

DIAM国内株式パッシブ・ファンド

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。

<委託会社> [ファンドの運用の指図を行う者]

DIAMアセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者登録番号/関東財務局長(金商)第324号

<受託会社> [ファンドの財産の保管および管理を行う者]

みずほ信託銀行株式会社

ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)を含む詳細な情報は下記委託会社への照会先までお問い合わせください。投資信託説明書(請求目論見書)は、委託会社のホームページで閲覧できる他、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。

また、本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は投資信託説明書(請求目論見書)に添付されております。

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/>

| 商品分類 | | | | 属性区分 | | | | |
|---------|--------|---------------|---------|-------------------|------|--------|-----------|----------|
| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産(収益の源泉) | 補足分類 | 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 |
| 追加型 | 国内 | 株式 | インデックス型 | その他資産(投資信託証券(株式)) | 年1回 | 日本 | ファミリーファンド | TOPIX |

※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。
商品分類および属性区分の定義については、投資信託協会ホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)にてご確認ください。

| ＜委託会社の情報＞ | |
|------------------------|-----------------------|
| 委託会社名 | D I A Mアセットマネジメント株式会社 |
| 設立年月日 | 1985年7月1日 |
| 資本金 | 20億円 |
| 運用する投資信託財産の 合計純資産総額 | 4兆1,679億円 |
| | (2011年10月31日現在) |

- 「DIAM国内株式パッシブ・ファンド」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1月12日に関東財務局長に提出しており、2012年1月13日にその効力が発生しております。
- 当ファンドは、商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- 当ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法に基づき受託会社の固有財産等との分別管理等がされています。
- 販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの販売会社、ファンドの基準価額等については、前記の委託会社への照会先までお問い合わせください。
- ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

1. ファンドの目的・特色

ファンドの目的

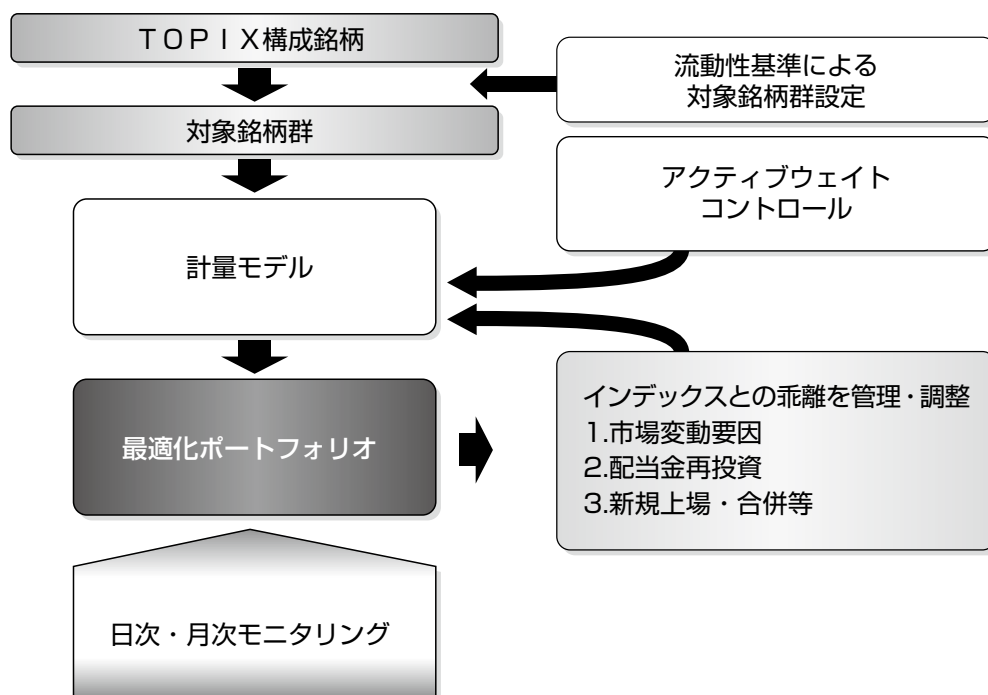
東証株価指数(TOPIX)(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

ファンドの特色

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

*東証株価指数(TOPIX)は、東証の知的財産であり、これらの指数の算出、指数の公表、利用など同指数に関する権利は東証が有しています。東証株価指数(TOPIX)の算出においては、電子計算機の障害または天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、その算出を延期または中止する場合があります。また、東証は、同指数がいかなる場合においても真正であることを保証するものではなく、同指数の算出において、指数に誤謬が発生しても、東証は一切その賠償の責めを負いません。

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



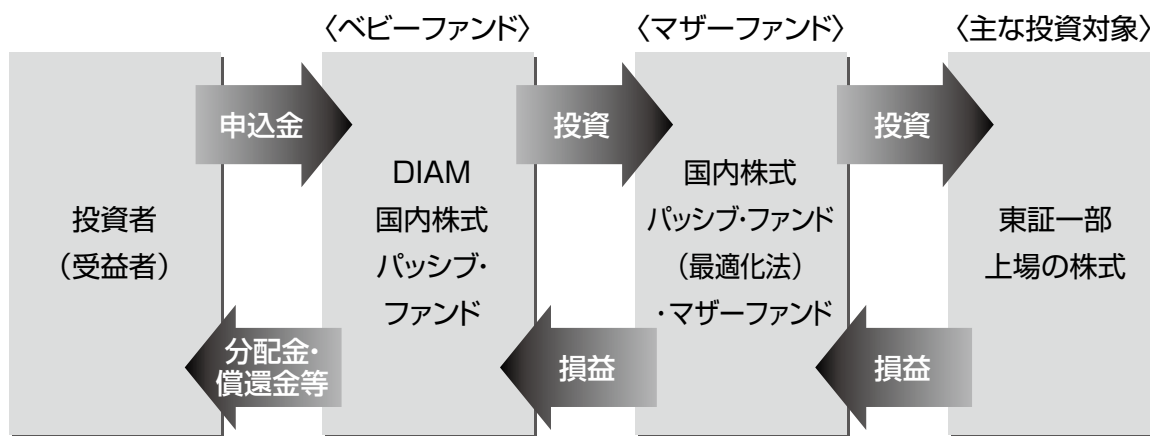
- ③ 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

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。

1. ファンドの目的・特色

ファンドの仕組み

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。



主な投資制限

- ①マザーファンドへの投資割合には、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外貨建資産への投資は行いません。

分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、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。

マザーファンドの概要

| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | |
|--|--|
| 主要投資対象 | |
| 東京証券取引所第1部に上場されている株式 | |
| 投資態度 | |
| <ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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。 ・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。 ・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。 ・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。 | |
| 投資制限 | |
| <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には、制限を設けません。 | |
| 資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。 | |

2. 投資リスク

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

※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

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。

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

●信用リスク

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

分配金に関する留意点

- 収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。))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。

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）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。当該インデックス構成銘柄を組入れない場合があること、資金流出から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

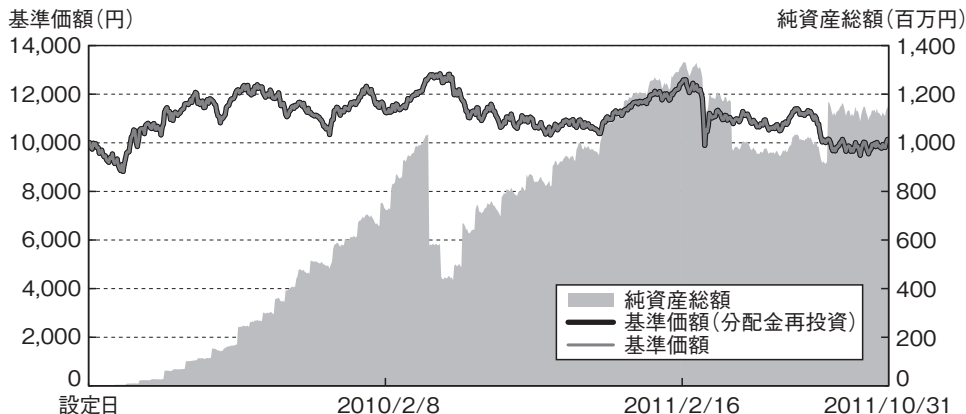
リスクの管理体制

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

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

基準価額・純資産の推移

《設定日(2009年1月30日)~2011年10月31日》



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

分配の推移(税引前)

| | |
|-----------------|----|
| 第1期(2009.10.13) | 0円 |
| 第2期(2010.10.12) | 0円 |
| 第3期(2011.10.12) | 0円 |
| 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 | 100.03 |

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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 | 97.52 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 2.48 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

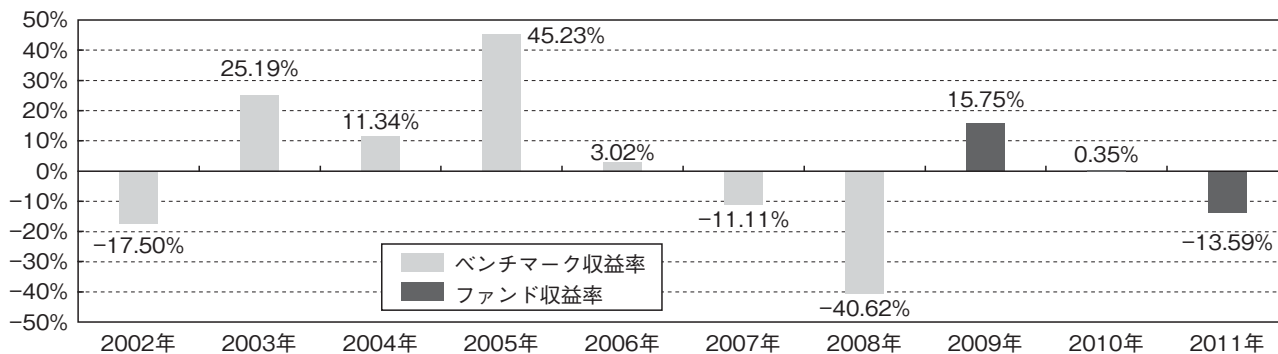
組入上位10銘柄

| 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 | 3.18 |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 2.41 |
| 3 | キヤノン | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2.09 |
| 4 | 本田技研 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 1.90 |
| 5 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.72 |
| 6 | 三井住友フィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.55 |
| 7 | みずほフィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.32 |
| 8 | 武田薬品 | 株式 | 日本 | 医薬品 | 1.30 |
| 9 | ファナック | 株式 | 日本 | 電気機器 | 1.26 |
| 10 | 三菱商事 | 株式 | 日本 | 卸売業 | 1.10 |

組入上位5業種(株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|--------|---------|
| 1 | 電気機器 | 13.91 |
| 2 | 輸送用機器 | 9.33 |
| 3 | 銀行業 | 8.96 |
| 4 | 情報・通信業 | 6.63 |
| 5 | 化学 | 5.96 |

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して算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2009年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※2008年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」です。

○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
 ○当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
 ○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

4. 手続・手数料等

お申込みメモ

| | |
|------------------------|---|
| 購 入 単 位 | 各販売会社が定める単位(当初元本: 1口=1円) |
| 購 入 価 額 | お申込日の基準価額とします。 |
| 購 入 代 金 | お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに購入代金を販売会社に支払うものとします。 |
| 換 金 単 位 | 各販売会社が定める単位 |
| 換 金 価 額 | 換金のお申込日の基準価額とします。 |
| 換 金 代 金 | 原則として換金のお申込日より起算して4営業日目から支払います。 |
| 申 込 締 切 時 間 | 原則として販売会社の毎営業日の午後2時までとします。 |
| 購 入 の 申 込 期 間 | 2012年1月13日~2013年1月11日 ※上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。 |
| 換 金 制 限 | 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。 |
| 購入・換金申込受付の中止 および取消し | 金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。 |
| 信 託 期 間 | 無期限です。(設定日:2009年1月30日) |
| 繰 上 償 還 | 次のいずれかに該当する場合等には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了する場合があります。 ① 受益権口数が10億口を下回ることとなった場合。 ② 受益者のために有利であると認めるとき。 ③ 対象インデックスが改廃された場合。 ④ やむを得ない事情が発生したとき。 |
| 決 算 日 | 原則として毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日) |
| 収 益 分 配 | 年1回、毎決算日に、収益分配方針に基づき、収益分配を行います。 ※「分配金受取コース」の場合、決算日から起算して原則として5営業日までにお支払いを開始します。 ※「分配金自動けいぞく投資コース」の場合、税引後、無手数料で自動的に全額が再投資されます。 |
| 信 託 金 の 限 度 額 | 5,000億円とします。 |
| 公 告 | 日本経済新聞に掲載します。 |
| 運 用 報 告 書 | 毎年10月のファンドの決算時および償還時に運用報告書を作成し、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けいたします。 ※委託会社のホームページにおいても開示しております。(URL http://www.diam.co.jp/) |
| 課 税 関 係 | 課税上は、株式投資信託として取り扱われます。 ※益金不算入制度、配当控除の適用はありません。 |
| 基準価額の照会方法 | 基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせいただくか、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。 (委託会社の略称:DIAM、当ファンドの略称:パ国内株) |

4. 手続・手数料等

ファンドの費用・税金

ファンドの費用

| 投資者が直接的に負担する費用 | | | | | |
|---------------------|---|------|----|------------------------------------|------------------------|
| 購入時手数料 | ありません。 | | | | |
| 信託財産留保額 | ありません。 | | | | |
| 投資者が信託財産で間接的に負担する費用 | | | | | |
| 運用管理費用 (信託報酬) | <p>ファンドの日々の純資産総額に対して年0.63%(税抜0.60%)の率を乗じて得た額とします。また、運用管理費用(信託報酬)の配分は下記の通りとします。ファンドの運用管理費用(信託報酬)は、日々の基準価額に反映され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。</p> | | | | |
| | 時期 | 項目 | 費用 | | |
| | 毎日 | 信託報酬 | 総額 | 信託財産の純資産総額に対して 年率0.63%(税抜0.60%) | |
| | | | 配分 | 委託会社 | 年率0.5775% (税抜0.55%) |
| 販売会社 | | | | 年率0.021% (税抜0.02%) | |
| 受託会社 | 年率0.0315% (税抜0.03%) | | | | |
| その他費用・手数料 | <p>組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用に要する諸費用等がお客様の保有期間中、その都度かかります。 ※これらの費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を示すことができません。</p> | | | | |

※当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することができません。

税金

| 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、2011年10月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※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。