

DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>

追加型投信／国内／株式（インデックス型）

DIAMアセットマネジメント

本書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。
当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

委託会社への照会先

【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）

【ホームページ】 <http://www.diam.co.jp/>

「D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >」の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により、有価証券届出書を2012年5月7日に関東財務局長に提出しており、2012年5月8日にその効力が発生しております。

「D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >」の受益権の価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動きのほか、為替変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家の皆様に帰属します。したがって、当ファンドは、**元本が保証されているものではありません。**

この投資信託は、実質的に国内の株式を主要投資対象とします。この投資信託の基準価額は、組入る有価証券の値動き、為替相場の変動等の影響により上下しますので、これにより、**投資元本を割り込むことがあります。**

また、組入れた株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、**投資元本を割り込むことがあります。**

発行者：D I A Mアセットマネジメント株式会社

代表者の役職氏名：代表取締役社長 中島 敬雄

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所：該当事項はありません。

届出の対象とした募集

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国内株式インデックスファンド
< D C 年金 >

募集内国投資信託受益証券の金額：1兆円を上限とします。

目 次		頁
第一部	証券情報	1
第二部	ファンド情報	4
第 1	ファンドの状況	4
1	ファンドの性格	4
2	投資方針	9
3	投資リスク	17
4	手数料等及び税金	19
5	運用状況	21
第 2	管理及び運営	28
1	申込（販売）手続等	28
2	換金（解約）手続等	29
3	資産管理等の概要	30
4	受益者の権利等	33
第 3	ファンドの経理状況	34
1	財務諸表	37
2	ファンドの現況	87
第 4	内国投資信託受益証券事務の概要	88
第三部	委託会社等の情報	89
第 1	委託会社等の概況	89
1	委託会社等の概況	89
2	事業の内容及び営業の概況	91
3	委託会社等の経理状況	92
4	利害関係人との取引制限	135
5	その他	135
	約款	136
	用語説明	148

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>
(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当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）

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位となります。

(7)【申込期間】

継続申込期間：平成24年5月8日から平成25年5月7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

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、各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

(10)【払込取扱場所】

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

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

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動いぞく投資）専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが

完了したものを当日のお申込みとします。

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

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当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、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、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、

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

当ファンドは契約型の追加型株式投資信託に属します。

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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

<ファンドの特色>

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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の指数値および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」という。）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および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の指数値およ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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよ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。

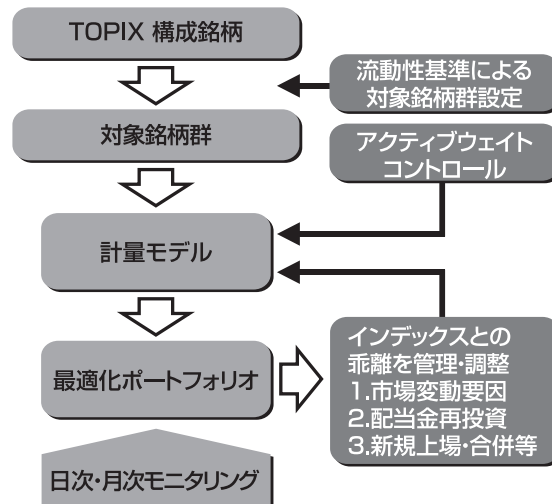
株東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、当社又は国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよ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)東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよ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** 株式(株価指数先物取引を含みます。)の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

分配方針

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

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

補足分類

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

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

・投資信託協会への照会

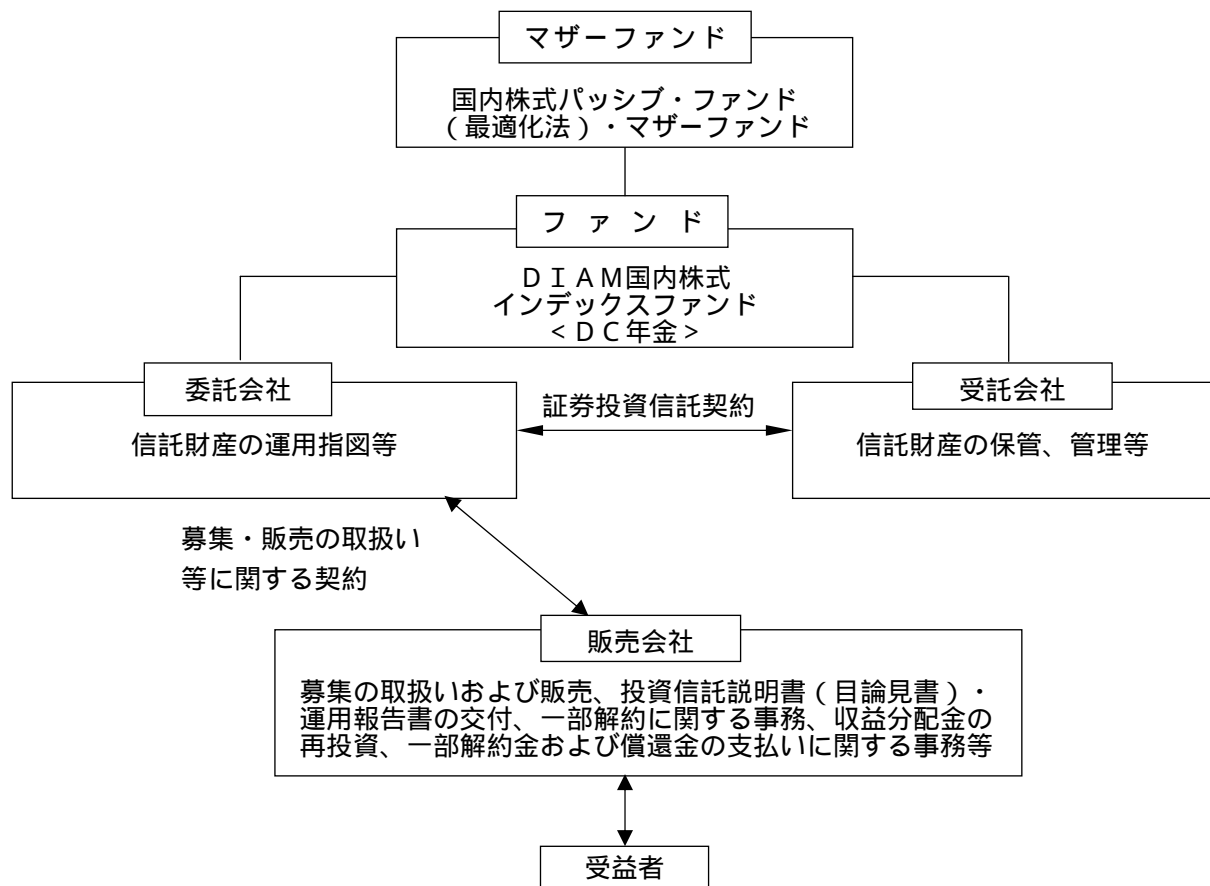
ホームページ URL <http://www.toushin.or.jp/>

(2) 【ファンドの沿革】

平成14年11月15日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

平成17年10月 1日 信託報酬率の変更

(3) 【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

・「証券投資信託契約」の概要

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

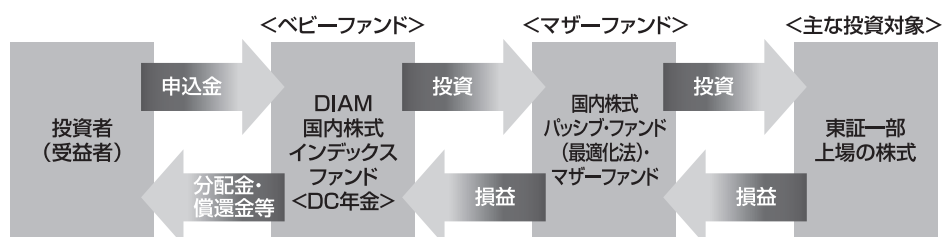
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成24年2月29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「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

(平成24年2月29日現在)

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

<投資態度>

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 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。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 有価証券等の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかるオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

1.投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

- a. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます、以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条に定めるものに限ります。)
 - ハ．金銭債権

二．約束手形

b．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第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
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 外国貸付債権信託受益権（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 13) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 14) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 16) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 17) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1)の証券または証書、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに11)および14)の証券または証書のうち2)から6)までの性質を有するものを以下「公社債」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

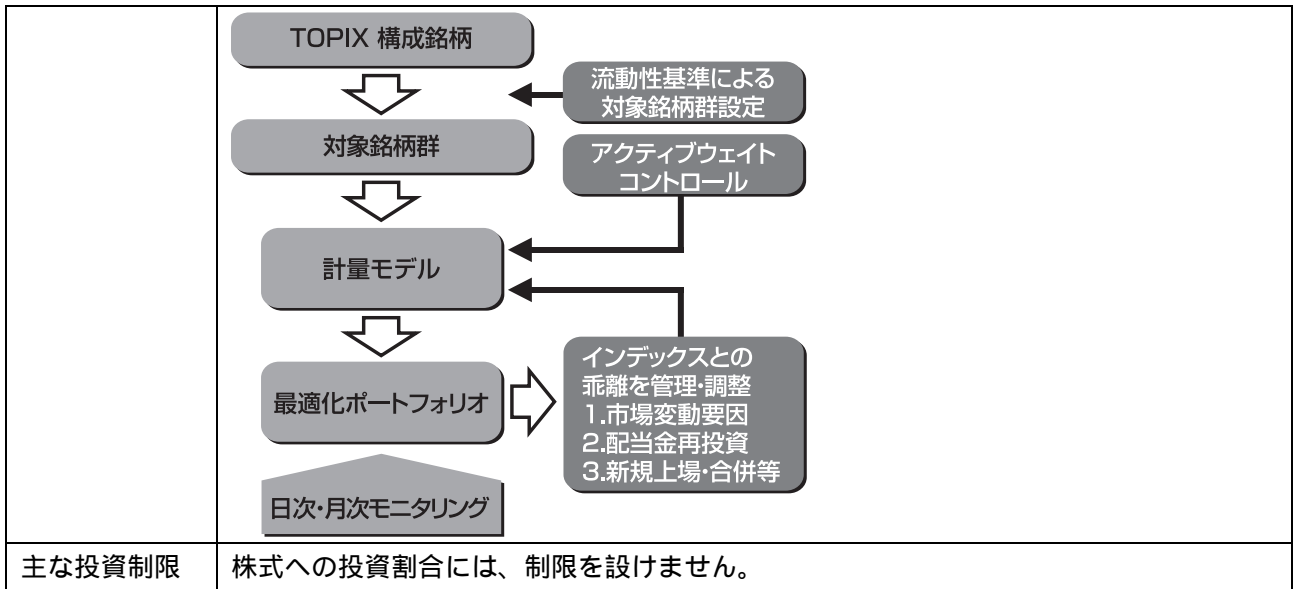
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

4.上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

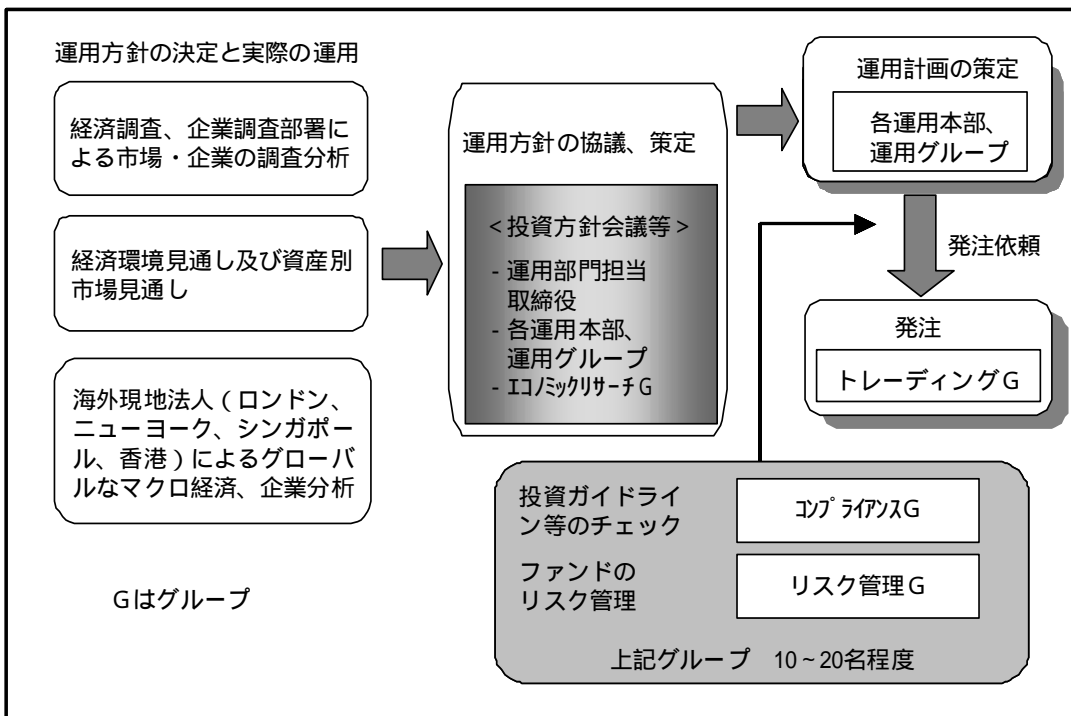
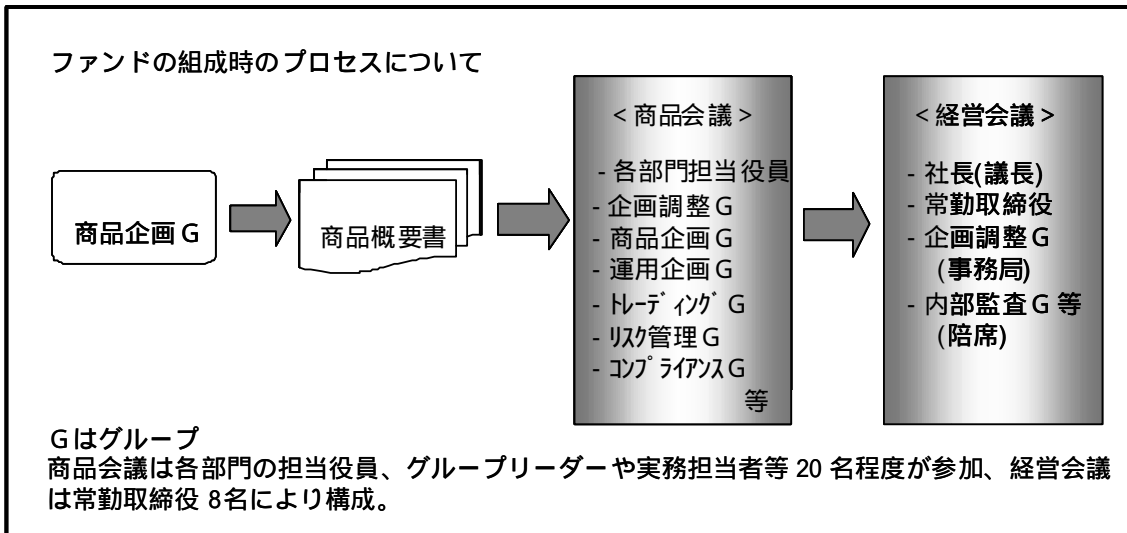
(参考)当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<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、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 6. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> 1. 流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2. 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3. インデックスとの乖離を管理 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。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

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

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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

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

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

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

ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

上記体制は平成24年2月29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2月7日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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) 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかか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、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

2) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

3) マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

4) 投資する株式等の範囲(約款第18条)

委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所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、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

5) 信用取引の指図範囲(約款第19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.~5.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~5.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券

2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券

4. 売り出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め

「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

6) 先物取引等の運用指図・目的(約款第20条)

- (a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に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) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第22条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b) 上記(a)の1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

9) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第24条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

10) 外貨為替予約の指図(約款第25条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

11) 資金の借入れ(約款第33条)

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

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

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

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

3【投資リスク】

(1)基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き等による影響を受けますが、これらの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、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

株価変動リスク

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

信用リスク

株式や短期金融商品等の発行者が経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想される場合、当該株式等の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

(2)分配金に関する留意点

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

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

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

(3)その他の留意点

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

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。当該インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流

出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。

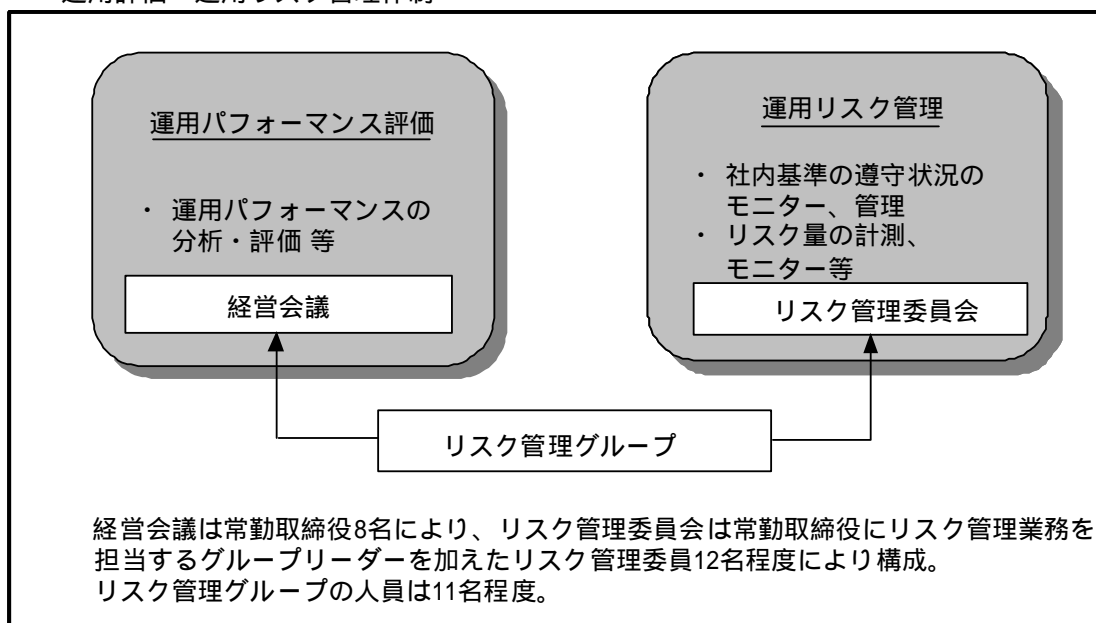
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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

注意事項

- イ.当ファンドは、実質的に株式など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を行い、適宜見直しを行います。

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

上記体制は平成24年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

時期	項目	費用		
		総額	信託財産の純資産総額に対して 年率0.231%（税抜0.22%）	
毎日	信託報酬	配分	委託会社	年率0.084%（税抜0.08%）
			販売会社	年率0.1155%（税抜0.11%）
			受託会社	年率0.0315%（税抜0.03%）

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。また、信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中より支弁します。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

イ.信託財産留保額

ありません。

ロ.その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立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、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・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ならびに外貨建資産の保管等に関する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・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ならびに外貨建資産の保管等に関する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

確定拠出年金の加入者におかれましては、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
なお、上記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

個人の受益者に対する課税

時 期	項 目	税 金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して10%
換金（解約）時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して10%

税金は表に記載の時期に適用されます。

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

上記は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは10.147%の税率となります。また、平成26年1月1日以降は20.315%の税率となる予定です。

法人の受益者に対する課税

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

上記7%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））となります。

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

益金不算入制度、配当控除の適用

益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

上記は、平成24年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本

の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	38,635,597,232	100.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,249,929	0.01
合 計（純資産総額）		38,630,347,303	100.00

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

（参考）マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	263,886,178,002	98.86
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,053,384,563	1.14
合 計（純資産総額）		266,939,562,565	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	34,632,123,729	10,317.93	35,733,193,470	11,156.00	38,635,597,232	100.01

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は1銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は券面総額	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3,000,900	2,986.00	8,960,687,400	3,355.00	10,068,019,500	3.77
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	17,290,500	380.00	6,570,390,000	420.00	7,262,010,000	2.72
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1,952,500	2,764.00	5,396,710,000	3,095.00	6,042,987,500	2.26
4	キヤノン	株式	日本	電気機器	1,437,500	3,395.00	4,880,312,500	3,680.00	5,290,000,000	1.98
5	三井住友フ	株式	日本	銀行業	1,727,300	2,542.00	4,390,796,600	2,757.00	4,762,166,100	1.78

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
	イナンシャルG									
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1,051,700	3,785.00	3,980,684,500	3,835.00	4,033,269,500	1.51
7	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	29,344,900	121.00	3,550,732,900	136.00	3,990,906,400	1.50
8	ファナック	株式	日本	電気機器	240,900	12,960.00	3,122,064,000	14,730.00	3,548,457,000	1.33
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	907,900	3,340.00	3,032,386,000	3,670.00	3,331,993,000	1.25
10	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,663,500	1,794.00	2,984,319,000	1,991.00	3,312,028,500	1.24
11	三井物産	株式	日本	卸売業	1,971,700	1,321.00	2,604,615,700	1,399.00	2,758,408,300	1.03
12	小松製作所	株式	日本	機械	1,130,400	2,198.00	2,484,619,200	2,422.00	2,737,828,800	1.03
13	エヌ・ティ・イー・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・通信業	18,819	137,300.00	2,583,848,700	138,800.00	2,612,077,200	0.98
14	ソニー	株式	日本	電気機器	1,443,800	1,513.00	2,184,469,400	1,737.00	2,507,880,600	0.94
15	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1,034,700	2,160.00	2,234,952,000	2,421.00	2,505,008,700	0.94
16	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	5,749	406,500.00	2,336,968,500	432,000.00	2,483,568,000	0.93
17	日立	株式	日本	電気機器	5,197,000	428.00	2,224,316,000	473.00	2,458,181,000	0.92
18	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	2,923,400	756.00	2,210,090,400	832.00	2,432,268,800	0.91
19	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,599,000	1,266.00	2,024,334,000	1,470.00	2,350,530,000	0.88
20	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	955,400	2,167.00	2,070,351,800	2,246.00	2,145,828,400	0.80
21	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	402,400	4,915.00	1,977,796,000	5,210.00	2,096,504,000	0.79
22	パナソニック	株式	日本	電気機器	2,643,800	636.00	1,681,456,800	759.00	2,006,644,200	0.75
23	東京海上HLD	株式	日本	保険業	867,100	2,013.00	1,745,472,300	2,245.00	1,946,639,500	0.73
24	信越化学	株式	日本	化学	434,700	4,150.00	1,804,005,000	4,355.00	1,893,118,500	0.71
25	野村ホールディングス	株式	日本	証券、商品先物取引業	4,943,800	311.00	1,537,521,800	375.00	1,853,925,000	0.69
26	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3,545	479,500.00	1,699,827,500	516,000.00	1,829,220,000	0.69
27	国際石油開発	株式	日本	鉱業	3,152	505,000.00	1,591,760,000	577,000.00	1,818,704,000	0.68

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
	発帝石									
28	アステラス 製薬	株式	日本	医薬品	538,100	3,205.00	1,724,610,500	3,340.00	1,797,254,000	0.67
29	東 芝	株式	日本	電気機 器	4,872,000	319.00	1,554,168,000	356.00	1,734,432,000	0.65
30	三菱電機	株式	日本	電気機 器	2,314,000	670.00	1,550,380,000	729.00	1,686,906,000	0.63

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

種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	電気機器	13.50
	輸送用機器	10.42
	銀行業	9.74
	情報・通信業	6.03
	化学	5.81
	卸売業	5.63
	機械	5.14
	医薬品	4.67
	小売業	3.98
	陸運業	3.81
	食料品	3.43
	電気・ガス業	3.00
	不動産業	2.46
	保険業	2.42
	建設業	2.34
	鉄鋼	1.94
	サービス業	1.83
	その他製品	1.58
	精密機器	1.39
	証券、商品先物取引業	1.23
	非鉄金属	1.21
	ガラス・土石製品	1.13
	繊維製品	0.89
	石油・石炭製品	0.84
	その他金融業	0.79
	鉱業	0.77
	ゴム製品	0.77
	金属製品	0.69
	海運業	0.42
	パルプ・紙	0.37
空運業	0.29	
倉庫・運輸関連業	0.23	

平成24年2月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
	水産・農林業	0.10
合計		98.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成24年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額 (円)	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末 (平成16年2月9日現在)	425	425	1.2564	1.2564
第2期末 (平成17年2月7日現在)	4,179	4,179	1.4271	1.4271
第3期末 (平成18年2月7日現在)	24,604	24,604	2.1436	2.1436
第4期末 (平成19年2月7日現在)	32,044	32,044	2.1853	2.1853
第5期末 (平成20年2月7日現在)	30,110	30,110	1.6674	1.6674
第6期末 (平成21年2月9日現在)	22,737	22,737	1.0115	1.0115
第7期末 (平成22年2月8日現在)	31,206	31,206	1.1660	1.1660
第8期末 (平成23年2月7日現在)	38,104	38,104	1.2631	1.2631
第9期末 (平成24年2月7日現在)	35,526	35,526	1.0602	1.0602
平成23年2月末	38,157		1.2780	
3月末	35,895		1.1798	
4月末	35,236		1.1563	
5月末	35,155		1.1380	
6月末	36,069		1.1535	
7月末	35,789		1.1427	
8月末	33,518		1.0469	
9月末	33,770		1.0438	
10月末	34,027		1.0471	
11月末	32,826		0.9986	
12月末	33,372		0.9999	
平成24年1月末	34,765		1.0364	
2月末	38,630		1.1470	

【分配の推移】

	1口当たりの分配額(円)
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-
第5期	-
第6期	-
第7期	-
第8期	-
第9期	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	25.64
第2期	13.59
第3期	50.21
第4期	1.95
第5期	23.70
第6期	39.34
第7期	15.27
第8期	8.33
第9期	16.06

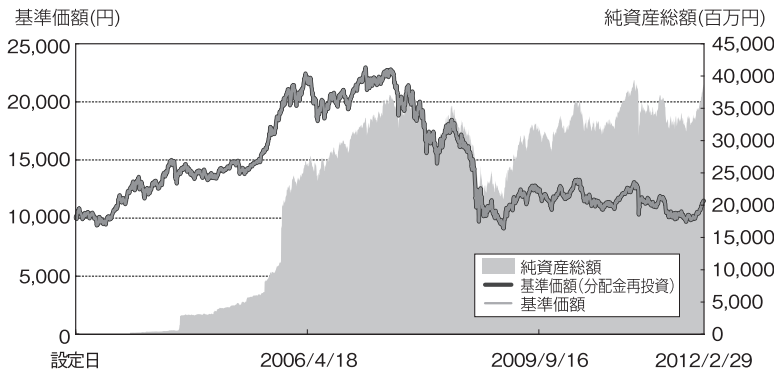
(注)収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

<< 参考情報 >>

データの基準日:2012年2月29日

基準価額・純資産の推移

〈設定日(2002年11月15日)~2012年2月29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:2002年11月15日)
※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第5期	(2008.02.07)	0円
第6期	(2009.02.09)	0円
第7期	(2010.02.08)	0円
第8期	(2011.02.07)	0円
第9期	(2012.02.07)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

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

■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。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	日本	98.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.14
合計(純資産総額)		100.00

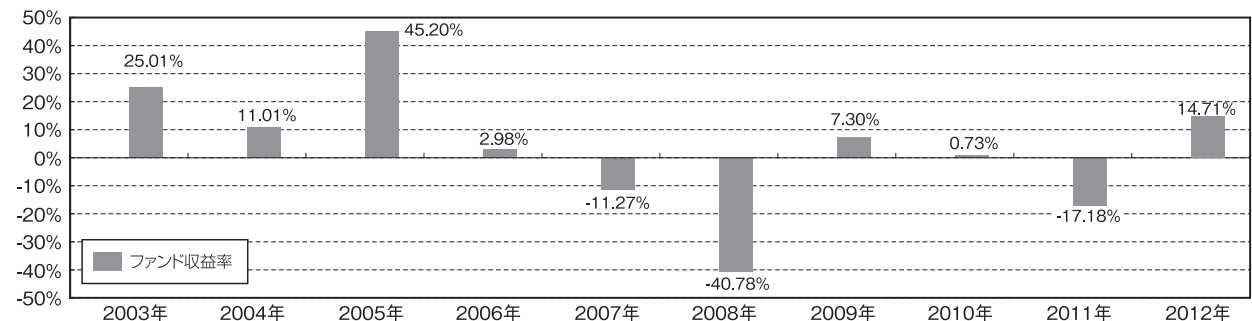
組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.77
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.72
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.26
4	キヤノン	株式	日本	電気機器	1.98
5	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.78
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.51
7	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.50
8	ファナック	株式	日本	電気機器	1.33
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	1.25
10	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.24

組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	電気機器	13.50
2	輸送用機器	10.42
3	銀行業	9.74
4	情報・通信業	6.03
5	化学	5.81

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、2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(4) 【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	342,319,925	3,838,586
第2期	2,786,767,317	196,338,675
第3期	10,152,833,879	1,603,466,761
第4期	7,400,148,798	4,214,916,172
第5期	8,779,618,539	5,384,513,066
第6期	8,569,368,552	4,148,881,796
第7期	8,901,159,838	4,615,887,504
第8期	7,387,878,523	3,984,381,861
第9期	8,287,509,892	4,947,169,536

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

- ・当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく）専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定

した旨の通知を行います。

お申込価額（発行価格）

- ・お申込日の基準価額 とします。

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）

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位とします。

お申込手数料

ありません。

払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の実行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けたものとし、

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

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

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。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ：URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

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

(3) 【信託期間】

信託期間は平成14年11月15日から原則として無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には、信託を終了する場合があります。

(4) 【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。
- b. 上記 a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、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け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 委託会社は上記 a.b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記 a.b.につき、上記 c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記 c. ~ e.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記 c.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 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。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更 d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続し

ます。

- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。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。
- j. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.~e.の規定にしたがいます。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。
- h. 上記b.に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ.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。

ニ.公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ．運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（毎年2月7日。休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資される性質を有します。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します。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に、原則として償還日（償還日が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。

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

なお、解約の請求を受益者がするとき、振替受益権をもって行うものとします。受益証券をお手許で保有されている方は、解約のお申込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

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)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(平成22年2月9日から平成23年2月7日まで)及び第9期計算期間(平成23年2月8日から平成24年2月7日まで)の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

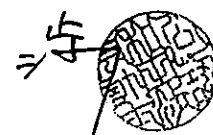
平成23年3月16日

DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人
指定社員 公認会計士
業務執行社員



指定社員 公認会計士
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DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成22年2月9日から平成23年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成23年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

DIAM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

独立監査人の監査報告書

平成24年3月14日

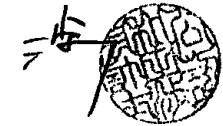
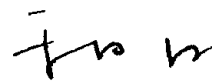
DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員



指定社員 公認会計士
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DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成23年2月8日から平成24年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成24年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

DIAM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

1 【財務諸表】

【D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 平成23年2月7日現在	第9期 平成24年2月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	100,648,787	78,742,376
親投資信託受益証券	38,104,775,192	35,526,815,717
未収入金	19,394,000	8,200,000
流動資産合計	38,224,817,979	35,613,758,093
資産合計	38,224,817,979	35,613,758,093
負債の部		
流動負債		
未払解約金	79,831,103	47,577,980
未払受託者報酬	5,361,486	5,240,076
未払委託者報酬	33,956,328	33,187,340
その他未払費用	893,498	829,597
流動負債合計	120,042,415	86,834,993
負債合計	120,042,415	86,834,993
純資産の部		
元本等		
元本	30,167,870,950	33,508,211,306
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,936,904,614	2,018,711,794
(分配準備積立金)	1,906,331,272	1,626,012,341
元本等合計	38,104,775,564	35,526,923,100
純資産合計	38,104,775,564	35,526,923,100
負債純資産合計	38,224,817,979	35,613,758,093

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	平成22年2月9日 至 平成23年2月7日	自	平成23年2月8日 至 平成24年2月7日
営業収益				
受取利息		39,315		43,730
有価証券売買等損益		2,985,785,674		△6,046,763,475
営業収益合計		2,985,824,989		△6,046,719,745
営業費用				
受託者報酬		10,599,296		10,838,745
委託者報酬		67,129,456		68,645,812
その他費用		1,766,396		1,715,965
営業費用合計		79,495,148		81,200,522
営業利益又は営業損失(△)		2,906,329,841		△6,127,920,267
経常利益又は経常損失(△)		2,906,329,841		△6,127,920,267
当期純利益又は当期純損失(△)		2,906,329,841		△6,127,920,267
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(△)		94,863,457		△670,941,485
期首剰余金又は期首欠損金(△)		4,441,729,491		7,936,904,614
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,358,646,151		777,187,034
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,358,646,151		777,187,034
剰余金減少額又は欠損金増加額		674,937,412		1,238,401,072
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		674,937,412		1,238,401,072
分配金		*1 —		*1 —
期末剰余金又は期末欠損金(△)		7,936,904,614		2,018,711,794

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第8期		第9期	
	自	平成22年2月9日 至平成23年2月7日	自	平成23年2月8日 至平成24年2月7日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券	同左
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い	当ファンドの計算期間は前計算期間末日が休業日のため、平成22年2月9日から平成23年2月7日までとなっております。		

(追加情報)

第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	第 9 期 自平成23年2月8日 至平成24年2月7日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日)を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 8 期 平成23年2月7日現在	第 9 期 平成24年2月7日現在
*1 期首元本額	26,764,374,288円	30,167,870,950円
期中追加設定元本額	7,387,878,523円	8,287,509,892円
期中解約元本額	3,984,381,861円	4,947,169,536円
*2 計算期間末日における受益権の総数	30,167,870,950口	33,508,211,306口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	第 9 期 自平成23年2月8日 至平成24年2月7日
*1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(39,036円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,644,111,555円)及び分配準備積立金(1,906,292,236円)より分配対象収益は15,550,442,827円(1万口当たり5,154.64円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(15,646,271,653円)及び分配準備積立金(1,626,012,341円)より分配対象収益は17,272,283,994円(1万口当たり5,154.64円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 8 期 自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	第 9 期 自平成23年2月8日 至平成24年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 8 期 平成23年2月7日現在	第 9 期 平成24年2月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「注記表(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

区分	第 8 期 平成23年2月7日現在	第 9 期 平成24年2月7日現在
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

	第 8 期 平成23年2月7日現在	第 9 期 平成24年2月7日現在
種 類	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	2,941,573,598	5,790,626,255
合 計	2,941,573,598	5,790,626,255

(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 8 期 平成23年2月7日現在	第 9 期 平成24年2月7日現在
1口当たり純資産額	1.2631円	1.0602円
(1万口当たり純資産額)	(12,631円)	(10,602円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年2月7日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適 化法)・マザーファンド	34,455,257,218	35,526,815,717	
合 計		34,455,257,218	35,526,815,717	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,327,746,026	3,363,963,411
株式	*2	273,563,558,237	253,387,727,604
派生商品評価勘定		73,279,820	145,965,712
未収入金		1,267,049	15,027,336
未収配当金		248,961,162	274,105,417
流動資産合計		278,214,812,294	257,186,789,480
資産合計		278,214,812,294	257,186,789,480
負債の部			
流動負債			
前受金		45,931,000	130,996,000
未払解約金		68,903,000	81,267,000
流動負債合計		114,834,000	212,263,000
負債合計		114,834,000	212,263,000
純資産の部			
元本等			
元本		226,920,593,309	249,229,464,222
剰余金			
剰余金又は欠損金()		51,179,384,985	7,745,062,258
元本等合計		278,099,978,294	256,974,526,480
純資産合計		278,099,978,294	256,974,526,480
負債純資産合計		278,214,812,294	257,186,789,480

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	自平成23年2月8日 至平成24年2月7日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 等における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準ず る価額）、又は金融商品取引業者 等から提示される気配相場に基づ いて評価しております。	株式 同左
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。	先物取引 同左
3.その他財務諸表作成のための基 本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は前計 算期間末日が休業日のため、平成 22年2月9日から平成23年2月7日ま でとなっております。	

(追加情報)

自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	自平成23年2月8日 至平成24年2月7日
当計算期間より、「金融商品に關 する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の 時価等の開示に関する適用指針」(企 業会計基準適用指針第19号 平成20 年3月10日)を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	232,901,625,288円	226,920,593,309円
同期中追加設定元本額	41,108,058,720円	66,279,901,769円
同期中解約元本額	47,089,090,699円	43,971,030,856円
同期末における元本の内訳		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	1,632,201,799円	2,738,588,899円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,051,730,628円	1,043,633,268円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	31,093,247,811円	34,455,257,218円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	712,139,658円	925,425,479円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,753,718,902円	3,401,440,637円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,879,900,485円	3,422,156,802円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	439,327,114円	508,920,813円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,346,266,486円	1,541,596,037円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,026,991,340円	1,163,271,959円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	146,626,731円	131,173,730円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,333,348,096円	1,458,141,145円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,726,090円	20,123,737円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	254,234,637円	273,143,125円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	10,258,858,383円	10,848,726,918円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,749,020,252円	1,784,889,063円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	201,395,341円	214,619,558円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	768,230,703円	826,819,576円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	218,275,389円	224,839,985円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	287,503,938円	298,371,564円

区分	平成23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	19,218,353,105円	20,621,073,216円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	6,403,299,958円	6,818,227,913円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,985,484,853円	5,342,574,432円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	3,364,210,374円	3,489,438,622円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	7,923,905,765円	8,054,144,562円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	1,197,644,228円	1,252,097,402円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	2,518,998,194円	2,722,971,152円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,563,374,021円	2,770,463,631円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	13,799,025,986円	15,530,537,665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)	204,230,422円	246,895,382円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド (適格機関投資家向け)	291,738,856円	円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	4,705,490,295円	5,071,285,516円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	8,713,351,160円	9,604,697,727円
D I A Mグローバル分散ファンドVA (適格機関投資家限定)	443,102,609円	488,514,372円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	39,457,105,770円	43,300,098,584円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,681,236,251円	2,817,633,611円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,783,662,672円	5,342,331,400円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	23,902,624,473円	26,387,900,604円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	272,794,912円	305,023,572円

区分	平成23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
D I A M バランス 5 0 V A (適格機関投資家限定)	91,930円	105,664円
D I A M バランス 7 0 V A (適格機関投資家限定)	144,867円	162,492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)	20,842,866,754円	23,137,555,872円
D I A M 世界バランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	199,881,436円	312,273,959円
D I A M 国内バランス 3 0 V A (適格機関投資家限定)	76,294,306円	98,972,357円
D I A M バランス 2 0 V A (適格機関投資家限定)	206,717,719円	233,095,763円
D I A M バランス 4 0 V A (適格機関投資家限定)	86,168円	99,142円
D I A M バランス 6 0 V A (適格機関投資家限定)	132,442円	150,097円
(合 計)	226,920,593,309円	249,229,464,222円
*2 差入代用有価証券	株式 1,745,000,000円	株式 1,493,000,000円
*3 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	226,920,593,309口	249,229,464,222口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	自平成23年2月8日 至平成24年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リス	同左

区分	自平成22年2月9日 至平成23年2月7日	自平成23年2月8日 至平成24年2月7日
	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。	
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

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)株式 「注記表（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)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。	(1)株式 同左 (2)派生商品評価勘定 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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	同左

区分	平成23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
	<p>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。</p>	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
種 類	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	18,328,050,286	47,367,839,954
合計	18,328,050,286	47,367,839,954

(デリバティブ取引等に関する注記)

(株式関連)

平成23年2月7日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	4,417,219,000	-	4,490,810,000	73,279,820
合 計		4,417,219,000	-	4,490,810,000	73,279,820

平成24年2月7日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	3,343,208,000	-	3,489,440,000	145,965,712
合 計		3,343,208,000	-	3,489,440,000	145,965,712

(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23年2月7日現在	平成24年2月7日現在
1口当たり純資産額	1.2255円	1.0311円
(1万口当たり純資産額)	(12,255円)	(10,311円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極 洋	110,000	187	20,570,000	
日本水産	311,300	277	86,230,100	
マルハニチロホールディングス	535,000	144	77,040,000	
ハウスイ	23,000	119	2,737,000	
サカタのタネ	40,200	1,080	43,416,000	
ホクト	27,600	1,647	45,457,200	
ショーボンドHD	24,000	1,951	46,824,000	
ミライト・ホールディングス	77,000	612	47,124,000	
住石ホールディングス	79,400	99	7,860,600	
日鉄鉱業	69,000	377	26,013,000	
三井松島	175,000	167	29,225,000	
国際石油開発帝石	3,274	505,000	1,653,370,000	
日本海洋掘削	6,700	2,660	17,822,000	
関東天然瓦斯	28,000	423	11,844,000	
石油資源開発	38,400	3,365	129,216,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	163,300	3,592,600	
間組	103,100	248	25,568,800	
東急建設	95,320	231	22,018,920	
コムシスホールディングス	131,400	838	110,113,200	
ミサワホーム	26,000	666	17,316,000	
高松コンストラクショングP	20,500	1,263	25,891,500	
東建コーポレーション	10,060	2,810	28,268,600	
ヤマウラ	8,500	235	1,997,500	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
大成建設	1,363,000	218	297,134,000	
大林組	808,000	371	299,768,000	
清水建設	825,000	349	287,925,000	
飛島建設	165,000	127	20,955,000	
長谷工コーポレーション	1,681,500	58	97,527,000	
松井建設	2,000	312	624,000	
鹿島建設	1,263,000	264	333,432,000	
不動テトラ	190,900	172	32,834,800	
大末建設	93,000	79	7,347,000	
鉄建建設	153,000	126	19,278,000	
安藤建設	91,000	147	13,377,000	
太平工業	47,000	432	20,304,000	
西松建設	353,000	189	66,717,000	
三井住友建設	168,500	116	19,546,000	
大豊建設	80,000	142	11,360,000	
前田建設	167,000	332	55,444,000	
佐田建設	93,000	90	8,370,000	
ナカノフドー建設	20,500	211	4,325,500	
奥村組	257,000	335	86,095,000	
大和小田急建設	14,000	215	3,010,000	
東鉄工業	35,000	817	28,595,000	
イチケン	31,000	155	4,805,000	
浅沼組	86,000	85	7,310,000	
戸田建設	290,000	312	90,480,000	
熊谷組	201,000	99	19,899,000	
青木あすなる建設	19,000	446	8,474,000	
北野建設	61,000	186	11,346,000	
植木組	34,000	209	7,106,000	
三井ホーム	35,000	406	14,210,000	
矢作建設	33,600	385	12,936,000	
ピーエス三菱	17,700	482	8,531,400	
大東建託	102,300	6,760	691,548,000	
新日本建設	32,200	241	7,760,200	
NIPPO	63,000	852	53,676,000	
東亜道路	52,000	233	12,116,000	
前田道路	78,000	942	73,476,000	
日本道路	81,000	347	28,107,000	
東亜建設	237,000	174	41,238,000	
若築建設	146,000	120	17,520,000	
東洋建設	406,000	91	36,946,000	
五洋建設	342,000	281	96,102,000	
大林道路	34,000	265	9,010,000	
世紀東急	81,000	82	6,642,000	
福田組	41,000	292	11,972,000	
住友林業	185,600	682	126,579,200	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本基礎技術	31,000	347	10,757,000	
日成ビルド工業	79,000	199	15,721,000	
エス・バイ・エル	137,000	171	23,427,000	
巴コーポレーション	35,400	319	11,292,600	
パナホーム	101,000	535	54,035,000	
大和ハウス	672,000	974	654,528,000	
ライト工業	57,000	513	29,241,000	
積水ハウス	758,000	719	545,002,000	
日特建設	66,000	124	8,184,000	
北陸電気工事	15,000	237	3,555,000	
ユアテック	37,000	433	16,021,000	
西部電気工業	1,000	353	353,000	
四電工	6,000	328	1,968,000	
中電工	39,400	821	32,347,400	
関電工	124,000	425	52,700,000	
きんでん	180,000	643	115,740,000	
東京エネシス	30,000	485	14,550,000	
トーエネック	39,000	431	16,809,000	
住友電設	19,000	551	10,469,000	
日本電設工業	49,000	746	36,554,000	
協和エクシオ	88,500	735	65,047,500	
新日本空調	22,500	441	9,922,500	
日本工営	85,000	289	24,565,000	
日本電話施設	47,000	250	11,750,000	
九電工	50,000	486	24,300,000	
三機工業	62,000	424	26,288,000	
日揮	251,000	2,133	535,383,000	
中外炉工業	87,000	270	23,490,000	
ヤマト	16,000	312	4,992,000	
太平電業	35,000	631	22,085,000	
高砂熱学	77,700	634	49,261,800	
三晃金属	30,000	244	7,320,000	
NEC ネットズエスアイ	22,700	1,105	25,083,500	
朝日工業社	30,000	329	9,870,000	
アタカ大機	18,000	275	4,950,000	
大気社	41,400	1,698	70,297,200	
ダイダン	25,000	541	13,525,000	
日比谷総合設	33,400	853	28,490,200	
東芝プラントシステム	44,000	892	39,248,000	
日本製粉	170,000	349	59,330,000	
日清製粉G本社	244,500	919	224,695,500	
日東富士製粉	8,000	298	2,384,000	
昭和産業	113,000	246	27,798,000	
鳥越製粉	24,500	667	16,341,500	
協同飼料	98,000	100	9,800,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
中部飼料	24,300	509	12,368,700	
日本配合飼料	83,000	118	9,794,000	
東洋精糖	43,000	99	4,257,000	
日本甜菜糖	152,000	171	25,992,000	
三井製糖	96,000	255	24,480,000	
ネクスト	9,700	331	3,210,700	
日本M & Aセンター	50	381,500	19,075,000	
ノバレーゼ	49	50,300	2,464,700	
アコーディア・ゴルフ	1,019	60,000	61,140,000	
パソナグループ	249	71,800	17,878,200	
リンクアンドモチベーション	51	39,900	2,034,900	
テンプホールディングス	34,400	756	26,006,400	
クックパッド	3,700	1,553	5,746,100	
森永製菓	267,000	182	48,594,000	
中村屋	64,000	392	25,088,000	
江崎グリコ	98,000	874	85,652,000	
名糖産業	12,500	998	12,475,000	
不二家	155,000	166	25,730,000	
山崎製パン	197,000	1,016	200,152,000	
第一屋製パン	43,000	92	3,956,000	
モロゾフ	43,000	272	11,696,000	
カルビー	14,500	3,500	50,750,000	
森永乳業	228,000	302	68,856,000	
ヤクルト	144,500	2,313	334,228,500	
明治ホールディングス	79,900	3,420	273,258,000	
雪印メグミルク	58,200	1,504	87,532,800	
プリマハム	152,000	136	20,672,000	
日本ハム	205,000	964	197,620,000	
伊藤ハム	149,000	307	45,743,000	
林兼産業	89,000	73	6,497,000	
丸大食品	130,000	293	38,090,000	
米久	23,800	743	17,683,400	
S Foods	17,500	702	12,285,000	
学情	8,900	248	2,207,200	
スタジオアリス	11,500	1,139	13,098,500	
シミックホールディングス	8,200	1,123	9,208,600	
システナ	282	53,800	15,171,600	
NECフィールディング	20,400	975	19,890,000	
新日鉄ソリューションズ	15,700	1,519	23,848,300	
総合警備保障	91,500	890	81,435,000	
日本駐車場開発	2,605	3,530	9,195,650	
コア	9,000	672	6,048,000	
カカクコム	39,000	2,158	84,162,000	
アイロムホールディングス	542	2,946	1,596,732	
ルネサンス	11,800	415	4,897,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
新日本科学	15,600	256	3,993,600	
エムスリー	197	334,500	65,896,500	
ベストプライダル	54	73,200	3,952,800	
ディー・エヌ・エー	112,500	2,293	257,962,500	
博報堂DYHLDGS	31,910	4,760	151,891,600	
ぐるなび	17,500	915	16,012,500	
一休	182	37,250	6,779,500	
ジャパンベストレスキューS	37	72,800	2,693,600	
ジェイコムホールディングス	4,300	692	2,975,600	
PGMホールディングス	350	50,300	17,605,000	
サッポロホールディングス	442,000	294	129,948,000	
アサヒグループホールディング	505,400	1,701	859,685,400	
キリンHD	1,081,000	924	998,844,000	
宝ホールディングス	228,000	493	112,404,000	
オエノンホールディングス	72,000	181	13,032,000	
養命酒	3,000	770	2,310,000	
三国コカ・コ・ラ	29,100	685	19,933,500	
コカ・コーラウエスト	91,600	1,285	117,706,000	
コカコーラセントラルジャパン	31,000	1,012	31,372,000	
ダイドードリンコ	12,600	3,110	39,186,000	
伊藤園	74,900	1,299	97,295,100	
キーコーヒー	23,900	1,466	35,037,400	
ユニカフェ	6,100	355	2,165,500	
ジャパンフーズ	4,000	806	3,224,000	
日清オイリオグループ	105,000	327	34,335,000	
不二製油	65,400	1,085	70,959,000	
J-オイルミルズ	102,000	226	23,052,000	
ローソン	74,800	4,685	350,438,000	
インターニックス	9,800	351	3,439,800	
サンエー	8,000	3,175	25,400,000	
キリン堂	10,100	558	5,635,800	
ダイユーエイト	3,600	881	3,171,600	
カワチ薬品	16,500	1,640	27,060,000	
エービーシー・マート	33,700	2,735	92,169,500	
ハードオフコーポレーション	11,400	578	6,589,200	
高千穂交易	10,100	888	8,968,800	
アスクル	18,600	1,244	23,138,400	
ゲオホールディングス	391	84,600	33,078,600	
ポイント	19,990	3,045	60,869,550	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	153	765,000	
伊藤忠食品	6,000	2,785	16,710,000	
くらコーポレーション	12,300	1,093	13,443,900	
キャンドウ	128	86,200	11,033,600	
エレマテック	19,000	1,381	26,239,000	
パル	6,900	3,260	22,494,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
JALUX	7,700	776	5,975,200	
エディオン	94,200	601	56,614,200	
サーラコーポレーション	20,500	486	9,963,000	
トーメンデバイス	3,500	1,880	6,580,000	
あみやき亭	40	196,700	7,868,000	
東京エレクトロンデバイス	48	138,500	6,648,000	
ひらまつ	100	67,700	6,770,000	
双日	1,590,400	139	221,065,600	
ゲンキー	1,700	1,736	2,951,200	
アルフレッサホールディングス	62,100	3,395	210,829,500	
ハニーズ	20,760	1,302	27,029,520	
キッコーマン	220,000	841	185,020,000	
味の素	710,000	908	644,680,000	
キューピー	137,400	1,127	154,849,800	
ハウス食品	95,900	1,403	134,547,700	
カゴメ	104,600	1,535	160,561,000	
焼津水産化工	13,500	730	9,855,000	
アリアケジャパン	24,700	1,525	37,667,500	
ニチレイ	303,000	373	113,019,000	
横浜冷凍	56,000	605	33,880,000	
東洋水産	116,000	1,915	222,140,000	
日清食品HD	105,300	2,903	305,685,900	
永谷園	7,000	886	6,202,000	
フジッコ	30,000	996	29,880,000	
ロックフィールド	13,600	1,322	17,979,200	
日本たばこ産業	5,970	406,500	2,426,805,000	
わらべや日洋	15,200	1,066	16,203,200	
なとり	13,500	865	11,677,500	
片倉工業	31,600	706	22,309,600	
グンゼ	188,000	238	44,744,000	
昭栄	43,300	344	14,895,200	
神栄	27,000	150	4,050,000	
山下医科器械	2,200	950	2,090,000	
ラサ商事	11,500	376	4,324,000	
アルペン	18,100	1,425	25,792,500	
アルコニックス	6,200	1,783	11,054,600	
ビックカメラ	895	44,450	39,782,750	
DCMホールディングス	122,500	583	71,417,500	
MonotaRO	13,400	1,009	13,520,600	
あいホールディングス	42,100	331	13,935,100	
J.フロントリテイリング	560,000	372	208,320,000	
ドトール・日レスHD	37,900	1,068	40,477,200	
マツモトキヨシHLDGS	43,900	1,617	70,986,300	
物語コーポレーション	2,500	1,288	3,220,000	
ココカラファイン	24,700	2,036	50,289,200	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
三越伊勢丹HD	471,200	868	409,001,600	
東洋紡績	1,064,000	110	117,040,000	
ユニチカ	554,000	46	25,484,000	
富士紡ホールディングス	110,000	169	18,590,000	
日清紡ホールディングス	160,000	708	113,280,000	
倉敷紡績	259,000	154	39,886,000	
ダイワボウHD	229,000	187	42,823,000	
シキボウ	162,000	115	18,630,000	
日東紡績	185,000	250	46,250,000	
トヨタ紡織	83,900	844	70,811,600	
クリエイトSDH	10,000	1,755	17,550,000	
バイタルKSKHD	44,700	658	29,412,600	
八洲電機	15,600	350	5,460,000	
UKCホールディングス	13,900	808	11,231,200	
丸善CHIHD	6,700	205	1,373,500	
TOKAIホールディングス	115,900	386	44,737,400	
日本毛織	86,000	575	49,450,000	
大東紡織	38,000	69	2,622,000	
トーア紡コーポレーション	106,000	58	6,148,000	
ダイドーリミテッド	31,300	677	21,190,100	
東京建物不動産販	9,200	219	2,014,800	
野村不動産HLDGS	113,600	1,257	142,795,200	
常和ホールディングス	4,400	1,375	6,050,000	
ヒューリック	76,900	970	74,593,000	
帝国繊維	23,000	486	11,178,000	
ブックオフコーポレーション	14,100	719	10,137,900	
日本コークス工業	202,000	114	23,028,000	
ミタチ産業	3,800	364	1,383,200	
JFE商事HLDGS	159,000	340	54,060,000	
あさひ	13,700	1,542	21,125,400	
サークルKサンクス	51,500	1,312	67,568,000	
日本調剤	2,990	2,539	7,591,610	
コスモス薬品	10,400	3,550	36,920,000	
シップヘルスケアHD	30,800	1,723	53,068,400	
ソフトクリエイト	2,600	1,114	2,896,400	
セブン&アイ・HLDGS	992,100	2,167	2,149,880,700	
ツルハホールディングス	19,500	4,115	80,242,500	
サンマルクホールディングス	6,800	2,994	20,359,200	
フェリシモ	6,600	1,078	7,114,800	
トリドール	20,400	838	17,095,200	
クスリのアオキ	3,400	1,537	5,225,800	
帝人	1,028,000	245	251,860,000	
東レ	1,826,000	586	1,070,036,000	
クラレ	400,100	1,089	435,708,900	
旭化成	1,465,000	479	701,735,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
サカイ オーベックス	70,000	129	9,030,000	
稲葉製作所	12,400	913	11,321,200	
宮地エンジニアリングG	81,000	201	16,281,000	
三協・立山HLDGS	340,000	145	49,300,000	
トーカロ	14,100	1,688	23,800,800	
アルファCO	8,500	959	8,151,500	
SUMCO	153,700	716	110,049,200	
川田テクノロジーズ	5,900	1,269	7,487,100	
住江織物	69,000	153	10,557,000	
日本フェルト	15,000	399	5,985,000	
イチカワ	14,000	164	2,296,000	
日本バイリン	32,000	339	10,848,000	
エコナックホールディングス	73,000	34	2,482,000	
日東製網	31,000	171	5,301,000	
芦森工業	61,000	122	7,442,000	
アツギ	196,000	98	19,208,000	
ダイニック	47,000	147	6,909,000	
共和レザー	13,400	288	3,859,200	
セーレン	62,700	461	28,904,700	
東海染工	35,000	90	3,150,000	
小松精練	39,000	390	15,210,000	
ワコールホールディングス	150,000	989	148,350,000	
ホギメディカル	15,900	3,280	52,152,000	
レナウン	54,100	147	7,952,700	
クラウディア	3,000	1,065	3,195,000	
TSIホールディングス	112,300	419	47,053,700	
デジタルハーツ	19	142,900	2,715,100	
ITホールディングス	71,900	944	67,873,600	
グリー	121,300	2,611	316,714,300	
コーエーテクモHD	47,000	606	28,482,000	
三菱総合研究所	9,200	1,426	13,119,200	
ボルテージ	2,100	1,200	2,520,000	
ネクソン	119,200	1,145	136,484,000	
特種東海製紙	158,000	179	28,282,000	
ドワンゴ	118	144,500	17,051,000	
ベリサーブ	13	134,000	1,742,000	
マクロミル	23,000	759	17,457,000	
ティーガイア	152	144,200	21,918,400	
GMOペイメントゲートウェイ	51	322,000	16,422,000	
ザッパラス	130	85,400	11,102,000	
インターネットイニシアティブ	139	262,400	36,473,600	
ソネットエンタテインメント	133	314,500	41,828,500	
SRAホールディングス	12,400	830	10,292,000	
JBSホールディングス	24,500	308	7,546,000	
朝日ネット	20,000	357	7,140,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
王子製紙	1,112,000	371	412,552,000	
三菱製紙	362,000	75	27,150,000	
北越紀州製紙	156,500	518	81,067,000	
中越パルプ	98,000	158	15,484,000	
巴川製紙	43,000	178	7,654,000	
大王製紙	106,000	503	53,318,000	
日本製紙G本社	121,500	1,619	196,708,500	
レンゴー	202,000	520	105,040,000	
トーモク	79,000	221	17,459,000	
ザ・パック	15,900	1,138	18,094,200	
コ・プケミカル	38,000	124	4,712,000	
昭和電工	1,564,000	167	261,188,000	
住友化学	1,730,000	310	536,300,000	
日本化成	49,000	139	6,811,000	
住友精化	47,000	341	16,027,000	
日産化学	191,500	750	143,625,000	
ラサ工業	101,000	126	12,726,000	
クレハ	163,000	406	66,178,000	
テイカ	43,000	312	13,416,000	
石原産業	422,000	95	40,090,000	
片倉チツカリン	13,000	234	3,042,000	
日本曹達	150,000	346	51,900,000	
東ソー	673,000	232	156,136,000	
トクヤマ	391,000	275	107,525,000	
セントラル硝子	241,000	352	84,832,000	
東亜合成	315,000	326	102,690,000	
ダイソー	101,000	255	25,755,000	
関東電化	56,000	304	17,024,000	
電気化学	529,000	315	166,635,000	
イビデン	157,500	1,700	267,750,000	
信越化学	451,400	4,150	1,873,310,000	
日本カ-バイド	77,000	114	8,778,000	
堺化学	78,000	298	23,244,000	
エア・ウォーター	205,000	1,019	208,895,000	
大陽日酸	331,000	525	173,775,000	
日本化学工業	102,000	140	14,280,000	
日本パ-カラijing	59,000	1,039	61,301,000	
高压ガス	38,000	468	17,784,000	
チタン工業	29,000	372	10,788,000	
四国化成	34,000	421	14,314,000	
戸田工業	33,000	707	23,331,000	
ステラケミファ	11,900	2,225	26,477,500	
保土谷化学	51,000	260	13,260,000	
日本触媒	183,000	911	166,713,000	
大日精化	91,000	355	32,305,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
カネカ	314,000	438	137,532,000	
協和発酵キリン	345,000	911	314,295,000	
三菱瓦斯化学	433,000	471	203,943,000	
三井化学	1,068,000	258	275,544,000	
J S R	229,100	1,599	366,330,900	
東京応化工業	45,200	1,758	79,461,600	
大阪有機化学	15,400	425	6,545,000	
三菱ケミカルH L D G S	1,573,500	444	698,634,000	
日本合成化学	51,000	477	24,327,000	
ダイセル	327,000	511	167,097,000	
住友ベークライト	216,000	464	100,224,000	
積水化学	524,000	654	342,696,000	
日本ゼオン	235,000	693	162,855,000	
アイカ工業	68,200	1,118	76,247,600	
宇部興産	1,055,000	232	244,760,000	
積水樹脂	36,000	778	28,008,000	
タキロン	59,000	264	15,576,000	
旭有機材	91,000	217	19,747,000	
日立化成	108,800	1,396	151,884,800	
ニチバン	22,000	263	5,786,000	
リケンテクノス	44,000	232	10,208,000	
大倉工業	61,000	240	14,640,000	
積水化成成品	65,000	282	18,330,000	
群栄化学	70,000	200	14,000,000	
タイガース ポリマー	12,300	301	3,702,300	
日本カ・リット	20,500	405	8,302,500	
日本化薬	177,000	729	129,033,000	
イーピーエス	135	159,500	21,532,500	
パナソニック電工I S	5,500	2,046	11,253,000	
フェイス	801	9,200	7,369,200	
アミューズ	7,200	1,035	7,452,000	
野村総合研究所	134,200	1,794	240,754,800	
ドリームインキュベータ	79	62,600	4,945,400	
サイバネットシステム	196	20,960	4,108,160	
T A C	13,900	207	2,877,300	
ケネディクス	2,731	11,270	30,778,370	
電通	228,400	2,510	573,284,000	
インテージ	7,000	1,500	10,500,000	
テイクアンドグヴィニーズ	1,235	6,150	7,595,250	
びあ	7,600	815	6,194,000	
シンプレクスホールディング	394	24,340	9,589,960	
イオンファンタジー	8,200	1,430	11,726,000	
ソースネクスト	59	15,500	914,500	
ネクシィーズ	952	1,911	1,819,272	
メディカルシステムネットワーク	3,900	954	3,720,600	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本精化	21,700	543	11,783,100	
ADEKA	108,600	752	81,667,200	
日油	201,000	403	81,003,000	
ミヨシ油脂	88,000	112	9,856,000	
ハリマ化成	21,600	570	12,312,000	
花王	667,700	2,003	1,337,403,100	
第一工業製薬	46,000	225	10,350,000	
三洋化成	79,000	534	42,186,000	
武田薬品	942,900	3,340	3,149,286,000	
アステラス製薬	558,800	3,205	1,790,954,000	
大日本住友製薬	178,500	862	153,867,000	
塩野義製薬	393,100	993	390,348,300	
田辺三菱製薬	251,400	1,046	262,964,400	
わかもと製薬	7,000	235	1,645,000	
あすか製薬	30,000	478	14,340,000	
日本新薬	53,000	929	49,237,000	
中外製薬	292,500	1,233	360,652,500	
科研製薬	99,000	1,026	101,574,000	
エーザイ	309,900	3,120	966,888,000	
ロート製薬	106,000	930	98,580,000	
小野薬品	123,200	4,345	535,304,000	
久光製薬	78,100	3,420	267,102,000	
有機合成薬品	18,000	191	3,438,000	
持田製薬	89,000	866	77,074,000	
参天製薬	84,500	3,090	261,105,000	
扶桑薬品	86,000	204	17,544,000	
日本ケミファ	39,000	308	12,012,000	
ツムラ	68,700	2,241	153,956,700	
日医工	42,600	1,800	76,680,000	
テルモ	170,000	3,590	610,300,000	
みらかホールディングス	65,500	2,824	184,972,000	
キッセイ薬品工業	46,800	1,552	72,633,600	
生化学工業	48,300	885	42,745,500	
栄研化学	19,700	1,071	21,098,700	
日水製薬	10,900	713	7,771,700	
鳥居薬品	17,300	1,468	25,396,400	
東和薬品	12,800	3,345	42,816,000	
沢井製薬	16,500	8,300	136,950,000	
ゼリア新薬工業	36,000	1,335	48,060,000	
第一三共	846,800	1,373	1,162,656,400	
キョーリン製薬HD	62,000	1,364	84,568,000	
大幸薬品	11,700	865	10,120,500	
ダイト	7,000	1,149	8,043,000	
大塚ホールディングス	499,500	2,169	1,083,415,500	
大正製薬HD	60,500	6,850	414,425,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
大日本塗料	147,000	95	13,965,000	
日本ペイント	238,000	600	142,800,000	
関西ペイント	285,000	740	210,900,000	
トウベ	22,000	102	2,244,000	
中国塗料	77,000	504	38,808,000	
日本特殊塗料	20,000	317	6,340,000	
藤倉化成	31,700	389	12,331,300	
太陽ホールディングス	20,700	2,066	42,766,200	
D I C	960,000	152	145,920,000	
サカタインクス	47,000	354	16,638,000	
東洋インキS Cホールディン	227,000	308	69,916,000	
アルプス技研	11,400	631	7,193,400	
サニックス	36,300	230	8,349,000	
ダイオーズ	4,700	487	2,288,900	
日本空調サービス	6,700	727	4,870,900	
オリエンタルランド	67,900	8,290	562,891,000	
ダスキン	75,500	1,549	116,949,500	
パーク24	122,500	993	121,642,500	
明光ネットワークジャパン	22,900	714	16,350,600	
ファルコS Dホールディングス	13,600	919	12,498,400	
クレスコ	6,000	643	3,858,000	
フジ・メディア・HD	2,470	117,600	290,472,000	
秀英予備校	4,100	302	1,238,200	
田谷	900	682	613,800	
ラウンドワン	78,300	487	38,132,100	
リゾートトラスト	38,600	1,242	47,941,200	
オービック	7,420	14,520	107,738,400	
ティーディーシーソフトウェア	4,800	778	3,734,400	
ヤフー	17,366	24,640	427,898,240	
ビー・エム・エル	16,500	1,896	31,284,000	
ワタベウェディング	7,500	715	5,362,500	
トレンドマイクロ	104,700	2,446	256,096,200	
もしもしホットライン	41,500	773	32,079,500	
東急コミュニティー	6,500	2,477	16,100,500	
リソー教育	2,585	5,240	13,545,400	
日本オラクル	47,400	2,676	126,842,400	
アルファシステムズ	6,400	1,189	7,609,600	
フューチャーアーキテクト	286	30,750	8,794,500	
ウェアハウス	5,500	233	1,281,500	
シーエーシー	16,300	636	10,366,800	
ソフトバンク・テクノ	5,700	669	3,813,300	
トーセ	6,000	540	3,240,000	
ユー・エス・エス	32,740	7,420	242,930,800	
オービックビジネスC	6,000	3,590	21,540,000	
伊藤忠テクノソリュー	27,900	3,430	95,697,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
アイティフォー	26,300	289	7,600,700	
東京個別指導学院	17,000	175	2,975,000	
東計電算	4,500	1,023	4,603,500	
エクスネット	18	116,600	2,098,800	
テー・オー・ダブリュー	8,500	471	4,003,500	
大塚商会	18,900	5,590	105,651,000	
総合メディカル	5,700	2,542	14,489,400	
サイボウズ	433	23,510	10,179,830	
ソフトブレーン	333	8,310	2,767,230	
アグレックス	6,800	756	5,140,800	
セントラルスポーツ	8,000	1,037	8,296,000	
電通国際情報S	14,600	633	9,241,800	
ウェザーニューズ	7,100	2,118	15,037,800	
C I J	24,200	303	7,332,600	
WOWOW	73	197,900	14,446,700	
フルキャストホールディングス	198	16,410	3,249,180	
富士フイルムHLDGS	537,600	1,803	969,292,800	
コニカミノルタHLDGS	634,500	581	368,644,500	
資生堂	418,000	1,362	569,316,000	
ライオン	291,000	468	136,188,000	
高砂香料	83,000	364	30,212,000	
マンダム	25,200	1,928	48,585,600	
ミルボン	13,500	2,399	32,386,500	
ファンケル	63,400	1,026	65,048,400	
コーセー	40,700	1,834	74,643,800	
ドクターシーラボ	151	375,500	56,700,500	
ポーラ・オルビスHD	25,600	2,050	52,480,000	
エステー	15,700	1,001	15,715,700	
コニシ	18,200	1,046	19,037,200	
長谷川香料	32,200	1,235	39,767,000	
小林製薬	35,000	3,945	138,075,000	
荒川化学工業	20,000	694	13,880,000	
メック	18,500	297	5,494,500	
日本高純度化学	72	205,800	14,817,600	
荏原ユージライト	3,500	2,255	7,892,500	
アース製薬	18,200	2,871	52,252,200	
イハラケミカル	44,000	312	13,728,000	
北興化学	11,000	232	2,552,000	
大成ラミック	7,200	2,480	17,856,000	
クミアイ化学	59,000	342	20,178,000	
日本農薬	58,000	331	19,198,000	
昭和シエル石油	225,000	531	119,475,000	
コスモ石油	696,000	224	155,904,000	
富士興産	89,000	80	7,120,000	
ニチレキ	35,000	429	15,015,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
東燃ゼネラル石油	380,000	734	278,920,000	
ユシロ化学	13,700	834	11,425,800	
ビーピー・カストロール	9,800	330	3,234,000	
AOCホールディングス	58,300	531	30,957,300	
MORESCO	5,500	820	4,510,000	
出光興産	29,800	8,480	252,704,000	
JXホールディングス	2,792,700	465	1,298,605,500	
横浜ゴム	307,000	470	144,290,000	
東洋ゴム	190,000	198	37,620,000	
ブリヂストン	788,700	1,768	1,394,421,600	
住友ゴム	196,200	964	189,136,800	
藤倉ゴム	15,500	291	4,510,500	
オカモト	93,000	297	27,621,000	
アキレス	205,000	114	23,370,000	
フコク	10,600	718	7,610,800	
ニッタ	24,800	1,408	34,918,400	
クリエートメディック	7,000	797	5,579,000	
東海ゴム工業	46,500	917	42,640,500	
三ツ星ベルト	67,000	418	28,006,000	
バンドー化学	90,000	294	26,460,000	
鬼怒川ゴム	55,000	635	34,925,000	
旭硝子	1,239,000	628	778,092,000	
日本板硝子	1,079,000	128	138,112,000	
石塚硝子	31,000	151	4,681,000	
有沢製作所	42,000	308	12,936,000	
日本山村硝子	100,000	207	20,700,000	
日本電気硝子	483,000	670	323,610,000	
オハラ	9,500	840	7,980,000	
住友大阪セメント	511,000	250	127,750,000	
太平洋セメント	1,478,000	169	249,782,000	
デイ・シイ	25,500	288	7,344,000	
リゾートソリューション	23,000	161	3,703,000	
日本ヒューム	21,000	396	8,316,000	
日本コンクリート	40,000	282	11,280,000	
東海カーボン	218,000	413	90,034,000	
日本カーボン	115,000	226	25,990,000	
東洋炭素	12,400	3,090	38,316,000	
ノリタケ	130,000	238	30,940,000	
TOTO	389,000	591	229,899,000	
日本碍子	327,000	1,019	333,213,000	
日本特殊陶業	217,000	1,009	218,953,000	
ダントーホールディングス	39,000	88	3,432,000	
MARUWA	7,400	3,130	23,162,000	
品川リフラクトリーズ	63,000	235	14,805,000	
黒崎播磨	54,000	263	14,202,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
東京窯業	30,000	188	5,640,000	
ニッカトー	9,200	484	4,452,800	
フジインコーポレーテッド	23,000	927	21,321,000	
エーアンドエーマテリアル	53,000	93	4,929,000	
ニチアス	112,000	429	48,048,000	
新日本製鐵	6,602,000	195	1,287,390,000	
住友金属工業	4,661,000	140	652,540,000	
神戸製鋼所	3,486,000	123	428,778,000	
日新製鋼	890,000	121	107,690,000	
中山製鋼所	128,000	89	11,392,000	
合同製鐵	140,000	212	29,680,000	
JFEホールディングス	595,900	1,409	839,623,100	
東京製鐵	127,100	598	76,005,800	
共英製鋼	26,800	1,481	39,690,800	
大和工業	57,400	2,427	139,309,800	
東京鐵鋼	51,000	292	14,892,000	
大阪製鐵	15,700	1,457	22,874,900	
淀川製鋼所	179,000	358	64,082,000	
東洋鋼鈹	60,000	291	17,460,000	
住友鋼管	16,700	669	11,172,300	
丸一鋼管	77,200	1,801	139,037,200	
モリ工業	40,000	271	10,840,000	
大同特殊鋼	421,000	508	213,868,000	
日本高周波	99,000	104	10,296,000	
日本金属工業	195,000	72	14,040,000	
日本冶金工	184,500	133	24,538,500	
山陽特殊製鋼	124,000	450	55,800,000	
愛知製鋼	133,000	411	54,663,000	
日立金属	164,000	887	145,468,000	
日本金属	63,000	156	9,828,000	
大平洋金属	175,000	443	77,525,000	
日本電工	90,000	375	33,750,000	
栗本鉄工所	127,000	215	27,305,000	
旭テック	225,000	33	7,425,000	
日本鑄鉄管	27,000	191	5,157,000	
日本製鋼所	388,000	622	241,336,000	
三菱製鋼	151,000	241	36,391,000	
日亜鋼業	40,000	199	7,960,000	
日本精線	19,000	380	7,220,000	
日本軽金属	568,000	108	61,344,000	
大紀アルミニウム	39,000	290	11,310,000	
三井金属	683,000	212	144,796,000	
東邦亜鉛	142,000	314	44,588,000	
三菱マテリアル	1,569,000	239	374,991,000	
住友鋳山	651,000	1,118	727,818,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
DOWAホールディングス	300,000	513	153,900,000	
古河機金	425,000	72	30,600,000	
大阪チタニウム	24,700	3,405	84,103,500	
東邦チタニウム	40,800	1,286	52,468,800	
住友軽金属	604,000	78	47,112,000	
古河スカイ	101,000	219	22,119,000	
古河電工	791,000	207	163,737,000	
住友電工	888,600	946	840,615,600	
フジクラ	377,000	250	94,250,000	
昭和電線HLDGS	326,000	80	26,080,000	
東京特殊電線	35,000	104	3,640,000	
タツタ電線	47,000	401	18,847,000	
日立電線	198,000	181	35,838,000	
沖電線	27,000	165	4,455,000	
カナレ電気	3,500	1,210	4,235,000	
平河ヒューテック	4,400	749	3,295,600	
リョービ	141,000	282	39,762,000	
アサヒHD	35,100	1,583	55,563,300	
東洋製罐	177,900	1,078	191,776,200	
ホッカンホールディングス	61,000	233	14,213,000	
コロナ	11,500	1,253	14,409,500	
横河ブリッジHLDGS	52,000	588	30,576,000	
日本橋梁	10,350	779	8,062,650	
駒井ハルテック	50,000	286	14,300,000	
サクラダ	222,000	26	5,772,000	
高田機工	23,000	242	5,566,000	
三和ホールディングス	251,000	268	67,268,000	
文化シャツタ-	66,000	302	19,932,000	
東洋シャツタ-	7,500	378	2,835,000	
住生活グループ	327,000	1,678	548,706,000	
日本フィルコン	18,800	396	7,444,800	
ノーリツ	49,400	1,372	67,776,800	
長府製作所	24,300	1,961	47,652,300	
リンナイ	40,500	5,220	211,410,000	
ユニプレス	38,200	2,436	93,055,200	
ダイニチ工業	12,800	836	10,700,800	
日東精工	34,000	209	7,106,000	
三洋工業	33,000	178	5,874,000	
岡部	50,800	412	20,929,600	
日立ツール	14,600	856	12,497,600	
中国工業	38,000	109	4,142,000	
東プレ	48,400	792	38,332,800	
高周波熱錬	33,500	680	22,780,000	
東京製網	158,000	193	30,494,000	
パイオラックス	10,800	1,806	19,504,800	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本発条	181,900	761	138,425,900	
中央発條	28,000	290	8,120,000	
アドバネクス	51,000	68	3,468,000	
三浦工業	37,400	2,191	81,943,400	
タクマ	85,000	386	32,810,000	
ツガミ	61,000	531	32,391,000	
オークマ	151,000	595	89,845,000	
東芝機械	137,000	409	56,033,000	
アマダ	355,000	525	186,375,000	
アイダエンジニア	65,100	383	24,933,300	
牧野フライス	125,000	538	67,250,000	
オーエスジー	110,700	1,171	129,629,700	
ダイジェット	29,000	159	4,611,000	
旭ダイヤモンド	61,700	938	57,874,600	
森精機製作所	132,400	768	101,683,200	
ディスコ	25,300	4,140	104,742,000	
日東工器	14,700	1,830	26,901,000	
豊田自動織機	218,800	2,356	515,492,800	
豊和工業	130,000	72	9,360,000	
大阪機工	98,000	119	11,662,000	
石川製作所	55,000	74	4,070,000	
東洋機械金属	20,400	214	4,365,600	
津田駒工業	60,000	200	12,000,000	
エンシュウ	62,000	98	6,076,000	
島精機製作所	32,800	1,420	46,576,000	
日阪製作所	32,000	837	26,784,000	
やまびこ	9,900	981	9,711,900	
ベガサスミシン製造	24,700	238	5,878,600	
ナプテスコ	104,300	1,628	169,800,400	
三井海洋開発	20,800	1,420	29,536,000	
レオン自動機	21,000	195	4,095,000	
S M C	75,100	13,570	1,019,107,000	
新川	19,600	408	7,996,800	
ホソカワミクロン	39,000	385	15,015,000	
ユニオンツール	13,800	1,357	18,726,600	
オイレス工業	27,900	1,489	41,543,100	
サト - ホールディングス	26,400	992	26,188,800	
日本エアテック	6,800	380	2,584,000	
日精樹脂工業	20,000	387	7,740,000	
ワイエイシイ	10,500	648	6,804,000	
小松製作所	1,192,400	2,198	2,620,895,200	
住友重機械	642,000	412	264,504,000	
日立建機	128,300	1,519	194,887,700	
日工	33,000	317	10,461,000	
巴工業	9,500	1,473	13,993,500	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
井関農機	258,000	176	45,408,000	
TOWA	23,600	466	10,997,600	
丸山製作所	57,000	182	10,374,000	
北川鉄工所	115,000	152	17,480,000	
シンニッタン	23,200	366	8,491,200	
クボタ	1,151,000	698	803,398,000	
荏原実業	6,400	1,196	7,654,400	
東洋エンジニア	144,000	331	47,664,000	
三菱化工機	78,000	150	11,700,000	
月島機械	38,000	646	24,548,000	
帝国電機製作所	8,500	1,417	12,044,500	
東京機械	82,000	54	4,428,000	
新東工業	54,900	753	41,339,700	
渋谷工業	14,400	844	12,153,600	
アイチ コーポレーション	41,800	339	14,170,200	
小森コーポレーション	71,600	535	38,306,000	
鶴見製作所	14,000	592	8,288,000	
住友精密	35,000	489	17,115,000	
酒井重工業	49,000	180	8,820,000	
荏原製作所	410,000	304	124,640,000	
石井鉄工所	37,000	166	6,142,000	
西島製作所	29,000	1,080	31,320,000	
千代田化工建	214,000	936	200,304,000	
ダイキン工業	306,200	2,191	670,884,200	
オルガノ	48,000	596	28,608,000	
ト・ヨ・カネツ	135,000	177	23,895,000	
栗田工業	138,700	2,065	286,415,500	
椿本チエイン	128,000	468	59,904,000	
大同工業	51,000	145	7,395,000	
日本コンベヤ	80,000	85	6,800,000	
日 機 装	78,000	688	53,664,000	
木村化工機	22,900	341	7,808,900	
新興プランテック	55,100	636	35,043,600	
アネスト岩田	42,000	339	14,238,000	
ダイフク	110,500	441	48,730,500	
加藤製作所	57,000	288	16,416,000	
油研工業	44,000	166	7,304,000	
タダノ	116,000	524	60,784,000	
フジテック	70,000	502	35,140,000	
シーケーディ	67,200	578	38,841,600	
キトー	102	60,800	6,201,600	
平和	52,000	1,350	70,200,000	
理想科学工業	17,200	1,147	19,728,400	
SANKYO	72,800	3,715	270,452,000	
日本金銭機械	22,300	570	12,711,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
マースエンジニアリング	13,600	1,393	18,944,800	
福島工業	7,500	1,004	7,530,000	
オーイズミ	8,500	242	2,057,000	
ダイコク電機	11,300	855	9,661,500	
アマノ	72,900	697	50,811,300	
JUKI	144,000	168	24,192,000	
サンデン	125,000	267	33,375,000	
蛇の目マシン	233,000	60	13,980,000	
ブラザー工業	310,500	976	303,048,000	
マックス	38,000	936	35,568,000	
モリタホールディングス	40,000	486	19,440,000	
グローリー	71,700	1,693	121,388,100	
大和冷機工業	35,000	432	15,120,000	
セガサミーホールディングス	258,200	1,492	385,234,400	
日本ピストンリング	91,000	169	15,379,000	
リケン	87,000	318	27,666,000	
TPR	26,500	1,066	28,249,000	
ホシザキ電機	48,400	1,722	83,344,800	
大豊工業	16,900	799	13,503,100	
日本精工	535,000	577	308,695,000	
NTN	556,000	328	182,368,000	
ジェイテクト	229,700	827	189,961,900	
不二越	241,000	418	100,738,000	
ミネベア	357,000	355	126,735,000	
日本トムソン	77,000	481	37,037,000	
THK	159,700	1,669	266,539,300	
ユースン精機	12,000	1,570	18,840,000	
前澤給装工業	9,400	1,072	10,076,800	
イーグル工業	30,000	700	21,000,000	
前澤工業	17,400	232	4,036,800	
日本ピラ - 工業	25,000	575	14,375,000	
キッツ	98,700	346	34,150,200	
日立	5,396,000	428	2,309,488,000	
東芝	5,059,000	319	1,613,821,000	
三菱電機	2,403,000	670	1,610,010,000	
富士電機	724,000	208	150,592,000	
東洋電機製造	42,000	294	12,348,000	
安川電機	282,000	693	195,426,000	
シンフォニアテクノロジー	145,000	174	25,230,000	
明電舎	238,000	280	66,640,000	
オリジン電気	35,000	255	8,925,000	
デンヨー	22,700	1,087	24,674,900	
日立工機	64,400	629	40,507,600	
三桜工業	30,600	606	18,543,600	
マキタ	156,600	2,970	465,102,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
東芝テック	150,000	285	42,750,000	
芝浦メカトロニクス	42,000	226	9,492,000	
マブチモーター	32,800	3,390	111,192,000	
日本電産	129,900	7,570	983,343,000	
宮越ホールディングス	8,400	417	3,502,800	
高岳製作所	95,000	240	22,800,000	
ダイヘン	142,000	291	41,322,000	
JVCケンウッド	144,800	335	48,508,000	
第一精工	5,600	2,398	13,428,800	
日新電機	48,000	527	25,296,000	
大崎電気	35,000	757	26,495,000	
オムロン	267,600	1,608	430,300,800	
日東工業	36,200	922	33,376,400	
I D E C	31,500	788	24,822,000	
エルピーダメモリ	324,400	341	110,620,400	
ジーエス・ユアサ コーポ	463,000	423	195,849,000	
サクサホールディングス	61,000	173	10,553,000	
メルコホールディングス	13,200	1,903	25,119,600	
テクノメディカ	13	300,000	3,900,000	
日本電気	3,303,000	152	502,056,000	
富士通	2,317,000	380	880,460,000	
沖電気	927,000	76	70,452,000	
岩崎通信機	107,000	77	8,239,000	
電気興業	74,000	370	27,380,000	
サンケン電気	121,000	300	36,300,000	
ナカヨ通信機	24,000	323	7,752,000	
アイホン	14,000	1,547	21,658,000	
ルネサスエレクトロニクス	62,200	505	31,411,000	
セイコーエプソン	163,900	992	162,588,800	
ワコム	472	130,100	61,407,200	
アルバック	47,900	1,041	49,863,900	
アクセル	11,200	1,663	18,625,600	
ピクセラ	9,900	197	1,950,300	
ナナオ	20,300	1,669	33,880,700	
日本信号	56,000	455	25,480,000	
京三製作所	52,000	339	17,628,000	
能美防災	31,000	501	15,531,000	
ホーチキ	19,000	402	7,638,000	
日本無線	62,000	195	12,090,000	
パナソニック	2,745,700	636	1,746,265,200	
シャープ	1,160,000	536	621,760,000	
アンリツ	115,000	913	104,995,000	
富士通ゼネラル	57,000	436	24,852,000	
日立国際電気	55,000	673	37,015,000	
ソ ニ ー	1,499,300	1,513	2,268,440,900	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
T D K	125,700	3,680	462,576,000	
帝国通信工業	59,000	140	8,260,000	
ミツミ電機	84,800	704	59,699,200	
タムラ製作所	80,000	219	17,520,000	
アルプス電気	189,500	628	119,006,000	
池上通信機	76,000	59	4,484,000	
パイオニア	340,500	356	121,218,000	
日本電波工業	18,500	983	18,185,500	
日本トリム	2,750	1,815	4,991,250	
ローランド ディー・ジー・	10,500	876	9,198,000	
日本コロムビア	235,000	32	7,520,000	
山水電気	1,498,000	2	2,996,000	
フオスタ - 電機	22,700	1,073	24,357,100	
クラリオン	147,000	145	21,315,000	
S M K	77,000	258	19,866,000	
ヨコオ	20,000	393	7,860,000	
東 光	109,000	162	17,658,000	
ティアック	131,000	35	4,585,000	
ホシデン	65,200	570	37,164,000	
ヒロセ電機	41,800	7,580	316,844,000	
日本航空電子	55,000	616	33,880,000	
T O A	27,000	555	14,985,000	
ユニデン	70,000	285	19,950,000	
アルパイン	46,800	973	45,536,400	
スミダコーポレーション	14,700	503	7,394,100	
アイコム	13,300	1,998	26,573,400	
リオン	5,300	742	3,932,600	
船井電機	21,500	1,822	39,173,000	
横河電機	260,800	764	199,251,200	
新電元工業	85,000	376	31,960,000	
山武	61,700	1,752	108,098,400	
日本光電工業	47,900	1,810	86,699,000	
チ ノ ー	47,000	213	10,011,000	
共和電業	3,000	235	705,000	
日本電子材料	10,400	381	3,962,400	
堀場製作所	44,400	2,424	107,625,600	
アドバンテスト	178,600	933	166,633,800	
小野測器	23,000	281	6,463,000	
エスベック	25,100	531	13,328,100	
パナソニック電工SUNX	21,200	401	8,501,200	
キーエンス	53,600	18,750	1,005,000,000	
日置電機	11,700	1,289	15,081,300	
シスメックス	84,600	2,614	221,144,400	
メガチップス	19,700	1,375	27,087,500	
OBARA GROUP	17,100	925	15,817,500	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本電産コパル電子	24,900	449	11,180,100	
ミヤチテクノス	11,700	649	7,593,300	
東京電波	7,000	392	2,744,000	
澤藤電機	14,000	227	3,178,000	
デンソー	593,700	2,425	1,439,722,500	
コーセル	35,000	1,148	40,180,000	
日立メディコ	18,000	921	16,578,000	
新日本無線	18,000	211	3,798,000	
オブテックス	16,600	970	16,102,000	
千代田インテグレ	11,700	964	11,278,800	
東光電気	15,000	345	5,175,000	
スタンレー電気	161,100	1,237	199,280,700	
岩崎電気	88,000	165	14,520,000	
ウシオ電機	145,800	1,163	169,565,400	
岡谷電機	12,900	351	4,527,900	
ヘリオステクノH	21,900	158	3,460,200	
日本セラミック	15,800	1,400	22,120,000	
日本デジタル研究所	20,100	854	17,165,400	
古河電池	17,000	366	6,222,000	
双信電機	11,800	339	4,000,200	
山一電機	23,600	178	4,200,800	
函研	15,700	571	8,964,700	
日本電子	90,000	213	19,170,000	
カシオ	229,000	468	107,172,000	
ファナック	250,200	12,960	3,242,592,000	
日本シイエムケイ	51,800	292	15,125,600	
エンプラス	12,100	1,744	21,102,400	
ローム	118,400	3,790	448,736,000	
浜松ホトニクス	93,800	2,683	251,665,400	
三井ハイテック	31,700	335	10,619,500	
新光電気工業	80,500	624	50,232,000	
京セラ	199,800	6,640	1,326,672,000	
協栄産業	29,000	146	4,234,000	
太陽誘電	107,800	725	78,155,000	
村田製作所	252,100	4,550	1,147,055,000	
ユーシン	33,400	578	19,305,200	
双葉電子工業	41,200	1,289	53,106,800	
日東電工	207,400	2,979	617,844,600	
北陸電気工業	97,000	115	11,155,000	
東海理化電機	56,200	1,345	75,589,000	
ニチコン	75,600	871	65,847,600	
日本ケミコン	138,000	287	39,606,000	
K O A	30,300	748	22,664,400	
三井造船	929,000	145	134,705,000	
日立造船	950,500	108	102,654,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
佐世保重工業	156,000	142	22,152,000	
三菱重工業	4,028,000	363	1,462,164,000	
川崎重工業	1,746,000	219	382,374,000	
I H I	1,642,000	198	325,116,000	
日本車輛	88,000	336	29,568,000	
日本輸送機	32,000	224	7,168,000	
近畿車輛	36,000	261	9,396,000	
日産自動車	3,036,000	756	2,295,216,000	
いすゞ自動車	1,519,000	395	600,005,000	
トヨタ自動車	3,116,400	2,986	9,305,570,400	*
日野自動車	343,000	519	178,017,000	
三菱自動車工業	5,374,000	95	510,530,000	
エフテック	8,300	1,143	9,486,900	
武蔵精密工業	23,200	1,825	42,340,000	
日産車体	70,000	825	57,750,000	
新明和工業	108,000	374	40,392,000	
極東開発工業	41,700	690	28,773,000	
日信工業	43,900	1,254	55,050,600	
トピー工業	180,000	221	39,780,000	
ティラド	87,000	304	26,448,000	
曙ブレーキ	121,800	409	49,816,200	
タチエス	31,300	1,559	48,796,700	
N O K	116,200	1,483	172,324,600	
フタバ産業	67,800	440	29,832,000	
カヤバ工業	166,000	435	72,210,000	
シロキ工業	53,000	230	12,190,000	
市光工業	58,000	140	8,120,000	
大同メタル工業	37,000	919	34,003,000	
プレス工業	110,000	393	43,230,000	
カルソニックカンセイ	143,000	493	70,499,000	
太平洋工業	49,000	377	18,473,000	
ケーヒン	49,600	1,521	75,441,600	
河西工業	29,000	403	11,687,000	
アイシン精機	197,800	2,583	510,917,400	
富士機工	28,000	242	6,776,000	
マ ッ ダ	1,993,000	137	273,041,000	
ダイハツ	223,000	1,484	330,932,000	
愛知機械	54,000	300	16,200,000	
今仙電機製作所	17,500	977	17,097,500	
本田技研	2,027,600	2,764	5,604,286,400	
スズキ	502,400	1,773	890,755,200	
富士重工業	759,000	507	384,813,000	
ヤマハ発動機	391,400	1,023	400,402,200	
ショーワ	51,100	550	28,105,000	
小糸製作所	120,000	1,273	152,760,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
T B K	24,000	400	9,600,000	
エクセディ	32,600	2,356	76,805,600	
ミツバ	44,000	647	28,468,000	
豊田合成	67,900	1,301	88,337,900	
愛三工業	24,900	692	17,230,800	
ヨロズ	14,400	1,868	26,899,200	
エフ・シー・シー	39,300	1,716	67,438,800	
新家工業	58,000	137	7,946,000	
シマノ	91,000	3,905	355,355,000	
タカタ	43,400	1,840	79,856,000	
テイ・エス テック	50,700	1,426	72,298,200	
小野建	20,600	651	13,410,600	
はるやま商事	11,100	396	4,395,600	
佐鳥電機	17,500	485	8,487,500	
カップクリエイト	17,450	1,859	32,439,550	
エコートレーディング	5,900	731	4,312,900	
伯東	14,600	772	11,271,200	
コンドーテック	17,400	493	8,578,200	
中山福	14,400	612	8,812,800	
ライトオン	17,700	583	10,319,100	
ナガイレーベン	31,400	1,091	34,257,400	
ジーンズメイト	7,800	193	1,505,400	
三菱食品	21,700	2,073	44,984,100	
良品計画	25,100	3,780	94,878,000	
三城ホールディングス	29,300	612	17,931,600	
松田産業	17,400	1,232	21,436,800	
メディパルHD	255,400	903	230,626,200	
アドヴァン	14,300	750	10,725,000	
S P K	5,800	1,384	8,027,200	
アズワン	15,500	1,697	26,303,500	
スズデン	8,000	516	4,128,000	
尾家産業	6,800	830	5,644,000	
シモジマ	14,600	1,020	14,892,000	
ドウシシャ	11,300	2,340	26,442,000	
コナカ	27,700	728	20,165,600	
高速	14,100	661	9,320,100	
ハウス ローゼ	2,700	1,287	3,474,900	
G - 7ホールディングス	6,000	410	2,460,000	
イオン北海道	17,400	367	6,385,800	
コジマ	31,600	503	15,894,800	
コーナン商事	25,200	1,191	30,013,200	
黒田電気	29,300	789	23,117,700	
ネットワンシステムズ	534	191,200	102,100,800	
エコス	8,400	502	4,216,800	
ワタミ	28,000	1,779	49,812,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
マルシェ	6,800	717	4,875,600	
ドン・キホーテ	63,300	2,769	175,277,700	
丸文	18,700	362	6,769,400	
メガネトップ	33,900	822	27,865,800	
西松屋チェーン	51,800	640	33,152,000	
ゼンショーホールディングス	90,300	1,034	93,370,200	
ハピネット	12,600	699	8,807,400	
幸楽苑	14,900	1,239	18,461,100	
トーマンエレクトロニクス	10,700	997	10,667,900	
ハークスレイ	6,600	555	3,663,000	
サイゼリヤ	35,000	1,223	42,805,000	
エクセル	11,400	760	8,664,000	
マルカキカイ	7,900	726	5,735,400	
アルゴグラフィックス	8,800	1,067	9,389,600	
ガリバーインターナショナル	7,190	3,070	22,073,300	
日本エム・ディ・エム	20,400	250	5,100,000	
ポプラ	7,600	490	3,724,000	
ユナイテッドアローズ	25,500	1,623	41,386,500	
進和	14,300	930	13,299,000	
エスケイジャパン	5,500	263	1,446,500	
ダイトエレクトロン	10,600	417	4,420,200	
ハイデイ日高	10,500	1,398	14,679,000	
シークス	15,000	994	14,910,000	
京都きもの友禅	16,700	935	15,614,500	
コロワイド	79,000	607	47,953,000	
田中商事	7,400	444	3,285,600	
オーハシテクニカ	13,400	598	8,013,200	
壱番屋	9,600	2,260	21,696,000	
マクニカ	12,100	1,845	22,324,500	
白銅	7,900	805	6,359,500	
トップカルチャー	9,200	386	3,551,200	
スギホールディングス	42,500	2,141	90,992,500	
島津製作所	287,000	676	194,012,000	
J M S	37,000	244	9,028,000	
クボテック	52	22,010	1,144,520	
モリテックス	5,300	321	1,701,300	
長野計器	17,100	776	13,269,600	
ブイ・テクノロジー	34	282,200	9,594,800	
スター精密	38,700	738	28,560,600	
東京計器	85,000	161	13,685,000	
愛知時計	26,000	280	7,280,000	
日本電産トーソク	11,600	916	10,625,600	
東京精密	43,100	1,597	68,830,700	
ニコン	418,700	2,063	863,778,100	
トプコン	55,500	447	24,808,500	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
オリンパス	283,300	1,243	352,141,900	
理研計器	19,600	604	11,838,400	
大日本スクリーン	227,000	587	133,249,000	
キヤノン電子	22,000	1,937	42,614,000	
タムロン	21,000	2,170	45,570,000	
HOYA	584,300	1,705	996,231,500	
ノーリツ鋼機	21,900	367	8,037,300	
エー・アンド・デイ	23,400	256	5,990,400	
キヤノン	1,492,900	3,395	5,068,395,500	
リコー	723,000	606	438,138,000	
日本電産コバル	18,900	850	16,065,000	
日本電産サンキョー	57,000	515	29,355,000	
シチズンホールディングス	287,400	450	129,330,000	
リズム時計	117,000	144	16,848,000	
大研医器	3,800	799	3,036,200	
パラマウントベッドHD	20,600	2,196	45,237,600	
SHOBI	3,700	478	1,768,600	
永大産業	31,000	399	12,369,000	
SRIスポーツ	15,700	842	13,219,400	
バンダイナムコHLDGS	257,400	1,069	275,160,600	
共立印刷	28,000	296	8,288,000	
フランスベッドHLDGS	162,000	165	26,730,000	
パイロットコーポレーション	212	153,300	32,499,600	
エイベックス・グループHD	44,800	993	44,486,400	
トッパン・フォームズ	51,500	636	32,754,000	
フジシールインターナショナル	26,900	1,397	37,579,300	
タカラトミー	78,900	551	43,473,900	
廣濟堂	20,300	222	4,506,600	
アーケ	81,600	79	6,446,400	
レック	7,600	1,187	9,021,200	
タカノ	9,800	432	4,233,600	
プロネクサス	27,100	395	10,704,500	
ホクシン	17,700	169	2,991,300	
ウッドワン	40,000	303	12,120,000	
大建工業	99,000	256	25,344,000	
きもと	20,500	522	10,701,000	
凸版印刷	731,000	595	434,945,000	
大日本印刷	732,000	793	580,476,000	
図書印刷	38,000	154	5,852,000	
共同印刷	82,000	204	16,728,000	
日本写真印刷	40,300	1,041	41,952,300	
光村印刷	3,000	264	792,000	
藤森工業	18,100	1,146	20,742,600	
宝印刷	14,200	583	8,278,600	
前澤化成工業	18,100	815	14,751,500	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
アシックス	223,700	946	211,620,200	
ツ ツ ミ	12,100	1,922	23,256,200	
ジェイ エス ピー	16,300	1,174	19,136,200	
ニ チ ハ	27,900	870	24,273,000	
ローランド	24,800	731	18,128,800	
エフピコ	11,100	5,060	56,166,000	
小松ウオール工業	9,100	818	7,443,800	
ヤマハ	176,600	668	117,968,800	
河合楽器	90,000	150	13,500,000	
クリナップ	28,300	529	14,970,700	
ビジョン	21,200	2,905	61,586,000	
天馬	20,300	699	14,189,700	
兼松日産農林	38,000	184	6,992,000	
キングジム	20,300	606	12,301,800	
リンテック	45,600	1,543	70,360,800	
T A S A K I	50,000	49	2,450,000	
信越ポリマー	49,500	360	17,820,000	
東 リ	66,000	166	10,956,000	
イトーキ	51,600	189	9,752,400	
任 天 堂	137,400	10,550	1,449,570,000	
三菱鉛筆	20,500	1,364	27,962,000	
タカラスタンダ - ド	111,000	614	68,154,000	
コ ク ヨ	125,200	542	67,858,400	
ナカバヤシ	52,000	189	9,828,000	
ニ フ コ	56,200	2,039	114,591,800	
グローブライド	118,000	103	12,154,000	
岡村製作所	84,000	558	46,872,000	
日本バルカー	98,000	219	21,462,000	
M U T O Hホールディングス	29,000	511	14,819,000	
伊 藤 忠	1,892,300	885	1,674,685,500	
丸 紅	2,075,000	539	1,118,425,000	
スクロール	32,800	305	10,004,000	
高 島	41,000	204	8,364,000	
F & Aアクアホールディングス	18,100	784	14,190,400	
三陽商会	123,000	196	24,108,000	
長瀬産業	134,500	930	125,085,000	
ナイガイ	71,000	51	3,621,000	
蝶 理	141,000	99	13,959,000	
豊田通商	264,500	1,529	404,420,500	
オンワ - ドホールディングス	155,000	622	96,410,000	
三共生興	40,600	285	11,571,000	
兼 松	504,000	83	41,832,000	
美 津 濃	119,000	407	48,433,000	
ツカモトコーポレーション	41,000	197	8,077,000	
ファミリーマート	72,800	3,070	223,496,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ルック	41,000	207	8,487,000	
三井物産	2,047,400	1,321	2,704,615,400	
日本紙パルプ	123,000	279	34,317,000	
東京エレクトロン	202,100	4,040	816,484,000	
日立ハイテクノロジーズ	71,900	1,677	120,576,300	
カメイ	31,000	898	27,838,000	
東都水産	40,000	153	6,120,000	
スターゼン	81,000	246	19,926,000	
セイコーHD	139,000	163	22,657,000	
山 善	91,600	615	56,334,000	
椿本興業	25,000	229	5,725,000	
住友商事	1,400,000	1,152	1,612,800,000	
日本ユニシス	57,000	526	29,982,000	
内田洋行	55,000	226	12,430,000	
三菱商事	1,727,400	1,794	3,098,955,600	
第一実業	50,000	369	18,450,000	
キャノンマーケティングJPN	79,000	964	76,156,000	
西華産業	89,000	218	19,402,000	
佐藤商事	20,900	466	9,739,400	
菱洋エレクトロ	26,800	920	24,656,000	
東京産業	25,500	264	6,732,000	
ユアサ商事	245,000	129	31,605,000	
神鋼商事	60,000	186	11,160,000	
阪和興業	238,000	364	86,632,000	
カナデン	2,000	500	1,000,000	
菱電商事	36,000	461	16,596,000	
ニプロ	95,700	684	65,458,800	
フルサト工業	14,200	738	10,479,600	
岩谷産業	265,000	273	72,345,000	
すてきナイスグループ	104,000	243	25,272,000	
昭光通商	88,000	138	12,144,000	
ニチモウ	37,000	190	7,030,000	
極東貿易	29,000	180	5,220,000	
イワキ	36,000	202	7,272,000	
兼松エレクトロニクス	15,200	809	12,296,800	
三愛石油	57,000	349	19,893,000	
稲畑産業	63,900	488	31,183,200	
G S Iクレオス	61,000	118	7,198,000	
明和産業	19,200	299	5,740,800	
ゴ-ルドウイン	57,000	406	23,142,000	
ユニ・チャ-ム	138,900	4,165	578,518,500	
デサント	63,000	396	24,948,000	
ヤマトインタ-ナショナル	15,500	375	5,812,500	
東邦ホールディングス	76,000	1,285	97,660,000	
サンゲツ	42,100	2,093	88,115,300	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ミツウロコグループ	38,600	482	18,605,200	
シナネン	52,000	349	18,148,000	
伊藤忠エネクス	52,600	452	23,775,200	
サンリオ	59,800	3,535	211,393,000	
サンワ テクノス	11,500	774	8,901,000	
リョーサン	38,600	1,709	65,967,400	
新光商事	26,200	661	17,318,200	
トーホー	52,000	310	16,120,000	
三信電気	33,900	690	23,391,000	
東陽テクニカ	34,900	830	28,967,000	
モスフード サービス	31,200	1,545	48,204,000	
加賀電子	25,700	871	22,384,700	
三益半導体	21,100	736	15,529,600	
ソーダニツカ	2,000	351	702,000	
立花エレテック	14,500	683	9,903,500	
木曽路	27,200	1,508	41,017,600	
千 趣 会	42,600	512	21,811,200	
タカキュー	18,500	169	3,126,500	
ケーヨー	44,600	535	23,861,000	
アデランス	30,100	957	28,805,700	
上新電機	51,000	850	43,350,000	
日本瓦斯	22,700	1,285	29,169,500	
ベスト電器	74,000	195	14,430,000	
マルエツ	48,000	295	14,160,000	
ロイヤルホールディングス	39,900	935	37,306,500	
東 天 紅	17,000	170	2,890,000	
いなげや	26,700	940	25,098,000	
島 忠	53,500	1,822	97,477,000	
チヨダ	31,100	1,473	45,810,300	
ライフコーポレーション	14,900	1,406	20,949,400	
カ ス ミ	48,700	523	25,470,100	
リンガーハット	21,600	1,095	23,652,000	
さ が 美	20,000	96	1,920,000	
MR MAX	24,000	335	8,040,000	
テンアライド	18,700	285	5,329,500	
AOKIホールディングス	21,900	1,227	26,871,300	
オークワ	34,000	1,080	36,720,000	
コメリ	32,400	2,340	75,816,000	
青山商事	65,300	1,380	90,114,000	
しまむら	27,500	7,880	216,700,000	
CFSコーポレーション	19,000	396	7,524,000	
高 島 屋	321,000	587	188,427,000	
松 屋	47,700	470	22,419,000	
エイチ・ツー・オーリテイリング	123,000	593	72,939,000	
丸 栄	40,000	100	4,000,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ニッセンHD	47,100	361	17,003,100	
パルコ	43,000	629	27,047,000	
丸井グループ	309,400	608	188,115,200	
クレディセゾン	193,700	1,567	303,527,900	
原信ナルスHLDGS	13,200	1,330	17,556,000	
井筒屋	126,000	49	6,174,000	
ダイエー	146,750	273	40,062,750	
イズミヤ	83,000	407	33,781,000	
イオン	836,000	1,016	849,376,000	
ユニー	177,900	696	123,818,400	
イズミ	71,000	1,334	94,714,000	
東武ストア	31,000	287	8,897,000	
平和堂	43,600	1,022	44,559,200	
フジ	26,500	1,852	49,078,000	
ヤオコー	10,400	2,577	26,800,800	
ゼビオ	28,500	1,891	53,893,500	
ケーズホールディングス	59,100	2,925	172,867,500	
Paltac	24,900	1,025	25,522,500	
OLYMPIC	15,800	825	13,035,000	
日産東京販売HD	35,000	202	7,070,000	
新生銀行	1,848,000	88	162,624,000	
あおぞら銀行	739,000	213	157,407,000	
三菱UFJフィナンシャルG	17,955,300	380	6,823,014,000	
りそなホールディングス	2,064,000	353	728,592,000	
三井住友トラストHD	4,650,000	256	1,190,400,000	
三井住友フィナンシャルG	1,793,700	2,542	4,559,585,400	
第四銀行	309,000	258	79,722,000	
北越銀行	248,000	159	39,432,000	
西日本シティ銀行	831,000	221	183,651,000	
札幌北洋ホール	356,800	272	97,049,600	
千葉銀行	935,000	480	448,800,000	
横浜銀行	1,523,000	359	546,757,000	
常陽銀行	914,000	337	308,018,000	
群馬銀行	542,000	411	222,762,000	
武蔵野銀行	38,200	2,593	99,052,600	
千葉興業銀行	44,800	408	18,278,400	
筑波銀行	98,400	267	26,272,800	
東京都民銀行	45,000	955	42,975,000	
七十七銀行	372,000	348	129,456,000	
青森銀行	178,000	241	42,898,000	
秋田銀行	163,000	241	39,283,000	
山形銀行	145,000	380	55,100,000	
岩手銀行	16,000	3,435	54,960,000	
東邦銀行	200,000	253	50,600,000	
東北銀行	132,000	136	17,952,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
みちのく銀行	119,000	154	18,326,000	
ふくおかフィナンシャルG	962,000	326	313,612,000	
静岡銀行	716,000	776	555,616,000	
十六銀行	298,000	261	77,778,000	
スルガ銀行	231,000	692	159,852,000	
八十二銀行	437,000	439	191,843,000	
山梨中央銀行	145,000	345	50,025,000	
大垣共立銀行	316,000	259	81,844,000	
福井銀行	205,000	237	48,585,000	
北國銀行	284,000	300	85,200,000	
清水銀行	8,100	3,170	25,677,000	
滋賀銀行	223,000	512	114,176,000	
南都銀行	221,000	408	90,168,000	
百五銀行	214,000	335	71,690,000	
京都銀行	424,000	655	277,720,000	
三重銀行	98,000	178	17,444,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,661,000	154	255,794,000	
広島銀行	700,000	353	247,100,000	
山陰合同銀行	141,000	581	81,921,000	
中国銀行	194,000	1,038	201,372,000	
鳥取銀行	75,000	153	11,475,000	
伊予銀行	254,000	739	187,706,000	
百十四銀行	260,000	364	94,640,000	
四国銀行	171,000	283	48,393,000	
阿波銀行	210,000	520	109,200,000	
鹿児島銀行	153,000	519	79,407,000	
大分銀行	153,000	228	34,884,000	
宮崎銀行	157,000	196	30,772,000	
肥後銀行	184,000	447	82,248,000	
佐賀銀行	144,000	193	27,792,000	
十八銀行	151,000	231	34,881,000	
沖縄銀行	18,000	3,300	59,400,000	
琉球銀行	50,000	967	48,350,000	
八千代銀行	12,400	1,816	22,518,400	
セブン銀行	666,500	167	111,305,500	
みずほフィナンシャルG	30,466,400	121	3,686,434,400	
紀陽ホールディングス	947,000	119	112,693,000	
山口フィナンシャルG	237,000	736	174,432,000	
フィデック	141	8,700	1,226,700	
芙蓉総合リース	22,600	2,876	64,997,600	
興銀リース	33,000	1,753	57,849,000	
東京センチュリーリース	63,600	1,592	101,251,200	
SBIホールディングス	25,031	6,350	158,946,850	
日本証券金融	98,000	406	39,788,000	
大阪証券金融	28,500	177	5,044,500	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
アイフル	215,800	136	29,348,800	
日本アジア投資	171,000	62	10,602,000	
ポケットカード	24,200	278	6,727,600	
長野銀行	81,000	160	12,960,000	
名古屋銀行	214,000	260	55,640,000	
愛知銀行	8,600	4,605	39,603,000	
第三銀行	135,000	173	23,355,000	
中京銀行	99,000	207	20,493,000	
東日本銀行	113,000	168	18,984,000	
大光銀行	84,000	257	21,588,000	
愛媛銀行	150,000	225	33,750,000	
トマト銀行	95,000	135	12,825,000	
みなと銀行	215,000	149	32,035,000	
京葉銀行	195,000	375	73,125,000	
関西アーバン銀行	331,000	128	42,368,000	
栃木銀行	119,000	275	32,725,000	
北日本銀行	7,400	2,004	14,829,600	
東和銀行	236,000	89	21,004,000	
福島銀行	284,000	58	16,472,000	
大東銀行	154,000	72	11,088,000	
リコーリース	16,300	1,888	30,774,400	
イオン クレジットサービス	105,400	1,153	121,526,200	
アコム	47,660	1,521	72,490,860	
ジャックス	144,000	255	36,720,000	
オリコ	341,500	85	29,027,500	
日立キャピタル	46,600	1,173	54,661,800	
オリックス	123,370	7,440	917,872,800	
三菱UFJリース	60,130	3,450	207,448,500	
ジャフコ	28,800	1,623	46,742,400	
トモニホールディングス	182,200	348	63,405,600	
大和証券G本社	2,350,000	280	658,000,000	
野村ホールディングス	5,133,700	311	1,596,580,700	
岡三証券グループ	202,000	261	52,722,000	
丸三証券	80,100	278	22,267,800	
東洋証券	90,000	120	10,800,000	
東海東京HD	272,000	245	66,640,000	
光世証券	60,000	67	4,020,000	
水戸証券	71,000	113	8,023,000	
いちよし証券	53,700	404	21,694,800	
松井証券	140,700	429	60,360,300	
NKSJホールディングス	496,000	1,715	850,640,000	
だいこう証券ビジ	14,800	275	4,070,000	
マネックスG	1,898	13,050	24,768,900	
カブドットコム証券	96,600	251	24,246,600	
極東証券	32,000	546	17,472,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
岩井コスモホールディング	22,600	266	6,011,600	
フィデアホール	136,300	207	28,214,100	
池田泉州HD	976,800	114	111,355,200	
MS & AD	708,900	1,646	1,166,849,400	
SONY FH	227,100	1,301	295,457,100	
小林洋行	5,200	189	982,800	
第一生命	12,684	88,500	1,122,534,000	
東京海上HD	900,400	2,013	1,812,505,200	
アサックス	32	88,300	2,825,600	
NECキャピタルソリューション	8,000	1,232	9,856,000	
T & Dホールディングス	864,300	820	708,726,000	
三井不動産	1,052,000	1,289	1,356,028,000	
三菱地所	1,660,000	1,266	2,101,560,000	
平和不動産	225,500	178	40,139,000	
東京建物	452,000	297	134,244,000	
ダイビル	69,900	535	37,396,500	
サンケイビル	40,900	738	30,184,200	
東急不動産	477,000	334	159,318,000	
京阪神ビルディング	28,600	366	10,467,600	
住友不動産	568,000	1,525	866,200,000	
東宝不動産	25,500	438	11,169,000	
太平洋興発	82,000	83	6,806,000	
大京	364,000	176	64,064,000	
テーオーシー	92,200	404	37,248,800	
東京楽天地	27,000	278	7,506,000	
レオパレス21	183,200	163	29,861,600	
フジ住宅	30,400	395	12,008,000	
空港施設	25,000	369	9,225,000	
明和地所	13,400	357	4,783,800	
住友不動産販売	8,560	3,235	27,691,600	
ゴールドクレスト	21,350	1,381	29,484,350	
東栄住宅	16,000	793	12,688,000	
リロ・ホールディング	7,600	2,056	15,625,600	
日本エスリード	10,200	702	7,160,400	
東急リバブル	21,500	648	13,932,000	
飯田産業	26,800	610	16,348,000	
日神不動産	13,800	456	6,292,800	
アーネストワン	39,100	855	33,430,500	
タカラレーベン	27,100	467	12,655,700	
サンヨーハウジ 名古屋	102	78,000	7,956,000	
イオンモール	108,100	1,731	187,121,100	
フージャースコーポレーション	362	37,850	13,701,700	
タクトホーム	124	65,900	8,171,600	
ランド	24,700	13	321,100	
トーセイ	224	21,250	4,760,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,474	59,000	86,966,000	
サンフロンティア不動産	211	9,230	1,947,530	
ランドビジネス	160	14,820	2,371,200	
東武鉄道	1,365,000	394	537,810,000	
相鉄ホールディングス	386,000	249	96,114,000	
東京急行	1,415,000	377	533,455,000	
京浜急行	618,000	708	437,544,000	
小田急電鉄	771,000	758	584,418,000	
京王電鉄	672,000	572	384,384,000	
京成電鉄	387,000	582	225,234,000	
富士急行	66,000	475	31,350,000	
新京成電鉄	23,000	354	8,142,000	
東日本旅客鉄道	417,900	4,915	2,053,978,500	
西日本旅客鉄道	209,000	3,195	667,755,000	
東海旅客鉄道	2,086	648,000	1,351,728,000	
西日本鉄道	312,000	378	117,936,000	
ハマキョウレックス	6,800	2,251	15,306,800	
サカイ引越センター	4,300	1,716	7,378,800	
近畿日本鉄道	2,172,000	305	662,460,000	
阪急阪神HLDGS	1,613,000	353	569,389,000	
南海電鉄	502,000	351	176,202,000	
京阪電鉄	540,000	388	209,520,000	
名糖運輸	10,500	621	6,520,500	
名古屋鉄道	840,000	219	183,960,000	
日本通運	951,000	305	290,055,000	
ヤマトホールディングス	488,900	1,229	600,858,100	
山 九	291,000	310	90,210,000	
日 新	91,000	208	18,928,000	
丸 運	12,500	203	2,537,500	
丸全昭和運輸	81,000	255	20,655,000	
センコー	96,000	307	29,472,000	
トナミホールディングス	50,000	185	9,250,000	
日本梱包運輸	71,900	822	59,101,800	
日石輸送	28,000	198	5,544,000	
福山通運	146,000	442	64,532,000	
セイノーホールディングス	186,000	592	110,112,000	
神奈川中央交通	25,000	421	10,525,000	
日立物流	50,000	1,290	64,500,000	
日本郵船	1,903,000	218	414,854,000	
商船三井	1,259,000	329	414,211,000	
川崎汽船	742,000	157	116,494,000	
NSユニテッド海運	103,000	141	14,523,000	
乾 汽 船	27,700	346	9,584,200	
明治海運	21,500	390	8,385,000	
飯野海運	116,200	389	45,201,800	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
共栄タンカー	21,000	213	4,473,000	
第一中央汽船	156,000	132	20,592,000	
全日本空輸	3,204,000	245	784,980,000	
パスコ	22,000	304	6,688,000	
国際航業HLDGS	14,000	185	2,590,000	
三菱倉庫	171,000	854	146,034,000	
三井倉庫	112,000	296	33,152,000	
住友倉庫	176,000	370	65,120,000	
渋沢倉庫	58,000	231	13,398,000	
ヤマタネ	118,000	123	14,514,000	
東陽倉庫	40,000	177	7,080,000	
日本トランスシティ	50,000	276	13,800,000	
ケイヒン	45,000	121	5,445,000	
安田倉庫	20,700	495	10,246,500	
東洋埠頭	72,000	146	10,512,000	
宇徳	17,500	298	5,215,000	
上組	266,000	684	181,944,000	
サンリツ	1,700	517	878,900	
キムラユニティー	4,800	709	3,403,200	
キューソー流通システム	8,000	857	6,856,000	
郵船ロジスティクス	18,800	1,123	21,112,400	
近鉄エクスプレス	21,400	2,423	51,852,200	
東海運	16,400	254	4,165,600	
バンテック	28	232,000	6,496,000	
東京放送HD	142,200	1,086	154,429,200	
日本テレビ放送網	20,820	11,780	245,259,600	
テレビ朝日	601	138,000	82,938,000	
スカパーJSAHD	1,803	39,950	72,029,850	
テレビ東京HD	15,200	1,069	16,248,800	
アイ・ティー・シーネットワーク	20,700	501	10,370,700	
イー・アクセス	1,803	18,030	32,508,090	
NECモバイルリング	8,600	2,652	22,807,200	
日本電信電話	1,092,200	3,785	4,133,977,000	
KDDI	3,681	479,500	1,765,039,500	
光通信	21,800	2,024	44,123,200	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,544	137,300	2,683,391,200	
GMOインターネット	70,300	316	22,214,800	
学研ホールディングス	72,000	176	12,672,000	
ゼンリン	34,300	723	24,798,900	
昭文社	14,200	603	8,562,600	
角川グループHLDGS	22,400	2,373	53,155,200	
インプレスホールディングス	19,300	119	2,296,700	
東京電力	1,918,500	198	379,863,000	
中部電力	792,000	1,426	1,129,392,000	
関西電力	980,800	1,256	1,231,884,800	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
中国電力	332,200	1,434	476,374,800	
北陸電力	235,400	1,501	353,335,400	
東北電力	600,500	750	450,375,000	
四国電力	221,300	2,217	490,622,100	
九州電力	530,800	1,109	588,657,200	
北海道電力	224,900	1,116	250,988,400	
沖縄電力	14,400	3,315	47,736,000	
電源開発	149,000	2,045	304,705,000	
東京瓦斯	2,900,000	361	1,046,900,000	
大阪瓦斯	2,332,000	308	718,256,000	
東邦瓦斯	611,000	499	304,889,000	
北海道瓦斯	44,000	277	12,188,000	
西部瓦斯	272,000	214	58,208,000	
静岡瓦斯	62,500	516	32,250,000	
アイネット	10,800	477	5,151,600	
松竹	156,000	797	124,332,000	
東宝	169,600	1,340	227,264,000	
エイチ・アイ・エス	25,500	2,225	56,737,500	
東映	99,000	372	36,828,000	
葵プロモーション	7,500	418	3,135,000	
NTTデータ	1,464	254,400	372,441,600	
共立メンテナンス	12,500	1,549	19,362,500	
イチネンホールディングス	26,500	420	11,130,000	
建設技術研究所	14,000	512	7,168,000	
アインファーマシーズ	13,100	3,595	47,094,500	
燦ホールディングス	5,800	1,494	8,665,200	
スバル興業	3,000	268	804,000	
東京テアトル	96,000	110	10,560,000	
よみうりランド	55,000	253	13,915,000	
東京都競馬	195,000	111	21,645,000	
常磐興産	78,000	104	8,112,000	
カナモト	32,000	781	24,992,000	
東京ドーム	201,000	211	42,411,000	
DTS	24,500	992	24,304,000	
スクウェア・エニックス・HD	77,400	1,468	113,623,200	
シーイーシー	15,700	362	5,683,400	
カプコン	45,400	1,606	72,912,400	
東海観光	108,000	21	2,268,000	
日本空港ビルデング	75,700	1,088	82,361,600	
トランス・コスモス	32,600	1,029	33,545,400	
乃村工藝社	48,000	270	12,960,000	
ジャステック	15,900	464	7,377,600	
SCSK	48,200	1,178	56,779,600	
藤田観光	65,000	259	16,835,000	
近畿日本ツーリスト	79,000	97	7,663,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本管財	9,400	1,457	13,695,800	
トーカイ	10,100	1,732	17,493,200	
白洋舎	5,000	214	1,070,000	
セコム	243,700	3,610	879,757,000	
日本システムウエア	9,100	313	2,848,300	
セントラル警備保障	11,600	814	9,442,400	
アイネス	28,600	600	17,160,000	
丹青社	24,000	221	5,304,000	
メイテック	39,300	1,594	62,644,200	
TKC	20,000	1,608	32,160,000	
アサツー ディ・ケイ	43,800	2,179	95,440,200	
富士ソフト	32,000	1,454	46,528,000	
応用地質	26,600	1,048	27,876,800	
船井総合研究所	26,800	532	14,257,600	
NSD	45,800	670	30,686,000	
進学会	12,700	307	3,898,900	
丸紅建材リース	24,000	194	4,656,000	
コナミ	107,100	1,919	205,524,900	
ベネッセホールディングス	77,800	3,675	285,915,000	
イオンディライト	28,300	1,579	44,685,700	
ナック	6,400	1,495	9,568,000	
福井コンピュータ	1,500	392	588,000	
ニチイ学館	49,000	966	47,334,000	
ダイセキ	40,400	1,402	56,640,800	
日鐵商事	51,000	218	11,118,000	
元気寿司	7,500	999	7,492,500	
トラスコ中山	30,000	1,582	47,460,000	
ヤマダ電機	115,330	5,090	587,029,700	
オートバックスセブン	28,100	3,675	103,267,500	
アークランドサカモト	15,400	1,370	21,098,000	
ニトリホールディングス	46,950	6,870	322,546,500	
グルメ杵屋	15,000	447	6,705,000	
愛眼	19,400	368	7,139,200	
吉野家ホールディングス	645	108,900	70,240,500	
加藤産業	34,200	1,542	52,736,400	
イノテック	13,900	544	7,561,600	
イエローハット	22,300	1,172	26,135,600	
富士エレクトロニクス	12,100	1,176	14,229,600	
松屋フーズ	11,500	1,637	18,825,500	
JBCホールディングス	18,600	533	9,913,800	
JKホールディングス	22,000	389	8,558,000	
サガミチェーン	28,000	535	14,980,000	
日伝	9,900	2,240	22,176,000	
北沢産業	11,000	173	1,903,000	
杉本商事	13,200	735	9,702,000	

平成24年2月7日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
因幡電機産業	28,100	2,260	63,506,000	
住金物産	112,000	221	24,752,000	
プレナス	26,600	1,323	35,191,800	
ミニストップ	17,600	1,421	25,009,600	
アークス	32,500	1,474	47,905,000	
バロー	47,100	1,243	58,545,300	
ミスミグループ本社	87,600	1,843	161,446,800	
江守商事	5,100	912	4,651,200	
アルテック	11,500	211	2,426,500	
ベルク	11,600	1,230	14,268,000	
大庄	11,400	1,050	11,970,000	
タキヒヨー	36,000	454	16,344,000	
ファーストリテイリング	55,400	15,620	865,348,000	
ソフトバンク	1,074,500	2,160	2,320,920,000	
スズケン	91,200	2,312	210,854,400	
サンドラッグ	45,100	2,289	103,233,900	
ジェコス	17,000	340	5,780,000	
ヤマザワ	6,200	1,439	8,921,800	
やまや	3,960	1,118	4,427,280	
ベルーナ	29,350	603	17,698,050	
合計	370,080,934		253,387,727,604	

*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	株数
トヨタ自動車	500,000

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
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	38,720,006,135円
負債総額	89,658,832円
純資産総額 (-)	38,630,347,303円
発行済数量	33,680,144,597口
1口当たり純資産額 (/)	1.1470円

(参考) マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	267,521,714,297円
負債総額	582,151,732円
純資産総額 (-)	266,939,562,565円
発行済数量	239,268,492,047口
1口当たり純資産額 (/)	1.1156円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかか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、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

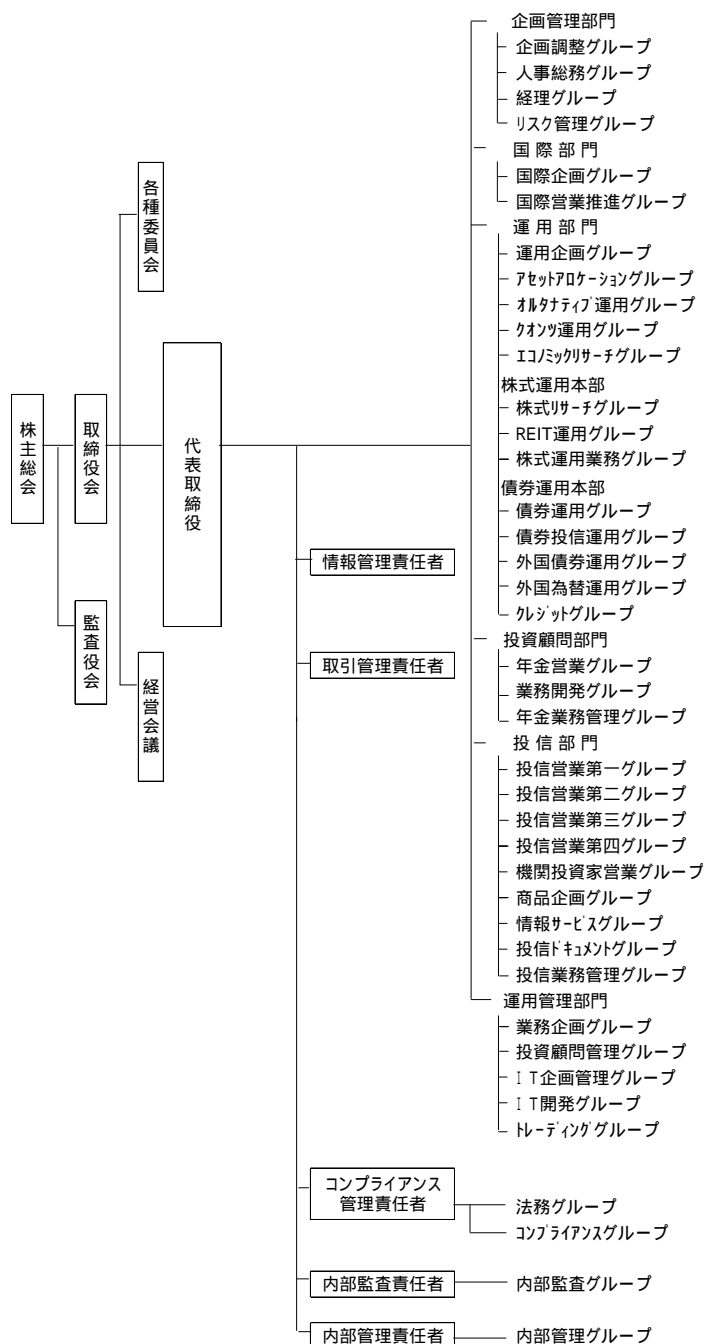
(1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動
該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成24年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

会社の意思決定機構

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

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

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

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

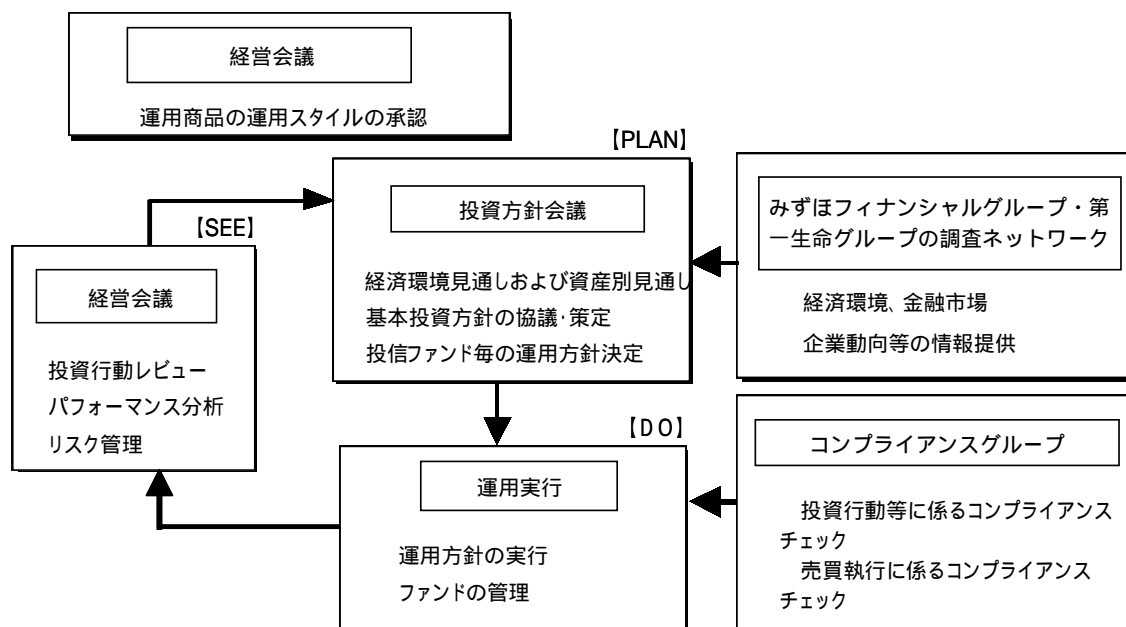
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成24年2月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成24年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は275本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	13	25,098,443,613
追加型株式投資信託	252	4,185,613,693,844
単位型公社債投資信託	9	75,758,017,008
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	407,439,406
合計	275	4,286,877,593,871

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23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27期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23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。

独立監査人の監査報告書


平成22年6月30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

浅野 功 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

近藤 敏弘 

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21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上


独立監査人の監査報告書

平成23年6月10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

浅野 功 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

近藤 敏弘 

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22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	13,820,588	12,220,759
金銭の信託	399,833	5,967,344
前払費用	33,221	27,593
未収委託者報酬	3,169,323	2,942,180
未収運用受託報酬	1,000,785	1,061,935
未収投資助言報酬	2 271,577	2 267,240
未収収益	247,552	186,483
繰延税金資産	383,608	403,201
その他	21,009	102,404
流動資産計	19,347,501	23,179,143
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 237,642	1 183,704
器具備品	1 351,237	1 206,306
建設仮勘定	10,541	10,956
無形固定資産		
商標権	1 804	1 510
ソフトウェア	1 557,870	1 780,190
ソフトウェア仮勘定	397,829	478,971
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 531	1 451
投資その他の資産		
投資有価証券	1,194,081	604,498
関係会社株式	2,161,144	2,457,319
繰延税金資産	403,908	402,191
長期差入保証金	1,187,070	702,696
その他	328,612	85,690
貸倒引当金	26,925	-
固定資産計	6,811,497	5,920,638
資産合計	26,158,999	29,099,782

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	119,466	120,910
未払金	1,526,031	1,479,756
未払収益分配金	7,837	3,223
未払償還金	96,340	98,362
未払手数料	1,206,815	1,134,992
その他未払金	215,038	243,178
未払費用	2 1,522,325	2 1,226,658
未払法人税等	1,283,275	1,706,391
未払消費税等	113,923	143,728
賞与引当金	572,614	575,326
その他	38,231	10,000
流動負債計	5,175,867	5,262,771
固定負債		
退職給付引当金	488,790	579,063
役員退職慰労引当金	96,342	100,260
固定負債計	585,133	679,324
負債合計	5,761,000	5,942,095
(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	15,737,995	18,512,674
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,464,702	4,459,380
株主資本計	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	231,525	216,534
評価・換算差額等計	231,525	216,534
純資産合計	20,397,999	23,157,686
負債・純資産合計	26,158,999	29,099,782

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	26,734,588		24,367,005	
運用受託報酬	4,297,349		4,458,894	
投資助言報酬	1,027,153		1,019,727	
その他営業収益	723,055		789,867	
営業収益計		32,782,146		30,635,495
営業費用				
支払手数料	13,000,141		10,405,593	
広告宣伝費	218,782		272,928	
公告費	1,767		2,297	
調査費	5,056,427		4,755,890	
調査費	2,555,070		2,611,173	
委託調査費	2,501,356		2,144,716	
委託計算費	351,370		338,206	
営業雑経費	679,608		671,721	
通信費	32,088		30,286	
印刷費	613,198		585,041	
協会費	21,225		23,561	
諸会費	41		38	
支払販売手数料	13,054		32,794	
営業費用計		19,308,097		16,446,637
一般管理費				
給料	4,678,614		4,576,265	
役員報酬	1 244,725		1 235,289	
給料・手当	3,840,052		3,768,114	
賞与	593,836		572,860	
交際費	45,342		38,997	
寄付金	3,450		13,335	
旅費交通費	269,516		255,190	
租税公課	85,030		89,571	
不動産賃借料	791,980		718,929	
退職給付費用	132,513		139,773	
固定資産減価償却費	397,252		486,987	
福利厚生費	22,233		20,476	
修繕費	5,615		20,842	
賞与引当金繰入	572,614		575,326	
役員退職慰労引当金繰入	45,086		42,036	
役員退職金	18,129		13,140	
機器リース料	2,191		1,951	
事務委託費	285,449		331,935	
消耗品費	78,753		70,952	
器具備品費	2,046		575	
諸経費	88,728		124,218	
一般管理費計		7,524,549		7,520,506
営業利益		5,949,500		6,668,351

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
	営業外収益			
受取配当金	5,287		4	341,775
受取利息	18,745			9,168
時効成立分配金	157			2,574
投資信託解約益	559,971			157,213
先物利益	-			9,816
金銭の信託運用益	-			69,014
雑収入	3,431			8,602
営業外収益計		587,592		598,165
営業外費用				
為替差損	17,771			755
時効成立後支払分配金	444			-
先物損失	719,577			-
金銭の信託運用損	1,116			-
雑損失	-			6,089
営業外費用計		738,911		6,844
経常利益		5,798,181		7,259,672
特別利益				
貸倒引当金戻入益	-			4,288
過年度損益修正益	-		3, 4	105,241
特別利益計		-		109,530
特別損失				
固定資産除却損	2	21,626	2	31,419
固定資産売却損		2,464		1,440
関係会社株式評価損		-		3,825
特別損失計		24,090		36,684
税引前当期純利益		5,774,091		7,332,518
法人税、住民税及び事業税		2,508,095		2,885,426
法人税等調整額		135,267		7,586
法人税等合計		2,372,828		2,877,839
当期純利益		3,401,263		4,454,678

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	前期末残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	前期末残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	前期末残高	10,040,000	11,650,000
	当期変動額	1,610,000	1,780,000
	当期末残高	11,650,000	13,430,000
	研究開発積立金		
	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	前期末残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	前期末残高	3,299,438	3,464,702
	当期変動額		
	剰余金の配当	1,626,000	1,680,000
	別途積立金の積立	1,610,000	1,780,000
	当期純利益	3,401,263	4,454,678
	当期末残高	3,464,702	4,459,380
	利益剰余金合計		
	前期末残高	13,962,732	15,737,995
	当期変動額	1,775,263	2,774,678
	当期末残高	15,737,995	18,512,674
	株主資本合計		
	前期末残高	18,391,210	20,166,473
	当期変動額	1,775,263	2,774,678
	当期末残高	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	1,547	231,525
	当期変動額(純額)	233,073	14,991
	当期末残高	231,525	216,534
純資産合計			
	前期末残高	18,389,662	20,397,999
	当期変動額	2,008,336	2,759,687
	当期末残高	20,397,999	23,157,686

重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)</p>
<p>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</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> <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>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。</p> <p>6. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</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>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 同左</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 同左</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左</p> <p>5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>6. 引当金の計上基準 (1) 同左</p> <p>(2) 同左</p>

<p style="text-align: center;">第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)</p>
<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準委員会 平成20年7月31日 企業会計基準第19号)を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>7. リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <hr style="width: 20%; margin: 20px auto;"/> <p>(4) 同左</p> <p>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p>

追加情報

<p style="text-align: center;">第25期 (平成22年3月31日現在)</p>	<p style="text-align: center;">第26期 (平成23年3月31日現在)</p>
<p>当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。</p>	<hr style="width: 20%; margin: 20px auto;"/>

注記事項

(貸借対照表関係)

第25期 (平成22年3月31日現在)			第26期 (平成23年3月31日現在)		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物		471,484千円	建物		484,832千円
器具備品		356,326千円	器具備品		499,620千円
商標権		6,882千円	商標権		2,428千円
ソフトウェア		684,370千円	ソフトウェア		809,403千円
電話施設利用権		1,065千円	電話施設利用権		1,145千円
2. 関係会社項目			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。			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。		
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円
流動負債	未払費用	400,075千円	流動負債	未払費用	291,628千円

(損益計算書関係)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
1. 役員報酬の限度額		1. 役員報酬の限度額	
取締役	年額250,000千円	同左	
監査役	年額 50,000千円		
2. 固定資産除却損の内訳		2. 固定資産除却損の内訳	
建物	1,199千円	建物	15,317千円
器具備品	15,159千円	器具備品	3,597千円
ソフトウェア	5,267千円	ソフトウェア	12,503千円
		3. 過年度損益修正益の内訳	
		特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。	
		4. 関係会社項目	
		各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。	
		受取配当金	331,240千円
		過年度損益修正益	105,241千円

(株主資本等変動計算書関係)

第25期(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

第26期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

(リース取引関係)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)																																																																																																		
<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額 相当額及び期末残高相当額</p> <table> <thead> <tr> <th></th> <th>器具備品</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td>90,601千円</td> <td>-</td> <td>90,601千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>相当額</td> <td>75,063千円</td> <td>-</td> <td>75,063千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td>15,538千円</td> <td>-</td> <td>15,538千円</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <thead> <tr> <th></th> <th>1年以内</th> <th>1年超</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>未経過リース料</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td>15,764千円</td> <td>586千円</td> <td>16,350千円</td> </tr> </tbody> </table> <p>当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <table> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td>24,096千円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td>22,727千円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td>845千円</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p> <p>2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <thead> <tr> <th></th> <th>1年以内</th> <th>1年超</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>1,609千円</td> <td>1,475千円</td> <td>3,084千円</td> </tr> </tbody> </table>		器具備品	その他	合計	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	減価償却累計額				相当額	75,063千円	-	75,063千円	期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円		1年以内	1年超	合計	未経過リース料				期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円	支払リース料	24,096千円		減価償却費相当額	22,727千円		支払利息相当額	845千円			1年以内	1年超	合計		1,609千円	1,475千円	3,084千円	<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額 相当額及び期末残高相当額</p> <table> <thead> <tr> <th></th> <th>器具備品</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td>46,681千円</td> <td>-</td> <td>46,681千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>相当額</td> <td>46,138千円</td> <td>-</td> <td>46,138千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td>543千円</td> <td>-</td> <td>543千円</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <thead> <tr> <th></th> <th>1年以内</th> <th>1年超</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>未経過リース料</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td>586千円</td> <td>-</td> <td>586千円</td> </tr> </tbody> </table> <p>当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <table> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td>15,998千円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td>14,995千円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td>234千円</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 同左</p> <p>利息相当額の算定方法 同左</p> <p>2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <thead> <tr> <th></th> <th>1年以内</th> <th>1年超</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>1,475千円</td> <td>-</td> <td>1,475千円</td> </tr> </tbody> </table>		器具備品	その他	合計	取得価額相当額	46,681千円	-	46,681千円	減価償却累計額				相当額	46,138千円	-	46,138千円	期末残高相当額	543千円	-	543千円		1年以内	1年超	合計	未経過リース料				期末残高相当額	586千円	-	586千円	支払リース料	15,998千円		減価償却費相当額	14,995千円		支払利息相当額	234千円			1年以内	1年超	合計		1,475千円	-	1,475千円
	器具備品	その他	合計																																																																																																
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円																																																																																																
減価償却累計額																																																																																																			
相当額	75,063千円	-	75,063千円																																																																																																
期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円																																																																																																
	1年以内	1年超	合計																																																																																																
未経過リース料																																																																																																			
期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円																																																																																																
支払リース料	24,096千円																																																																																																		
減価償却費相当額	22,727千円																																																																																																		
支払利息相当額	845千円																																																																																																		
	1年以内	1年超	合計																																																																																																
	1,609千円	1,475千円	3,084千円																																																																																																
	器具備品	その他	合計																																																																																																
取得価額相当額	46,681千円	-	46,681千円																																																																																																
減価償却累計額																																																																																																			
相当額	46,138千円	-	46,138千円																																																																																																
期末残高相当額	543千円	-	543千円																																																																																																
	1年以内	1年超	合計																																																																																																
未経過リース料																																																																																																			
期末残高相当額	586千円	-	586千円																																																																																																
支払リース料	15,998千円																																																																																																		
減価償却費相当額	14,995千円																																																																																																		
支払利息相当額	234千円																																																																																																		
	1年以内	1年超	合計																																																																																																
	1,475千円	-	1,475千円																																																																																																

(金融商品関係)

第25期 (平成22年3月31日現在)

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

(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

投資有価証券及び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であり、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貸契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。

デリバティブ取引は、投資有価証券及び金銭の信託に係る為替及び市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引及び株価指数先物取引等であります。

(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。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	13,820,588	13,820,588	-
(2) 金銭の信託	399,833	399,833	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	1,111,335	1,111,335	-
(4) 長期差入保証金	61,485	61,485	-
資産計	15,393,243	15,393,243	-
(1) 未払法人税等	1,283,275	1,283,275	-
負債計	1,283,275	1,283,275	-
デリバティブ取引(*)	(38,094)	(38,094)	-

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については()で示しております。

(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。

(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。

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、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。

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(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

非上場株式(貸借対照表計上額82,746千円)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(貸借対照表計上額2,161,144千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、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・保証金等(貸借対照表計上額1,125,584千円)につきましては、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ため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

(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

	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	13,819,459	-	-	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
(3) 長期差入保証金(*)	61,485	-	-	-
合計	13,880,945	-	-	-

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である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・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

(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。

1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(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。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

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

（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

非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）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（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、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（貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、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

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

(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)

第25期 (平成22年3月31日現在)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

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(貸借対照表計上額2,161,144千円)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

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額(千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	368,968	146,101	222,866
債券	-	-	-
その他(投資信託)	716,414	544,802	171,611
小計	1,085,382	690,904	394,477
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)	25,953	30,000	4,047
小計	25,953	30,000	4,047
合計	1,111,335	720,904	390,430

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額82,746千円)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

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
2,070,000	563,988	4,017

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

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（貸借対照表計上額2,457,319千円）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

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	513,129	146,101	367,027
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,400	3,000	400
小計	516,529	149,101	367,427
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,723	10,000	2,277
小計	7,723	10,000	2,277
合計	524,252	159,101	365,150

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
719,016	162,043	4,830

(金銭の信託関係)

第25期 (平成22年3月31日現在)

1. 運用目的の金銭の信託

	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	399,833	838

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。

第26期 (平成23年3月31日現在)

1. 運用目的の金銭の信託

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

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)

第25期 (平成22年3月31日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	22,960	-	743	743
	香港ドル	27,416	-	264	264
	豪ドル	101,481	-	1,076	1,076
	シンガポールドル	14,547	-	154	154
	合計	166,405	-	2,238	2,238

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	561,971	-	29,413	29,413
	合計	561,971	-	29,413	29,413

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 不動産投資信託関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	REIT指数先物取引 売建	104,418	-	6,442	6,442
	合計	104,418	-	6,442	6,442

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

2. 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。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。
2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

	第25期 (平成22年3月31日現在) (千円)
(1) 退職給付債務	530,305
(2) 未認識数理計算上の差異	41,515
退職給付引当金	488,790

3. 退職給付費用に関する事項

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) (千円)
(1) 勤務費用	82,653
(2) 利息費用	6,471
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	5,402
(4) 確定拠出年金 拠出額	37,987
退職給付費用	132,513

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第25期 (平成22年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

	第26期 (平成23年3月31日現在) (千円)
(1) 退職給付債務	636,624
(2) 未認識数理計算上の差異	57,560
退職給付引当金	579,063

3. 退職給付費用に関する事項

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) (千円)
(1) 勤務費用	85,216
(2) 利息費用	7,954
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	9,383
(4) 確定拠出年金 拠出額	37,218
退職給付費用	139,773

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第26期 (平成23年3月31日)
(1) 割引率 (%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数 (年)	5

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	108,541	128,299
未払事業所税	6,290	6,141
賞与引当金	233,054	234,157
未払法定福利費	26,912	28,823
未払確定拠出年金掛金	2,712	2,739
減価償却超過額	17,598	36,256
減価償却超過額(一括償却資産)	6,098	3,039
繰延資産償却超過額(税法上)	89,657	139,027
退職給付引当金	198,937	235,678
役員退職慰労引当金	39,211	40,806
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	66,421	763
関係会社株式評価損	-	1,556
貸倒引当金繰入額	14,840	-
繰延税金資産合計	815,851	862,867
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	28,334	57,474
繰延税金負債合計	28,334	57,474
差引繰延税金資産の純額	787,517	805,393

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

第25期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第26期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第26期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(追加情報)

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」(企業会計基準第17号 平成21年3月27日)及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日)を適用しております。

(関連当事者との取引)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

(1) 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残 高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200 億円 (基金 償却積 立金)	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運 用及び助 言、当社 設定投信 の販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	711,279	未収投資 助言報酬	190,025
								販売手数料 の支払	13,054		
								保険料の支 払	6,572		

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) 支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

(注5) 平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。

新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(2) 子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資産 の運用の顧問 料の支払	785,924	未払 費用	296,169
	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	244,629	未払 費用	98,673

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	1,434,905 90,148 199	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	122,995 412,513 -
	株式会社 みずほ コーポ レート銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	613,204 1,133,958 16,966	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	104,436 12,572,634 1,071
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	247,604 48,770	未払 費用 未払 費用	113,245 36,277
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	401,000 130	金銭の 信託	399,833

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

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

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

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

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

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

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) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税が含まれております。
- (注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭	1株当たり純資産額 964,903円60銭 1株当たり当期純利益金額 185,611円60銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

(注) 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25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)


第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
_____	_____


独立監査人の中間監査報告書


平成23年12月9日

DIAM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 三彦 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 浅野 功 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 近藤 敏弘 

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DIAMアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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、DIAMアセットマネジメント株式会社の平成23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23年4月1日から平成23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

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,268,020
金銭の信託		5,629,150
前払費用		59,568
未収委託者報酬		2,810,956
未収運用受託報酬		1,659,443
未収投資助言報酬		313,603
未収収益		243,409
繰延税金資産		375,975
その他		20,513
	流動資産計	22,380,642
固定資産		
有形固定資産		381,897
建物	1	168,959
器具備品	1	173,255
建設仮勘定		39,682
無形固定資産		1,279,779
商標権	1	430
ソフトウェア	1	1,082,772
ソフトウェア仮勘定		189,016
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	411
投資その他の資産		4,173,376
投資有価証券		388,843
関係会社株式		2,457,319
繰延税金資産		542,108
長期差入保証金		702,696
その他		82,408
	固定資産計	5,835,053
資産合計		28,215,695

(単位：千円)

	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	45,556
未払金	1,335,271
未払収益分配金	3,223
未払償還金	95,222
未払手数料	1,089,997
その他未払金	146,827
未払費用	1,253,226
未払法人税等	1,383,356
未払消費税等	121,733
前受収益	4,659
賞与引当金	566,648
流動負債計	4,710,452
固定負債	
退職給付引当金	616,545
役員退職慰労引当金	118,905
固定負債計	735,451
負債合計	5,445,903
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	18,252,663
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	15,630,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,999,370
株主資本計	22,681,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	88,650
評価・換算差額等計	88,650
純資産合計	22,769,792
負債・純資産合計	28,215,695

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,186,600	
運用受託報酬	2,427,618	
投資助言報酬	487,590	
その他営業収益	367,965	
営業収益計		15,469,773
営業費用		
支払手数料	5,317,217	
広告宣伝費	77,160	
調査費	2,399,769	
調査費	1,478,893	
委託調査費	920,876	
委託計算費	170,060	
営業雑経費	274,550	
通信費	13,894	
印刷費	212,477	
協会費	12,507	
諸会費	19	
支払販売手数料	35,652	
営業費用計		8,238,758
一般管理費		
給料	2,023,999	
役員報酬	123,681	
給料・手当	1,900,318	
交際費	15,479	
寄付金	3,156	
旅費交通費	98,767	
租税公課	46,092	
不動産賃借料	322,850	
退職給付費用	73,794	
固定資産減価償却費	1 228,152	
福利厚生費	15,312	
修繕費	3,575	
賞与引当金繰入	566,648	
役員退職慰労引当金繰入	26,763	
役員退職金	528	
機器リース料	828	
事務委託費	174,574	
消耗品費	28,721	
器具備品費	671	
諸経費	52,322	
一般管理費計		3,682,240
営業利益		3,548,774

(単位：千円)

	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	57,123	
受取利息	2,091	
雑収入	3,855	
営業外収益計		63,070
営業外費用		
為替差損	1,209	
時効成立後支払分配金	36	
金銭の信託運用損	337,781	
雑損失	997	
営業外費用計		340,025
経常利益		3,271,819
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	1,959	
特別利益計		1,959
特別損失		
固定資産除却損	5,729	
固定資産売却損	381	
特別損失計		6,111
税引前中間純利益		3,267,666
法人税、住民税及び事業税		1,344,597
法人税等調整額		24,919
法人税等合計		1,319,677
中間純利益		1,947,989

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	13,430,000
	当中間期変動額	2,200,000
	当中間期末残高	15,630,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	4,459,380
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	2,208,000
	別途積立金の積立	2,200,000
	中間純利益	1,947,989
	当中間期末残高	1,999,370
	利益剰余金合計	
	当期首残高	18,512,674
	当中間期変動額	260,010
	当中間期末残高	18,252,663
	株主資本合計	
	当期首残高	22,941,152
	当中間期変動額	260,010
	当中間期末残高	22,681,141
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	216,534
	当中間期変動額(純額)	127,883
	当中間期末残高	88,650
純資産合計		
	当期首残高	23,157,686
	当中間期変動額	387,894
	当中間期末残高	22,769,792

重要な会計方針

項目	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23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（リース資産を除く）：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 器具備品 ... 2～20年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：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。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。

8. 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

<p>第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)</p>
<p>当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第27期中間会計期間末 (平成23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: 15%;">建物</td> <td style="width: 10%;">...</td> <td style="width: 10%;">499,974千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>531,842千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td>...</td> <td>2,508千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td>...</td> <td>798,730千円</td> </tr> <tr> <td>電話施設利用権</td> <td>...</td> <td>1,185千円</td> </tr> </table>	建物	...	499,974千円	器具備品	...	531,842千円	商標権	...	2,508千円	ソフトウェア	...	798,730千円	電話施設利用権	...	1,185千円
建物	...	499,974千円														
器具備品	...	531,842千円														
商標権	...	2,508千円														
ソフトウェア	...	798,730千円														
電話施設利用権	...	1,185千円														

(中間損益計算書関係)

項目	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%;">...</td> <td style="width: 10%;">64,964千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td>...</td> <td>163,188千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	64,964千円	無形固定資産	...	163,188千円
有形固定資産	...	64,964千円					
無形固定資産	...	163,188千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第27期中間会計期間(自平成23年4月1日 至平成23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23年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

(リース取引関係)

第27期中間会計期間(自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)		
1. ファイナンス・リース取引		
(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)		
リース資産の内容 該当事項はありません。		
リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「4. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。		
(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)		
リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額 該当事項はありません。		
未経過リース料中間期末残高相当額 該当事項はありません。		
当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額		
支払リース料	588千円	
減価償却費相当額	543千円	
支払利息相当額	1千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。		
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。		
2. オペレーティング・リース取引		
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料中間期末残高相当額		
<u>1年以内</u>	<u>1年超</u>	<u>合計</u>
670千円	-	670千円

(金融商品関係)

第27期中間会計期間末(平成23年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成23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	11,268,020	11,268,020	-
(2) 金銭の信託	5,629,150	5,629,150	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	308,597	308,597	-
資産計	17,205,769	17,205,769	-
(1) 未払法人税等	1,383,356	1,383,356	-
負債計	1,383,356	1,383,356	-

(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

非上場株式(中間貸借対照表計上額80,246千円)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(中間貸借対照表計上額2,457,319千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、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(中間貸借対照表計上額702,696千円)につきましては、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ため、記載しておりません。

(有価証券関係)

第27期中間会計期間末（平成23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2,457,319千円）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	298,359	146,101	152,257
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,118	3,000	118
小計	301,478	149,101	152,376
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,119	10,000	2,881
小計	7,119	10,000	2,881
合計	308,597	159,101	149,495
(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27期中間会計期間末（平成23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 該当事項はありません。	

(セグメント情報等)

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23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	12,186,600	2,915,208	367,965	15,469,773

(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。

(持分法損益等)

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)		
1株当たり純資産額	948,741円	34銭
1株当たり中間純利益金額	81,166円	22銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
中間純利益	1,947,989千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,947,989千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。

・株券不発行に伴う対応および役付取締役(取締役会長職)追加に伴う変更

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>

運用の基本方針

約款第17条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動する投資成果を目指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。)の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 有価証券等の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかるオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
- 5) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >
約款

< 信託の種類、委託者および受託者 >

第1条 この信託は、証券投資信託であり、D I A Mアセットマネジメント株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

< 信託事務の委託 >

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

< 信託の目的、金額および限度額 >

第3条 委託者は、金100万円を、受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行った時は、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 3) 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

< 信託期間 >

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第45条第7項、第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項および第51条第2項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

< 受益権の分割および再分割 >

第5条 委託者は、第3条第1項によって生じた受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第10条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- 2) 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

< 受益権の帰属と受益証券の不発行 >

第6条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。)の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)及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、以下「振替機関等」といいます。)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。)

- 2) 委託者は、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、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、委託者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なわないものとします。

- 3) 委託者は、第5条の規定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、委託者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せん。

- 4) 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権(受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。)を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。)および登録金融機関(委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)に当該申請の手続きを委任することが

できます。

< 受益権の設定に係る受託者の通知 >

第7条 受託者は、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せん。

< 受益権の取得申込の勧誘の種類 >

第8条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

< 当初の受益者 >

第9条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

< 追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法 >

第10条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- 2) この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。
- 3) なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- 4) 第26条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 信託日時の異なる受益権の内容 >

第11条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

< 受益権の申込み単位、価額および手数料 >

第12条 委託者の指定する証券会社（証券取引法第2条第9項に規定する証券会社をいい、外国証券業者に関する法律第2条第2号に規定する外国証券会社を含みます。以下同じ。）および登録金融機関（証券取引法第65条の2第3項に規定する登録金融機関といいます。以下同じ。）は、第5条の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に対して、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- 2) 前項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- 3) 第1項の受益権の取得価額は、取得申込日の基準価額に、第4項に規定する手数料ならびに当該手数料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。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1口につき1円に、第3項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- 4) 前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については1口につき1円とします。）に乘じて得た金額とします。
- 5) 前各項の規定にかかわらず委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第42条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 6) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付けを取消することができるものとします。

< 受益権の譲渡に係る記載または記録 >

第13条 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。

- 2) 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録す

るものとし、ただし、前項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なわれるよう通知するものとし、

- 3) 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者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。

< 受益権の譲渡の対抗要件 >

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

< 投資の対象とする資産の種類 >

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、

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20条、第21条に定めるものに限ります。）
 - 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

< 運用の指図範囲等 >

第16条 委託者は、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者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド（「以下「マザーファンド」といいます。」の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 12. 外国貸付債権信託受益権（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 13. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 14. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 15. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 16. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 17. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 18. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 19. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第11号ならびに第14号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第11号および第14号の証券または証書のうち第2号から第6号までの性質を有するものを以下「公社債」といいます。
- 2) 委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図する

ことができます。

1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 3) 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と定めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

<運用の基本方針>

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第18条 委託者が投資することを指図する株式は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

<信用取引の指図範囲>

第19条 委託者は、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。

- 2) 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

<先物取引等の運用指図・目的>

第20条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。))および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。))ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。))

- 2) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における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。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 4) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

第22条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- 3) 委託者は、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。

< 外貨建資産への投資制限 >

第23条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の10を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

- 2) 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

< 特別の場合の外貨建資産への投資制限 >

第24条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

< 外貨為替予約の指図 >

第25条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

< 保管業務の委任 >

第26条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

< 有価証券の保管 >

第27条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

< 混蔵寄託 >

第28条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を終結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

< 一括登録 >

第29条 (削除)

< 信託財産の登記等および記載等の留保等 >

第30条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- 2) 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- 3) 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- 4) 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第31条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第32条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第33条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第34条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- 2) 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- 3) 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第36条 この信託の計算期間は、原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。ただし、第1計算期間は平成14年11月15日から平成16年2月9日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

- 2) 前項にかかわらず、前項の原則により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、計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<信託財産に関する報告>

第37条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 2) 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

<信託事務の諸費用>

第38条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年8月7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中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで ……年10,000分の25
2. 平成17年10月1日から信託終了の日まで ……年10,000分の22
- 2) 前項の信託報酬は、毎年8月7日（休業日のときは翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
- 3) 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

< 収益の分配方式 >

第40条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品賃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（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

< 収益分配金、償還金および一部解約金の委託者への払込みと支払いに関する受託者の免責 >

第41条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第43条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第43条第2項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

2) 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

< 収益分配金の再投資等 >

第42条 収益分配金については、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

2) 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末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委託者の指定する証券会社または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行ないます。当該売付けにより増加した受益権は、第6条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

3) 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

4) 第3項および第43条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

< 償還金および一部解約金の支払い >

第43条 償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行な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委託者の指定する証券会社または登録金融機関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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

2) 一部解約金は、第45条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。

3) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。

4) 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

< 償還金の時効 >

第44条 受益者が、信託終了による償還金について第43条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払い

を請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

< 信託契約の一部解約 >

第45条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- 2) 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。
- 3) 委託者は、第1項の一部解約の実行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。なお、前項の一部解約の実行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者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なわれます。
- 4) 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額とします。
- 5) 委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込の受け付けを取消すことができます。
- 6) 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。
- 7) 委託者は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、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、第47条の規定を準用するものとします。

< 質権口記載又は記録の受益権の取り扱い >

第46条 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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

< 信託契約の解約 >

第47条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 6) 第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

< 信託契約に関する監督官庁の命令 >

第48条 委託者は、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。

- 2) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第52条の規定にしたがいます。

< 委託者の登録取消等に伴う取扱い >

第49条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- 2) 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第52条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会

社と受託者との間において存続します。

< 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い >

第50条 委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

2) 委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

< 受託者の辞任に伴う取扱い >

第51条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第52条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

2) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

< 信託約款の変更 >

第52条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

5) 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

< 反対者の買取請求権 >

第53条 第47条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第47条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

< 公告 >

第54条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 信託約款に関する疑義の取扱い >

第55条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

附則第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

附則第2条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条から第19条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

附則第3条 第21条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

附則第4条 第21条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在

価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 14 年 11 月 15 日 （信託契約締結日）

委託者	興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社
受託者	みずほ信託銀行株式会社

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

運用の基本方針

約款第 14 条に基づき委託者の定める方針は、次のものとしします。

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- 1) 主として東京証券取引所第 1 部に上場されている株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の 50% 以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の 10% 以下とします。
- 6) 有価証券等の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 有価証券先物取引等は約款第 17 条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第 18 条の範囲で行います。

用語説明

・基準価額	投資信託に組み入れている株式や債券などをすべて計算日の時価で評価し、債券の利息や株式の配当金などの収入を加えて資産総額を算出。そこから投資信託の運用に必要な経費等を差し引いて純資産総額を出し、さらに計算日の受益権口数で割ったものです。
・解約価額	解約時の基準価額から信託財産留保額を控除した価額。
・信託財産留保額	解約によって組入証券など売却費用についての受益者間の公平性を図るため、途中換金によって解約した受益者から徴収するものです。この留保額はその投資信託の信託財産に留保され、基準価額に反映されます。
・信託報酬	投資信託の運営の中で販売会社、委託会社、受託会社が果たす役割・業務の報酬として、信託財産から差し引かれ、販売会社、委託会社、受託会社に支払われる報酬のことをいいます。
・信託約款	委託会社と受託会社の間で取り交わされた信託契約の具体的な内容を記した契約書のことです。委託会社と受託会社および受益者の権利、運用方針・投資制限などが規定されています。
・ファンドマネジャー (運用担当者)	投資信託の運用を行う担当者。複数のファンドマネジャーが一つのファンドの運用に携わる場合もあります。