

【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28年1月13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

す。
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

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28年1月14日から平成29年1月12日まで

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（ 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>

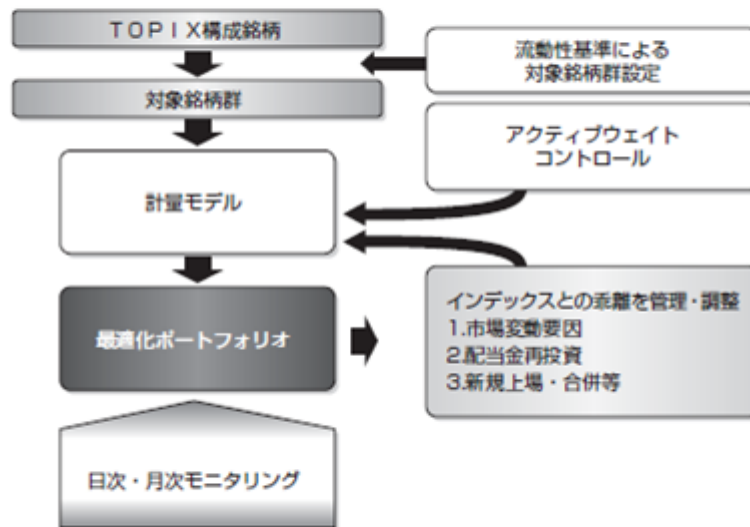
① 主に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」に投資を行い、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。D I A M国内株式パッシブ・ファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、D I A M国内株式パッシブ・ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。D I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、D I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、D I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。(株)東京証券取引所は、当社又はD I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所はD I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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



- ③ 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

分配方針

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

補足分類

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

属性区分表

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

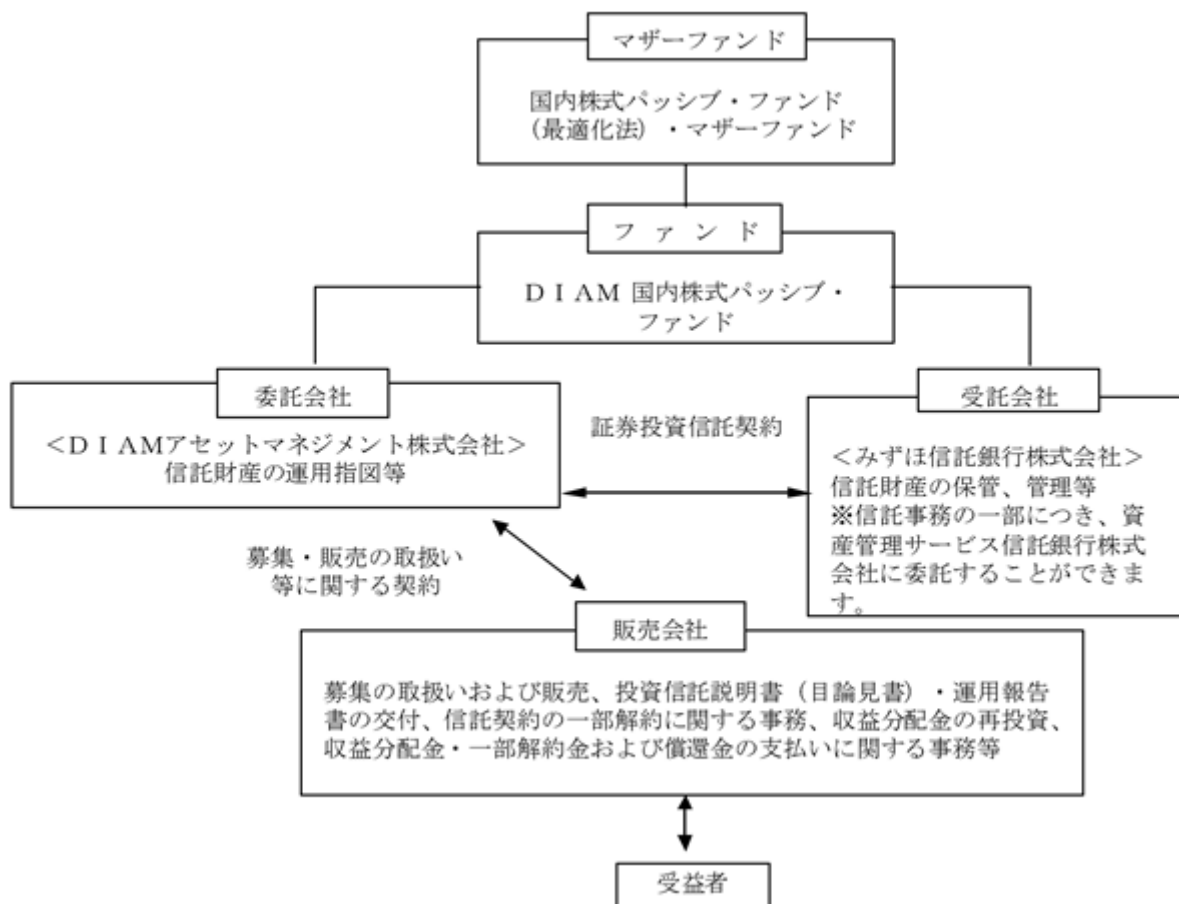
「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

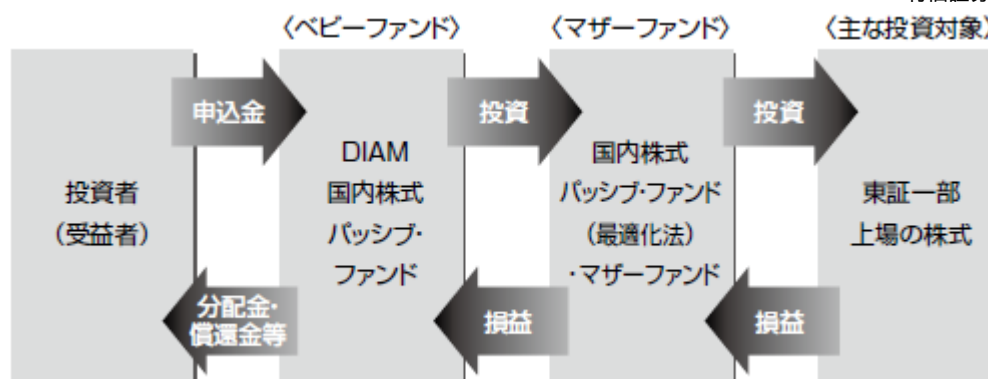
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

- ・「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27年10月30日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日 会社設立

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

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

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

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

大株主の状況

（平成27年10月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	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書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。 ）

7．投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。 ）

8．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。 ）

9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
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。

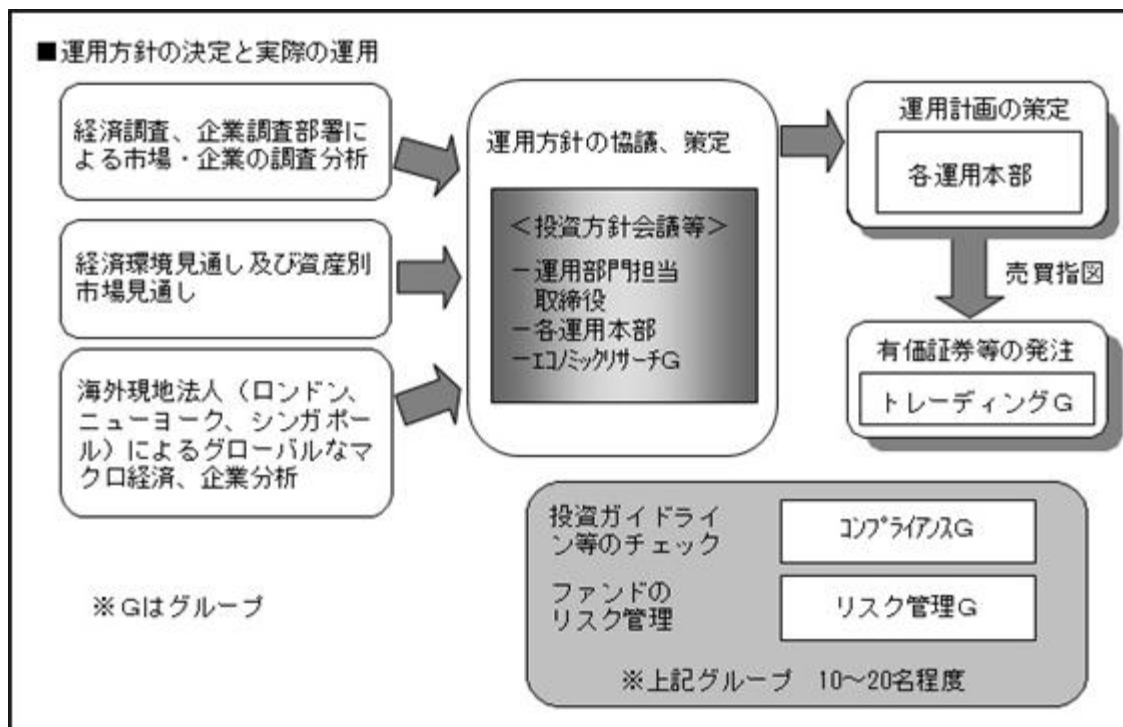
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（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】



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、各運用本部の運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

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

国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。それ以外の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。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に、以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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、受益者毎に異なります。

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

< その他の留意点 >

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

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

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

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

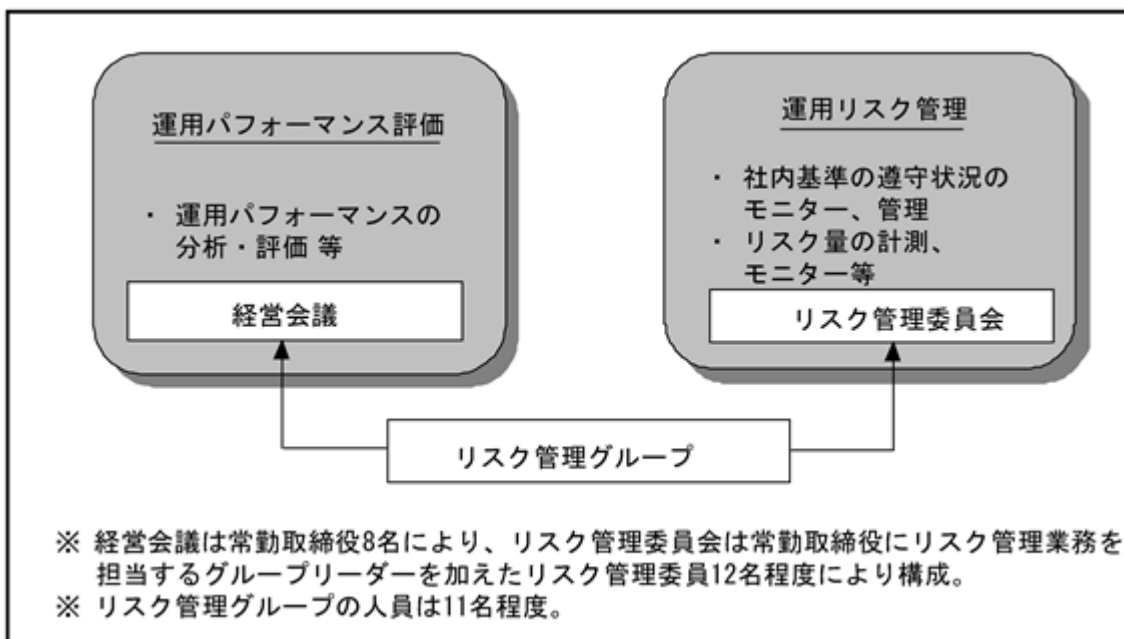
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができます。

当ファンドは、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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。
- ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

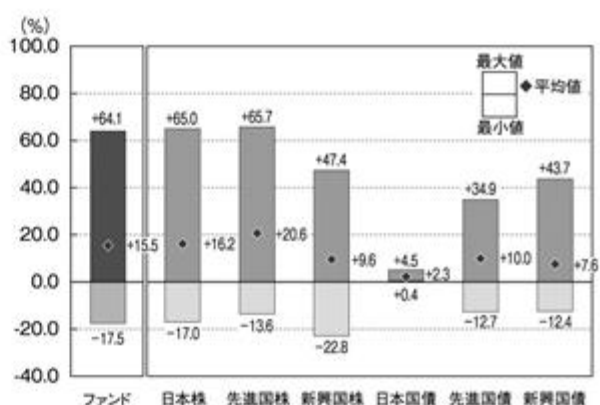
上記体制は平成27年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(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



2010年11月～2015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。

*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。

*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・セキュリティーズ・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ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等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「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額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一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、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28年1月1日現在のものです。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27年10月30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	3,848,199,764	100.03
内 日本	3,848,199,764	100.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,139,885	0.03
純資産総額	3,847,059,879	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27年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	309,970,234,760	97.47
内 日本	309,970,234,760	97.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,033,875,255	2.53
純資産総額	318,004,110,015	100.00

その他資産の投資状況

平成27年10月30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）	8,119,785,000	2.55
内 日本	8,119,785,000	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27年10月30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	1,708,412,770	2.1725 3,711,663,425	2.2525 3,848,199,764	- -	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27年10月30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27年10月30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	1,720,700	7,683.24 13,220,562,764	7,469.00 12,851,908,300	- -	4.04%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	10,699,400	681.78 7,294,703,822	790.60 8,458,945,640	- -	2.66%
3	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,067,000	4,225.53 4,508,650,700	4,860.00 5,185,620,000	- -	1.63%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	755,400	7,094.43 5,359,138,400	6,797.00 5,134,453,800	- -	1.61%
5	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,216,100	3,815.91 4,640,533,268	4,044.00 4,917,908,400	- -	1.55%
6	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	18,765,800	201.45 3,780,448,993	250.30 4,697,079,740	- -	1.48%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,030,800	3,636.47 3,748,481,643	4,486.00 4,624,168,800	- -	1.45%
8	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,354,700	2,606.43 3,530,939,796	2,946.00 3,990,946,200	- -	1.25%
9	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	894,900	3,542.09 3,169,820,784	4,211.00 3,768,423,900	- -	1.19%

10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	563,100	5,906.70 3,326,066,100	5,930.00 3,339,183,000	- -	1.05%
11	ソニー 日本	株式 電気機器	952,900	3,097.45 2,951,567,165	3,480.00 3,316,092,000	- -	1.04%
12	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	557,800	4,399.43 2,454,005,714	5,511.00 3,074,035,800	- -	0.97%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	138,200	20,012.42 2,765,716,650	21,555.00 2,978,901,000	- -	0.94%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	247,000	9,172.46 2,265,599,078	11,570.00 2,857,790,000	- -	0.90%
15	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,584,800	1,823.52 2,889,927,144	1,765.00 2,797,172,000	- -	0.88%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	121,000	19,445.41 2,352,895,400	22,200.00 2,686,200,000	- -	0.84%
17	キヤノン 日本	株式 電気機器	727,500	3,730.46 2,713,914,608	3,640.00 2,648,100,000	- -	0.83%
18	三菱地所 日本	株式 不動産業	992,000	2,510.19 2,490,112,000	2,607.00 2,586,144,000	- -	0.81%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	540,300	4,089.24 2,209,418,426	4,692.00 2,535,087,600	- -	0.80%
20	村田製作所 日本	株式 電気機器	141,700	12,862.44 1,822,608,556	17,355.00 2,459,203,500	- -	0.77%
21	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,028,500	2,010.55 2,067,851,690	2,357.50 2,424,688,750	- -	0.76%
22	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,445,000	788.28 2,715,633,400	702.90 2,421,490,500	- -	0.76%
23	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,897,100	1,064.94 2,020,311,400	1,266.50 2,402,677,150	- -	0.76%
24	花王 日本	株式 化学	380,600	5,014.85 1,908,652,315	6,239.00 2,374,563,400	- -	0.75%
25	三井不動産 日本	株式 不動産業	707,000	3,125.43 2,209,686,000	3,310.00 2,340,170,000	- -	0.74%
26	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,543,800	1,316.30 2,032,118,352	1,435.00 2,215,353,000	- -	0.70%
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,000,700	2,221.37 2,222,933,645	2,212.50 2,214,048,750	- -	0.70%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	477,700	4,546.43 2,171,833,570	4,476.00 2,138,185,200	- -	0.67%
29	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	427,100	3,984.61 1,701,830,092	4,728.00 2,019,328,800	- -	0.64%
30	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	2,567,000	645.07 1,655,900,853	765.60 1,965,295,200	- -	0.62%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年10月30日現在

種類	投資比率
株式	97.47%
合計	97.47%

（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27年10月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.64%
輸送用機器		10.53%
銀行業		9.11%
情報・通信業		7.13%
化学		5.83%
医薬品		4.93%
小売業		4.54%
機械		4.45%
陸運業		4.30%
食料品		4.23%
卸売業		4.02%
サービス業		3.27%
不動産業		2.82%
建設業		2.79%
保険業		2.51%
電気・ガス業		2.21%
その他製品		1.58%
精密機器		1.46%
その他金融業		1.35%
証券、商品先物取引業		1.24%
鉄鋼		1.21%
ゴム製品		0.93%
ガラス・土石製品		0.90%
非鉄金属		0.89%
繊維製品		0.71%
空運業		0.66%
金属製品		0.63%
石油・石炭製品		0.47%
鉱業		0.34%
パルプ・紙		0.27%
海運業		0.26%
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.08%	
合計	97.47%	

（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27年10月30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 2712月	買建	521	7,693,481,804	8,119,785,000	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27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
第7計算期間末 (平成27年10月13日)	3,717	3,717	2.0908	2.0908
平成26年10月末日	3,032	-	1.8319	-
11月末日	3,218	-	1.9365	-
12月末日	3,261	-	1.9334	-
平成27年1月末日	2,797	-	1.9429	-
2月末日	3,046	-	2.0924	-
3月末日	3,161	-	2.1341	-
4月末日	2,980	-	2.2023	-
5月末日	3,187	-	2.3142	-
6月末日	3,479	-	2.2550	-
7月末日	3,631	-	2.2941	-
8月末日	3,622	-	2.1236	-
9月末日	3,394	-	1.9632	-
10月末日	3,847	-	2.1670	-

【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
第7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
第7計算期間	25.3

(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
第7計算期間	1,112,887,322	742,283,812

(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。

データの基準日:2015年10月30日

基準価額・純資産の推移

《設定日(2009年1月30日)~2015年10月30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
第7期(2015.10.13)	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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.03%

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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	97.47
内 日本	97.47
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.53
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

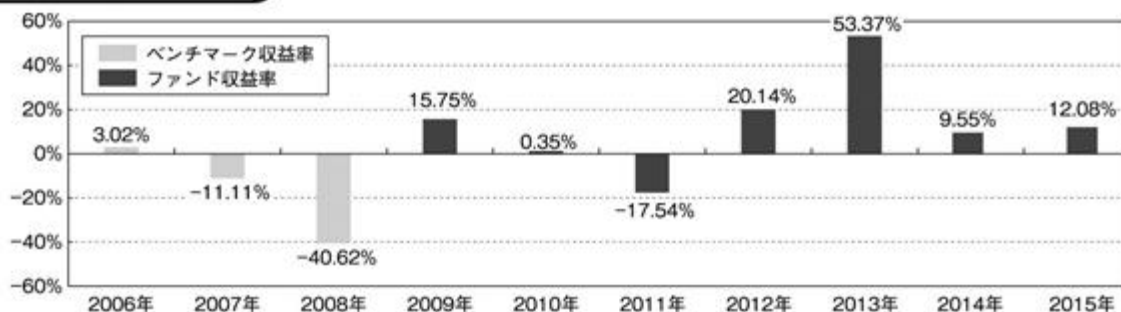
組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.64%
2	輸送用機器	10.53%
3	銀行業	9.11%
4	情報・通信業	7.13%
5	化学	5.83%

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	4.04%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.66%
3	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.63%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.61%
5	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.55%
6	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.48%
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.45%
8	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.25%
9	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.19%
10	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.05%

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2015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。

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

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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。委託会社は、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経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。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。主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
国内株式	原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

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

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了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7期計算期間（平成26年10月15日から平成27年10月13日まで）の財務諸表について、P w C 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6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,060,398	12,034,479
親投資信託受益証券	2,345,386,672	3,716,423,397
流動資産合計	2,355,447,070	3,728,457,876
資産合計	2,355,447,070	3,728,457,876
負債の部		
流動負債		
未払解約金	294,121	271,801
未払受託者報酬	384,403	544,638
未払委託者報酬	7,304,479	10,348,810
その他未払費用	60,777	86,160
流動負債合計	8,043,780	11,251,409
負債合計	8,043,780	11,251,409
純資産の部		
元本等		
元本	1,407,311,568	1,777,915,078
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	940,091,722	1,939,291,389
（分配準備積立金）	365,801,163	644,479,674
元本等合計	2,347,403,290	3,717,206,467
純資産合計	2,347,403,290	3,717,206,467
負債純資産合計	2,355,447,070	3,728,457,876

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期		第7期	
	自	平成25年10月16日 平成26年10月14日	自	平成26年10月15日 平成27年10月13日
営業収益				
受取利息		2,676		3,429
有価証券売買等損益		107,824,032		708,450,725
営業収益合計		107,826,708		708,454,154
営業費用				
受託者報酬		731,525		1,037,355
委託者報酬		13,900,622		19,711,189
その他費用		115,654		164,097
営業費用合計		14,747,801		20,912,641
営業利益又は営業損失（ ）		93,078,907		687,541,513
経常利益又は経常損失（ ）		93,078,907		687,541,513
当期純利益又は当期純損失（ ）		93,078,907		687,541,513
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（ ）		44,605,524		266,630,564
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		703,819,790		940,091,722
剰余金増加額又は欠損金減少額		510,866,491		1,117,012,393
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		510,866,491		1,117,012,393
剰余金減少額又は欠損金増加額		323,067,942		538,723,675
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		323,067,942		538,723,675
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		940,091,722		1,939,291,389

(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26年10月14日、当計算期間末日を平成27年10月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13日現在
1 . 1 期首元本額	1,128,743,533円	1,407,311,568円
期中追加設定元本額	796,957,698円	1,112,887,322円
期中一部解約元本額	518,389,663円	742,283,812円
2 . 受益権の総数	1,407,311,568口	1,777,915,078口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期 自 平成25年10月16日 至 平成26年10月14日	第7期 自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13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（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。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（59,331,552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（361,579,397円）、信託約款に規定される収益調整金（1,294,811,715円）及び分配準備積立金（223,568,725円）より分配対象収益は1,939,291,389円（1万口当たり10,907.67円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期	第7期
	自 平成25年10月16日 至 平成26年10月14日	自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13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6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13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6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13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	62,089,682	448,155,421
合計	62,089,682	448,155,421

（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6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6680円 (16,680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27年10月13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	1,710,587,958	3,716,423,397	
親投資信託受益証券	合計	1,710,587,958	3,716,423,397	
合計		1,710,587,958	3,716,423,397	

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26年10月14日現在	平成27年10月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,728,552,244	15,699,526,390
株式	2	291,122,195,810	298,006,771,240
派生商品評価勘定		-	912,484,328
未収入金		-	270,897
未収配当金		2,340,471,163	2,254,145,788
前払金		390,637,000	-
流動資産合計		297,581,856,217	316,873,198,643
資産合計		297,581,856,217	316,873,198,643
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		496,752,320	1,777,864
前受金		-	1,048,336,000
未払金		54,415,104	-
未払解約金		109,133,000	95,077,000
流動負債合計		660,300,424	1,145,190,864
負債合計		660,300,424	1,145,190,864
純資産の部			
元本等			
元本	1	172,419,018,706	145,322,675,861
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		124,502,537,087	170,405,331,918
元本等合計		296,921,555,793	315,728,007,779
純資産合計		296,921,555,793	315,728,007,779
負債純資産合計		297,581,856,217	316,873,198,643

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26年10月14日現在	平成27年10月13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	194,304,771,358円	172,419,018,706円
同期中追加設定元本額	24,603,500,257円	31,584,585,842円
同期中一部解約元本額	46,489,252,909円	58,680,928,687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	4,061,001,025円	4,904,881,467円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,361,934,076円	1,710,587,958円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	37,079,695,951円	37,051,819,937円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	789,765,436円	764,634,018円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,921,108,415円	2,684,633,915円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,124,705,439円	2,872,820,592円
D I A M D C バランス3 0インデックスファンド	408,966,225円	373,358,353円
D I A M D C バランス5 0インデックスファンド	1,342,206,708円	1,245,398,675円
D I A M D C バランス7 0インデックスファンド	1,164,438,617円	1,086,857,834円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	98,455,976円	62,619,404円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,304,021,788円	1,203,210,489円

マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	25,554,243円	27,396,594円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	14,442,430円	23,756,350円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	29,247,302円	45,682,466円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	69,064,411円	101,283,311円
投資のソムリエ	99,254,112円	1,020,790,717円
クルーズコントロール	618,305,066円	155,459,929円
投資のソムリエ<DC年金>	2,268,819円	16,812,882円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	20,247,495円	61,807,655円
D I A M D C バランス・F (成長型)	110,184円	31,375,738円
クルーズコントロール<DC年金 >	23,779円	49,425円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	- 円	9,172,876円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	- 円	21,543,025円
D I A Mアクティブアロケーショ ン私募ファンド(適格機関投資家 限定)	- 円	207,698,063円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	138,240,011円	118,114,707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)	2,960,224,465円	926,465,668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)	723,857,783円	504,047,033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)	87,696,282円	45,923,119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)	334,474,001円	188,212,246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)	78,310,132円	46,957,650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)	131,284,555円	68,517,010円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	13,146,606,188円	6,574,581,132円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	4,312,903,912円	2,491,550,675円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	3,194,516,772円	2,353,033,392円
D I A Mバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	2,145,037,313円	1,672,753,796円

D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	5,267,871,094円	4,338,155,069円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	484,994,727円	338,073,544円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	1,338,831,785円	907,582,858円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格 機関投資家限定)	1,344,398,395円	1,044,848,687円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家向 け)	6,402,971,932円	4,367,379,494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)	93,432,732円	41,880,337円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	2,457,352,023円	1,418,624,773円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	6,914,432,913円	5,591,983,651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)	232,107,184円	3,307,217円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資家 限定)	25,344,463,723円	21,654,420,117円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投資 家限定)	1,152,284,866円	846,229,797円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投資 家限定)	2,935,040,722円	2,502,748,523円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資家 限定)	15,844,662,933円	13,786,277,812円
D I A Mバランス3 0 V A (適格 機関投資家限定)	39,763円	35,673円
D I A Mバランス5 0 V A (適格 機関投資家限定)	38,730,706円	16,727,956円
D I A Mバランス7 0 V A (適格 機関投資家限定)	54,404,238円	6,456,080円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資家 限定)	14,176,369,864円	12,371,832,331円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	134,326,610円	118,620,812円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	47,729,289円	43,123,009円
D I A Mバランス2 0 V A (適格 機関投資家限定)	36,466,369円	25,728,391円
D I A Mバランス4 0 V A (適格 機関投資家限定)	90,048,289円	42,787,484円
D I A Mバランス6 0 V A (適格 機関投資家限定)	124,281円	120,989円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212)(適 格機関投資家限定)	900,296,115円	709,042,970円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303)(適 格機関投資家限定)	2,273,472,480円	1,887,540,594円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	2,945,619,832円	2,485,634,300円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	120,576,930円	99,705,292円
	計	172,419,018,706円	145,322,675,861円
2 .	受益権の総数	172,419,018,706口	145,322,675,861口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 2,989,000,000円	株式 3,658,000,000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25年10月16日 至 平成26年10月14日	自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13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26年10月14日現在	平成27年10月13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26年10月14日現在	平成27年10月13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	5,827,362,488	15,187,364,441
合計	5,827,362,488	15,187,364,441

(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26年2月8日から平成26年10月14日まで及び平成27年2月10日から平成27年10月13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26年10月14日 現在			平成27年10月13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	5,703,913,000	-	5,207,300,000	496,613,000	18,086,804,000	-	18,997,920,000	911,116,000
合計	5,703,913,000	-	5,207,300,000	496,613,000	18,086,804,000	-	18,997,920,000	911,116,000

(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26年10月14日現在	平成27年10月13日現在
1口当たり純資産額	1.7221円	2.1726円
(1万口当たり純資産額)	(17,221円)	(21,726円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年10月13日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	65,000	263.00	17,095,000	
日本水産	186,000	364.00	67,704,000	
マルハニチロ	31,000	1,740.00	53,940,000	
ハウスイ	14,000	129.00	1,806,000	
サカタのタネ	24,400	2,416.00	58,950,400	
ホクト	16,900	2,310.00	39,039,000	
ショーボンドホールディングス	14,700	4,700.00	69,090,000	
ミライト・ホールディングス	46,500	1,131.00	52,591,500	
タマホーム	11,100	473.00	5,250,300	
サンヨーホームズ	1,900	566.00	1,075,400	
住石ホールディングス	42,900	120.00	5,148,000	
日鉄鉱業	42,000	553.00	23,226,000	
三井松島産業	98,000	123.00	12,054,000	
国際石油開発帝石	797,800	1,228.00	979,698,400	
日本海洋掘削	4,500	2,809.00	12,640,500	
石油資源開発	21,600	3,650.00	78,840,000	
K&Oエナジーグループ	10,100	1,547.00	15,624,700	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,280.00	4,864,000	
安藤・間	100,900	808.00	81,527,200	
東急建設	53,700	1,004.00	53,914,800	
コムシスホールディングス	67,400	1,559.00	105,076,600	
ミサワホーム	17,700	755.00	13,363,500	
高松コンストラクショングループ	11,400	2,516.00	28,682,400	
東建コーポレーション	5,600	9,490.00	53,144,000	
ヤマウラ	7,800	503.00	3,923,400	
大成建設	786,000	817.00	642,162,000	
大林組	454,000	1,117.00	507,118,000	
清水建設	463,000	1,045.00	483,835,000	
飛鳥建設	109,900	238.00	26,156,200	
長谷工コーポレーション	189,200	1,440.00	272,448,000	
松井建設	7,000	684.00	4,788,000	
銭高組	22,000	676.00	14,872,000	
鹿島建設	665,000	687.00	456,855,000	
不動テトラ	114,500	170.00	19,465,000	
大末建設	5,900	811.00	4,784,900	
鉄建建設	92,000	337.00	31,004,000	
西松建設	163,000	507.00	82,641,000	
三井住友建設	613,800	159.00	97,594,200	
大豊建設	47,000	547.00	25,709,000	
前田建設工業	101,000	922.00	93,122,000	
佐田建設	10,800	578.00	6,242,400	
ナカノブドー建設	11,700	761.00	8,903,700	
奥村組	144,000	664.00	95,616,000	

東鉄工業	18,200	2,660.00	48,412,000
イチケン	18,000	438.00	7,884,000
浅沼組	48,000	339.00	16,272,000
戸田建設	189,000	571.00	107,919,000
熊谷組	190,000	404.00	76,760,000
青木あすなる建設	10,000	869.00	8,690,000
北野建設	32,000	327.00	10,464,000
植木組	20,000	250.00	5,000,000
三井ホーム	20,000	598.00	11,960,000
矢作建設工業	18,500	1,115.00	20,627,500
ピーエス三菱	15,700	410.00	6,437,000
日本ハウスホールディングス	30,300	520.00	15,756,000
大東建託	56,600	12,715.00	719,669,000
新日本建設	18,200	616.00	11,211,200
N I P P O	35,000	2,145.00	75,075,000
東亜道路工業	28,000	473.00	13,244,000
前田道路	47,000	2,193.00	103,071,000
日本道路	45,000	658.00	29,610,000
東亜建設工業	113,000	302.00	34,126,000
若築建設	87,000	161.00	14,007,000
東洋建設	45,300	550.00	24,915,000
五洋建設	167,900	581.00	97,549,900
大林道路	18,000	822.00	14,796,000
世紀東急工業	22,000	602.00	13,244,000
福田組	24,000	1,203.00	28,872,000
日本ドライケミカル	2,100	2,225.00	4,672,500
住友林業	111,600	1,443.00	161,038,800
日本基礎技術	18,300	582.00	10,650,600
日成ビルド工業	42,000	389.00	16,338,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	71,000	89.00	6,319,000
巴コーポレーション	18,800	371.00	6,974,800
パナホーム	56,000	817.00	45,752,000
大和ハウス工業	446,600	3,097.00	1,383,120,200
ライト工業	24,200	1,165.00	28,193,000
積水ハウス	476,400	2,049.00	976,143,600
日特建設	20,300	547.00	11,104,100
北陸電気工事	8,000	1,093.00	8,744,000
ユアテック	24,000	1,168.00	28,032,000
西部電気工業	12,000	428.00	5,136,000
四電工	6,000	417.00	2,502,000
中電工	21,900	2,516.00	55,100,400
関電工	69,000	849.00	58,581,000
きんでん	100,800	1,575.00	158,760,000
東京エネシス	17,000	885.00	15,045,000
トーエネック	21,000	890.00	18,690,000
住友電設	12,000	1,483.00	17,796,000
日本電設工業	24,700	2,303.00	56,884,100
協和エクシオ	64,300	1,246.00	80,117,800
新日本空調	12,700	1,000.00	12,700,000
日本工営	47,000	487.00	22,889,000

N D S	25,000	302.00	7,550,000
九電工	28,000	2,059.00	57,652,000
三機工業	30,900	894.00	27,624,600
日揮	152,000	1,820.00	276,640,000
中外炉工業	46,000	232.00	10,672,000
ヤマト	14,000	442.00	6,188,000
太平電業	20,000	1,254.00	25,080,000
高砂熱学工業	41,700	1,708.00	71,223,600
三晃金属工業	16,000	267.00	4,272,000
N E C ネットエスアイ	16,800	2,308.00	38,774,400
朝日工業社	16,000	443.00	7,088,000
明星工業	25,000	560.00	14,000,000
大気社	21,600	2,848.00	61,516,800
ダイダン	20,000	868.00	17,360,000
日比谷総合設備	19,600	1,488.00	29,164,800
東芝プラントシステム	24,700	1,344.00	33,196,800
日本製粉	93,000	726.00	67,518,000
日清製粉グループ本社	166,100	1,706.00	283,366,600
日東富士製粉	8,000	341.00	2,728,000
昭和産業	63,000	454.00	28,602,000
鳥越製粉	12,700	763.00	9,690,100
中部飼料	14,400	1,108.00	15,955,200
フィード・ワン	92,400	143.00	13,213,200
東洋精糖	28,000	113.00	3,164,000
日本甜菜製糖	79,000	193.00	15,247,000
三井製糖	60,000	486.00	29,160,000
塩水港精糖	16,700	240.00	4,008,000
ネクスト	33,000	950.00	31,350,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,500	834.00	5,421,000
日本M&Aセンター	21,800	5,060.00	110,308,000
ノバレーゼ	3,800	879.00	3,340,200
アコーディア・ゴルフ	53,100	1,125.00	59,737,500
タケエイ	13,700	1,219.00	16,700,300
トラスト・テック	2,500	2,200.00	5,500,000
パソナグループ	10,500	939.00	9,859,500
C D S	3,500	957.00	3,349,500
リンクアンドモチベーション	27,500	135.00	3,712,500
G C A サヴィアン	12,500	1,464.00	18,300,000
エス・エム・エス	15,800	2,219.00	35,060,200
テンプホールディングス	28,600	5,360.00	153,296,000
リニカル	3,900	1,642.00	6,403,800
クックパッド	31,300	2,439.00	76,340,700
エスクリ	5,100	940.00	4,794,000
アイ・ケイ・ケイ	7,800	552.00	4,305,600
森永製菓	136,000	578.00	78,608,000
中村屋	35,000	456.00	15,960,000
江崎グリコ	35,000	5,330.00	186,550,000
名糖産業	7,000	1,314.00	9,198,000
不二家	89,000	191.00	16,999,000
山崎製パン	111,000	1,986.00	220,446,000

第一屋製パン	24,000	116.00	2,784,000
モロゾフ	24,000	408.00	9,792,000
亀田製菓	8,500	4,830.00	41,055,000
寿スピリッツ	3,600	3,900.00	14,040,000
カルビー	56,100	3,900.00	218,790,000
森永乳業	136,000	467.00	63,512,000
六甲バター	6,900	1,814.00	12,516,600
ヤクルト本社	81,200	6,090.00	494,508,000
明治ホールディングス	89,800	8,860.00	795,628,000
雪印メグミルク	35,600	2,239.00	79,708,400
プリマハム	90,000	339.00	30,510,000
日本ハム	111,000	2,487.00	276,057,000
伊藤ハム	83,000	637.00	52,871,000
林兼産業	50,000	132.00	6,600,000
丸大食品	78,000	460.00	35,880,000
米久	4,800	2,283.00	10,958,400
S Foods	9,500	2,341.00	22,239,500
学情	5,400	1,108.00	5,983,200
スタジオアリス	6,500	2,319.00	15,073,500
シミックホールディングス	6,300	1,687.00	10,628,100
システナ	13,200	1,159.00	15,298,800
N J S	3,100	1,417.00	4,392,700
デジタルアーツ	7,100	2,063.00	14,647,300
新日鉄住金ソリューションズ	11,100	5,000.00	55,500,000
総合警備保障	47,100	5,370.00	252,927,000
キューブシステム	6,300	573.00	3,609,900
日本駐車場開発	144,000	138.00	19,872,000
コア	6,000	821.00	4,926,000
カカクコム	93,000	1,946.00	180,978,000
アイロムグループ	3,600	1,418.00	5,104,800
ルネサンス	7,300	1,230.00	8,979,000
ディップ	15,600	2,112.00	32,947,200
S B Sホールディングス	13,100	1,074.00	14,069,400
オプトホールディング	8,700	623.00	5,420,100
新日本科学	13,300	483.00	6,423,900
ツクイ	16,700	1,230.00	20,541,000
総合臨床ホールディングス	6,800	458.00	3,114,400
キャリアデザインセンター	4,200	1,150.00	4,830,000
エムスリー	122,200	2,324.00	283,992,800
ツカダ・グローバルホールディング	10,400	754.00	7,841,600
アウトソーシング	6,500	2,355.00	15,307,500
ウェルネット	4,900	2,357.00	11,549,300
ディー・エヌ・エー	69,600	2,320.00	161,472,000
博報堂D Yホールディングス	195,600	1,187.00	232,177,200
ぐるなび	16,300	2,120.00	34,556,000
エスアールジータカミヤ	11,700	619.00	7,242,300
一休	11,000	2,510.00	27,610,000
ジャパンベストレスキューシステム	15,700	232.00	3,642,400
ファンコミュニケーションズ	32,400	915.00	29,646,000
ジェイコムホールディングス	3,500	1,180.00	4,130,000

WDBホールディングス	5,200	1,297.00	6,744,400
ティア	5,800	715.00	4,147,000
バリューコマース	12,800	499.00	6,387,200
サッポロホールディングス	232,000	486.00	112,752,000
アサヒグループホールディングス	284,200	3,766.00	1,070,297,200
キリンホールディングス	613,800	1,665.00	1,021,977,000
宝ホールディングス	118,800	798.00	94,802,400
オエノンホールディングス	43,000	217.00	9,331,000
養命酒製造	1,500	1,910.00	2,865,000
コカ・コーラウエスト	51,300	2,253.00	115,578,900
コカ・コーライーストジャパン	53,700	1,700.00	91,290,000
サントリー食品インターナショナル	103,800	4,700.00	487,860,000
ダイドードリンコ	7,700	5,140.00	39,578,000
伊藤園	45,000	2,618.00	117,810,000
キーコーヒー	13,400	2,015.00	27,001,000
ユニカフェ	4,500	914.00	4,113,000
ジャパンフーズ	2,600	1,137.00	2,956,200
日清オイリオグループ	73,000	436.00	31,828,000
不二製油グループ本社	40,400	1,644.00	66,417,600
J・オイルミルズ	64,000	340.00	21,760,000
ローソン	50,500	8,830.00	445,915,000
サンエー	10,100	4,740.00	47,874,000
ダイユーエイト	3,000	802.00	2,406,000
カワチ薬品	10,400	2,008.00	20,883,200
エービーシー・マート	19,700	6,870.00	135,339,000
ハードオフコーポレーション	6,700	1,508.00	10,103,600
高千穂交易	5,000	1,011.00	5,055,000
アスクル	13,900	4,525.00	62,897,500
ゲオホールディングス	25,100	1,835.00	46,058,500
アダストリア	11,200	7,100.00	79,520,000
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	17,000	108.00	1,836,000
伊藤忠食品	3,300	4,070.00	13,431,000
くらコーポレーション	7,800	3,530.00	27,534,000
キャンドゥ	7,200	1,556.00	11,203,200
エレマテック	6,200	2,814.00	17,446,800
パル	7,800	3,590.00	28,002,000
JALUX	3,800	2,271.00	8,629,800
エディオン	61,100	843.00	51,507,300
あらた	6,000	2,535.00	15,210,000
サーラコーポレーション	11,200	585.00	6,552,000
ワッツ	5,500	918.00	5,049,000
トーマンデバイス	1,900	1,975.00	3,752,500
J Pホールディングス	35,600	340.00	12,104,000
あみやき亭	2,300	4,615.00	10,614,500
東京エレクトロン デバイス	3,500	1,588.00	5,558,000
ひらまつ	18,300	669.00	12,242,700
フィールズ	8,800	1,758.00	15,470,400
双日	891,800	254.00	226,517,200
ゲンキー	2,600	5,320.00	13,832,000
アルフレッサ ホールディングス	157,800	2,055.00	324,279,000

大黒天物産	3,200	4,005.00	12,816,000
ハニーズ	11,800	1,003.00	11,835,400
ファーマライズホールディングス	2,900	619.00	1,795,100
キッコーマン	124,000	3,600.00	446,400,000
味の素	349,000	2,522.50	880,352,500
キュービー	77,100	2,579.00	198,840,900
ハウス食品グループ本社	56,100	2,009.00	112,704,900
カゴメ	54,700	1,991.00	108,907,700
焼津水産化学工業	7,700	996.00	7,669,200
アリアケジャパン	13,800	5,100.00	70,380,000
エバラ食品工業	2,800	1,975.00	5,530,000
ニチレイ	161,000	788.00	126,868,000
横浜冷凍	33,100	992.00	32,835,200
東洋水産	79,200	4,525.00	358,380,000
イートアンド	1,800	2,096.00	3,772,800
日清食品ホールディングス	64,200	5,710.00	366,582,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,036.00	7,252,000
一正蒲鉾	5,200	999.00	5,194,800
フジッコ	14,700	2,261.00	33,236,700
ロック・フィールド	7,900	2,927.00	23,123,300
日本たばこ産業	895,300	4,037.00	3,614,326,100
ケンコーマヨネーズ	5,200	1,616.00	8,403,200
わらべや日洋	8,900	2,066.00	18,387,400
なとり	7,100	1,521.00	10,799,100
ユーグレナ	50,900	1,703.00	86,682,700
片倉工業	17,700	1,281.00	22,673,700
ゲンゼ	114,000	387.00	44,118,000
ヒューリック	278,000	1,160.00	322,480,000
神栄	21,000	146.00	3,066,000
山下医科器械	1,200	1,713.00	2,055,600
ラサ商事	7,300	579.00	4,226,700
アルペン	11,900	1,926.00	22,919,400
クオール	13,500	1,669.00	22,531,500
アルコニックス	7,800	1,711.00	13,345,800
神戸物産	4,300	9,850.00	42,355,000
ジェイアイエヌ	9,000	4,960.00	44,640,000
ビックカメラ	68,100	1,046.00	71,232,600
D C Mホールディングス	65,500	805.00	52,727,500
MonotaRO	47,000	2,700.00	126,900,000
東京一番フーズ	2,100	654.00	1,373,400
ダイヤモンドダイニング	2,000	1,049.00	2,098,000
あい ホールディングス	21,300	2,911.00	62,004,300
ディービーエックス	4,100	1,109.00	4,546,900
きちり	3,500	692.00	2,422,000
アークランドサービス	2,100	4,825.00	10,132,500
J . フロント リテイリング	168,700	1,926.00	324,916,200
ドトール・日レスホールディングス	23,400	1,910.00	44,694,000
マツモトキヨシホールディングス	29,800	5,200.00	154,960,000
ブロンコビリー	5,200	2,476.00	12,875,200
スタートトゥデイ	41,500	4,035.00	167,452,500

トレジャー・ファクトリー	3,200	1,414.00	4,524,800
物語コーポレーション	3,800	4,740.00	18,012,000
ココカラファイン	13,900	4,695.00	65,260,500
三越伊勢丹ホールディングス	265,200	1,854.00	491,680,800
東洋紡	560,000	175.00	98,000,000
ユニチカ	409,000	61.00	24,949,000
富士紡ホールディングス	69,000	237.00	16,353,000
日清紡ホールディングス	90,000	1,536.00	138,240,000
倉敷紡績	145,000	228.00	33,060,000
ダイワボウホールディングス	121,000	232.00	28,072,000
シキボウ	81,000	123.00	9,963,000
日東紡績	104,000	345.00	35,880,000
トヨタ紡織	47,200	2,461.00	116,159,200
マクニカ・富士エレホールディングス	24,000	1,540.00	36,960,000
ウエルシアホールディングス	13,100	5,770.00	75,587,000
クリエイトSDホールディングス	6,500	7,000.00	45,500,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,200	831.00	20,941,200
八洲電機	10,200	596.00	6,079,200
UKCホールディングス	8,500	2,401.00	20,408,500
丸善CHIホールディングス	16,000	354.00	5,664,000
OCHIホールディングス	3,300	1,018.00	3,359,400
TOKAIホールディングス	65,100	492.00	32,029,200
ミサワ	1,500	697.00	1,045,500
エー・ピーカンパニー	2,000	1,522.00	3,044,000
三洋貿易	7,600	1,574.00	11,962,400
チムニー	3,200	2,918.00	9,337,600
ウイン・パートナーズ	4,300	1,711.00	7,357,300
ネクステージ	2,000	840.00	1,680,000
ジョイフル本田	19,500	2,261.00	44,089,500
キリン堂ホールディングス	4,500	1,342.00	6,039,000
すかいらーく	40,800	1,519.00	61,975,200
日本毛織	45,000	974.00	43,830,000
大東紡織	24,000	69.00	1,656,000
トーア紡コーポレーション	6,500	631.00	4,101,500
ダイドーリミテッド	15,900	499.00	7,934,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,900	1,062.00	46,621,800
三栄建築設計	5,400	1,545.00	8,343,000
野村不動産ホールディングス	80,400	2,413.00	194,005,200
三重交通グループホールディングス	23,500	423.00	9,940,500
日本商業開発	4,400	2,042.00	8,984,800
プレサンスコーポレーション	4,500	5,010.00	22,545,000
ユニゾホールディングス	7,300	5,010.00	36,573,000
日本管理センター	8,500	1,244.00	10,574,000
サンセイランディック	2,900	1,010.00	2,929,000
エストラスト	1,500	539.00	808,500
フージャースホールディングス	20,300	485.00	9,845,500
オープンハウス	19,200	2,085.00	40,032,000
東急不動産ホールディングス	349,500	841.00	293,929,500

飯田グループホールディングス	86,400	2,182.00	188,524,800
帝国繊維	14,700	1,501.00	22,064,700
ブックオフコーポレーション	7,700	921.00	7,091,700
日本コークス工業	126,100	103.00	12,988,300
ミタチ産業	3,300	724.00	2,389,200
あさひ	8,800	1,283.00	11,290,400
日本調剤	3,400	4,445.00	15,113,000
コスモス薬品	6,700	14,870.00	99,629,000
シップヘルスケアホールディングス	24,400	2,796.00	68,222,400
トーエル	7,200	628.00	4,521,600
一六堂	3,600	413.00	1,486,800
ソフトクリエイイトホールディングス	4,700	933.00	4,385,100
セブン&アイ・ホールディングス	558,000	5,469.00	3,051,702,000
薬王堂	1,900	3,090.00	5,871,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	9,200	2,540.00	23,368,000
明治電機工業	3,700	1,184.00	4,380,800
ツルハホールディングス	28,500	9,860.00	281,010,000
デリカフーズ	2,300	1,000.00	2,300,000
スターティア	2,800	751.00	2,102,800
サンマルクホールディングス	9,500	3,605.00	34,247,500
フェリシモ	3,400	1,168.00	3,971,200
トリドール	14,200	1,423.00	20,206,600
クスリのアオキ	10,500	6,040.00	63,420,000
帝人	578,000	411.00	237,558,000
東レ	1,095,000	1,043.00	1,142,085,000
クラレ	223,500	1,553.00	347,095,500
旭化成	883,000	930.80	821,896,400
サカイオーベックス	38,000	192.00	7,296,000
稲葉製作所	7,600	1,285.00	9,766,000
宮地エンジニアリンググループ	41,000	224.00	9,184,000
トーカロ	9,300	2,414.00	22,450,200
アルファ	5,000	1,315.00	6,575,000
SUMCO	110,700	1,267.00	140,256,900
川田テクノロジーズ	2,700	4,560.00	12,312,000
住江織物	35,000	362.00	12,670,000
日本フェルト	7,800	502.00	3,915,600
イチカワ	10,000	339.00	3,390,000
エコナックホールディングス	49,000	72.00	3,528,000
日東製網	18,000	149.00	2,682,000
芦森工業	31,000	196.00	6,076,000
アツギ	119,000	112.00	13,328,000
ダイニック	29,000	164.00	4,756,000
共和レザー	9,700	1,142.00	11,077,400
セーレン	35,200	1,358.00	47,801,600
東海染工	22,000	121.00	2,662,000
小松精練	23,400	659.00	15,420,600
ワコールホールディングス	84,000	1,496.00	125,664,000
ホギメディカル	8,900	5,710.00	50,819,000
レナウン	34,300	151.00	5,179,300

クラウドシア	3,600	595.00	2,142,000
T S Iホールディングス	63,100	877.00	55,338,700
I Tホールディングス	44,100	2,611.00	115,145,100
ネオス	3,700	550.00	2,035,000
電算システム	4,800	2,016.00	9,676,800
グリー	80,800	587.00	47,429,600
コーエーテックモホールディングス	36,100	1,594.00	57,543,400
三菱総合研究所	5,200	3,015.00	15,678,000
ボルテージ	2,400	1,650.00	3,960,000
電算	1,600	2,169.00	3,470,400
A G S	2,400	966.00	2,318,400
ファインデックス	8,600	943.00	8,109,800
ヒト・コミュニケーションズ	1,600	2,415.00	3,864,000
ブレインパッド	1,600	533.00	852,800
K L a b	20,500	1,248.00	25,584,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,900	1,114.00	9,914,600
イーブクイニシアティブジャパン	3,200	777.00	2,486,400
ネクソン	126,300	1,635.00	206,500,500
アイスタイル	11,200	1,017.00	11,390,400
エムアップ	3,700	640.00	2,368,000
エイチーム	4,800	1,856.00	8,908,800
e n i s h	3,600	869.00	3,128,400
コロプラ	36,700	2,050.00	75,235,000
モバイルクリエイト	7,600	511.00	3,883,600
オルトプラス	4,700	494.00	2,321,800
ブロードリーフ	13,700	1,361.00	18,645,700
ハーツユナイテッドグループ	4,100	1,823.00	7,474,300
ブイキューブ	3,200	2,915.00	9,328,000
特種東海製紙	82,000	355.00	29,110,000
ベリサーブ	1,700	1,068.00	1,815,600
ティーガイア	13,200	1,672.00	22,070,400
日本アジアグループ	11,200	476.00	5,331,200
豆蔵ホールディングス	10,800	499.00	5,389,200
テクマトリックス	6,000	1,111.00	6,666,000
G M Oペイメントゲートウェイ	11,600	4,705.00	54,578,000
ザッパラス	7,500	509.00	3,817,500
インターネットイニシアティブ	21,500	2,241.00	48,181,500
G M Oクラウド	2,800	792.00	2,217,600
ビットアイル	15,600	915.00	14,274,000
S R Aホールディングス	7,000	1,967.00	13,769,000
システムインテグレータ	1,800	697.00	1,254,600
朝日ネット	13,900	527.00	7,325,300
コムチュア	2,400	1,935.00	4,644,000
王子ホールディングス	581,000	595.00	345,695,000
日本製紙	68,300	2,126.00	145,205,800
三菱製紙	216,000	83.00	17,928,000
北越紀州製紙	87,700	747.00	65,511,900
中越パルプ工業	53,000	207.00	10,971,000
巴川製紙所	21,000	221.00	4,641,000

大王製紙	63,000	1,058.00	66,654,000
g u m i	13,500	1,362.00	18,387,000
パイブドHD	1,600	1,185.00	1,896,000
レンゴー	125,000	544.00	68,000,000
トモク	44,000	260.00	11,440,000
ザ・パック	10,000	2,732.00	27,320,000
昭和電工	943,000	150.00	141,450,000
住友化学	1,042,000	699.00	728,358,000
日本化成	27,000	131.00	3,537,000
住友精化	29,000	823.00	23,867,000
日産化学工業	91,700	2,823.00	258,869,100
ラサ工業	53,000	139.00	7,367,000
クレハ	99,000	460.00	45,540,000
多木化学	8,000	704.00	5,632,000
テイカ	24,000	492.00	11,808,000
石原産業	238,000	116.00	27,608,000
片倉コープアグリ	16,050	249.00	3,996,450
日東エフシー	8,300	975.00	8,092,500
日本曹達	91,000	759.00	69,069,000
東ソー	378,000	634.00	239,652,000
トクヤマ	220,000	229.00	50,380,000
セントラル硝子	144,000	594.00	85,536,000
東亜合成	88,800	950.00	84,360,000
大阪ソーダ	56,000	420.00	23,520,000
関東電化工業	34,000	869.00	29,546,000
デンカ	293,000	543.00	159,099,000
イビデン	88,600	1,719.00	152,303,400
信越化学工業	253,900	6,812.00	1,729,566,800
日本カーバイド工業	48,000	190.00	9,120,000
堺化学工業	57,000	354.00	20,178,000
エア・ウォーター	125,000	1,915.00	239,375,000
大陽日酸	181,800	1,249.00	227,068,200
日本化学工業	52,000	273.00	14,196,000
日本パーカライジング	66,900	1,022.00	68,371,800
高压ガス工業	20,000	636.00	12,720,000
チタン工業	17,000	214.00	3,638,000
四国化成工業	20,000	1,007.00	20,140,000
戸田工業	28,000	325.00	9,100,000
ステラ ケミファ	7,300	1,203.00	8,781,900
保土谷化学工業	43,000	169.00	7,267,000
日本触媒	22,200	8,720.00	193,584,000
大日精化工業	59,000	559.00	32,981,000
カネカ	191,000	960.00	183,360,000
協和発酵キリン	169,000	1,763.00	297,947,000
三菱瓦斯化学	244,000	633.00	154,452,000
三井化学	643,000	444.00	285,492,000
J S R	140,000	1,915.00	268,100,000
東京応化工業	29,300	3,770.00	110,461,000
大阪有機化学工業	10,300	637.00	6,561,100
三菱ケミカルホールディングス	885,000	708.00	626,580,000

日本合成化学工業	33,000	823.00	27,159,000
ダイセル	199,200	1,544.00	307,564,800
住友ベークライト	133,000	482.00	64,106,000
積水化学工業	328,000	1,339.00	439,192,000
日本ゼオン	122,000	1,038.00	126,636,000
アイカ工業	42,600	2,439.00	103,901,400
宇部興産	713,000	234.00	166,842,000
積水樹脂	21,800	1,562.00	34,051,600
タキロン	30,000	518.00	15,540,000
旭有機材工業	50,000	228.00	11,400,000
日立化成	70,000	1,899.00	132,930,000
ニチバン	14,000	576.00	8,064,000
リケンテクノス	22,900	404.00	9,251,600
大倉工業	34,000	327.00	11,118,000
積水化成品工業	40,000	392.00	15,680,000
群栄化学工業	38,000	295.00	11,210,000
タイガースポリマー	7,300	710.00	5,183,000
ミライアル	5,100	1,200.00	6,120,000
ダイキアクシス	2,400	1,014.00	2,433,600
ダイキョーニシカワ	4,500	6,070.00	27,315,000
日本化薬	92,000	1,221.00	112,332,000
カーリットホールディングス	12,900	516.00	6,656,400
E P Sホールディングス	12,800	1,185.00	15,168,000
レグス	1,900	729.00	1,385,100
プレステージ・インターナショナル	10,800	1,137.00	12,279,600
フェイス	4,100	1,386.00	5,682,600
アミューズ	4,300	4,720.00	20,296,000
野村総合研究所	83,000	4,620.00	383,460,000
ドリームインキュベータ	4,800	2,131.00	10,228,800
サイバネットシステム	11,400	403.00	4,594,200
クイック	6,300	870.00	5,481,000
T A C	6,900	239.00	1,649,100
C Eホールディングス	1,800	861.00	1,549,800
ケネディクス	189,100	435.00	82,258,500
電通	157,300	6,600.00	1,038,180,000
インテージホールディングス	7,600	1,771.00	13,459,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,500	693.00	3,811,500
東邦システムサイエンス	4,500	648.00	2,916,000
ぴあ	4,200	2,098.00	8,811,600
イオンファンタジー	4,600	1,828.00	8,408,800
ソースネクスト	6,900	489.00	3,374,100
ネクシィーズ	5,200	818.00	4,253,600
メディカルシステムネットワーク	13,400	678.00	9,085,200
ティー・ワイ・オー	17,700	206.00	3,646,200
日本精化	11,700	876.00	10,249,200
A D E K A	65,400	1,651.00	107,975,400
日油	116,000	854.00	99,064,000
ミヨシ油脂	54,000	136.00	7,344,000
新日本理化	22,800	207.00	4,719,600
ハリマ化成グループ	12,300	457.00	5,621,100

花王	380,700	5,690.00	2,166,183,000
第一工業製薬	31,000	365.00	11,315,000
三洋化成工業	45,000	836.00	37,620,000
武田薬品工業	530,500	5,467.00	2,900,243,500
アステラス製薬	1,585,100	1,583.50	2,510,005,850
大日本住友製薬	100,200	1,279.00	128,155,800
塩野義製薬	221,000	4,165.00	920,465,000
田辺三菱製薬	165,000	2,045.00	337,425,000
わかもと製薬	7,000	274.00	1,918,000
あすか製薬	16,600	1,331.00	22,094,600
日本新薬	32,000	4,455.00	142,560,000
バイオフェルミン製薬	2,400	3,215.00	7,716,000
中外製薬	140,900	3,755.00	529,079,500
科研製薬	24,500	8,740.00	214,130,000
エーザイ	186,700	6,918.00	1,291,590,600
理研ビタミン	4,500	3,895.00	17,527,500
ロート製薬	64,400	1,901.00	122,424,400
小野薬品工業	64,300	14,550.00	935,565,000
久光製薬	40,000	4,310.00	172,400,000
有機合成薬品工業	10,000	280.00	2,800,000
持田製薬	9,700	6,890.00	66,833,000
参天製薬	260,400	1,583.00	412,213,200
扶桑薬品工業	48,000	280.00	13,440,000
日本ケミファ	18,000	591.00	10,638,000
ツムラ	44,600	2,728.00	121,668,800
日医工	33,100	3,090.00	102,279,000
テルモ	207,200	3,340.00	692,048,000
みらかホールディングス	36,000	4,905.00	176,580,000
キッセイ薬品工業	25,100	2,827.00	70,957,700
生化学工業	27,000	1,557.00	42,039,000
栄研化学	11,900	2,033.00	24,192,700
日水製薬	5,800	1,317.00	7,638,600
鳥居薬品	9,700	2,823.00	27,383,100
JCRファーマ	10,900	2,438.00	26,574,200
東和薬品	7,200	7,360.00	52,992,000
富士製薬工業	4,000	2,029.00	8,116,000
沢井製薬	22,400	7,460.00	167,104,000
ゼリア新薬工業	29,000	1,629.00	47,241,000
第一三共	476,000	2,193.50	1,044,106,000
キョーリン製薬ホールディングス	37,800	1,904.00	71,971,200
大幸薬品	6,300	1,889.00	11,900,700
ダイト	6,300	2,867.00	18,062,100
大塚ホールディングス	304,400	3,835.00	1,167,374,000
大正製薬ホールディングス	34,100	7,040.00	240,064,000
大日本塗料	81,000	169.00	13,689,000
日本ペイントホールディングス	122,500	2,486.00	304,535,000
関西ペイント	172,000	1,777.00	305,644,000
神東塗料	11,000	202.00	2,222,000
中国塗料	41,000	867.00	35,547,000
日本特殊塗料	11,100	1,060.00	11,766,000

藤倉化成	19,400	579.00	11,232,600
太陽ホールディングス	11,500	3,935.00	45,252,500
D I C	567,000	306.00	173,502,000
サカタインクス	28,900	1,035.00	29,911,500
東洋インキ S Cホールディングス	140,000	481.00	67,340,000
T & K T O K A	4,800	2,189.00	10,507,200
アルプス技研	5,200	2,380.00	12,376,000
サニックス	16,600	283.00	4,697,800
ダイオーズ	3,300	1,214.00	4,006,200
日本空調サービス	7,100	1,132.00	8,037,200
オリエンタルランド	152,600	6,760.00	1,031,576,000
ダスキン	40,000	2,127.00	85,080,000
パーク 2 4	67,100	2,311.00	155,068,100
明光ネットワークジャパン	16,300	1,426.00	23,243,800
ファルコホールディングス	6,200	1,504.00	9,324,800
クレスコ	3,200	1,854.00	5,932,800
フジ・メディア・ホールディングス	139,000	1,495.00	207,805,000
秀英予備校	3,200	710.00	2,272,000
田谷	3,000	702.00	2,106,000
ラウンドワン	39,900	540.00	21,546,000
リゾートトラスト	54,600	3,115.00	170,079,000
オービック	45,900	5,520.00	253,368,000
ジャストシステム	24,100	918.00	22,123,800
T D Cソフトウェアエンジニアリング	3,200	1,257.00	4,022,400
ヤフー	956,000	478.00	456,968,000
ビー・エム・エル	8,300	3,340.00	27,722,000
ワタベウェディング	4,800	499.00	2,395,200
トレンドマイクロ	64,700	4,395.00	284,356,500
りらいあコミュニケーションズ	26,200	1,147.00	30,051,400
インフォメーション・ディベロプメン ト	2,900	947.00	2,746,300
リソー教育	22,300	284.00	6,333,200
日本オラクル	21,300	5,310.00	113,103,000
早稲田アカデミー	2,400	800.00	1,920,000
アルファシステムズ	4,500	2,011.00	9,049,500
フューチャーアーキテクト	15,700	699.00	10,974,300
C A C H o l d i n g s	9,600	1,001.00	9,609,600
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	1,215.00	4,495,500
トーセ	3,600	784.00	2,822,400
ユー・エス・エス	170,900	2,011.00	343,679,900
オービックビジネスコンサルタント	8,400	6,000.00	50,400,000
伊藤忠テクノソリューションズ	30,100	2,706.00	81,450,600
アイティフォー	16,600	498.00	8,266,800
東京個別指導学院	7,100	577.00	4,096,700
東計電算	2,600	2,105.00	5,473,000
サイバーエージェント	34,500	4,960.00	171,120,000
楽天	660,100	1,588.50	1,048,568,850
エックスネット	1,600	1,467.00	2,347,200
テー・オー・ダブリュー	9,000	779.00	7,011,000
大塚商会	35,900	5,830.00	209,297,000

総合メディカル	6,400	4,085.00	26,144,000
サイボウズ	18,000	311.00	5,598,000
ソフトブレーン	19,100	170.00	3,247,000
セントラルスポーツ	4,800	2,288.00	10,982,400
パラカ	4,700	1,534.00	7,209,800
電通国際情報サービス	8,300	1,670.00	13,861,000
イーエムシステムズ	2,000	2,138.00	4,276,000
ウェザーニューズ	4,000	3,880.00	15,520,000
C I J	12,800	521.00	6,668,800
東洋ビジネスエンジニアリング	1,600	1,328.00	2,124,800
日本エンタープライズ	11,400	284.00	3,237,600
WOWOW	6,300	3,205.00	20,191,500
フュージョンパートナー	7,700	504.00	3,880,800
フルキャストホールディングス	12,900	806.00	10,397,400
富士フイルムホールディングス	323,900	4,630.00	1,499,657,000
コニカミノルタ	316,400	1,371.00	433,784,400
資生堂	251,800	2,796.50	704,158,700
ライオン	163,000	1,122.00	182,886,000
高砂香料工業	9,400	3,095.00	29,093,000
マンダム	14,200	4,230.00	60,066,000
ミルボン	8,300	4,270.00	35,441,000
ファンケル	32,800	1,890.00	61,992,000
コーセー	22,900	11,250.00	257,625,000
コタ	4,900	1,245.00	6,100,500
ドクターシーラボ	19,200	2,269.00	43,564,800
シーボン	1,600	2,574.00	4,118,400
ポーラ・オルビスホールディングス	14,400	7,480.00	107,712,000
ノエビアホールディングス	9,000	2,753.00	24,777,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	892.00	2,497,600
エステー	10,000	1,025.00	10,250,000
アグロ カネショウ	5,500	969.00	5,329,500
コニシ	11,100	2,182.00	24,220,200
長谷川香料	18,100	1,618.00	29,285,800
星光P M C	7,600	1,149.00	8,732,400
小林製薬	23,200	8,780.00	203,696,000
荒川化学工業	12,000	1,196.00	14,352,000
メック	11,000	743.00	8,173,000
日本高純度化学	4,100	2,226.00	9,126,600
J C U	3,800	4,320.00	16,416,000
新田ゼラチン	8,800	783.00	6,890,400
デクセリアルズ	31,800	1,497.00	47,604,600
アース製薬	10,300	4,660.00	47,998,000
イハラケミカル工業	21,700	1,409.00	30,575,300
北興化学工業	15,000	457.00	6,855,000
大成ラミック	4,000	2,846.00	11,384,000
クミアイ化学工業	29,300	967.00	28,333,100
日本農薬	32,300	918.00	29,651,400
昭和シェル石油	142,200	1,055.00	150,021,000
富士興産	5,500	504.00	2,772,000
ニチレキ	17,000	962.00	16,354,000

東燃ゼネラル石油	214,000	1,258.00	269,212,000
ユシロ化学工業	7,700	1,398.00	10,764,600
ピーピー・カストロール	6,000	1,243.00	7,458,000
富士石油	32,600	382.00	12,453,200
MORESCO	3,700	1,719.00	6,360,300
出光興産	67,200	2,018.00	135,609,600
JXホールディングス	1,570,900	487.10	765,185,390
コスモエネルギーホールディングス	39,100	1,650.00	64,515,000
横浜ゴム	85,300	2,328.00	198,578,400
東洋ゴム工業	64,000	2,750.00	176,000,000
ブリヂストン	477,700	4,284.00	2,046,466,800
住友ゴム工業	132,400	1,800.00	238,320,000
藤倉ゴム工業	11,800	609.00	7,186,200
オカモト	48,000	1,247.00	59,856,000
アキレス	120,000	151.00	18,120,000
フコク	6,200	987.00	6,119,400
ニッタ	14,000	2,908.00	40,712,000
クリエートメディック	4,500	951.00	4,279,500
住友理工	26,200	1,099.00	28,793,800
三ツ星ベルト	34,000	946.00	32,164,000
バンドー化学	51,000	495.00	25,245,000
鬼怒川ゴム工業	31,000	696.00	21,576,000
旭硝子	747,000	738.00	551,286,000
日本板硝子	681,000	113.00	76,953,000
石塚硝子	19,000	224.00	4,256,000
有沢製作所	23,700	778.00	18,438,600
日本山村硝子	56,000	176.00	9,856,000
日本電気硝子	292,000	603.00	176,076,000
オハラ	5,300	594.00	3,148,200
住友大阪セメント	263,000	445.00	117,035,000
太平洋セメント	883,000	383.00	338,189,000
デイ・シイ	14,500	396.00	5,742,000
リゾートソリューション	15,000	277.00	4,155,000
日本ヒューム	14,900	768.00	11,443,200
日本コンクリート工業	24,300	447.00	10,862,100
三谷セキサン	7,100	1,729.00	12,275,900
アジアパイルホールディングス	18,800	813.00	15,284,400
東海カーボン	122,000	318.00	38,796,000
日本カーボン	69,000	296.00	20,424,000
東洋炭素	7,800	1,694.00	13,213,200
ノリタケカンパニーリミテド	80,000	274.00	21,920,000
TOTO	104,000	3,945.00	410,280,000
日本碍子	179,000	2,440.00	436,760,000
日本特殊陶業	122,000	3,050.00	372,100,000
ダントーホールディングス	18,000	220.00	3,960,000
MARUWA	4,100	2,681.00	10,992,100
品川リフラクトリーズ	36,000	274.00	9,864,000
黒崎播磨	30,000	247.00	7,410,000
ヨータイ	8,000	334.00	2,672,000
イソライト工業	7,400	210.00	1,554,000

東京窯業	17,000	189.00	3,213,000	
ニッカトー	5,500	403.00	2,216,500	
フジインコーポレーテッド	13,700	1,816.00	24,879,200	
エーアンドエーマテリアル	31,000	92.00	2,852,000	
ニチアス	65,000	741.00	48,165,000	
新日鐵住金	604,200	2,513.50	1,518,656,700	
神戸製鋼所	2,446,000	155.00	379,130,000	
中山製鋼所	106,000	82.00	8,692,000	
合同製鐵	71,000	213.00	15,123,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	360,900	1,906.50	688,055,850	
日新製鋼	59,800	1,269.00	75,886,200	
東京製鐵	71,500	741.00	52,981,500	
共英製鋼	15,100	2,171.00	32,782,100	
大和工業	31,500	2,768.00	87,192,000	
東京鐵鋼	27,000	533.00	14,391,000	
大阪製鐵	8,900	2,044.00	18,191,600	
淀川製鋼所	19,600	2,365.00	46,354,000	
東洋鋼鈑	33,700	397.00	13,378,900	
丸一鋼管	43,500	3,015.00	131,152,500	
モリ工業	21,000	375.00	7,875,000	
大同特殊鋼	237,000	439.00	104,043,000	
日本高周波鋼業	56,000	103.00	5,768,000	
日本冶金工業	110,500	182.00	20,111,000	
山陽特殊製鋼	84,000	521.00	43,764,000	
愛知製鋼	83,000	501.00	41,583,000	
日立金属	144,000	1,634.00	235,296,000	
日本金属	37,000	141.00	5,217,000	
大平洋金属	90,000	305.00	27,450,000	
新日本電工	80,300	247.00	19,834,100	
栗本鐵工所	73,000	213.00	15,549,000	
虹 技	20,000	176.00	3,520,000	
日本鑄鉄管	14,000	194.00	2,716,000	
日本製鋼所	203,000	442.00	89,726,000	
三菱製鋼	92,000	247.00	22,724,000	
日亜鋼業	18,800	266.00	5,000,800	
日本精線	11,000	515.00	5,665,000	
大紀アルミニウム工業所	24,000	337.00	8,088,000	
日本輕金属ホールディングス	343,200	206.00	70,699,200	
三井金属鉱業	384,000	256.00	98,304,000	
東邦亜鉛	79,000	348.00	27,492,000	
三菱マテリアル	883,000	419.00	369,977,000	
住友金属鉱山	391,000	1,542.00	602,922,000	
D O W Aホールディングス	169,000	1,047.00	176,943,000	
古河機械金属	220,000	278.00	61,160,000	
エス・サイエンス	70,700	46.00	3,252,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	3,150.00	43,785,000	
東邦チタニウム	23,900	1,522.00	36,375,800	
U A C J	162,000	228.00	36,936,000	
古河電気工業	415,000	213.00	88,395,000	

住友電気工業	533,100	1,685.00	898,273,500
フジクラ	197,000	559.00	110,123,000
昭和電線ホールディングス	157,000	82.00	12,874,000
東京特殊電線	1,900	959.00	1,822,100
タツタ電線	26,600	471.00	12,528,600
沖電線	15,000	230.00	3,450,000
カナレ電気	2,300	1,990.00	4,577,000
平河ヒューテック	3,500	1,245.00	4,357,500
リョービ	79,000	445.00	35,155,000
アーレスティ	16,300	840.00	13,692,000
アサヒホールディングス	21,300	1,917.00	40,832,100
東洋製罐グループホールディングス	100,500	2,144.00	215,472,000
ホッカンホールディングス	34,000	306.00	10,404,000
コロナ	7,500	1,122.00	8,415,000
横河ブリッジホールディングス	26,800	1,097.00	29,399,600
OSJ Bホールディングス	20,800	238.00	4,950,400
駒井ハルテック	25,000	222.00	5,550,000
高田機工	12,000	227.00	2,724,000
三和ホールディングス	132,900	886.00	117,749,400
文化シャッター	39,300	974.00	38,278,200
三協立山	18,500	1,720.00	31,820,000
アルインコ	6,200	1,137.00	7,049,400
東洋シャッター	3,900	925.00	3,607,500
LIXILグループ	210,200	2,623.00	551,354,600
日本フィルコン	10,600	510.00	5,406,000
ノーリツ	27,600	1,942.00	53,599,200
長府製作所	15,100	2,301.00	34,745,100
リンナイ	26,300	9,870.00	259,581,000
ユニプレス	26,000	2,641.00	68,666,000
ダイニチ工業	7,300	719.00	5,248,700
日東精工	20,000	296.00	5,920,000
三洋工業	20,000	184.00	3,680,000
岡部	30,000	1,024.00	30,720,000
ジーテクト	12,800	1,544.00	19,763,200
中国工業	2,500	740.00	1,850,000
東プレ	27,200	2,546.00	69,251,200
高周波熱錬	24,400	908.00	22,155,200
東京製綱	96,000	191.00	18,336,000
サンコール	8,500	658.00	5,593,000
モリテックスチール	7,500	294.00	2,205,000
パイオラックス	7,100	5,820.00	41,322,000
日本発条	122,900	1,244.00	152,887,600
中央発條	17,000	286.00	4,862,000
アドバネクス	2,700	1,783.00	4,814,100
三浦工業	63,200	1,420.00	89,744,000
タクマ	45,000	967.00	43,515,000
テクノプロ・ホールディング	20,000	3,050.00	61,000,000
リブセンス	9,300	466.00	4,333,800
ジャパンマテリアル	5,800	2,007.00	11,640,600
ベクトル	3,000	2,248.00	6,744,000

ウチヤマホールディングス	8,100	465.00	3,766,500
サクセスホールディングス	1,300	1,306.00	1,697,800
キャリアリンク	1,800	1,714.00	3,085,200
I B J	2,700	1,375.00	3,712,500
アサンテ	4,600	1,483.00	6,821,800
N・フィールド	4,900	1,521.00	7,452,900
M & Aキャピタルパートナーズ	1,100	1,605.00	1,765,500
E R Iホールディングス	3,900	794.00	3,096,600
アピスト	1,400	1,564.00	2,189,600
ウィルグループ	3,000	867.00	2,601,000
日本ビューホテル	1,500	2,283.00	3,424,500
リクルートホールディングス	213,500	3,660.00	781,410,000
ツガミ	41,000	534.00	21,894,000
オークマ	92,000	869.00	79,948,000
東芝機械	77,000	391.00	30,107,000
アマダホールディングス	210,800	1,043.00	219,864,400
アイダエンジニアリング	30,800	1,094.00	33,695,200
滝澤鉄工所	46,000	188.00	8,648,000
富士機械製造	46,200	1,160.00	53,592,000
牧野フライス製作所	70,000	856.00	59,920,000
オーエスジー	64,400	2,232.00	143,740,800
ダイジェット工業	17,000	175.00	2,975,000
旭ダイヤモンド工業	38,700	1,251.00	48,413,700
D M G 森精機	89,200	1,657.00	147,804,400
ソディック	26,800	875.00	23,450,000
ディスコ	16,500	9,750.00	160,875,000
日東工器	8,200	2,456.00	20,139,200
パンチ工業	4,800	938.00	4,502,400
豊田自動織機	123,100	6,160.00	758,296,000
豊和工業	8,100	706.00	5,718,600
O K K	56,000	149.00	8,344,000
石川製作所	36,000	91.00	3,276,000
東洋機械金属	9,800	420.00	4,116,000
津田駒工業	34,000	120.00	4,080,000
エンシュウ	36,000	96.00	3,456,000
島精機製作所	19,900	1,812.00	36,058,800
日阪製作所	17,800	953.00	16,963,400
やまびこ	22,000	1,100.00	24,200,000
ペガサスミシン製造	12,800	473.00	6,054,400
ナブテスコ	86,100	2,438.00	209,911,800
三井海洋開発	16,600	1,653.00	27,439,800
レオン自動機	10,900	583.00	6,354,700
S M C	42,400	29,450.00	1,248,680,000
新川	11,600	775.00	8,990,000
ホソカワミクロン	23,000	602.00	13,846,000
ユニオンツール	6,100	2,852.00	17,397,200
オイレス工業	16,800	1,942.00	32,625,600
日精エー・エス・ピー機械	5,100	2,435.00	12,418,500
サトーホールディングス	17,600	2,257.00	39,723,200
日本エアテック	4,800	710.00	3,408,000

日精樹脂工業	10,300	1,030.00	10,609,000
ワイエイシイ	5,900	881.00	5,197,900
小松製作所	693,400	1,967.00	1,363,917,800
住友重機械工業	387,000	564.00	218,268,000
日立建機	63,100	1,878.00	118,501,800
日工	19,000	417.00	7,923,000
巴工業	5,700	1,661.00	9,467,700
井関農機	145,000	197.00	28,565,000
T O W A	11,600	810.00	9,396,000
丸山製作所	29,000	199.00	5,771,000
北川鉄工所	65,000	306.00	19,890,000
シンニッタン	14,300	569.00	8,136,700
クボタ	680,000	1,790.00	1,217,200,000
荏原実業	4,300	1,477.00	6,351,100
東洋エンジニアリング	73,000	320.00	23,360,000
三菱化工機	46,000	316.00	14,536,000
月島機械	24,900	1,104.00	27,489,600
帝国電機製作所	9,300	861.00	8,007,300
東京機械製作所	51,000	62.00	3,162,000
新東工業	32,000	1,004.00	32,128,000
澁谷工業	11,800	1,907.00	22,502,600
アイチコーポレーション	20,000	741.00	14,820,000
小森コーポレーション	34,300	1,431.00	49,083,300
鶴見製作所	10,500	2,010.00	21,105,000
住友精密工業	22,000	471.00	10,362,000
酒井重工業	27,000	240.00	6,480,000
荏原製作所	293,000	490.00	143,570,000
石井鐵工所	21,000	194.00	4,074,000
西島製作所	13,800	922.00	12,723,600
北越工業	13,800	853.00	11,771,400
千代田化工建設	109,000	925.00	100,825,000
ダイキン工業	196,800	7,708.00	1,516,934,400
オルガノ	27,000	457.00	12,339,000
トーヨーカネツ	81,000	205.00	16,605,000
栗田工業	80,100	2,820.00	225,882,000
椿本チエイン	72,000	850.00	61,200,000
大同工業	27,000	208.00	5,616,000
日本コンベヤ	44,000	196.00	8,624,000
日機装	43,700	929.00	40,597,300
木村化工機	12,900	506.00	6,527,400
新興プランテック	31,100	970.00	30,167,000
アネスト岩田	21,100	841.00	17,745,100
ダイフク	66,700	1,731.00	115,457,700
サムコ	2,300	930.00	2,139,000
加藤製作所	29,000	540.00	15,660,000
油研工業	27,000	241.00	6,507,000
タダノ	65,000	1,441.00	93,665,000
フジテック	39,300	1,215.00	47,749,500
C K D	37,500	1,053.00	39,487,500
キトー	14,700	950.00	13,965,000

平和	40,000	2,175.00	87,000,000
理想科学工業	16,400	2,184.00	35,817,600
SANKYO	37,600	4,515.00	169,764,000
日本金銭機械	12,400	1,368.00	16,963,200
マースエンジニアリング	7,600	2,010.00	15,276,000
福島工業	7,400	2,616.00	19,358,400
オーイズミ	4,900	640.00	3,136,000
ダイコク電機	5,700	1,617.00	9,216,900
竹内製作所	16,900	2,057.00	34,763,300
アマノ	45,000	1,468.00	66,060,000
JUKI	20,000	1,468.00	29,360,000
サンデンホールディングス	82,000	436.00	35,752,000
蛇の目マシン工業	13,000	948.00	12,324,000
ブラザー工業	174,700	1,550.00	270,785,000
マックス	20,000	1,170.00	23,400,000
モリタホールディングス	23,600	1,189.00	28,060,400
グローリー	43,200	3,130.00	135,216,000
新晃工業	9,400	1,314.00	12,351,600
大和冷機工業	21,700	770.00	16,709,000
セガサミーホールディングス	145,200	1,252.00	181,790,400
日本ピストンリング	5,300	2,003.00	10,615,900
リケン	58,000	434.00	25,172,000
T P R	15,000	2,930.00	43,950,000
ホシザキ電機	29,600	8,510.00	251,896,000
大豊工業	10,800	1,380.00	14,904,000
日本精工	277,600	1,345.00	373,372,000
NTN	313,000	586.00	183,418,000
ジェイテクト	144,000	1,962.00	282,528,000
不二越	125,000	547.00	68,375,000
ミネベア	201,000	1,358.00	272,958,000
日本トムソン	46,000	541.00	24,886,000
THK	89,900	2,168.00	194,903,200
ユースン精機	6,000	2,293.00	13,758,000
前澤給装工業	5,300	1,516.00	8,034,800
イーグル工業	18,800	2,271.00	42,694,800
前澤工業	10,300	417.00	4,295,100
日本ビラー工業	14,600	1,029.00	15,023,400
キッツ	60,600	571.00	34,602,600
日立製作所	3,245,000	685.40	2,224,123,000
東芝	2,845,000	337.30	959,618,500
三菱電機	1,352,000	1,241.50	1,678,508,000
富士電機	376,000	494.00	185,744,000
東洋電機製造	26,000	410.00	10,660,000
安川電機	165,500	1,320.00	218,460,000
シンフォニアテクノロジー	93,000	190.00	17,670,000
明電舎	124,000	408.00	50,592,000
オリジン電気	20,000	342.00	6,840,000
山洋電気	30,000	768.00	23,040,000
デンヨー	11,500	1,984.00	22,816,000
日立工機	36,200	901.00	32,616,200

三櫻工業	17,000	789.00	13,413,000
マキタ	88,100	6,790.00	598,199,000
東芝テック	97,000	433.00	42,001,000
芝浦メカトロニクス	22,000	228.00	5,016,000
マブチモーター	38,700	5,620.00	217,494,000
日本電産	149,400	8,311.00	1,241,663,400
東光高岳	6,900	1,397.00	9,639,300
宮越ホールディングス	4,600	573.00	2,635,800
ダイヘン	74,000	592.00	43,808,000
田淵電機	15,200	865.00	13,148,000
ヤーマン	1,800	1,747.00	3,144,600
JVCケンウッド	98,900	318.00	31,450,200
ミマキエンジニアリング	8,200	680.00	5,576,000
第一精工	5,600	1,669.00	9,346,400
日新電機	31,600	785.00	24,806,000
大崎電気工業	25,000	624.00	15,600,000
オムロン	146,000	3,915.00	571,590,000
日東工業	21,600	2,194.00	47,390,400
I D E C	16,000	1,019.00	16,304,000
不二電機工業	1,300	1,475.00	1,917,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	260,000	519.00	134,940,000
サクサホールディングス	34,000	242.00	8,228,000
メルコホールディングス	7,400	2,161.00	15,991,400
テクノメディカ	3,000	2,534.00	7,602,000
日本電気	1,749,000	395.00	690,855,000
富士通	1,303,000	577.30	752,221,900
沖電気工業	475,000	197.00	93,575,000
岩崎通信機	60,000	83.00	4,980,000
電気興業	38,000	532.00	20,216,000
サンケン電気	68,000	466.00	31,688,000
ナカヨ	14,000	337.00	4,718,000
アイホン	7,800	1,958.00	15,272,400
ルネサスエレクトロニクス	70,100	695.00	48,719,500
セイコーエプソン	184,500	1,944.00	358,668,000
ワコム	106,100	473.00	50,185,300
アルバック	22,800	2,100.00	47,880,000
アクセル	6,300	1,426.00	8,983,800
E I Z O	12,400	2,769.00	34,335,600
ジャパンディスプレイ	277,500	371.00	102,952,500
日本信号	37,300	1,196.00	44,610,800
京三製作所	32,000	330.00	10,560,000
能美防災	17,900	1,383.00	24,755,700
ホーチキ	9,700	1,155.00	11,203,500
エレコム	10,000	1,457.00	14,570,000
日本無線	29,000	423.00	12,267,000
パナソニック	1,654,900	1,337.00	2,212,601,300
シャープ	1,142,000	148.00	169,016,000
アンリツ	81,100	813.00	65,934,300
富士通ゼネラル	41,000	1,510.00	61,910,000
日立国際電気	35,000	1,437.00	50,295,000

ソニー	949,700	3,204.00	3,042,838,800
T D K	81,600	7,210.00	588,336,000
帝国通信工業	33,000	195.00	6,435,000
ミツミ電機	47,600	669.00	31,844,400
タムラ製作所	52,000	365.00	18,980,000
アルプス電気	110,800	3,360.00	372,288,000
池上通信機	47,000	151.00	7,097,000
パイオニア	203,200	321.00	65,227,200
日本電波工業	12,200	857.00	10,455,400
鈴木	3,800	585.00	2,223,000
日本トリム	3,300	4,435.00	14,635,500
ローランド ディー . ジー .	5,400	2,733.00	14,758,200
日本コロムビア	4,500	449.00	2,020,500
フォスター電機	15,800	2,812.00	44,429,600
クラリオン	71,000	426.00	30,246,000
S M K	40,000	598.00	23,920,000
ヨコオ	10,900	671.00	7,313,900
東光	27,000	310.00	8,370,000
ティアック	73,000	45.00	3,285,000
ホシデン	40,900	725.00	29,652,500
ヒロセ電機	22,900	14,370.00	329,073,000
日本航空電子工業	39,000	2,091.00	81,549,000
T O A	14,400	1,176.00	16,934,400
日立マクセル	26,800	1,933.00	51,804,400
古野電気	15,800	945.00	14,931,000
ユニデンホールディングス	36,000	197.00	7,092,000
アルパイン	32,200	1,543.00	49,684,600
スミダコーポレーション	11,100	854.00	9,479,400
アイコム	7,400	2,550.00	18,870,000
リオン	5,100	1,715.00	8,746,500
船井電機	13,600	1,174.00	15,966,400
横河電機	135,300	1,306.00	176,701,800
新電元工業	52,000	444.00	23,088,000
アズビル	44,200	2,909.00	128,577,800
東亜ディーケーケー	5,800	479.00	2,778,200
日本光電工業	56,500	2,060.00	116,390,000
チノー	4,900	1,096.00	5,370,400
共和電業	16,700	438.00	7,314,600
日本電子材料	6,000	691.00	4,146,000
堀場製作所	25,000	4,440.00	111,000,000
アドバンテスト	92,000	975.00	89,700,000
小野測器	6,800	997.00	6,779,600
エスベック	14,900	1,153.00	17,179,700
パナソニック デバイス S U N X	12,100	652.00	7,889,200
キーエンス	30,600	57,740.00	1,766,844,000
日置電機	7,000	2,163.00	15,141,000
シスメックス	104,800	6,310.00	661,288,000
メガチップス	14,100	1,246.00	17,568,600
O B A R A G R O U P	8,700	5,270.00	45,849,000

イマジカ・ロボット ホールディングス	9,100	463.00	4,213,300	
澤藤電機	9,000	223.00	2,007,000	
デンソー	333,900	5,555.00	1,854,814,500	
コーセル	19,700	1,191.00	23,462,700	
新日本無線	10,000	528.00	5,280,000	
オブテックス	10,000	2,228.00	22,280,000	
千代田インテグレ	7,100	2,750.00	19,525,000	
レーザーテック	13,800	1,316.00	18,160,800	
スタンレー電気	97,000	2,724.00	264,228,000	
岩崎電気	46,000	267.00	12,282,000	
ウシオ電機	82,000	1,560.00	127,920,000	
岡谷電機産業	7,000	386.00	2,702,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	12,900	428.00	5,521,200	
日本セラミック	7,700	1,697.00	13,066,900	
遠藤照明	6,300	1,256.00	7,912,800	
日本デジタル研究所	11,300	1,644.00	18,577,200	
古河電池	10,000	774.00	7,740,000	
双信電機	6,900	353.00	2,435,700	
山一電機	15,400	1,000.00	15,400,000	
図研	9,800	1,130.00	11,074,000	
日本電子	57,000	680.00	38,760,000	
カシオ計算機	135,500	2,227.00	301,758,500	
ファナック	140,700	20,095.00	2,827,366,500	
日本シイエムケイ	34,200	235.00	8,037,000	
エンプラス	6,100	4,460.00	27,206,000	
大真空	25,000	247.00	6,175,000	
ローム	66,600	5,780.00	384,948,000	
浜松ホトニクス	105,500	2,927.00	308,798,500	
三井ハイテック	17,800	738.00	13,136,400	
新光電気工業	50,900	778.00	39,600,200	
京セラ	221,900	5,812.00	1,289,682,800	
協栄産業	15,000	178.00	2,670,000	
太陽誘電	70,700	1,655.00	117,008,500	
村田製作所	141,800	15,585.00	2,209,953,000	
ユーシン	17,200	797.00	13,708,400	
双葉電子工業	23,100	1,683.00	38,877,300	
日東電工	109,400	7,950.00	869,730,000	
北陸電気工業	58,000	160.00	9,280,000	
東海理化電機製作所	35,500	2,692.00	95,566,000	
ニチコン	42,500	932.00	39,610,000	
日本ケミコン	109,000	285.00	31,065,000	
K O A	18,700	1,120.00	20,944,000	
三井造船	523,000	199.00	104,077,000	
日立造船	105,600	679.00	71,702,400	
三菱重工業	2,265,000	611.40	1,384,821,000	
川崎重工業	981,000	474.00	464,994,000	
I H I	973,000	362.00	352,226,000	
名村造船所	37,500	1,023.00	38,362,500	
サノヤスホールディングス	16,300	277.00	4,515,100	

日本車輛製造	49,000	313.00	15,337,000	
ニチユ三菱フォークリフト	15,900	512.00	8,140,800	
近畿車輛	20,000	375.00	7,500,000	
F P G	39,300	940.00	36,942,000	
島根銀行	3,100	1,419.00	4,398,900	
じもとホールディングス	95,400	207.00	19,747,800	
全国保証	34,700	4,135.00	143,484,500	
足利ホールディングス	83,900	504.00	42,285,600	
東京T Yフィナンシャルグループ	17,100	3,970.00	67,887,000	
九州フィナンシャルグループ	212,230	905.00	192,068,150	
日産自動車	1,897,100	1,217.00	2,308,770,700	
いすゞ自動車	427,200	1,407.00	601,070,400	
トヨタ自動車	1,864,600	7,316.00	13,641,413,600	*
日野自動車	192,800	1,309.00	252,375,200	
三菱自動車工業	495,400	985.00	487,969,000	
エフテック	7,800	1,114.00	8,689,200	
レシップホールディングス	4,500	857.00	3,856,500	
G M B	2,200	1,094.00	2,406,800	
ファルテック	1,800	1,444.00	2,599,200	
武蔵精密工業	14,400	2,444.00	35,193,600	
日産車体	59,400	1,449.00	86,070,600	
新明和工業	55,000	1,255.00	69,025,000	
極東開発工業	25,100	1,290.00	32,379,000	
日信工業	24,700	1,876.00	46,337,200	
トピー工業	111,000	273.00	30,303,000	
ティラド	52,000	205.00	10,660,000	
曙ブレーキ工業	57,000	394.00	22,458,000	
タチエス	21,400	1,559.00	33,362,600	
N O K	65,400	2,779.00	181,746,600	
フタバ産業	41,100	476.00	19,563,600	
K Y B	151,000	350.00	52,850,000	
シロキ工業	30,000	332.00	9,960,000	
市光工業	33,000	219.00	7,227,000	
大同メタル工業	18,800	1,113.00	20,924,400	
プレス工業	66,700	477.00	31,815,900	
ミクニ	13,100	492.00	6,445,200	
カルソニックカンセイ	103,000	975.00	100,425,000	
太平洋工業	27,500	1,327.00	36,492,500	
ケーヒン	31,000	1,851.00	57,381,000	
河西工業	16,500	1,426.00	23,529,000	
アイシン精機	123,700	4,535.00	560,979,500	
富士機工	15,800	488.00	7,710,400	
マツダ	402,700	2,322.00	935,069,400	
ダイハツ工業	161,400	1,495.00	241,293,000	
今仙電機製作所	11,500	1,136.00	13,064,000	
本田技研工業	1,216,300	3,895.00	4,737,488,500	
スズキ	282,500	3,919.00	1,107,117,500	
富士重工業	459,900	4,541.00	2,088,405,900	
安永	4,300	533.00	2,291,900	
ヤマハ発動機	190,800	2,733.00	521,456,400	

ショーワ	31,800	1,047.00	33,294,600
小糸製作所	80,900	4,270.00	345,443,000
T B K	17,500	479.00	8,382,500
エクセディ	18,300	2,821.00	51,624,300
ミツバ	24,800	1,849.00	45,855,200
豊田合成	43,600	2,665.00	116,194,000
愛三工業	20,900	1,240.00	25,916,000
盟和産業	1,300	1,185.00	1,540,500
ヨロズ	12,600	2,573.00	32,419,800
エフ・シー・シー	19,800	2,158.00	42,728,400
新家工業	30,000	145.00	4,350,000
シマノ	54,500	18,330.00	998,985,000
タカタ	24,400	1,433.00	34,965,200
テイ・エス テック	28,500	3,575.00	101,887,500
ジャムコ	5,100	4,895.00	24,964,500
小野建	11,500	1,049.00	12,063,500
はるやま商事	5,700	720.00	4,104,000
佐鳥電機	10,400	858.00	8,923,200
カップ・クリエイト	20,800	1,208.00	25,126,400
エコートレーディング	3,400	638.00	2,169,200
伯東	9,100	1,421.00	12,931,100
コンドーテック	10,200	748.00	7,629,600
中山福	7,900	830.00	6,557,000
ライトオン	9,900	1,030.00	10,197,000
ナガイレーベン	19,200	1,987.00	38,150,400
ジーンズメイト	4,600	254.00	1,168,400
三菱食品	14,700	2,867.00	42,144,900
良品計画	16,500	24,030.00	396,495,000
三城ホールディングス	16,800	466.00	7,828,800
松田産業	9,600	1,408.00	13,516,800
メディopalホールディングス	133,400	1,921.00	256,261,400
アドヴァン	13,800	1,035.00	14,283,000
S P K	3,100	2,257.00	6,996,700
萩原電気	3,800	1,806.00	6,862,800
アルビス	2,900	2,263.00	6,562,700
アズワン	9,500	4,060.00	38,570,000
スズデン	4,600	913.00	4,199,800
尾家産業	5,100	889.00	4,533,900
シモジマ	7,700	1,063.00	8,185,100
ドウシシャ	17,200	2,199.00	37,822,800
小津産業	2,700	2,127.00	5,742,900
コナカ	15,600	631.00	9,843,600
高速	8,200	900.00	7,380,000
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,417.00	2,408,900
G - 7ホールディングス	2,900	1,895.00	5,495,500
たけびし	4,800	1,049.00	5,035,200
イオン北海道	8,700	521.00	4,532,700
コジマ	19,600	287.00	5,625,200
ヒマラヤ	4,100	1,094.00	4,485,400
コーナン商事	20,300	1,579.00	32,053,700

黒田電気	23,100	2,399.00	55,416,900
ネットワークシステムズ	54,000	704.00	38,016,000
エコス	4,800	1,466.00	7,036,800
ワタミ	15,900	858.00	13,642,200
マルシェ	3,400	846.00	2,876,400
ドンキホーテホールディングス	86,100	4,470.00	384,867,000
丸文	11,600	875.00	10,150,000
西松屋チェーン	26,200	1,032.00	27,038,400
ゼンショーホールディングス	68,800	1,148.00	78,982,400
ハピネット	8,200	1,241.00	10,176,200
幸楽苑ホールディングス	8,500	1,532.00	13,022,000
ハークスレイ	3,900	1,343.00	5,237,700
橋本総業	2,600	1,355.00	3,523,000
サイゼリヤ	21,900	2,577.00	56,436,300
エクセル	6,100	1,514.00	9,235,400
V Tホールディングス	41,200	760.00	31,312,000
マルカキカイ	4,400	1,776.00	7,814,400
アルゴグラフィックス	5,700	1,755.00	10,003,500
魚力	3,700	1,654.00	6,119,800
ガリバーインターナショナル	40,300	1,214.00	48,924,200
日本エム・ディ・エム	11,200	629.00	7,044,800
ポプラ	3,500	532.00	1,862,000
ユナイテッドアローズ	17,400	5,410.00	94,134,000
進和	7,800	1,733.00	13,517,400
エスケイジャパン	3,900	429.00	1,673,100
ダイトエレクトロン	6,200	878.00	5,443,600
ハイデイ日高	10,100	3,110.00	31,411,000
シークス	8,400	3,350.00	28,140,000
京都きもの友禅	7,900	995.00	7,860,500
コロワイド	44,200	1,740.00	76,908,000
田中商事	4,900	696.00	3,410,400
オーハシテクニカ	8,400	1,382.00	11,608,800
壱番屋	6,000	5,340.00	32,040,000
白銅	3,900	1,316.00	5,132,400
トップカルチャー	5,900	509.00	3,003,100
P L A N T	3,300	1,291.00	4,260,300
スギホールディングス	23,900	5,810.00	138,859,000
島津製作所	161,000	1,700.00	273,700,000
J M S	24,000	287.00	6,888,000
クボテック	3,000	699.00	2,097,000
モリテックス	3,000	216.00	648,000
長野計器	8,700	783.00	6,812,100
ブイ・テクノロジー	2,600	3,950.00	10,270,000
スター精密	25,600	1,472.00	37,683,200
東京計器	46,000	227.00	10,442,000
愛知時計電機	19,000	329.00	6,251,000
オーバル	12,700	262.00	3,327,400
東京精密	24,300	2,522.00	61,284,600
マニー	12,300	2,216.00	27,256,800
ニコン	252,400	1,578.00	398,287,200

トプコン	40,800	1,629.00	66,463,200
オリンパス	201,300	3,830.00	770,979,000
理研計器	11,900	1,445.00	17,195,500
S C R E E Nホールディングス	128,000	640.00	81,920,000
キヤノン電子	12,400	2,079.00	25,779,600
タムロン	10,900	2,329.00	25,386,100
H O Y A	314,400	4,304.00	1,353,177,600
ノーリツ鋼機	12,300	593.00	7,293,900
エー・アンド・デイ	12,600	441.00	5,556,600
キヤノン	727,700	3,706.00	2,696,856,200
リコー	406,500	1,335.00	542,677,500
シチズンホールディングス	166,300	874.00	145,346,200
リズム時計工業	59,000	170.00	10,030,000
大研医器	9,200	1,040.00	9,568,000
メニコン	6,800	2,741.00	18,638,800
パラマウントベッドホールディングス	14,300	3,580.00	51,194,000
トランザクション	1,900	462.00	877,800
S H O B I	5,000	401.00	2,005,000
ニホンフラッシュ	3,800	1,264.00	4,803,200
前田工織	14,700	959.00	14,097,300
永大産業	20,000	417.00	8,340,000
アートネイチャー	9,700	1,175.00	11,397,500
ダンロップスポーツ	8,600	1,186.00	10,199,600
パンダイナムコホールディングス	149,100	3,015.00	449,536,500
共立印刷	25,500	312.00	7,956,000
フランスベッドホールディングス	19,000	918.00	17,442,000
マーベラス	22,400	1,005.00	22,512,000
パイロットコーポレーション	23,600	4,865.00	114,814,000
萩原工業	3,000	2,111.00	6,333,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	26,400	1,531.00	40,418,400
トッパン・フォームズ	24,100	1,457.00	35,113,700
フジシールインターナショナル	16,400	3,920.00	64,288,000
タカラトミー	48,500	629.00	30,506,500
廣濟堂	12,600	410.00	5,166,000
アーク	42,500	119.00	5,057,500
レック	4,900	1,380.00	6,762,000
タカノ	6,200	691.00	4,284,200
プロネクサス	12,700	885.00	11,239,500
ホクシン	13,100	134.00	1,755,400
ウッドワン	23,000	254.00	5,842,000
大建工業	52,000	374.00	19,448,000
きもと	25,500	259.00	6,604,500
凸版印刷	382,000	1,022.00	390,404,000
大日本印刷	400,000	1,201.00	480,400,000
図書印刷	22,000	515.00	11,330,000
共同印刷	41,000	334.00	13,694,000
日本写真印刷	22,600	2,491.00	56,296,600
光村印刷	3,000	246.00	738,000
藤森工業	12,200	3,215.00	39,223,000

宝印刷	7,300	1,319.00	9,628,700
前澤化成工業	10,100	1,059.00	10,695,900
アシックス	125,900	3,140.00	395,326,000
ツツミ	6,800	2,428.00	16,510,400
J S P	10,600	2,278.00	24,146,800
ニチハ	18,700	1,630.00	30,481,000
エフピコ	12,600	4,700.00	59,220,000
小松ウオール工業	4,200	2,143.00	9,000,600
ヤマハ	99,300	2,859.00	283,898,700
河合楽器製作所	4,700	2,142.00	10,067,400
クリナップ	12,300	826.00	10,159,800
ピジョン	76,600	3,095.00	237,077,000
天馬	10,900	2,028.00	22,105,200
兼松日産農林	19,000	157.00	2,983,000
キングジム	11,300	830.00	9,379,000
リンテック	32,100	2,688.00	86,284,800
T A S A K I	2,600	1,619.00	4,209,400
信越ポリマー	27,700	577.00	15,982,900
東リ	37,000	316.00	11,692,000
イトーキ	28,400	790.00	22,436,000
任天堂	83,200	22,045.00	1,834,144,000
三菱鉛筆	10,100	5,500.00	55,550,000
松風	6,600	1,508.00	9,952,800
タカラスタンダード	56,000	915.00	51,240,000
コクヨ	70,300	1,291.00	90,757,300
ナカバヤシ	29,000	313.00	9,077,000
ニフコ	31,600	4,635.00	146,466,000
立川ブラインド工業	5,700	829.00	4,725,300
グローブライド	6,600	1,529.00	10,091,400
岡村製作所	51,900	1,083.00	56,207,700
日本バルカー工業	59,000	290.00	17,110,000
M U T O Hホールディングス	18,000	310.00	5,580,000
伊藤忠商事	1,116,400	1,471.50	1,642,782,600
丸紅	1,166,800	676.50	789,340,200
スクロール	17,700	530.00	9,381,000
高島	26,000	263.00	6,838,000
ヨンドシーホールディングス	10,100	2,464.00	24,886,400
三陽商会	79,000	365.00	28,835,000
長瀬産業	75,000	1,468.00	110,100,000
ナイガイ	52,000	62.00	3,224,000
蝶理	8,500	1,754.00	14,909,000
豊田通商	148,500	2,795.00	415,057,500
オンワードホールディングス	102,000	741.00	75,582,000
三共生興	22,600	468.00	10,576,800
兼松	265,000	197.00	52,205,000
美津濃	73,000	585.00	42,705,000
ツカモトコーポレーション	24,000	134.00	3,216,000
ファミリーマート	45,100	5,300.00	239,030,000
ルック	25,000	183.00	4,575,000
三井物産	1,130,900	1,494.50	1,690,130,050

日本紙パルプ商事	70,000	335.00	23,450,000
東京エレクトロン	113,700	6,450.00	733,365,000
日立ハイテクノロジーズ	46,200	2,881.00	133,102,200
カメイ	17,300	1,254.00	21,694,200
東都水産	24,000	188.00	4,512,000
OUGホールディングス	22,000	246.00	5,412,000
スターゼン	5,200	3,145.00	16,354,000
セイコーホールディングス	95,000	725.00	68,875,000
山善	51,000	1,055.00	53,805,000
椿本興業	15,000	327.00	4,905,000
住友商事	787,100	1,293.50	1,018,113,850
日本ユニシス	36,700	1,271.00	46,645,700
内田洋行	33,000	393.00	12,969,000
三菱商事	1,000,700	2,231.50	2,233,062,050
第一実業	33,000	603.00	19,899,000
キャノンマーケティングジャパン	38,100	1,797.00	68,465,700
西華産業	44,000	268.00	11,792,000
佐藤商事	11,800	733.00	8,649,400
菱洋エレクトロ	15,400	1,555.00	23,947,000
東京産業	12,900	483.00	6,230,700
ユアサ商事	11,600	2,617.00	30,357,200
神鋼商事	35,000	242.00	8,470,000
小林産業	10,300	234.00	2,410,200
阪和興業	133,000	480.00	63,840,000
カナデン	6,000	900.00	5,400,000
菱電商事	21,000	782.00	16,422,000
ニプロ	86,300	1,247.00	107,616,100
フルサト工業	7,300	1,805.00	13,176,500
岩谷産業	148,000	646.00	95,608,000
すてきナイスグループ	56,000	179.00	10,024,000
昭光通商	49,000	92.00	4,508,000
ニチモウ	24,000	249.00	5,976,000
極東貿易	16,000	243.00	3,888,000
イワキ	21,000	238.00	4,998,000
兼松エレクトロニクス	8,600	1,799.00	15,471,400
三愛石油	34,000	856.00	29,104,000
稲畑産業	31,800	1,355.00	43,089,000
G S Iクレオス	36,000	115.00	4,140,000
明和産業	11,000	397.00	4,367,000
キムラタン	644,000	8.00	5,152,000
ゴールドウイン	6,400	5,680.00	36,352,000
ユニ・チャーム	286,600	2,245.50	643,560,300
デザート	32,200	1,602.00	51,584,400
キング	6,900	428.00	2,953,200
ワキタ	28,300	1,025.00	29,007,500
ヤマトインターナショナル	9,200	395.00	3,634,000
東邦ホールディングス	46,000	2,487.00	114,402,000
サンゲツ	45,700	1,981.00	90,531,700
ミツウロコグループホールディングス	21,300	584.00	12,439,200
シナネンホールディングス	28,000	448.00	12,544,000

伊藤忠エネクス	29,300	943.00	27,629,900
サンリオ	37,400	3,170.00	118,558,000
サンワテクノス	8,500	1,137.00	9,664,500
リョーサン	22,500	2,914.00	65,565,000
新光商事	15,600	1,312.00	20,467,200
トーホー	6,100	2,079.00	12,681,900
三信電気	18,300	1,233.00	22,563,900
東陽テクニカ	19,500	968.00	18,876,000
モスフードサービス	17,500	2,610.00	45,675,000
加賀電子	12,000	1,661.00	19,932,000
三益半導体工業	10,400	1,136.00	11,814,400
ソーダニッカ	2,000	489.00	978,000
立花エレテック	9,800	1,336.00	13,092,800
木曽路	16,400	2,002.00	32,832,800
サトレストランシシステムズ	14,700	830.00	12,201,000
千趣会	26,500	778.00	20,617,000
タカキュー	9,900	196.00	1,940,400
ケーヨー	25,300	510.00	12,903,000
アデランス	15,600	985.00	15,366,000
上新電機	28,000	900.00	25,200,000
日本瓦斯	21,400	3,210.00	68,694,000
ベスト電器	42,600	130.00	5,538,000
ロイヤルホールディングス	22,300	2,115.00	47,164,500
東天紅	10,000	168.00	1,680,000
いなげや	14,900	1,180.00	17,582,000
島忠	34,500	2,422.00	83,559,000
チヨダ	15,700	3,760.00	59,032,000
ライフコーポレーション	8,400	3,280.00	27,552,000
リンガーハット	12,900	2,513.00	32,417,700
さが美	11,000	152.00	1,672,000
MR MAX	13,600	325.00	4,420,000
テンアライド	11,500	384.00	4,416,000
AOKIホールディングス	30,600	1,403.00	42,931,800
オークワ	20,000	1,014.00	20,280,000
コメリ	22,800	2,599.00	59,257,200
青山商事	30,200	4,070.00	122,914,000
しまむら	15,500	13,760.00	213,280,000
はせがわ	4,800	504.00	2,419,200
高島屋	194,000	1,021.00	198,074,000
松屋	26,800	1,530.00	41,004,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	63,100	2,271.00	143,300,100
近鉄百貨店	52,000	329.00	17,108,000
丸栄	22,000	116.00	2,552,000
ニッセンホールディングス	19,700	206.00	4,058,200
パルコ	12,800	1,008.00	12,902,400
丸井グループ	140,300	1,476.00	207,082,800
クレディセゾン	108,900	2,459.00	267,785,100
アクシアル リテイリング	10,300	4,065.00	41,869,500
井筒屋	75,000	69.00	5,175,000
イオン	550,100	1,869.00	1,028,136,900

ユニグループ・ホールディングス	127,600	736.00	93,913,600
イズミ	29,800	4,585.00	136,633,000
東武ストア	17,000	299.00	5,083,000
フォーバル	5,400	641.00	3,461,400
平和堂	27,000	2,752.00	74,304,000
フジ	14,800	2,580.00	38,184,000
ヤオコー	15,100	5,130.00	77,463,000
ゼビオホールディングス	18,100	2,230.00	40,363,000
ケースホールディングス	30,700	4,160.00	127,712,000
PALTA C	21,300	2,113.00	45,006,900
三谷産業	14,400	381.00	5,486,400
Olympicグループ	7,200	583.00	4,197,600
日産東京販売ホールディングス	22,700	314.00	7,127,800
新生銀行	1,269,000	244.00	309,636,000
あおぞら銀行	900,000	438.00	394,200,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,702,500	759.70	8,130,689,250
りそなホールディングス	1,560,300	641.40	1,000,776,420
三井住友トラスト・ホールディングス	2,948,000	450.80	1,328,958,400
三井住友フィナンシャルグループ	1,008,800	4,771.00	4,812,984,800
第四銀行	169,000	548.00	92,612,000
北越銀行	143,000	239.00	34,177,000
西日本シティ銀行	468,000	346.00	161,928,000
千葉銀行	514,000	834.00	428,676,000
横浜銀行	895,000	723.70	647,711,500
常陽銀行	482,000	611.00	294,502,000
群馬銀行	316,000	742.00	234,472,000
武蔵野銀行	21,200	4,345.00	92,114,000
千葉興業銀行	32,900	693.00	22,799,700
筑波銀行	55,200	422.00	23,294,400
七十七銀行	225,000	648.00	145,800,000
青森銀行	104,000	363.00	37,752,000
秋田銀行	88,000	377.00	33,176,000
山形銀行	81,000	481.00	38,961,000
岩手銀行	9,300	5,260.00	48,918,000
東邦銀行	119,000	439.00	52,241,000
東北銀行	75,000	151.00	11,325,000
みちのく銀行	67,000	208.00	13,936,000
ふくおかフィナンシャルグループ	541,000	597.00	322,977,000
静岡銀行	391,000	1,193.00	466,463,000
十六銀行	167,000	520.00	86,840,000
スルガ銀行	140,800	2,276.00	320,460,800
八十二銀行	241,000	815.00	196,415,000
山梨中央銀行	83,000	579.00	48,057,000
大垣共立銀行	167,000	458.00	76,486,000
福井銀行	114,000	244.00	27,816,000
北國銀行	149,000	473.00	70,477,000
清水銀行	4,500	3,080.00	13,860,000
滋賀銀行	134,000	598.00	80,132,000
南都銀行	130,000	376.00	48,880,000
百五銀行	128,000	569.00	72,832,000

京都銀行	255,000	1,202.00	306,510,000
紀陽銀行	52,300	1,867.00	97,644,100
三重銀行	59,000	260.00	15,340,000
ほくほくフィナンシャルグループ	908,000	264.00	239,712,000
広島銀行	394,000	656.00	258,464,000
山陰合同銀行	81,000	1,114.00	90,234,000
中国銀行	94,600	1,697.00	160,536,200
鳥取銀行	42,000	208.00	8,736,000
伊予銀行	142,700	1,305.00	186,223,500
百十四銀行	146,000	449.00	65,554,000
四国銀行	103,000	243.00	25,029,000
阿波銀行	109,000	683.00	74,447,000
大分銀行	82,000	471.00	38,622,000
宮崎銀行	89,000	391.00	34,799,000
佐賀銀行	80,000	270.00	21,600,000
十八銀行	82,000	353.00	28,946,000
沖縄銀行	10,600	4,900.00	51,940,000
琉球銀行	27,500	1,735.00	47,712,500
セブン銀行	449,600	510.00	229,296,000
みずほフィナンシャルグループ	18,727,000	235.20	4,404,590,400
高知銀行	53,000	140.00	7,420,000
山口フィナンシャルグループ	133,000	1,438.00	191,254,000
アクリーティブ	9,500	541.00	5,139,500
芙蓉総合リース	14,000	5,010.00	70,140,000
興銀リース	25,000	2,473.00	61,825,000
東京センチュリーリース	31,300	3,870.00	121,131,000
S B Iホールディングス	160,100	1,438.00	230,223,800
日本証券金融	58,700	648.00	38,037,600
アイフル	223,200	470.00	104,904,000
日本アジア投資	10,400	483.00	5,023,200
ポケットカード	10,000	598.00	5,980,000
長野銀行	45,000	201.00	9,045,000
名古屋銀行	121,000	436.00	52,756,000
北洋銀行	201,000	469.00	94,269,000
愛知銀行	4,800	6,680.00	32,064,000
第三銀行	75,000	181.00	13,575,000
中京銀行	55,000	239.00	13,145,000
東日本銀行	58,000	392.00	22,736,000
大光銀行	47,000	238.00	11,186,000
愛媛銀行	79,000	247.00	19,513,000
トマト銀行	53,000	173.00	9,169,000
みなと銀行	120,000	204.00	24,480,000
京葉銀行	110,000	604.00	66,440,000
関西アーバン銀行	18,500	1,368.00	25,308,000
栃木銀行	67,000	665.00	44,555,000
北日本銀行	4,200	3,205.00	13,461,000
東和銀行	186,000	105.00	19,530,000
福島銀行	168,000	94.00	15,792,000
大東銀行	86,000	172.00	14,792,000
リコーリース	10,500	3,415.00	35,857,500

イオンフィナンシャルサービス	87,400	2,736.00	239,126,400
アコム	267,900	640.00	171,456,000
ジャックス	74,000	496.00	36,704,000
オリエントコーポレーション	413,300	226.00	93,405,800
日立キャピタル	26,200	3,200.00	83,840,000
アプラスフィナンシャル	63,900	122.00	7,795,800
オリックス	944,600	1,719.50	1,624,239,700
三菱UFJリース	338,500	579.00	195,991,500
ジャフコ	18,200	5,190.00	94,458,000
トモニホールディングス	102,100	469.00	47,884,900
大和証券グループ本社	1,248,000	833.10	1,039,708,800
野村ホールディングス	2,727,100	734.30	2,002,509,530
岡三証券グループ	113,000	745.00	84,185,000
丸三証券	42,200	1,234.00	52,074,800
東洋証券	51,000	401.00	20,451,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	152,800	703.00	107,418,400
光世証券	33,000	192.00	6,336,000
水戸証券	41,400	407.00	16,849,800
いちよし証券	27,800	1,098.00	30,524,400
松井証券	67,700	1,084.00	73,386,800
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	296,300	3,654.00	1,082,680,200
だいこう証券ビジネス	7,000	1,084.00	7,588,000
日本取引所グループ	391,600	1,915.00	749,914,000
マネックスグループ	156,300	322.00	50,328,600
カブドットコム証券	117,800	396.00	46,648,800
極東証券	17,800	1,683.00	29,957,400
岩井コスモホールディングス	13,500	1,386.00	18,711,000
藍澤證券	18,900	760.00	14,364,000
フィデアホールディングス	90,800	241.00	21,882,800
池田泉州ホールディングス	127,300	514.00	65,432,200
アニコムホールディングス	7,400	2,862.00	21,178,800
MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	425,200	3,386.00	1,439,727,200
マネースクウェアHD	5,400	1,723.00	9,304,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	127,800	2,165.00	276,687,000
マネーパートナーズグループ	14,200	409.00	5,807,800
小林洋行	4,700	270.00	1,269,000
第一生命保険	854,600	2,016.50	1,723,300,900
東京海上ホールディングス	540,400	4,548.00	2,457,739,200
イー・ギャランティ	4,000	2,490.00	9,960,000
アサックス	2,500	1,537.00	3,842,500
NECキャピタルソリューション	5,400	1,698.00	9,169,200
T & Dホールディングス	486,100	1,512.50	735,226,250
三井不動産	707,000	3,423.00	2,420,061,000
三菱地所	992,000	2,583.00	2,562,336,000
平和不動産	25,100	1,379.00	34,612,900
東京建物	145,600	1,537.00	223,787,200

ダイビル	34,300	997.00	34,197,100
京阪神ビルディング	22,100	697.00	15,403,700
住友不動産	320,000	4,070.00	1,302,400,000
太平洋興発	54,000	87.00	4,698,000
大京	212,000	214.00	45,368,000
テーオーシー	45,900	858.00	39,382,200
東京楽天地	21,000	489.00	10,269,000
レオパレス21	145,700	603.00	87,857,100
スターツコーポレーション	15,200	1,917.00	29,138,400
フジ住宅	17,400	677.00	11,779,800
空港施設	16,000	556.00	8,896,000
明和地所	7,800	549.00	4,282,200
住友不動産販売	9,600	3,205.00	30,768,000
ゴールドクレスト	12,000	2,280.00	27,360,000
リロ・ホールディング	4,800	12,710.00	61,008,000
日本エスリード	5,400	1,178.00	6,361,200
日神不動産	18,300	398.00	7,283,400
タカラレーベン	58,800	642.00	37,749,600
サンヨーハウジング名古屋	7,800	1,134.00	8,845,200
イオンモール	86,100	1,983.00	170,736,300
ファースト住建	5,100	1,375.00	7,012,500
ランド	54,300	14.00	760,200
東祥	3,000	3,285.00	9,855,000
トーセイ	20,000	782.00	15,640,000
穴吹興産	13,000	241.00	3,133,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	82,900	1,200.00	99,480,000
サンフロンティア不動産	14,500	968.00	14,036,000
エフ・ジェー・ネクスト	10,400	562.00	5,844,800
ランドビジネス	7,100	368.00	2,612,800
グランディハウス	12,100	387.00	4,682,700
東武鉄道	722,000	553.00	399,266,000
相鉄ホールディングス	232,000	689.00	159,848,000
東京急行電鉄	734,000	958.00	703,172,000
京浜急行電鉄	371,000	985.00	365,435,000
小田急電鉄	433,000	1,153.00	499,249,000
京王電鉄	378,000	919.00	347,382,000
京成電鉄	203,000	1,399.00	283,997,000
富士急行	37,000	1,179.00	43,623,000
新京成電鉄	18,000	414.00	7,452,000
東日本旅客鉄道	247,700	10,995.00	2,723,461,500
西日本旅客鉄道	130,100	8,037.00	1,045,613,700
東海旅客鉄道	121,000	20,525.00	2,483,525,000
西武ホールディングス	107,700	2,385.00	256,864,500
鴻池運輸	16,600	1,429.00	23,721,400
西日本鉄道	175,000	618.00	108,150,000
ハマキョウレックス	9,400	2,225.00	20,915,000
サカイ引越センター	2,300	5,810.00	13,363,000
近鉄グループホールディングス	1,361,000	459.00	624,699,000
阪急阪神ホールディングス	907,000	747.00	677,529,000
南海電気鉄道	303,000	641.00	194,223,000

京阪電気鉄道	303,000	817.00	247,551,000
神戸電鉄	33,000	361.00	11,913,000
名古屋鉄道	493,000	489.00	241,077,000
山陽電気鉄道	47,000	472.00	22,184,000
トランコム	3,900	6,300.00	24,570,000
日本通運	523,000	614.00	321,122,000
ヤマトホールディングス	231,900	2,488.50	577,083,150
山九	164,000	617.00	101,188,000
日新	51,000	381.00	19,431,000
丸運	8,600	262.00	2,253,200
丸全昭和運輸	45,000	426.00	19,170,000
センコー	59,000	883.00	52,097,000
トナミホールディングス	28,000	384.00	10,752,000
ニッコンホールディングス	44,200	2,240.00	99,008,000
日本石油輸送	17,000	236.00	4,012,000
福山通運	82,000	676.00	55,432,000
セイノーホールディングス	104,500	1,316.00	137,522,000
神奈川中央交通	16,000	669.00	10,704,000
日立物流	28,100	2,030.00	57,043,000
丸和運輸機関	2,400	2,370.00	5,688,000
C & F ロジホールディングス	6,000	748.00	4,488,000
日本郵船	1,141,000	320.00	365,120,000
商船三井	709,000	321.00	227,589,000
川崎汽船	591,000	287.00	169,617,000
N S ユナイテッド海運	59,000	254.00	14,986,000
明治海運	12,200	523.00	6,380,600
飯野海運	69,700	580.00	40,426,000
共栄タンカー	12,000	189.00	2,268,000
日本航空	258,700	4,290.00	1,109,823,000
A N A ホールディングス	2,656,000	346.40	920,038,400
パスコ	13,000	333.00	4,329,000
三菱倉庫	89,000	1,558.00	138,662,000
三井倉庫ホールディングス	78,000	382.00	29,796,000
住友倉庫	99,000	589.00	58,311,000
澁澤倉庫	35,000	312.00	10,920,000
ヤマタネ	68,000	183.00	12,444,000
東陽倉庫	25,000	265.00	6,625,000
乾汽船	9,300	823.00	7,653,900
日本トランスシティ	31,000	455.00	14,105,000
ケイヒン	26,000	190.00	4,940,000
中央倉庫	8,100	928.00	7,516,800
安田倉庫	10,600	928.00	9,836,800
東洋埠頭	42,000	200.00	8,400,000
宇徳	11,400	478.00	5,449,200
上組	161,000	987.00	158,907,000
サンリツ	1,700	524.00	890,800
キムラユニティー	3,700	1,279.00	4,732,300
キューソー流通システム	3,800	2,583.00	9,815,400
郵船ロジスティクス	12,500	1,331.00	16,637,500
近鉄エクスプレス	24,200	2,147.00	51,957,400

東海運	8,300	282.00	2,340,600
エーアイティー	6,500	1,019.00	6,623,500
内外トランスライン	3,200	1,154.00	3,692,800
東京放送ホールディングス	79,900	1,678.00	134,072,200
日本テレビホールディングス	121,800	2,013.00	245,183,400
朝日放送	13,300	803.00	10,679,900
テレビ朝日ホールディングス	36,500	1,958.00	71,467,000
スカパーJ S A Tホールディングス	101,300	627.00	63,515,100
テレビ東京ホールディングス	10,900	2,170.00	23,653,000
日本BS放送	2,200	944.00	2,076,800
コネクシオ	9,800	1,243.00	12,181,400
日本通信	61,600	322.00	19,835,200
クロップス	1,400	513.00	718,200
日本電信電話	1,043,900	4,287.00	4,475,199,300
K D D I	1,355,000	2,664.50	3,610,397,500
光通信	12,000	8,630.00	103,560,000
N T T ドコモ	1,028,700	2,135.50	2,196,788,850
エムティーアイ	17,000	821.00	13,957,000
G M Oインターネット	49,400	1,541.00	76,125,400
カドカワ	32,800	1,744.00	57,203,200
学研ホールディングス	45,000	236.00	10,620,000
ゼンリン	17,600	1,791.00	31,521,600
昭文社	8,200	716.00	5,871,200
インプレスホールディングス	9,900	195.00	1,930,500
東京電力	1,146,300	842.00	965,184,600
中部電力	413,500	1,901.00	786,063,500
関西電力	551,500	1,476.00	814,014,000
中国電力	186,900	1,770.00	330,813,000
北陸電力	132,400	1,739.00	230,243,600
東北電力	337,700	1,747.00	589,961,900
四国電力	121,700	2,057.00	250,336,900
九州電力	298,400	1,415.00	422,236,000
北海道電力	126,500	1,277.00	161,540,500
沖縄電力	13,200	2,971.00	39,217,200
電源開発	98,000	3,830.00	375,340,000
東京瓦斯	1,609,000	592.10	952,688,900
大阪瓦斯	1,399,000	480.50	672,219,500
東邦瓦斯	341,000	746.00	254,386,000
北海道瓦斯	30,000	281.00	8,430,000
広島ガス	21,600	418.00	9,028,800
西部瓦斯	152,000	275.00	41,800,000
静岡ガス	38,300	818.00	31,329,400
メタウォーター	8,400	2,938.00	24,679,200
アイネット	7,200	1,203.00	8,661,600
松竹	88,000	1,048.00	92,224,000
東宝	95,200	2,898.00	275,889,600
エイチ・アイ・エス	23,000	3,930.00	90,390,000
東映	50,000	982.00	49,100,000
A O I P r o .	6,500	898.00	5,837,000
エヌ・ティ・ティ・データ	82,400	5,800.00	477,920,000

共立メンテナンス	8,900	7,980.00	71,022,000
イチネンホールディングス	14,900	1,053.00	15,689,700
建設技術研究所	8,400	1,244.00	10,449,600
スペース	8,000	1,293.00	10,344,000
アインファーマシーズ	16,000	6,130.00	98,080,000
燦ホールディングス	2,900	1,532.00	4,442,800
ピー・シー・エー	1,500	1,515.00	2,272,500
スバル興業	3,000	425.00	1,275,000
東京テアトル	54,000	133.00	7,182,000
よみうりランド	28,000	422.00	11,816,000
東京都競馬	96,000	301.00	28,896,000
常磐興産	52,000	153.00	7,956,000
カナモト	19,700	2,433.00	47,930,100
東京ドーム	96,000	563.00	54,048,000
D T S	13,700	2,802.00	38,387,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,300	3,085.00	158,260,500
シーイーシー	8,900	1,031.00	9,175,900
カブコン	34,100	2,436.00	83,067,600
西尾レントオール	11,400	2,702.00	30,802,800
アイ・エス・ビー	1,200	800.00	960,000
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	67,000	40.00	2,680,000
日本空港ビルデング	46,100	5,800.00	267,380,000
トランス・コスモス	18,400	3,180.00	58,512,000
乃村工藝社	27,600	1,548.00	42,724,800
ジャステック	8,100	1,131.00	9,161,100
S C S K	31,700	4,275.00	135,517,500
藤田観光	51,000	453.00	23,103,000
K N T - C Tホールディングス	68,000	282.00	19,176,000
日本管財	13,800	1,761.00	24,301,800
トーカイ	6,200	3,420.00	21,204,000
白洋舎	5,000	275.00	1,375,000
セコム	137,100	7,494.00	1,027,427,400
日本システムウエア	5,300	869.00	4,605,700
セントラル警備保障	6,400	1,467.00	9,388,800
アイネス	18,000	1,122.00	20,196,000
丹青社	24,100	825.00	19,882,500
メイテック	18,900	4,220.00	79,758,000
T K C	12,300	2,994.00	36,826,200
アサツー ディ・ケイ	24,700	2,920.00	72,124,000
富士ソフト	19,700	2,237.00	44,068,900
応用地質	14,800	1,415.00	20,942,000
船井総研ホールディングス	16,300	1,745.00	28,443,500
N S D	30,900	1,519.00	46,937,100
進学会	6,300	713.00	4,491,900
丸紅建材リース	12,000	232.00	2,784,000
コナミホールディングス	54,200	2,720.00	147,424,000
ベネッセホールディングス	51,600	3,155.00	162,798,000
イオンディライト	13,600	3,365.00	45,764,000

ナック	9,600	840.00	8,064,000
福井コンピュータホールディングス	3,900	886.00	3,455,400
ニチイ学館	27,500	830.00	22,825,000
ダイセキ	22,700	1,838.00	41,722,600
ステップ	5,000	1,033.00	5,165,000
日鉄住金物産	88,000	415.00	36,520,000
元気寿司	4,200	1,972.00	8,282,400
トラスコ中山	15,200	4,280.00	65,056,000
ヤマダ電機	527,400	538.00	283,741,200
オートバックスセブン	47,500	2,027.00	96,282,500
アークランドサカモト	9,500	2,597.00	24,671,500
ニトリホールディングス	57,600	9,200.00	529,920,000
グルメ杵屋	9,000	935.00	8,415,000
愛眼	10,800	256.00	2,764,800
ケーユーホールディングス	7,300	857.00	6,256,100
吉野家ホールディングス	37,700	1,478.00	55,720,600
加藤産業	20,900	2,702.00	56,471,800
イノテック	12,400	463.00	5,741,200
イエローハット	12,600	2,633.00	33,175,800
松屋フーズ	6,400	2,300.00	14,720,000
J B C Cホールディングス	11,600	776.00	9,001,600
J Kホールディングス	14,000	507.00	7,098,000
サガミチェーン	17,000	1,243.00	21,131,000
日伝	5,500	2,739.00	15,064,500
関西スーパーマーケット	10,300	816.00	8,404,800
ミロク情報サービス	9,100	835.00	7,598,500
北沢産業	11,000	215.00	2,365,000
杉本商事	7,200	1,278.00	9,201,600
因幡電機産業	19,800	3,770.00	74,646,000
王将フードサービス	9,800	4,000.00	39,200,000
プレナス	14,900	1,890.00	28,161,000
ミニストップ	9,800	2,324.00	22,775,200
アークス	23,200	2,322.00	53,870,400
バローホールディングス	28,700	2,784.00	79,900,800
パイテックホールディングス	4,600	1,502.00	6,909,200
ミスミグループ本社	149,700	1,446.00	216,466,200
アルテック	10,900	193.00	2,103,700
ベルク	5,900	4,455.00	26,284,500
大 庄	6,300	1,409.00	8,876,700
タキヒヨー	22,000	454.00	9,988,000
ファーストリテイリング	26,700	42,260.00	1,128,342,000
ソフトバンクグループ	705,400	6,243.00	4,403,812,200
蔵王産業	1,700	1,403.00	2,385,100
スズケン	60,700	4,005.00	243,103,500
サンドラッグ	28,200	6,200.00	174,840,000
サックスパー ホールディングス	10,000	2,088.00	20,880,000
ジェコス	9,200	1,111.00	10,221,200
ヤマザワ	2,900	1,674.00	4,854,600
やまや	2,300	2,549.00	5,862,700
ルネサスイーストン	6,500	472.00	3,068,000

ベルーナ	33,100	683.00	22,607,300	
合計	221,278,780		298,006,771,240	

*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27年10月30日現在

資産総額	3,850,081,386円
負債総額	3,021,507円
純資産総額（ - ）	3,847,059,879円
発行済数量	1,775,280,043口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1670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27年10月30日現在

資産総額	323,168,595,366円
負債総額	5,164,485,351円
純資産総額（ - ）	318,004,110,015円
発行済数量	141,180,373,153口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2525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カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

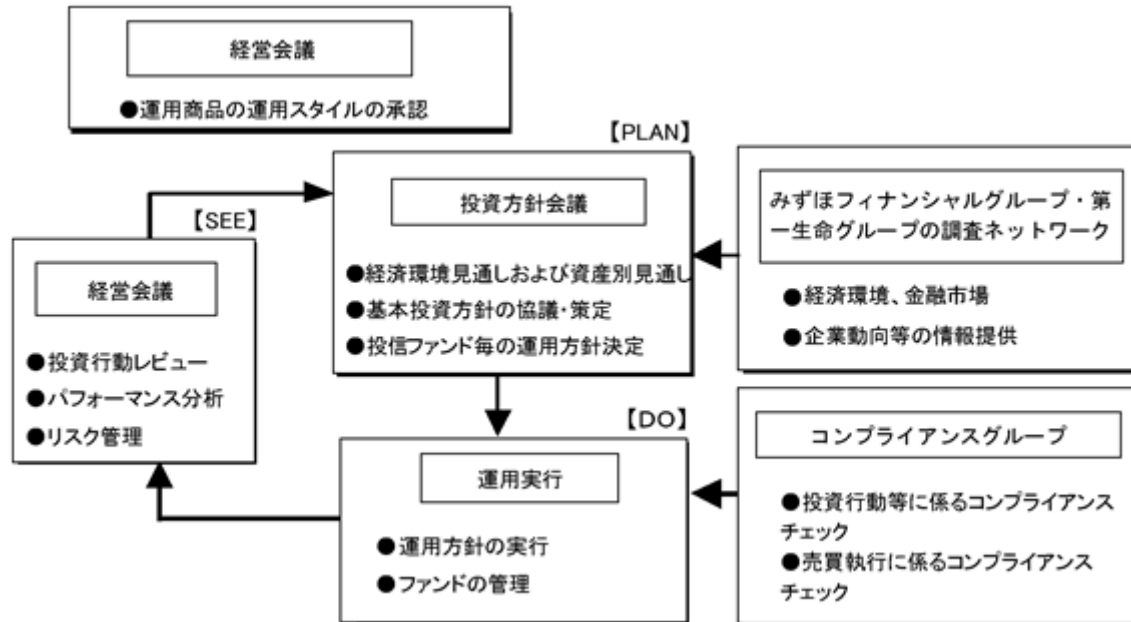
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年10月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に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27年10月30日現在、委託会社の運用する投資信託は394本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	5	23,257,375,581
追加型株式投資信託	353	5,925,127,729,592
単位型公社債投資信託	36	273,634,451,164
追加型公社債投資信託	0	0
合計	394	6,222,019,556,337

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30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27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31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27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29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	617,159	613,137
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（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	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第29期 （ 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 ）		第30期 （ 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日 ）	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

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
会計方針の変 更による累積 的影響額									
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	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
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 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

第30期（自平成26年4月1日至平成27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	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	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	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
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(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</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
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	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
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	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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事業年度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、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 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</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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。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27年3月26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事業年度より適用し、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。

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、当事業年度の期首において、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、当事業年度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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千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。

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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

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29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

（株主資本等変動計算書関係）

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

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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

(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27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30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等でありませ

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、株価指数先物取引及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及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 その他有価証券	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	-

第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

(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29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27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	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

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

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

当事業年度において、関係会社株式について202,477千円の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、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	-	-	-

第30期（平成27年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

（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29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）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。

4. その他有価証券

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。

第30期（平成27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	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
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	532,891	159,101	373,789

（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

第30期（平成27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	14,169,657	2,544,066

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度(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)

	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
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	973,035

(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)

	第29期	第30期
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

(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

	第29期	第30期
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり
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29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27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33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第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。

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

（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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	658,756	未払費用	235,583
	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	383,980	未払費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第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	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	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	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一ファイ 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	287,136	未払 費用	155,413
							業務委託料 の支払	11,810	未払金	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)	1,000,000	金銭の 信託	10,952,459
							信託報酬の 支払	7,933			

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	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	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
	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	-	兼務 1名	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	407,531	未払 費用	240,725
	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)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

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) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注4) 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5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「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、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

（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31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
資産合計		38,994,807

（単位：千円）

	第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	956,031
未払金	2,105,195
未払収益分配金	44
未払償還金	49,873
未払手数料	1,770,062
その他未払金	285,213
未払費用	1,927,420
未払法人税等	1,486,583
未払消費税等	289,515
賞与引当金	724,368
その他	20,000
流動負債計	7,509,114
固定負債	
退職給付引当金	920,913
役員退職慰労引当金	137,750
固定負債計	1,058,663
負債合計	8,567,778
（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	25,771,823
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	22,030,000
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	3,118,530
株主資本計	30,200,301
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	226,727
評価・換算差額等計	226,727
純資産合計	30,427,029
負債・純資産合計	38,994,807

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	15,465,477	
運用受託報酬	3,695,539	
投資助言報酬	510,549	
その他営業収益	383,893	
	営業収益計	20,055,459
営業費用		
支払手数料	6,672,717	
広告宣伝費	217,738	
公告費	129	
調査費	3,678,769	
調査費	2,272,268	
委託調査費	1,406,500	
委託計算費	207,057	
営業雑経費	280,193	
通信費	17,208	
印刷費	226,482	
協会費	11,849	
諸会費	17	
支払販売手数料	24,635	
	営業費用計	11,056,605
一般管理費		
給料	2,351,238	
役員報酬	121,094	
給料・手当	2,230,144	
交際費	19,774	
寄付金	2,156	
旅費交通費	119,653	
租税公課	94,838	
不動産賃借料	363,395	
退職給付費用	114,178	
固定資産減価償却費	1 362,235	
福利厚生費	10,385	
修繕費	30,844	
賞与引当金繰入額	724,368	
役員退職慰労引当金繰入額	27,285	
機器リース料	76	
事務委託費	137,814	
事務用消耗品費	33,473	
器具備品費	14,115	
諸経費	84,703	
	一般管理費計	4,490,538
営業利益		4,508,315

(単位:千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	8,323	
受取利息	1,015	
雑収入	5,491	
営業外収益計		14,830
営業外費用		
為替差損	3,664	
金銭の信託運用損	166,406	
営業外費用計		170,070
経常利益		4,353,076
特別損失		
固定資産除却損	182	
固定資産売却損	2,654	
ゴルフ会員権評価損	3,806	
特別損失計		6,642
税引前中間純利益		4,346,433
法人税、住民税及び事業税		1,434,006
法人税等調整額		14,388
法人税等合計		1,448,394
中間純利益		2,898,038

(3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
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	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

	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	252,905	30,099,168
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	26,178	26,178
当中間期変動額 合計	26,178	327,860
当中間期末残高	226,727	30,427,029

重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27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：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。

追加情報

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
<p>当社は、平成27年9月30日開催の取締役会の決議に基づき、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」)の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」)、及び新光投信株式会社(以下「新光投信」)の機能統合に向けた具体的な準備を開始すべく、同日付で当社、TB、MHAM及び新光投信の間で「統合基本合意書」を締結いたしました。今後、統合に必要な各社の取締役会決議及び株主総会決議、国内外の関係当局への届出、許認可の取得等を前提として、平成28年度上期中の統合を予定しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 40%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 60%; text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27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27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,613,571	10,613,571	-
(2) 金銭の信託	14,000,363	14,000,363	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	493,805	493,805	-
資産計	25,107,739	25,107,739	-
(1) 未払法人税等	1,486,583	1,486,583	-
負債計	1,486,583	1,486,583	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,316,596
差入保証金	771,427

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、時価開示の対象としておりません。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃貸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31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）			
1．満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2．子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,316,596千円）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	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
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	493,805	159,101	334,703
（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31期中間会計期間末 （平成27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31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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	15,465,477	4,206,088	383,893	20,055,459

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,267,792円	89銭
1株当たり中間純利益金額	120,751円	62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31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
中間純利益	2,898,038千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,898,038千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第31期中間会計期間
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、平成27年9月25日開催の取締役会において、子会社であるDIAM International Ltdの増資引受を決議いたしました。

1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成27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。

(注) 資本金の額は平成27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27年6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27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27年11月25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

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式パッシブ・ファンドの平成26年10月15日から平成27年10月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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27年10月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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27年11月25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27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。