338.00	220,815,400
オートバックスセブン	56,100	1,601.00	89,816,100
アークランドサカモト	10,800	2,353.00	25,412,400
ニトリホールディングス	65,500	6,700.00	438,850,000
グルメ杵屋	12,000	840.00	10,080,000
愛眼	13,700	261.00	3,575,700
ケーユーホールディングス	7,300	566.00	4,131,800
吉野家ホールディングス	44,800	1,285.00	57,568,000
加藤産業	23,900	2,160.00	51,624,000
イノテック	15,300	496.00	7,588,800
イエローハット	14,300	2,294.00	32,804,200
富士エレクトロニクス	8,600	1,369.00	11,773,400
松屋フーズ	8,000	2,046.00	16,368,000
J B C C ホールディングス	13,900	732.00	10,174,800
J Kホールディングス	15,400	532.00	8,192,800
サガミチェーン	21,000	1,017.00	21,357,000
日伝	7,500	2,266.00	16,995,000
関西スーパーマーケット	12,600	788.00	9,928,800
ミロク情報サービス	11,100	580.00	6,438,000
北沢産業	11,000	174.00	1,914,000
杉本商事	9,000	999.00	8,991,000
因幡電機産業	22,800	3,400.00	77,520,000
王将フードサービス	10,900	4,000.00	43,600,000
ブレナス	18,500	2,123.00	39,275,500
ミニストップ	12,300	1,541.00	18,954,300
アークス	28,300	2,161.00	61,156,300
バロ-	35,700	1,680.00	59,976,000
パイテック	5,800	727.00	4,216,600
ミスミグループ本社	66,300	2,915.00	193,264,500
江守グループHD	7,100	1,780.00	12,638,000
アルテック	8,200	217.00	1,779,400
ベルク	8,200	2,961.00	24,280,200
大庄	8,900	1,283.00	11,418,700
タキヒヨー	28,000	401.00	11,228,000

ファーストリテイリング	33,100	36,930.00	1,222,383,000	
ソフトバンク	812,100	6,877.00	5,584,811,700	
スズケン	68,400	2,823.00	193,093,200	
サンドラッグ	34,900	4,550.00	158,795,000	
サックスパーホールディング	12,450	1,520.00	18,924,000	
ジェコス	11,400	1,422.00	16,210,800	
ヤマザワ	4,000	1,554.00	6,216,000	
やまや	3,400	1,524.00	5,181,600	
ベルーナ	41,400	448.00	18,547,200	
合計	271,948,203		291,122,195,810	

*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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年10月31日現在

資産総額	3,033,403,369円
負債総額	797,356円
純資産総額（ - ）	3,032,606,013円
発行済数量	1,655,471,621口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8319円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年10月31日現在

資産総額	341,858,168,998円
負債総額	8,021,772,800円
純資産総額（ - ）	333,836,396,198円
発行済数量	176,466,754,447口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8918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。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け付け、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ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

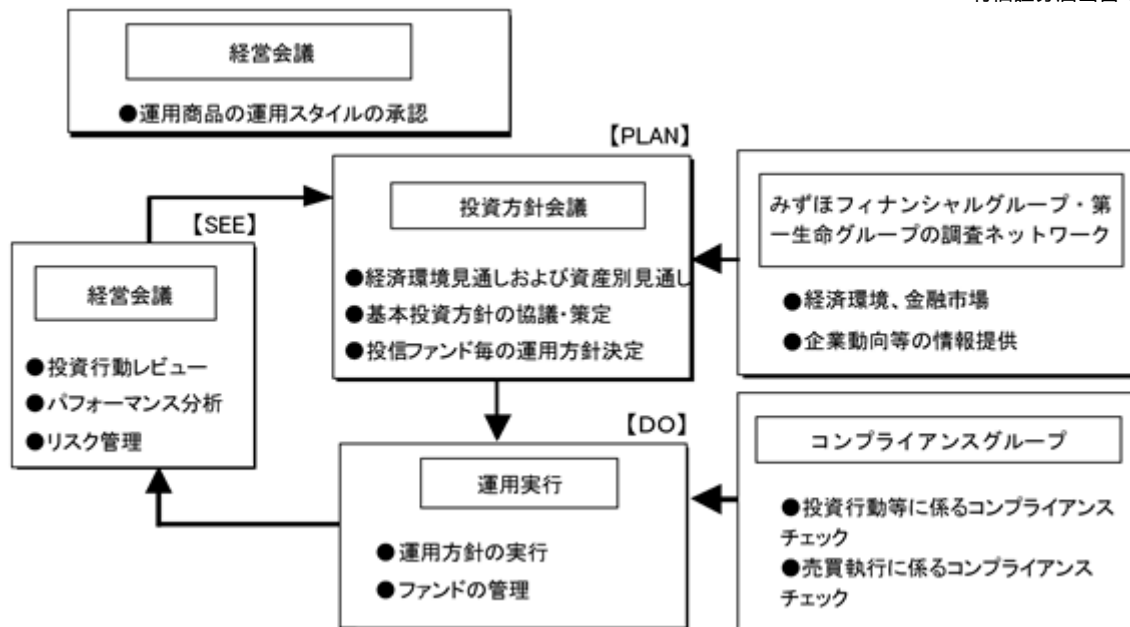
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成26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26年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は345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)
単体型株式投資信託	7	20,102,478,251
追加型株式投資信託	321	5,374,333,613,169
単体型公社債投資信託	17	161,002,526,851
追加型公社債投資信託	0	0
合計	345	5,555,438,618,271

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）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）、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29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26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30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	-
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	2 1,306,837	2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（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	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第28期 （ 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 ）		第29期 （ 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期		第29期	
	（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）		（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		-	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	-		213,744	
雑損失	-		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	1	1,752	1	22
固定資産売却損	2	115	2	1,448
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		134,463		13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の 配当							2,712,000	2,712,000	2,712,000
別途積立金 の積立				700,000			700,000	-	-
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	700,000	-	-	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の 配当		2,712,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	32,375	32,375
当期変動額 合計	32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の 配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金 の積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の 配当		3,096,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	139,391	139,391
当期変動額 合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

重要な会計方針

項目	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26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 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
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。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用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以内の一定の年数（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 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (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. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

（1）概要

財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。

（2）適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、現在評価中であります。

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28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウェア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	-	22
ソフトウェア	1,752	0

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	115	1,448

(株主資本等変動計算書関係)

第28期(自平成24年4月1日 至平成25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

(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25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25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

平成26年6月30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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（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28期（平成25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	10,806,745	10,806,745	-
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	320,332	320,332	-
資産計	21,341,518	21,341,518	-
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	-
負債計	1,299,068	1,299,068	-

第29期（平成26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	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

(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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
差入保証金	731,564	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、記載しておりません。

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。

(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28期(平成25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	10,806,412	-	-	-
合計	10,806,412	-	-	-

第29期(平成26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	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

(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28期及び第29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28期（平成25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	307,639	146,101	161,537
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
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）	8,688	10,000	1,312
小計	8,688	10,000	1,312
合計	320,332	159,101	161,231

（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」には含めていません。

第29期（平成26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	522,887	146,101	376,785
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
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）	9,474	10,000	526
小計	9,474	10,000	526
合計	536,913	159,101	377,811

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第28期（平成25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	10,214,440	946,377

第29期（平成26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	10,952,459	1,628,835

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）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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（非積立型制度であります）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）
（1）退職給付債務	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	133,522
退職給付引当金	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

(1) 勤務費用	102,125
(2) 利息費用	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	41,923
(5) その他	314
退職給付費用	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

1.5%

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

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）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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（非積立型制度であります）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. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	112,660
未認識過去勤務費用	19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759
退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（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28期	第29期
	(平成25年3月31日現在)	(平成26年3月31日現在)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	22,907	-
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	109	-
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	54,172
繰延税金負債合計	-	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

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. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。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従来の38.01%から35.64%になります。

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30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

（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せん。

2．関連情報

第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（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29期（自平成25年4月1日 至平成26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	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（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28期（自平成24年4月1日 至平成25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	710,289	未収投資 助言報酬	203,114

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

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28期（自平成24年4月1日 至平成25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	520,967	未払 費用	175,664
	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	214,290	未払 費用	89,815

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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	627,855	未払 費用	224,758
	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	251,110	未払 費用	97,587

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。

(3)兄弟会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25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 預金の預入 (純額) 受取利息	1,661,638 191,782 106	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	142,323 625,561 -
	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 預金の引出 (純額) 受取利息	460,605 1,912,442 3,210	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	100,875 9,527,582 61
	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 業務委託料 の支払	259,435 11,140	未払 費用 未払 費用	132,250 5,848
	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	3,500,000 5,908	金銭の 信託	10,214,440

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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 (旧株式 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)	1,629,874 775,579	未払 手数料 現金・ 預金	224,525 10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	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)	432,201 203,876	-	-
	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 業務委託料 の支払	287,136 11,810	未払 費用 未払金	155,413 2,646
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 7,933	金銭の 信託	10,952,459	

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、消費税等が含まれておりません。

（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。

（注7）株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行（株式会社みずほ銀行に商号変更）に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行（旧株式会社みずほコーポレート銀行）に引き継いでおります。

（1株当たり情報）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97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、潜在株式が存在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28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
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。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,723,059
金銭の信託		12,434,692
前払費用		41,958
未収委託者報酬		4,115,165
未収運用受託報酬		2,110,505
未収投資助言報酬		291,921
未収収益		276,092
繰延税金資産		381,830
その他		19,665
	流動資産計	29,394,891
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	112,415
車両運搬具	1	1,278
器具備品	1	155,618
無形固定資産		
商標権	1	148
ソフトウェア	1	1,293,646
ソフトウェア仮勘定		671,614
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	210
投資その他の資産		
投資有価証券		569,502
関係会社株式		1,916,596
繰延税金資産		632,938
差入保証金		731,858
その他		98,609
	固定資産計	6,191,588
資産合計		35,586,479

（単位：千円）

	第30期中間会計期間末 （平成26年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	1,166,764
未払金	1,957,162
未払償還金	51,109
未払手数料	1,643,563
その他未払金	262,489
未払費用	1,591,500
未払法人税等	1,472,835
未払消費税等	371,933
賞与引当金	654,870
その他	20,000
	流動負債計
	7,235,067
固定負債	
退職給付引当金	812,666
役員退職慰労引当金	83,180
	固定負債計
	895,847
負債合計	8,130,914
（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	22,814,599
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	19,480,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,711,306
	株主資本計
	27,243,077
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	212,487
	評価・換算差額等計
	212,487
純資産合計	27,455,565
負債・純資産合計	35,586,479

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日至平成26年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	13,286,051	
運用受託報酬	3,381,064	
投資助言報酬	490,761	
その他営業収益	421,279	
	営業収益計	17,579,156
営業費用		
支払手数料	5,909,864	
広告宣伝費	92,826	
公告費	159	
調査費	2,887,318	
調査費	2,043,582	
委託調査費	843,735	
委託計算費	190,750	
営業雑経費	236,536	
通信費	17,081	
印刷費	205,572	
協会費	12,088	
諸会費	15	
支払販売手数料	1,778	
	営業費用計	9,317,455
一般管理費		
給料	2,293,163	
役員報酬	121,968	
給料・手当	2,171,195	
交際費	15,267	
寄付金	2,697	
旅費交通費	108,306	
租税公課	63,009	
不動産賃借料	344,346	
退職給付費用	109,300	
固定資産減価償却費	1 271,644	
福利厚生費	11,154	
修繕費	4,020	
賞与引当金繰入額	654,870	
役員退職慰労引当金繰入額	23,042	
役員退職慰労金	25,501	
機器リース料	23	
事務委託費	102,506	
事務用消耗品費	33,911	
器具備品費	1,141	
諸経費	73,631	
	一般管理費計	4,137,538
営業利益		4,124,161

（単位：千円）

	第30期中間会計期間 （自平成26年4月1日至平成26年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,686	
受取利息	1,115	
雑収入	1,165	
		営業外収益計 8,967
営業外費用		
為替差損	896	
金銭の信託運用損	2,943	
		営業外費用計 3,839
経常利益		4,129,289
特別損失		
関係会社株式評価損	202,477	
		特別損失計 202,477
税引前中間純利益		3,926,811
法人税、住民税及び事業税		1,450,315
法人税等調整額		46,321
法人税等合計		1,403,993
中間純利益		2,522,818

(3) 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変更による累積的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の積立				2,350,000			2,350,000	-	-
中間純利益							2,522,818	2,522,818	2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	2,155,181	194,818	194,818
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	2,711,306	22,814,599	27,243,077

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変更による累積的影響額		131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	243,159	27,291,419
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の積立		-
中間純利益		2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	30,671	30,671
当中間期変動額合計	30,671	164,146
当中間期末残高	212,487	27,455,565

重要な会計方針

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26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 (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、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用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、それぞれ発生の際会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (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。

会計方針の変更

第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
<p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ4,584千円増加しております。なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。</p>	

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第30期中間会計期間末 (平成26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	3,645千円
	器具備品	690,539千円
	商標権	789千円
	ソフトウェア	1,737,240千円
	電信電話専用施設利用権	1,386千円

(中間損益計算書関係)

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26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	235,019千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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26年6月30日 定時株主総会	普通株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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	9,723,059	9,723,059	-
(2) 金銭の信託	12,434,692	12,434,692	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	489,256	489,256	-
資産計	22,647,008	22,647,008	-
(1) 未払法人税等	1,472,835	1,472,835	-
負債計	1,472,835	1,472,835	-

（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	1,916,596
差入保証金	731,858

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

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

なお、当中間会計期間において、関係会社株式について202,477千円減損処理を行っております。

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、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第30期中間会計期間末（平成26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1,916,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	474,395	146,101	328,293
債券	-	-	-
その他（投資信託）	14,861	13,000	1,861
小計	489,256	159,101	330,154
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）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	489,256	159,101	330,154

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

(金銭の信託関係)

第30期中間会計期間末（平成26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30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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	13,286,051	3,871,825	421,279	17,579,156

（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

顧客の名称又は氏名	営業収益 （千円）
第一生命グループ	1,799,530

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,143,981円	89銭
1株当たり中間純利益金額	105,117円	43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おりません。		

（注1）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30期中間会計期間 （自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）
中間純利益	2,522,818千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,522,818千円
期中平均株式数	24,000株

（注2）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額が5,582円81銭増加し、1株当たり中間純利益金額が122円93銭増加しております。

（重要な後発事象）

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1)受託会社**

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成26年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額* (単位：百万円)	事業の内容
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。

*平成26年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (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26年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29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26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1) 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。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年11月26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 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和田 渉 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、「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25年10月16日から平成26年10月14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26年10月14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。

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5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	山野 浩 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26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26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26年4月1日から平成26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1）上記は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。

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。