

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成23年2月14日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 石橋 俊朗

【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
連絡場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【電話番号】 03-5695-2111

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** D I R 日本株総合インデックス・ファンド
<愛称：D S I >

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】** 継続申込期間（平成23年2月15日から平成23年5月6日まで）
5兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

DIR日本株総合インデックス・ファンド<愛称：DSI>

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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、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、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。）。委託会社は、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。

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なわないものとします。

(3) 【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、1.3125%（税抜1.25%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

(6) 【申込単位】

1,000万口以上100万口単位とします。

(7) 【申込期間】

平成23年2月15日から平成23年5月6日まで（継続申込期間）

（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。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、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に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込金額に利息は付きません。

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扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、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します。

- ・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・記録によって行なわれますので、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、株式会社大和総研（D I R）が算出・公表するわが国の株式市場全体の値動きを表わす「D S I - 2 日本株総合インデックス」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	株式 一般
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	対象インデックス	その他の指数（D S I - 2 日本株総合インデックス）

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...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なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）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
- ・「株式」...目論見書等において、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
- ・「インデックス型」...目論見書等において、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

(注2) 属性区分の定義

- ・「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」...目論見書等において、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
- ・「その他の指数」...日経225、T O P I Xにあてはまらないすべてのもの

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・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 わが国の株式に投資し、わが国の株式市場全体の値動きを表わす「DSI-2 日本株総合インデックス」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「DSI-2 日本株総合インデックス」^(注)について



大和日本株インデックス (DSI) は、浮動株考慮の流通時価総額ベースで算出されるDSI-1および上場時価総額ベースで算出されるDSI-2の総称で、当ファンドが連動する投資成果をめざすのは、上場時価総額ベースで算出されるDSI-2の「日本株総合インデックス」です。

開発主体：大和証券キャピタル・マーケット株式会社および株式会社大和総研 (DIR) が共同開発。
対象ユニバース：東京証券取引所市場第一部・第二部、大阪証券取引所市場第一部・第二部、名古屋証券取引所市場第一部・第二部、東証マザーズ、JASDAQ、セントレックスに上場されている全銘柄（ただし、日本銀行および外国株を除く普通株）。

起点（基準日）：1979年12月末（1983年12月末＝100）。

算出方法：配当込みの時価総額加重型のインデックス。株価は対象銘柄の終値。

対象銘柄の異動：新規公開銘柄の追加は年2回（6月末と12月末）、上場廃止は発生日。

- ・上場時価総額は、 $\text{上場時価総額} = (\text{発行済株式総数} - \text{優先株} \cdot \text{後配株} \cdot \text{政府保有分}) \times \text{株価}$ による。

(注) 「DSI-2 日本株総合インデックス」の名称および内容は、変更となる場合があります。また、「DSI-2 日本株総合インデックス」の改廃に伴い、上記の運用内容が変更となる場合があります。「DSI-2 日本株総合インデックス」は、株式会社大和総研 (DIR) が算出・公表しています。

- ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式および株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- ・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、インデックスが改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記1.の運用が行なわれないことがあります。

2 毎年2月15日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益配分方針に基づいて収益の分配を行ないます。

<配分方針>

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②原則として、配当等収益等を中心に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成 12年 7月28日
平成 22年 7月 9日信託契約締結、当初設定、運用開始
信託期間終了日を平成25年2月15日に変更（当初は平成23年2月15日）

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金、償還金など お申込金(3)	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(1)に基づき、次の業務を行ないます。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
1	収益分配金、償還金など お申込金(3)	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図	損益 信託金(3)	
2	住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など
	損益 投資	
投資対象	わが国の公開されている株式 など	

1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、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に払込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（平成22年11月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・ 沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17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
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

・大株主の状況

名称	住所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

わが国の公開されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．株式会社大和総研（D I R）が算出・公表するわが国の株式市場全体の値動きを表わす「D S I - 2 日本株総合インデックス」の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ．運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式および株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、インデックスが改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 【投資対象】

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券と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. 特定目的会社にかかる特定社債券(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かかる優先出資証券(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. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 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。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 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。)
19. 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。)
20. 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
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前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、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 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5.の権利の性質を有するもの

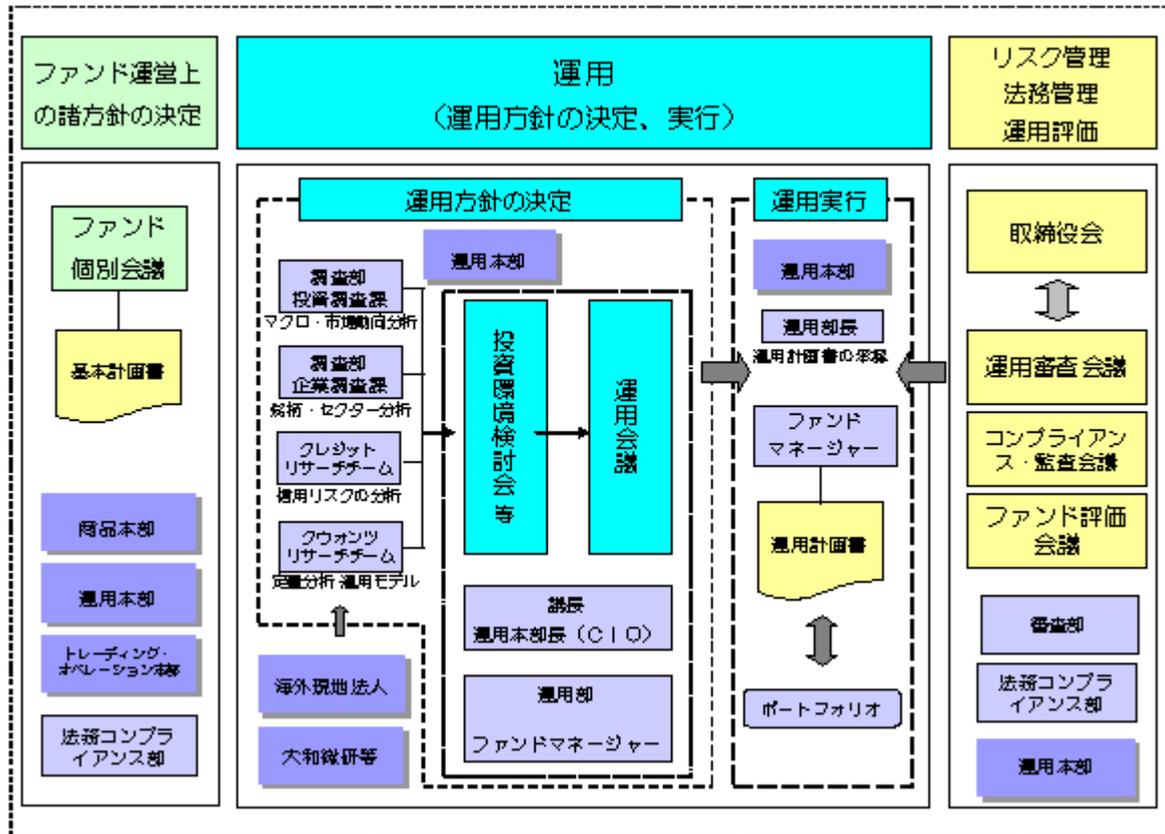
前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運

用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前記の1.から4.までの金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者である運用本部長（CIO）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．運用本部長（ＣＩＯ）（１名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ ファンド運用に関する組織運営
- ・ ファンドマネージャーの任命・変更
- ・ 運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・ 各ファンドの分配政策の決定
- ・ 代表取締役に対する随時的的確な状況報告
- ・ その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．運用副本部長（１～５名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に１名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

受託会社に対する管理体制

信託財産の管理業務を通じて、受託会社の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、年次で受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受けています。

上記の運用体制は平成22年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、配当等収益等を中心に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等（信託約款）

委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

投資信託証券（信託約款）

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

投資する株式等の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所（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号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．前イ．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

信用取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

ロ．信用取引の指図は、次の1.から6.まで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なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1．信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等（信託約款）

イ. 委託会社は、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。）、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。）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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行な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。）。

ロ. 委託会社は、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なうことの指図をすることができます。

スワップ取引（信託約款）

イ. 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、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ. 委託会社は、スワップ取引を行な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なうものとします。

金利先渡取引（信託約款）

イ. 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、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ. 委託会社は、金利先渡取引を行な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なうものとします。

同一銘柄の転換社債等（信託約款）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額が、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。

有価証券の貸付け（信託約款）

イ．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範囲内で貸付けること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の50%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。

ロ．前イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみ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。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、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なわないものとします。

ロ．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解約代金入金日までの間もしくは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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式など値動きのある証券に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社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。

投資家のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

その他

- イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
- ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性が制限される場合

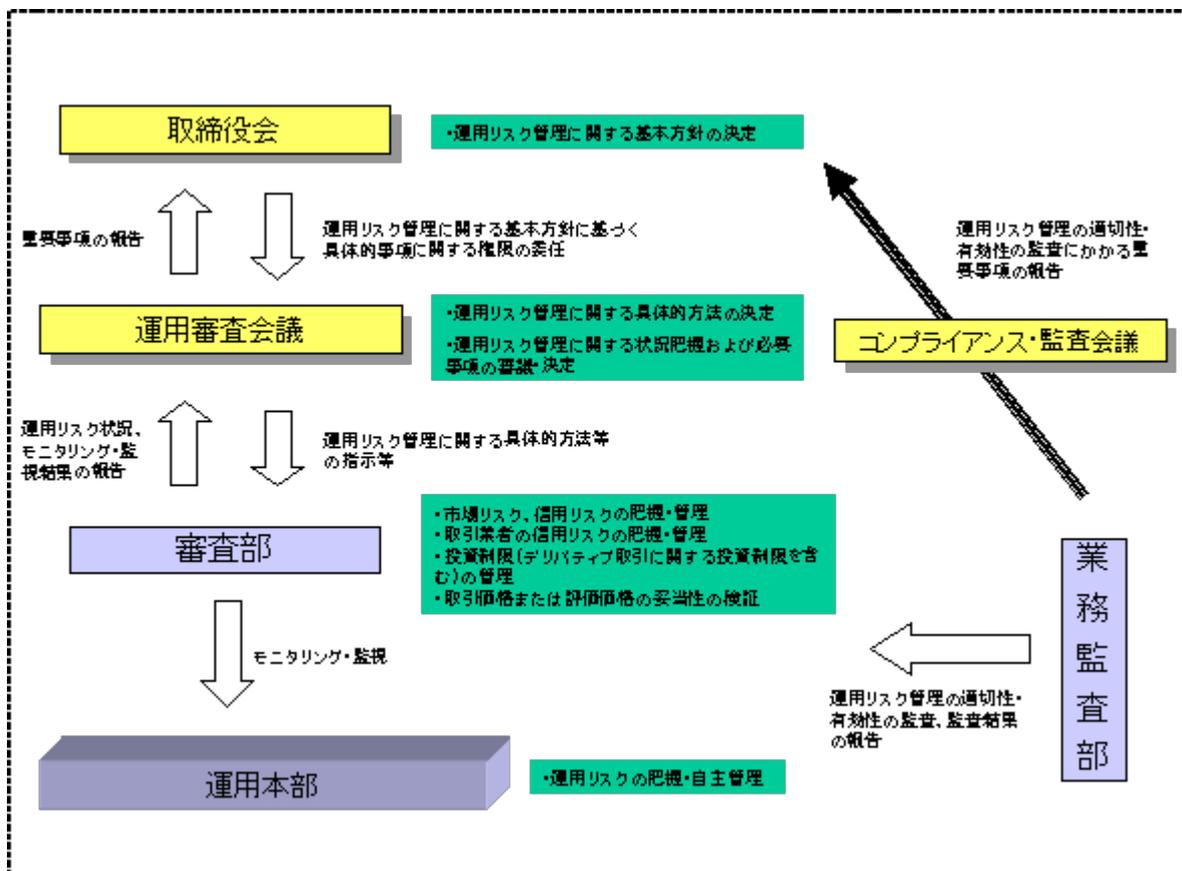
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所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、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、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ご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(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。

(4) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、1.3125%（税抜1.25%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.651%（税抜0.62%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、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。

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から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.2415% （税抜0.23%）	年率0.336% （税抜0.32%）	年率0.0735% （税抜0.07%）

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

(4) 【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる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。

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（ ）「その他の手数料等」については、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。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。

ただし、平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。

ただし、平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用されます。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能となります。また、一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

買取請求時の1万口当たりの手取額は、買取請求受付日の基準価額から、当該買取りに関して課税対象者にかかる源泉徴収額に相当する金額を差引いた金額となります（当該課税対象者にかかる源泉徴収は、免除されることがあります。）。買取価額と取得価額との差額については、譲渡所得の取扱いとなります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成23年12月31日までは7%（所得税7%）、平成24年1月1日から15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。

なお、益金不算入制度（当ファンドの場合、対象金額は二分の一となります。）および税額控除制度が適用されます。

買取請求時の1万口当たりの手取額は、買取請求受付日の基準価額から、当該買取りに関して課税対象

者にかかる源泉徴収額に相当する金額を差引いた金額となります（当該課税対象者にかかる源泉徴収は、免除されることがあります。）。この税相当額は税金ではないため、税額控除はありません。

<注1> 個別元本について

受益者ごと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に相当する金額は含まれません。）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な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、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該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。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受取る際、イ．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、ロ．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特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

- () 上記は、平成22年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成22年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	1,379,680,915	91.07
内 日本	1,379,680,915	91.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	135,272,005	8.93
純資産総額	1,514,952,920	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	128,700,000	8.50
内 日本	128,700,000	8.50

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

（注3）株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 【投資資産】（平成22年11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	15,300	3,355 51,331,500	3,220 49,266,000	- -	3.25%
2	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	195	137,500 26,812,500	135,800 26,481,000	- -	1.75%
3	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	62,600	445 27,857,000	396 24,789,600	- -	1.64%
4	本田技研 日本	株式 輸送用機器	8,200	2,985 24,477,000	3,010 24,682,000	- -	1.63%
5	キャノン 日本	株式 電気機器	5,900	3,529 20,823,210	3,945 23,275,500	- -	1.54%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	4,500	3,930 17,685,000	3,790 17,055,000	- -	1.13%
7	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	6,300	2,812 17,715,600	2,569 16,184,700	- -	1.07%
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	7,600	2,192 16,659,200	2,116 16,081,600	- -	1.06%
9	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	20,200	717 14,483,400	785 15,857,000	- -	1.05%
10	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	4,900	2,255 11,049,500	2,900 14,210,000	- -	0.94%
11	任天堂 日本	株式 その他製品	600	24,770 14,862,000	22,730 13,638,000	- -	0.90%

12	ソニー	日本	株式 電気機器	4,500	3,035 13,657,500	2,971 13,369,500	- -	0.88%
13	武田薬品	日本	株式 医薬品	3,400	3,905 13,277,000	3,890 13,226,000	- -	0.87%
14	ファナック	日本	株式 電気機器	1,100	8,870 9,757,000	11,990 13,189,000	- -	0.87%
15	パナソニック	日本	株式 電気機器	10,800	1,266 13,672,800	1,204 13,003,200	- -	0.86%
16	みずほフィナンシャルG	日本	株式 銀行業	93,600	162 15,205,525	133 12,448,800	- -	0.82%
17	東京電力	日本	株式 電気・ガス業	5,900	2,438 14,384,200	1,950 11,505,000	- -	0.76%
18	デンソー	日本	株式 輸送用機器	4,000	2,492 9,968,000	2,733 10,932,000	- -	0.72%
19	三井物産	日本	株式 卸売業	8,300	1,321 10,964,300	1,307 10,848,100	- -	0.72%
20	小松製作所	日本	株式 機械	4,500	1,776 7,992,000	2,318 10,431,000	- -	0.69%
21	KDDI	日本	株式 情報・通信業	21	493,500 10,363,500	478,500 10,048,500	- -	0.66%
22	東日本旅客鉄道	日本	株式 陸運業	1,700	5,860 9,962,000	5,000 8,500,000	- -	0.56%
23	三菱地所	日本	株式 不動産業	6,000	1,398 8,388,000	1,412 8,472,000	- -	0.56%
24	新日本製鐵	日本	株式 鉄鋼	30,000	317 9,510,000	277 8,310,000	- -	0.55%
25	三菱電機	日本	株式 電気機器	10,000	740 7,400,000	829 8,290,000	- -	0.55%
26	東芝	日本	株式 電気機器	19,000	425 8,075,000	436 8,284,000	- -	0.55%
27	関西電力	日本	株式 電気・ガス業	4,000	2,082 8,328,000	2,013 8,052,000	- -	0.53%
28	東京海上HD	日本	株式 保険業	3,400	2,411 8,197,400	2,367 8,047,800	- -	0.53%
29	ヤフー	日本	株式 情報・通信業	266	31,350 8,339,100	30,000 7,980,000	- -	0.53%
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式 小売業	3,900	1,942 7,573,800	2,045 7,975,500	- -	0.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	91.07%
合計	91.07%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.13%
鉱業	0.42%
建設業	2.09%
食料品	2.62%
繊維製品	0.81%

パルプ・紙	0.33%
化学	5.29%
医薬品	3.81%
石油・石炭製品	0.85%
ゴム製品	0.60%
ガラス・土石製品	1.05%
鉄鋼	2.20%
非鉄金属	1.14%
金属製品	0.62%
機械	4.42%
電気機器	12.23%
輸送用機器	9.83%
精密機器	1.27%
その他製品	1.88%
電気・ガス業	3.63%
陸運業	2.89%
海運業	0.51%
空運業	0.25%
倉庫・運輸関連業	0.25%
情報・通信業	7.63%
卸売業	4.94%
小売業	4.31%
銀行業	6.75%
証券・商品先物取引業	1.21%
保険業	1.97%
その他金融業	0.84%
不動産業	2.03%
サービス業	2.27%
合計	91.07%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2010年12月	買建	15	125,347,623	128,700,000	8.50%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成12年7月28日)	6,019,000,000	-	1.0000	-
第1計算期間末 (平成13年2月15日)	23,230,950,067	23,230,950,067	0.8513	0.8513
第2計算期間末 (平成14年2月15日)	19,134,411,086	19,162,862,086	0.6725	0.6735
第3計算期間末 (平成15年2月17日)	17,131,257,408	17,160,240,408	0.5911	0.5921
第4計算期間末 (平成16年2月16日)	9,799,815,269	9,880,905,269	0.7251	0.7311
第5計算期間末 (平成17年2月15日)	6,852,886,632	6,911,735,632	0.8151	0.8221
第6計算期間末 (平成18年2月15日)	6,790,593,148	6,832,180,148	1.1430	1.1500
第7計算期間末 (平成19年2月15日)	6,536,137,202	6,589,947,202	1.2147	1.2247
第8計算期間末 (平成20年2月15日)	4,192,582,152	4,224,866,152	0.9091	0.9161
第9計算期間末 (平成21年2月16日)	2,626,488,012	2,670,615,012	0.5357	0.5447
平成21年11月末日	1,634,510,496	-	0.5946	-
12月末日	1,783,529,249	-	0.6418	-
平成22年1月末日	1,771,802,420	-	0.6376	-
第10計算期間末 (平成22年2月15日)	1,670,533,206	1,694,923,206	0.6164	0.6254
2月末日	1,689,649,573	-	0.6235	-
3月末日	1,852,841,991	-	0.6862	-
4月末日	1,874,732,665	-	0.6943	-
5月末日	1,675,377,642	-	0.6205	-
6月末日	1,608,859,551	-	0.5959	-
7月末日	1,620,190,343	-	0.6001	-
8月末日	1,536,536,177	-	0.5691	-
9月末日	1,464,108,806	-	0.5904	-
10月末日	1,428,691,778	-	0.5761	-
11月末日	1,514,952,920	-	0.6109	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0010

第3計算期間	0.0010
第4計算期間	0.0060
第5計算期間	0.0070
第6計算期間	0.0070
第7計算期間	0.0100
第8計算期間	0.0070
第9計算期間	0.0090
第10計算期間	0.0090

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	14.9
第2計算期間	20.9
第3計算期間	12.0
第4計算期間	23.7
第5計算期間	13.4
第6計算期間	41.1
第7計算期間	7.1
第8計算期間	24.6
第9計算期間	40.1
第10計算期間	16.7

[次へ](#)

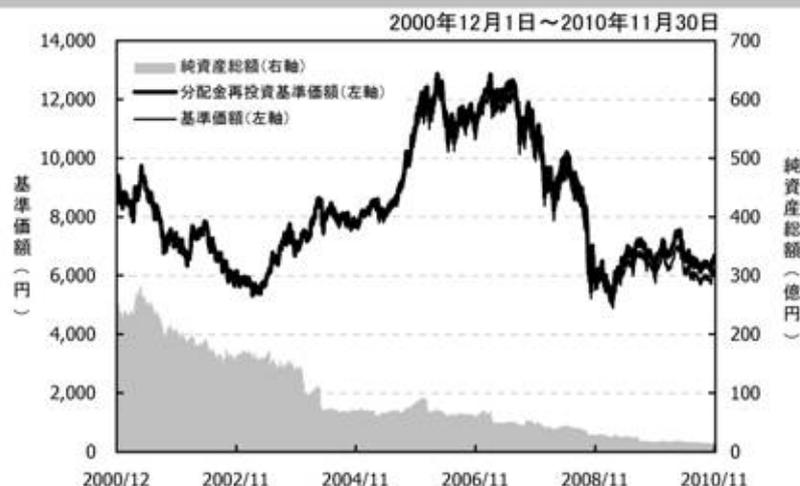
(参考情報)

2010年11月30日現在
基準価額・純資産の推移

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額	6,109円
純資産総額	15億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	6.0%
3カ月間	7.3%
6カ月間	-1.5%
1年間	4.2%
3年間	-39.7%
5年間	-40.7%
設定来	-34.3%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 90円 設定来分配金合計額: 570円

決算期	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	第10期
	01年2月	02年2月	03年2月	04年2月	05年2月	06年2月	07年2月	08年2月	09年2月	10年2月
分配金	0円	10円	10円	60円	70円	70円	100円	70円	90円	90円

※分配金は、収益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。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

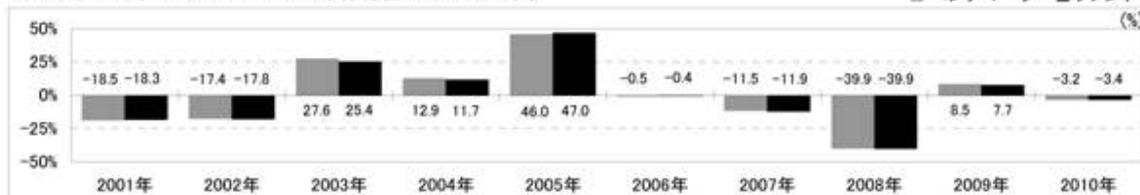
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	991	91.1%	電気機器	12.2%	TOPIX先物	-	8.5%
国内株式先物	1	8.5%	輸送用機器	9.8%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.3%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.6%	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	1.7%
コール・ローン、その他	-	8.9%	銀行業	6.7%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.6%
合計	992	-	化学	5.3%	本田技研	輸送用機器	1.6%
株式市場・上場別構成			卸売業	4.9%	キヤノン	電気機器	1.5%
一部(東証・大証・名証)		87.5%	機械	4.4%	日本電信電話	情報・通信業	1.1%
二部(東証・大証・名証)		1.1%	小売業	4.3%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.1%
新興市場他		2.5%	医薬品	3.8%	三菱商事	卸売業	1.1%
その他		-	その他	31.9%	日産自動車	輸送用機器	1.0%
合計		91.1%	合計	91.1%	合計		22.6%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはDSI-2 日本株総合インデックスです。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2010年は11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	21,369,000,000	100,000,000
第2計算期間	6,301,000,000	5,137,000,000
第3計算期間	7,615,000,000	7,084,000,000
第4計算期間	1,529,000,000	16,997,000,000
第5計算期間	840,000,000	5,948,000,000
第6計算期間	1,886,000,000	4,352,000,000
第7計算期間	485,000,000	1,045,000,000
第8計算期間	886,000,000	1,655,000,000
第9計算期間	350,000,000	59,000,000
第10計算期間	403,000,000	2,596,000,000

（注）当初設定数量は6,019,000,000口です。

第2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、1,000万口以上100万口単位をもって、取得の申込みに応じることができません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。

委託会社の各営業日の午後3時までには受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行な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なわれます。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なうことができます。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なうものとします。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ないません。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ないます。

2 【換金（解約）手続等】

受益者は、保有する受益権について、一部解約の実行を請求すること、または買取りを請求することにより換金することができます。

委託会社の各営業日の午後3時までには受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

イ．一部解約

受益者は、自己に帰属する受益権について、100万口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・ お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・ 委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所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、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。一部解約の実行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なった当日の一部解約の実行の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、当該振替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一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

委託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

ロ．買取り

受益者が買取請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

販売会社は、受益者の請求があるときは、100万口単位をもって、その振替受益権を買取ります。

振替受益権の買取価額は、買取りの申込みを受付けた日の基準価額から、当該買取りに関して課税対象者にかかる源泉徴収額に相当する金額を控除した額とします（当該課税対象者にかかる源泉徴収は、免除されることがあります。）。

受益者は、買取価額を、販売会社に問合わせることにより知ることができます。

販売会社は、金融商品取引所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、委託会社との協議に基づいて、振替受益権の買取りを中止することができます。振替受益権の買取りが中止された場合には、受益者は買取中止以前に行なった当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の買取価額は、買取中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取りの申込みを受付けたものとして、上記に準じて計算された価額とします。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、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なうものとし、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。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、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したがって時価（注）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控

除した金額をいいます。

（注）主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成12年7月28日から平成25年2月15日までとします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

毎年2月16日から翌年2月15日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める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、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.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、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、公告を行ないません。

3. 前2.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3.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2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、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、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、公告を行ないません。
6. 前3.から前5.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、前3.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なうことが困難な場合には適用しません。
7. 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。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、前4.に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 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において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 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、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、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。
2. 委託会社は、前1.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、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、公告を行ないません。
3. 前2.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3.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2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、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、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、公告を行ないません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 2.の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 3.または前 4.の一定の期間内に委託会社に対して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取るべき旨を請求することができます。

運用報告書

委託会社は、計算期間の末日ごとに、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、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。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、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。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替期間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なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

償還金は、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販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

換金請求権

受益者は、保有する受益権について、一部解約の実行を請求すること、または買取りを請求することにより換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（平成20年2月16日から平成21年2月16日まで）及び第10期計算期間（平成21年2月17日から平成22年2月15日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

DIR日本株総合インデックス・ファンド

【財務諸表】

D I R日本株総合インデックス・ファンド
(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 平成21年2月16日現在	第10期 平成22年2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	162,466,376	131,165,108
株式	3 2,502,888,440	3 1,569,584,755
派生商品評価勘定	-	156,530
未収入金	276,121	52,806
未収配当金	3,110,530	1,433,930
前払金	10,164,000	-
差入委託証拠金	11,130,000	-
流動資産合計	2,690,035,467	1,702,393,129
資産合計	2,690,035,467	1,702,393,129
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,072,895	124,295
前受金	-	1,578,000
未払金	2,176,416	-
未払収益分配金	44,127,000	24,390,000
未払受託者報酬	1,139,140	645,915
未払委託者報酬	8,950,724	5,075,290
その他未払費用	81,280	46,423
流動負債合計	63,547,455	31,859,923
負債合計	63,547,455	31,859,923
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,903,000,000	1 2,710,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 2,276,511,988	2 1,039,466,794
(分配準備積立金)	1,229,000,223	626,982,433
元本等合計	2,626,488,012	1,670,533,206
純資産合計	2,626,488,012	1,670,533,206
負債純資産合計	2,690,035,467	1,702,393,129

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期		第10期	
	自 平成20年2月16日 至 平成21年2月16日		自 平成21年2月17日 至 平成22年2月15日	
営業収益				
受取配当金	71,047,918		43,275,582	
受取利息	979,759		144,578	
有価証券売買等損益	1,625,125,042		425,303,444	
派生商品取引等損益	100,200,499		25,056,862	
その他収益	154,351		70,599	
営業収益合計	1,653,143,513		493,851,065	
営業費用				
受託者報酬	2,650,379		1,582,239	
委託者報酬	20,825,005		12,432,393	
その他費用	189,143		112,839	
営業費用合計	23,664,527		14,127,471	
営業利益又は営業損失（ ）	1,676,808,040		479,723,594	
経常利益又は経常損失（ ）	1,676,808,040		479,723,594	
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,676,808,040		479,723,594	
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（ ）	3,130,323		238,516,409	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	419,417,848		2,276,511,988	
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,365,577		1,206,421,609	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,365,577		1,206,421,609	
剰余金減少額又は欠損金増加額	144,655,000		186,193,600	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	144,655,000		186,193,600	
分配金	1 44,127,000		1 24,390,000	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,276,511,988		1,039,466,794	

(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9期 自 平成20年2月16日 至 平成21年2月16日	第10期 自 平成21年2月17日 至 平成22年2月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、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 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 平成21年2月15日が休日のため、当計算期間末日を平成21年2月16日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	計算期間末日の取扱い 平成21年2月15日が休日のため、前計算期間末日を平成21年2月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第9期 平成21年2月16日現在	第10期 平成22年2月15日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	4,612,000,000円 350,000,000円 59,000,000円	4,903,000,000円 403,000,000円 2,596,000,000円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,903,000,000口	2,710,000,000口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,276,511,988円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,039,466,794円であります。

4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 12,408,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 11,000,000円
--------------------	--	--

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自平成20年2月16日 至平成21年2月16日	第10期 自平成21年2月17日 至平成22年2月15日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(48,210,775円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(503,199,324円)及び分配準備積立金(1,224,916,448円)より分配対象額は1,776,326,547円(1万口当たり3,622.94円)であり、うち44,127,000円(1万口当たり90円)を分配金額としております。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(26,982,012円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(333,357,830円)及び分配準備積立金(624,390,421円)より分配対象額は984,730,263円(1万口当たり3,633.69円)であり、うち24,390,000円(1万口当たり90円)を分配金額としております。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第9期 平成21年2月16日現在		第10期 平成22年2月15日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,502,888,440	1,617,459,665	1,569,584,755	202,576,553
合計	2,502,888,440	1,617,459,665	1,569,584,755	202,576,553

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	第9期 自平成20年2月16日 至平成21年2月16日	第10期 自平成21年2月17日 至平成22年2月15日
1. 取引の内容	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。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。	同左

4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	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、又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。	同左

取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	第9期 平成21年2月16日 現在				第10期 平成22年2月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	129,824,000	-	122,800,000	7,024,000	97,057,000	-	97,130,000	73,000
合計	129,824,000	-	122,800,000	7,024,000	97,057,000	-	97,130,000	73,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末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場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自 平成20年2月16日 至 平成21年2月16日	第10期 自 平成21年2月17日 至 平成22年2月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	第9期 平成21年2月16日現在	第10期 平成22年2月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5357円 (5,357円)	0.6164円 (6,164円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	1,600	256	409,600	
マルハニチロホールディングス	4,000	122	488,000	
カネコ種苗	900	717	645,300	
ホクト	200	1,921	384,200	
国際石油開発帝石	12	673,000	8,076,000	
石油資源開発	300	4,215	1,264,500	
共立マテリアル	2,000	340	680,000	
東急建設	1,530	227	347,310	
コムシスホールディングス	1,000	830	830,000	
東建コーポレーション	80	2,010	160,800	
大成建設	6,000	178	1,068,000	
大林組	4,000	326	1,304,000	
清水建設	4,000	337	1,348,000	
長谷工コーポレーション	7,500	84	630,000	
鹿島建設	6,000	200	1,200,000	
不動テトラ	4,800	53	254,400	
西松建設	3,000	106	318,000	
大豊建設	1,000	67	67,000	
前田建設	1,000	257	257,000	
奥村組	1,000	318	318,000	
浅沼組	1,000	61	61,000	
戸田建設	2,000	314	628,000	
熊谷組	1,000	56	56,000	
青木あすなろ建設	500	454	227,000	
三井ホーム	1,000	463	463,000	
大東建託	600	4,435	2,661,000	
NIPPO	1,000	684	684,000	
前田道路	1,000	735	735,000	
東亜建設	2,000	92	184,000	
五洋建設	3,500	93	325,500	
大成温調	2,000	350	700,000	
住友林業	1,000	680	680,000	
日本基礎技術	2,200	185	407,000	
パナホーム	1,000	617	617,000	
大和ハウス	3,000	954	2,862,000	
ライト工業	1,800	203	365,400	
積水ハウス	3,000	862	2,586,000	
TTK	1,000	296	296,000	
シーキューブ	2,100	250	525,000	
四電工	1,000	453	453,000	
つうけん	3,000	221	663,000	
中電工	400	1,115	446,000	
関電工	1,000	570	570,000	
きんでん	1,000	788	788,000	
日本電設工業	1,000	729	729,000	
協和エクシオ	600	753	451,800	
九電工	1,000	531	531,000	
サンテック	1,000	298	298,000	
日揮	1,000	1,659	1,659,000	
高砂熱学	700	718	502,600	
NEC ネットズエスアイ	300	1,044	313,200	
明星工業	2,000	197	394,000	

東芝プラントシステム	1,000	1,008	1,008,000
日本製粉	1,000	452	452,000
日清製粉G本社	1,500	1,179	1,768,500
協同飼料	2,000	112	224,000
ユニ・チャーム ペットケア	200	2,912	582,400
ミクシィ	1	506,000	506,000
アコーディア・ゴルフ	6	91,300	547,800
パソナグループ	3	59,000	177,000
森永製菓	2,000	204	408,000
江崎グリコ	1,000	993	993,000
名糖産業	100	1,239	123,900
山崎製パン	1,000	1,131	1,131,000
コモ	600	1,570	942,000
森永乳業	2,000	368	736,000
ヤクルト	900	2,669	2,402,100
明治ホールディングス	400	3,425	1,370,000
日本ハム	1,000	1,058	1,058,000
伊藤ハム	2,000	303	606,000
シミック	20	18,880	377,600
S J I	12	21,880	262,560
N E C フィールドینگ	200	1,210	242,000
新日鉄ソリューションズ	300	1,365	409,500
総合警備保障	600	1,013	607,800
カカクコム	2	339,000	678,000
アイロムホールディングス	55	2,575	141,625
S B S ホールディングス	4	55,000	220,000
ジェイ・エー・エー	5	95,000	475,000
新日本科学	400	591	236,400
メッセージ	2	204,100	408,200
エムスリー	2	320,000	640,000
ディー・エヌ・エー	3	652,000	1,956,000
博報堂 D Y H L D G S	230	4,350	1,000,500
ぐるなび	2	184,800	369,600
パシフィックゴルフ G R P	6	63,000	378,000
サッポロホールディングス	2,000	472	944,000
アサヒビール	2,300	1,670	3,841,000
キリンHD	5,000	1,280	6,400,000
宝ホールディングス	1,000	480	480,000
メルシャン	1,000	180	180,000
コカ・コーラウエスト	600	1,491	894,600
伊藤園	600	1,331	798,600
ジャパンフーズ	300	798	239,400
日清オイリオグループ	1,000	448	448,000
不二製油	600	1,371	822,600
J - オイルミルズ	1,000	275	275,000
ローソン	500	4,000	2,000,000
イオン九州	500	1,323	661,500
カワチ薬品	200	1,800	360,000
三井情報	11	15,200	167,200
エービーシー・マート	400	2,825	1,130,000
高千穂交易	100	896	89,600
アスクル	300	1,624	487,200
ゲオ	5	93,300	466,500
ポイント	170	5,170	878,900
日本マクドナルド H L D G	900	1,828	1,645,200

スターバックスコーヒーJ	13	40,400	525,200
ITX	9	32,950	296,550
エディオン	600	851	510,600
サーラコーポレーション	1,000	535	535,000
ウイン・インターナショナル	800	511	408,800
石光商事	1,600	369	590,400
東京エレクトロニクス	2	116,300	232,600
日本風力開発	2	230,700	461,400
フィールズ	5	106,300	531,500
双日	7,500	154	1,155,000
コメ兵	1,000	354	354,000
セリア	4	119,600	478,400
アルフレッサホールディングス	200	3,710	742,000
ナフコ	300	1,601	480,300
大黒天物産	200	2,611	522,200
ハニーズ	410	631	258,710
キッコーマン	1,000	1,048	1,048,000
味の素	3,000	895	2,685,000
キューピー	800	992	793,600
ハウス食品	500	1,295	647,500
カゴメ	600	1,582	949,200
アリアケジャパン	200	1,350	270,000
エバラ食品工業	1,000	1,350	1,350,000
ニチレイ	2,000	333	666,000
東洋水産	1,000	2,397	2,397,000
オリエンタル酵母	1,000	453	453,000
日本食品化工	1,000	625	625,000
日清食品HD	600	3,070	1,842,000
日本たばこ産業	25	321,000	8,025,000
片倉工業	500	793	396,500
グンゼ	1,000	314	314,000
昭栄	600	711	426,600
アルペン	200	1,340	268,000
ビックカメラ	9	30,900	278,100
DCM JAPAN HLDGS	1,000	525	525,000
J. フロント リテイリング	3,000	472	1,416,000
ドトール・日レスHD	200	1,145	229,000
マツモトキヨシHLDGS	300	1,984	595,200
三越伊勢丹HD	2,200	896	1,971,200
東洋紡績	5,000	131	655,000
ユニチカ	6,000	68	408,000
日清紡ホールディングス	1,000	871	871,000
日東紡績	2,000	176	352,000
トヨタ紡織	1,000	1,637	1,637,000
日本毛織	1,000	616	616,000
野村不動産HLDGS	1,000	1,342	1,342,000
ブックオフコーポレーション	400	882	352,800
クロスプラス	300	862	258,600
JFE商事HLDGS	2,000	308	616,000
サークルKサンクス	500	1,130	565,000
セブン&アイ・HLDGS	4,400	1,942	8,544,800
ツルハホールディングス	200	3,305	661,000
帝人	5,000	264	1,320,000
東レ	7,000	480	3,360,000
三菱レイヨン	4,000	372	1,488,000

ク ラ レ	2,000	1,086	2,172,000
旭 化 成	7,000	453	3,171,000
三協・立山HLDGS	4,000	112	448,000
SUMCO	1,400	1,570	2,198,000
日本バイリン	1,000	406	406,000
NBCメッシュテック	600	812	487,200
セーレン	700	549	384,300
ソトー	500	795	397,500
小松精練	1,000	341	341,000
トムス・エンタテインメント	2,000	205	410,000
ワコールホールディングス	1,000	1,004	1,004,000
ホギメディカル	100	4,340	434,000
サンエー・インターナショナル	200	1,015	203,000
レナウン	1,800	159	286,200
ITホールディングス	500	957	478,500
コーエーテクモHD	400	581	232,400
ドワンゴ	3	150,600	451,800
日本ベリサイン	9	33,850	304,650
ティーガイア	4	132,000	528,000
ソネットエンタテインメント	3	227,000	681,000
王子製紙	5,000	382	1,910,000
三菱製紙	4,000	103	412,000
北越紀州製紙	1,500	438	657,000
大王製紙	1,000	715	715,000
日本製紙G本社	600	2,331	1,398,600
レンゴー	1,000	554	554,000
昭和電工	9,000	178	1,602,000
住友化学	8,000	397	3,176,000
日本化成	2,000	163	326,000
日産化学	1,000	1,225	1,225,000
クレハ	1,000	453	453,000
石原産業	5,000	67	335,000
日本曹達	1,000	356	356,000
東ソー	4,000	220	880,000
トクヤマ	2,000	465	930,000
セントラル硝子	1,000	370	370,000
東亜合成	1,000	331	331,000
関東電化	1,000	644	644,000
電気化学	3,000	369	1,107,000
イビデン	800	2,996	2,396,800
信越化学	2,200	4,850	10,670,000
エア・ウォーター	1,000	1,076	1,076,000
大陽日酸	2,000	865	1,730,000
ステラ ケミファ	100	4,195	419,500
日本触媒	1,000	797	797,000
大日精化	1,000	322	322,000
カネカ	2,000	544	1,088,000
協和発酵キリン	3,000	922	2,766,000
三菱瓦斯化学	3,000	460	1,380,000
三井化学	5,000	240	1,200,000
JSR	1,300	1,760	2,288,000
東京応化工業	200	1,626	325,200
三菱ケミカルHLDGS	7,500	374	2,805,000
ダイセル化学	2,000	582	1,164,000
住友ベークライト	1,000	458	458,000

積水化学	3,000	594	1,782,000
日本ゼオン	2,000	459	918,000
アイカ工業	500	904	452,000
宇部興産	6,000	222	1,332,000
日立化成	1,200	1,805	2,166,000
ニチバン	2,000	287	574,000
日本化薬	1,000	734	734,000
D . A . コンソーシアム	10	21,250	212,500
パナソニック電工 I S	200	2,188	437,600
フェイス	32	8,840	282,880
野村総合研究所	1,100	1,957	2,152,700
電通	1,400	2,100	2,940,000
ワークスアプリケーションズ	4	56,500	226,000
松本油脂製薬	500	1,580	790,000
A D E K A	700	828	579,600
日油	1,000	361	361,000
新日本理化	4,900	103	504,700
花 王	2,600	2,203	5,727,800
三洋化成	1,000	515	515,000
武田薬品	3,800	3,905	14,839,000
アステラス製薬	2,300	3,260	7,498,000
大日本住友製薬	2,200	886	1,949,200
塩野義製薬	1,800	1,792	3,225,600
田辺三菱製薬	3,000	1,250	3,750,000
日本新薬	1,000	962	962,000
中外製薬	2,900	1,728	5,011,200
科研製薬	1,000	768	768,000
エーザイ	1,500	3,305	4,957,500
ロート製薬	1,000	1,074	1,074,000
小野薬品	600	3,940	2,364,000
久光製薬	500	3,145	1,572,500
持田製薬	1,000	854	854,000
大正製薬	1,000	1,529	1,529,000
参天製薬	500	2,796	1,398,000
エスエス製薬	1,000	703	703,000
ツムラ	400	2,671	1,068,400
日医工	300	2,791	837,300
テ ル モ	1,100	4,815	5,296,500
みらかホールディングス	400	2,565	1,026,000
生化学工業	600	947	568,200
鳥居薬品	400	1,695	678,000
東和薬品	100	4,880	488,000
第一三共	3,500	1,773	6,205,500
キョーリン	1,000	1,349	1,349,000
大日本塗料	5,000	86	430,000
日本ペイント	2,000	573	1,146,000
関西ペイント	2,000	742	1,484,000
D I C	4,000	172	688,000
東洋インキ	2,000	373	746,000
T & K T O K A	200	1,196	239,200
オリエンタルランド	400	6,360	2,544,000
ダスキン	400	1,618	647,200
パーク24	800	931	744,800
フジ・メディア・HD	13	123,300	1,602,900
ラウンドワン	700	562	393,400

リゾートトラスト	400	1,178	471,200
オービック	50	16,050	802,500
ヤフー	296	31,350	9,279,600
ビー・エム・エル	200	2,365	473,000
トレンドマイクロ	600	3,190	1,914,000
もしもしホットライン	200	1,705	341,000
リソー教育	58	5,200	301,600
日本オラクル	500	4,045	2,022,500
アルファシステムズ	200	1,520	304,000
フューチャーアーキテクト	10	31,800	318,000
シーエーシー	600	605	363,000
ソフトバンク・テクノ	700	712	498,400
ユー・エス・エス	200	5,640	1,128,000
オービックビジネスC	150	3,870	580,500
伊藤忠テクノソリュー	300	2,868	860,400
楽天	73	66,900	4,883,700
カルチュア・コンビニエンス	1,200	431	517,200
大塚商会	200	5,290	1,058,000
富士通ビー・エス・シー	700	748	523,600
電通国際情報S	700	489	342,300
A C C E S S	3	114,800	344,400
東映アニメーション	300	1,570	471,000
ジュピターテレコム	40	90,000	3,600,000
ハドソン	600	354	212,400
シダックス	1,200	372	446,400
エン・ジャパン	4	104,900	419,600
富士フイルムHLDGS	2,600	2,848	7,404,800
コニカミノルタHLDGS	3,000	915	2,745,000
資生堂	2,000	1,878	3,756,000
ライオン	2,000	444	888,000
高砂香料	1,000	444	444,000
ミルボン	200	2,049	409,800
ファンケル	500	1,773	886,500
コーセー	400	1,906	762,400
ドクターシーラボ	3	187,400	562,200
エステー	500	994	497,000
長谷川香料	200	1,271	254,200
小林製薬	300	3,610	1,083,000
タカラバイオ	2	183,100	366,200
寺岡製作所	1,000	362	362,000
新日本石油	8,000	449	3,592,000
昭和シエル石油	2,000	686	1,372,000
コスモ石油	5,000	201	1,005,000
東燃ゼネラル石油	3,000	750	2,250,000
ユシロ化学	100	1,125	112,500
新日鉱ホールディングス	5,000	417	2,085,000
AOCホールディングス	500	508	254,000
MORESCO	500	551	275,500
出光興産	200	6,380	1,276,000
横浜ゴム	2,000	378	756,000
東洋ゴム	1,000	189	189,000
ブリヂストン	4,100	1,459	5,981,900
住友ゴム	1,500	704	1,056,000
アキレス	2,000	130	260,000
ニッタ	200	1,254	250,800

クリエートメディック	300	829	248,700
東海ゴム工業	700	1,110	777,000
三ツ星ベルト	1,000	351	351,000
旭硝子	6,000	934	5,604,000
日本板硝子	4,000	231	924,000
有沢製作所	200	650	130,000
日本電気硝子	3,000	1,193	3,579,000
オハラ	100	1,409	140,900
住友大阪セメント	2,000	134	268,000
太平洋セメント	6,000	107	642,000
東海カーボン	1,000	479	479,000
東洋炭素	100	4,600	460,000
TOTO	2,000	594	1,188,000
日本碍子	2,000	2,007	4,014,000
日本特殊陶業	1,000	1,072	1,072,000
日本ミクロコーティング	1,400	136	190,400
フジインコーポレーテッド	200	1,534	306,800
ニチアス	1,000	390	390,000
新日本製鐵	34,000	317	10,778,000
住友金属工業	23,000	239	5,497,000
神戸製鋼所	16,000	157	2,512,000
日新製鋼	6,000	151	906,000
中山製鋼所	2,000	123	246,000
合同製鐵	1,000	183	183,000
JFEホールディングス	3,100	3,095	9,594,500
東京製鐵	900	923	830,700
共英製鋼	300	1,638	491,400
大和工業	400	2,725	1,090,000
大阪製鐵	300	1,396	418,800
淀川製鋼所	1,000	371	371,000
東洋鋼鋳	1,000	447	447,000
丸一鋼管	500	1,731	865,500
大同特殊鋼	3,000	339	1,017,000
日本冶金工	1,000	265	265,000
山陽特殊鋼	1,000	362	362,000
愛知製鋼	1,000	359	359,000
日立金属	2,000	860	1,720,000
大平洋金属	1,000	606	606,000
日本電工	1,000	559	559,000
日本製鋼所	2,000	1,018	2,036,000
三菱製鋼	2,000	155	310,000
日亜鋼業	1,000	215	215,000
日本軽金属	3,000	87	261,000
大紀アルミニウム	2,000	189	378,000
三井金属	4,000	233	932,000
東邦亜鉛	1,000	395	395,000
三菱マテリアル	6,000	225	1,350,000
住友鉱山	3,000	1,226	3,678,000
DOWAホールディングス	2,100	503	1,056,300
古河機金	3,000	96	288,000
大阪チタニウム	200	2,800	560,000
東邦チタニウム	400	1,557	622,800
古河スカイ	2,000	171	342,000
古河電工	4,000	421	1,684,000
住友電工	4,000	1,073	4,292,000

フジクラ	2,000	464	928,000
日立電線	2,000	234	468,000
リョービ	2,000	253	506,000
東洋製罐	1,100	1,374	1,511,400
三和ホールディングス	2,000	256	512,000
住生活グループ	1,600	1,721	2,753,600
ノーリツ	300	1,275	382,500
長府製作所	200	2,035	407,000
リンナイ	300	4,510	1,353,000
ユニプレス	300	1,329	398,700
東京製綱	2,000	214	428,000
サンコール	1,000	371	371,000
エイチワン	600	549	329,400
日本発条	1,000	735	735,000
三浦工業	200	2,380	476,000
オークマ	1,000	551	551,000
東芝機械	1,000	356	356,000
アマダ	2,000	643	1,286,000
富士機械製造	300	1,396	418,800
牧野フライス	1,000	443	443,000
オーエスジー	600	884	530,400
森精機製作所	600	950	570,000
ソデイツク	400	198	79,200
ディスコ	200	5,130	1,026,000
日東工器	200	1,850	370,000
豊田自動織機	1,600	2,335	3,736,000
島精機製作所	300	1,754	526,200
エヌ・ピー・シー	200	2,080	416,000
ナブテスコ	1,000	1,082	1,082,000
三井海洋開発	200	1,690	338,000
S M C	300	10,830	3,249,000
ユニオンツール	100	2,495	249,500
サトー	300	1,074	322,200
日本エアーテック	300	424	127,200
小松製作所	5,000	1,776	8,880,000
住友重機械	4,000	474	1,896,000
日立建機	1,200	1,873	2,247,600
井関農機	2,000	258	516,000
ハーモニック・ドライブ・シス	1	290,500	290,500
クボタ	6,000	791	4,746,000
東洋エンジニア	1,000	291	291,000
テセック	800	720	576,000
アイチ コーポレーション	600	335	201,000
小森コーポレーション	300	998	299,400
三精輸送機	500	410	205,000
荏原製作所	3,000	425	1,275,000
西島製作所	100	2,049	204,900
千代田化工建	2,000	806	1,612,000
ダイキン工業	1,500	3,430	5,145,000
栗田工業	700	2,583	1,808,100
椿本チエイン	1,000	398	398,000
新興プランテック	600	884	530,400
ダイフク	1,000	589	589,000
タダノ	1,000	413	413,000
シーケーディ	400	699	279,600

平和	600	927	556,200
SANKYO	500	4,420	2,210,000
日本金銭機械	500	734	367,000
マースエンジニアリング	200	1,741	348,200
キヤノンファインテック	300	1,327	398,100
ユニバーサルエンターテインメン	800	1,214	971,200
ダイコク電機	200	1,547	309,400
アマノ	400	777	310,800
サンデン	1,000	279	279,000
ブラザー工業	1,400	1,051	1,471,400
グローリー	400	2,035	814,000
セガサミーホールディングス	1,400	1,061	1,485,400
帝国ピストン	200	369	73,800
放電精密加工研	700	501	350,700
日本精工	3,000	615	1,845,000
N T N	3,000	368	1,104,000
ジェイテクト	1,800	981	1,765,800
不二越	1,000	250	250,000
ミネベア	2,000	467	934,000
日本トムソン	1,000	477	477,000
T H K	800	1,706	1,364,800
ユーシン精機	100	1,489	148,900
キッツ	1,000	474	474,000
日立	22,000	301	6,622,000
東芝	21,000	425	8,925,000
三菱電機	11,000	740	8,140,000
富士電機HLDGS	5,000	203	1,015,000
安川電機	1,000	719	719,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	189	378,000
明電舎	1,000	402	402,000
日立工機	700	937	655,900
三桜工業	500	557	278,500
マキタ	700	2,924	2,046,800
東芝テック	2,000	346	692,000
マブチモーター	200	4,935	987,000
日本電産	700	8,540	5,978,000
ダイヘン	1,000	370	370,000
オムロン	1,300	1,829	2,377,700
エナジーサポート	2,000	172	344,000
不二電機工業	600	825	495,000
エルピーダメモリ	1,000	1,589	1,589,000
ジーエス・ユアサコーポ	2,000	589	1,178,000
メルコホールディングス	200	2,291	458,200
エスケーエレクトロニクス	5	79,300	396,500
日本電気	12,000	241	2,892,000
富士通	10,000	569	5,690,000
沖電気	4,000	71	284,000
サンケン電気	1,000	259	259,000
NECエレクトロニクス	900	777	699,300
セイコーエプソン	1,100	1,491	1,640,100
ワコム	2	136,500	273,000
アルバック	300	2,161	648,300
アクセル	100	3,225	322,500
ナナオ	100	2,163	216,300
日本信号	600	811	486,600

京三製作所	1,000	401	401,000
能美防災	1,000	568	568,000
星和電機	1,000	353	353,000
マスプロ電工	500	796	398,000
日本無線	2,000	159	318,000
パナソニック	12,300	1,266	15,571,800
シャープ	6,000	1,071	6,426,000
アンリツ	1,000	357	357,000
富士通ゼネラル	1,000	347	347,000
ソニー	5,100	3,035	15,478,500
T D K	700	5,260	3,682,000
三洋電機	15,000	138	2,070,000
ミツミ電機	500	1,560	780,000
タムラ製作所	1,000	256	256,000
ザインエレクトロニクス	1	185,400	185,400
アルプス電気	1,000	532	532,000
パイオニア	1,500	341	511,500
日本電波工業	100	1,869	186,900
メイコー	100	2,102	210,200
日本トリム	150	1,750	262,500
クラリオン	1,000	132	132,000
ホシデン	300	1,038	311,400
ヒロセ電機	200	9,340	1,868,000
ユニデン	1,000	210	210,000
アルパイン	400	1,076	430,400
スミダコーポレーション	500	726	363,000
新コスモス電機	500	895	447,500
日本電産リード	400	1,205	482,000
精工技研	400	712	284,800
船井電機	200	3,620	724,000
横河電機	1,600	742	1,187,200
新電元工業	1,000	254	254,000
山武	500	2,028	1,014,000
日本光電工業	200	1,532	306,400
日本電子材料	400	552	220,800
堀場製作所	200	2,345	469,000
アドバンテスト	1,100	2,150	2,365,000
キーエンス	300	19,880	5,964,000
シスメックス	300	5,380	1,614,000
メガチップス	100	1,222	122,200
キョウデン	2,100	118	247,800
タイテック	1,200	271	325,200
北川工業	500	1,006	503,000
デンソー	4,400	2,492	10,964,800
コーセル	300	1,128	338,400
スタンレー電気	1,000	1,618	1,618,000
ウシオ電機	800	1,454	1,163,200
ヘリオステクノH	700	275	192,500
富士通フロンテック	300	667	200,100
図研	600	661	396,600
日本電子	1,000	309	309,000
カシオ	1,600	650	1,040,000
ファナック	1,200	8,870	10,644,000
日本シイエムケイ	400	643	257,200
フクダ電子	200	2,213	442,600

エンブラス	200	1,494	298,800
ローム	600	6,090	3,654,000
浜松ホトニクス	500	2,131	1,065,500
新光電気工業	800	1,252	1,001,600
京セラ	1,000	7,920	7,920,000
太陽誘電	1,000	1,177	1,177,000
村田製作所	1,100	4,625	5,087,500
双葉電子工業	200	1,519	303,800
日東電工	900	3,400	3,060,000
パナソニック電工	4,000	999	3,996,000
指月電機	1,000	377	377,000
東海理化電機	600	1,717	1,030,200
ニチコン	600	961	576,600
日本タンクステン	3,000	116	348,000
K O A	300	841	252,300
三井造船	5,000	214	1,070,000
日立造船	5,000	127	635,000
三菱重工業	17,000	317	5,389,000
川崎重工業	9,000	234	2,106,000
I H I	8,000	149	1,192,000
日本車輛	1,000	560	560,000
日産自動車	22,700	717	16,275,900
いすゞ自動車	9,000	205	1,845,000
トヨタ自動車	17,200	3,355	57,706,000
日野自動車	3,000	319	957,000
三菱自動車工業	28,000	120	3,360,000
武蔵精密工業	200	1,909	381,800
トヨタ車体	700	1,460	1,022,000
日産車体	1,000	725	725,000
関東自動車	300	660	198,000
極東開発工業	1,100	304	334,400
日信工業	400	1,327	530,800
トピー工業	1,000	148	148,000
曙ブレーキ	600	452	271,200
N O K	1,000	1,226	1,226,000
カヤバ工業	1,000	283	283,000
シロキ工業	1,000	253	253,000
カルソニックカンセイ	2,000	233	466,000
太平洋工業	1,000	475	475,000
ケーヒン	500	1,506	753,000
河西工業	1,000	315	315,000
アイシン精機	1,500	2,394	3,591,000
マツダ	8,000	220	1,760,000
ダイハツ	2,000	832	1,664,000
愛知機械	1,000	352	352,000
本田技研	9,100	2,985	27,163,500
スズキ	2,700	1,973	5,327,100
富士重工業	4,000	402	1,608,000
ヤマハ発動機	1,500	1,202	1,803,000
ショーワ	300	549	164,700
小糸製作所	1,000	1,186	1,186,000
エクセディ	300	1,950	585,000
豊田合成	700	2,364	1,654,800
愛三工業	500	758	379,000
エフ・シー・シー	400	1,725	690,000

シマノ	500	3,775	1,887,500
タカタ	500	1,935	967,500
テイ・エス テック	500	1,415	707,500
アトム	1,600	232	371,200
小野建	400	612	244,800
カップクリエイト	150	1,890	283,500
コンドーテック	1,200	556	667,200
中山福	1,000	573	573,000
ライトオン	400	695	278,000
ナガイレーベン	200	1,992	398,400
菱食	200	2,257	451,400
良品計画	200	3,955	791,000
三城ホールディングス	200	754	150,800
松田産業	300	1,532	459,600
第一興商	700	1,208	845,600
メディパルHD	1,300	1,092	1,419,600
アドヴァン	700	581	406,700
萩原電気	700	582	407,400
ドウシシャ	300	2,204	661,200
ハウス ローゼ	200	1,282	256,400
コジマ	200	623	124,600
コーナン商事	200	1,005	201,000
黒田電気	200	1,252	250,400
ネットワークシステムズ	3	91,600	274,800
ムサシ	500	1,220	610,000
ワタミ	300	1,613	483,900
ドン・キホーテ	400	2,162	864,800
スリーエフ	1,200	560	672,000
西松屋チェーン	300	774	232,200
ゼンショー	800	663	530,400
サザビーリーグ	300	1,216	364,800
ジーエフシー	1,100	805	885,500
サイゼリヤ	400	1,605	642,000
PALTEK	1,300	295	383,500
アルゴグラフィックス	400	959	383,600
魚力	600	1,040	624,000
ガリバーインターナショナル	90	4,205	378,450
日本エム・ディ・エム	1,300	247	321,100
ユナイテッドアローズ	400	946	378,400
進和	300	1,021	306,300
ハイデイ日高	300	1,017	305,100
京都きもの友禅	400	806	322,400
マクニカ	200	1,474	294,800
白銅	600	576	345,600
スギホールディングス	400	2,126	850,400
島津製作所	2,000	642	1,284,000
スター精密	200	860	172,000
愛知時計	2,000	253	506,000
東京精密	200	1,169	233,800
ニコン	2,000	1,925	3,850,000
トプコン	400	444	177,600
オリンパス	1,400	2,695	3,773,000
大日本スクリーン	2,000	432	864,000
キヤノン電子	300	1,854	556,200
タムロン	200	1,242	248,400

HOYA	2,200	2,253	4,956,600
キヤノン	6,600	3,530	23,298,000
リコー	4,000	1,234	4,936,000
日本電産コパル	400	1,206	482,400
日本電産サンキョー	1,000	742	742,000
シチズンホールディングス	2,000	560	1,120,000
バンダイナムコHLDGS	1,300	827	1,075,100
フランスベッドHLDGS	3,000	127	381,000
エイベックス・グループHD	400	770	308,000
東京リスマチック	1,300	472	613,600
トッパン・フォームズ	800	944	755,200
フジシールインターナショナル	200	1,912	382,400
タカラトミー	700	691	483,700
廣済堂	300	171	51,300
三光合成	4,000	168	672,000
大建工業	1,000	255	255,000
凸版印刷	4,000	763	3,052,000
大日本印刷	3,000	1,211	3,633,000
日本写真印刷	300	3,410	1,023,000
アシックス	1,000	826	826,000
ツツミ	100	1,702	170,200
ジェイ エス ピー	400	1,152	460,800
ニチハ	500	633	316,500
エフピコ	200	4,220	844,000
ヤマハ	1,000	1,015	1,015,000
ピジョン	200	3,465	693,000
天馬	200	1,014	202,800
パラマウントベッド	300	1,794	538,200
キングジム	300	668	200,400
リンテック	500	1,688	844,000
任天堂	700	24,770	17,339,000
タカラスタンダ-ド	1,000	507	507,000
コクヨ	700	697	487,900
ニフコ	300	1,931	579,300
岡村製作所	1,000	460	460,000
伊藤忠	8,000	699	5,592,000
丸紅	9,000	512	4,608,000
三陽商会	1,000	336	336,000
長瀬産業	1,000	1,031	1,031,000
豊田通商	2,000	1,273	2,546,000
オンワ-ドホールディングス	1,000	572	572,000
三共生興	1,400	275	385,000
美津濃	1,000	405	405,000
ファミリーマート	500	2,868	1,434,000
三井物産	9,100	1,321	12,021,100
東京エレクトロン	900	5,600	5,040,000
日立ハイテクノロジーズ	800	1,812	1,449,600
OUGホールディングス	5,000	139	695,000
セイコーHD	1,000	158	158,000
住友商事	6,100	1,011	6,167,100
日本ユニシス	600	556	333,600
三菱商事	8,500	2,192	18,632,000
キヤノンマーケティングJPN	800	1,183	946,400
阪和興業	2,000	328	656,000
ニプロ	400	1,819	727,600

岩谷産業	2,000	248	496,000
すてきナイスグループ	1,000	183	183,000
イワキ	1,000	218	218,000
三愛石油	1,000	340	340,000
東京スタイル	1,000	647	647,000
ユニ・チャーム	400	8,620	3,448,000
キング	3,000	244	732,000
三栄コーポレーション	2,000	289	578,000
東邦ホールディングス	300	1,206	361,800
サンゲツ	200	1,984	396,800
シナネン	1,000	381	381,000
伊藤忠エネクス	1,000	434	434,000
ザ・トーカイ	1,000	479	479,000
サンリオ	500	742	371,000
ナガホリ	3,000	180	540,000
電響社	1,000	430	430,000
上原成商事	2,000	337	674,000
アデランスホールディングス	200	973	194,600
日本瓦斯	500	1,189	594,500
マルエツ	1,000	384	384,000
ロイヤルホールディングス	300	903	270,900
島忠	300	1,833	549,900
チヨダ	200	1,142	228,400
大塚家具	500	754	377,000
ライフコーポレーション	400	1,500	600,000
AOKIホールディングス	300	955	286,500
コメリ	300	2,335	700,500
青山商事	400	1,301	520,400
しまむら	200	7,850	1,570,000
高島屋	2,000	662	1,324,000
松屋	400	735	294,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	1,000	558	558,000
ニッセンHD	800	347	277,600
パルコ	600	709	425,400
丸井グループ	1,900	543	1,031,700
クレディセゾン	1,100	1,133	1,246,300
セディナ	3,600	163	586,800
イズミヤ	1,000	392	392,000
イオン	4,100	902	3,698,200
ユニー	1,100	687	755,700
イズミ	700	1,131	791,700
フォーバル	1,500	220	330,000
平和堂	400	1,135	454,000
フジ	300	1,723	516,900
ヤオコー	200	2,664	532,800
ゼビオ	300	1,659	497,700
ケーズホールディングス	300	2,705	811,500
新生銀行	12,000	97	1,164,000
あおぞら銀行	10,000	110	1,100,000
三菱UFJフィナンシャルG	70,100	445	31,194,500
りそなホールディングス	6,100	1,074	6,551,400
中央三井トラストHD	8,000	302	2,416,000
三井住友フィナンシャルG	6,800	2,812	19,121,600
第四銀行	2,000	300	600,000
西日本シティ銀行	5,000	239	1,195,000

札幌北洋ホール	2,500	360	900,000
千葉銀行	5,000	553	2,765,000
横浜銀行	7,000	434	3,038,000
常陽銀行	4,000	351	1,404,000
群馬銀行	3,000	481	1,443,000
武蔵野銀行	200	2,459	491,800
東京都民銀行	400	1,139	455,600
七十七銀行	2,000	482	964,000
岩手銀行	100	4,990	499,000
みちのく銀行	2,000	168	336,000
ふくおかフィナンシャルG	5,000	323	1,615,000
静岡銀行	4,000	772	3,088,000
十六銀行	2,000	338	676,000
スルガ銀行	2,000	741	1,482,000
八十二銀行	3,000	507	1,521,000
山梨中央銀行	1,000	378	378,000
大垣共立銀行	2,000	303	606,000
福井銀行	2,000	291	582,000
北國銀行	2,000	317	634,000
滋賀銀行	1,000	536	536,000
南都銀行	2,000	477	954,000
百五銀行	1,000	408	408,000
京都銀行	2,000	749	1,498,000
ほくほくフィナンシャルG	8,000	186	1,488,000
広島銀行	4,000	357	1,428,000
山陰合同銀行	1,000	699	699,000
中国銀行	1,000	1,125	1,125,000
伊予銀行	2,000	767	1,534,000
百十四銀行	2,000	332	664,000
四国銀行	2,000	282	564,000
阿波銀行	1,000	483	483,000
鹿児島銀行	1,000	634	634,000
大分銀行	1,000	315	315,000
肥後銀行	1,000	482	482,000
十八銀行	2,000	246	492,000
住友信託	8,000	487	3,896,000
みずほ信託銀行	27,000	87	2,349,000
セブン銀行	10	184,000	1,840,000
みずほフィナンシャルG	75,700	170	12,869,000
紀陽ホールディングス	5,000	114	570,000
山口フィナンシャルG	1,000	924	924,000
芙蓉総合リース	200	2,366	473,200
興銀リース	200	1,607	321,400
東京センチュリーリース	600	1,131	678,600
SBIホールディングス	95	16,290	1,547,550
日本証券金融	600	687	412,200
ポケットカード	800	250	200,000
名古屋銀行	1,000	342	342,000
愛知銀行	100	6,450	645,000
中京銀行	2,000	258	516,000
東日本銀行	1,000	173	173,000
みなと銀行	2,000	113	226,000
京葉銀行	2,000	412	824,000
関西アーバン銀行	5,000	124	620,000
香川銀行	1,000	293	293,000

東和銀行	7,000	59	413,000
武富士	640	394	252,160
リコーリース	200	1,967	393,400
イオン クレジットサービス	800	910	728,000
アコム	810	1,368	1,108,080
プロミス	750	712	534,000
ジャックス	1,000	201	201,000
日立キャピタル	700	1,161	812,700
オリックス	600	6,770	4,062,000
三菱UFJリース	470	2,947	1,385,090
ジャフコ	300	1,974	592,200
大和証券G本社	8,000	434	3,472,000
野村ホールディングス	18,400	632	11,628,800
みずほ証券	7,000	268	1,876,000
みずほインベストアズ証	8,000	89	712,000
岡三証券グループ	1,000	396	396,000
東海東京HD	2,000	330	660,000
光世証券	4,000	92	368,000
いちよし証券	400	541	216,400
松井証券	1,600	589	942,400
だいこう証券ビジ	900	365	328,500
大阪証券取引所	2	486,000	972,000
マネックスG	16	37,750	604,000
カブドットコム証券	6	86,300	517,800
池田泉州HD	3,700	211	780,700
三井住友海上HD	2,100	2,163	4,542,300
SONY FH	11	258,000	2,838,000
スパークス・グループ	52	10,000	520,000
エース交易	1,600	295	472,000
日本興亜損害保険	4,000	525	2,100,000
損害保険ジャパン	5,000	600	3,000,000
ニッセイ同和損害保険	2,000	411	822,000
あいおい損害保険	4,000	412	1,648,000
富士火災	6,000	92	552,000
東京海上HD	3,900	2,411	9,402,900
T&Dホールディングス	1,400	1,883	2,636,200
三井不動産	4,000	1,472	5,888,000
三菱地所	7,000	1,398	9,786,000
平和不動産	1,000	267	267,000
東京建物	2,000	332	664,000
ダイビル	800	705	564,000
サンケイビル	600	545	327,000
東急不動産	3,000	329	987,000
住友不動産	3,000	1,572	4,716,000
東宝不動産	700	472	330,400
大京	4,000	172	688,000
テーオーシー	1,400	332	464,800
レオパレス21	1,000	356	356,000
フジ住宅	1,000	313	313,000
空港施設	500	478	239,000
住友不動産販売	200	3,825	765,000
ゴールドクレスト	260	2,344	609,440
リロ・ホールディング	300	1,405	421,500
東急リバブル	500	637	318,500
飯田産業	300	1,536	460,800

イオンモール	1,000	1,666	1,666,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	19	67,900	1,290,100
東武鉄道	4,000	479	1,916,000
相鉄ホールディングス	2,000	388	776,000
東京急行	6,000	362	2,172,000
京浜急行	3,000	690	2,070,000
小田急電鉄	4,000	733	2,932,000
京王電鉄	3,000	581	1,743,000
京成電鉄	2,000	496	992,000
富士急行	1,000	430	430,000
東日本旅客鉄道	2,000	5,860	11,720,000
西日本旅客鉄道	10	305,500	3,055,000
東海旅客鉄道	11	657,000	7,227,000
西日本鉄道	2,000	349	698,000
近畿鉄道	8,000	271	2,168,000
阪急阪神HLDGS	6,000	406	2,436,000
南海電鉄	3,000	355	1,065,000
京阪電鉄	3,000	367	1,101,000
名古屋鉄道	5,000	263	1,315,000
ビューテックノオリン	400	686	274,400
富士物流	1,000	170	170,000
日本通運	5,000	370	1,850,000
ヤマトホールディングス	2,000	1,189	2,378,000
山九	2,000	410	820,000
日石輸送	2,000	192	384,000
福山通運	2,000	448	896,000
セイノーホールディングス	1,000	586	586,000
神奈川中央交通	1,000	502	502,000
日立物流	700	1,190	833,000
日本郵船	6,000	322	1,932,000
商船三井	6,000	543	3,258,000
川崎汽船	3,000	305	915,000
新和海運	2,000	262	524,000
飯野海運	1,100	475	522,500
第一中央汽船	2,000	217	434,000
全日本空輸	13,000	257	3,341,000
パスコ	3,000	165	495,000
三菱倉庫	1,000	961	961,000
三井倉庫	1,000	321	321,000
住友倉庫	1,000	387	387,000
渋沢倉庫	1,000	271	271,000
伊勢湾海運	1,000	380	380,000
上組	1,000	685	685,000
郵船航空サービス	200	1,224	244,800
近鉄エクスプレス	200	2,280	456,000
東京放送HD	1,100	1,296	1,425,600
日本テレビ放送網	140	12,160	1,702,400
朝日放送	50	4,620	231,000
テレビ朝日	7	142,100	994,700
テレビ東京	200	1,829	365,800
スカパーJSA THD	24	38,450	922,800
イー・アクセス	11	68,900	757,900
NECモバイルリング	200	2,244	448,800
日本電信電話	5,100	3,930	20,043,000
KDDI	23	493,500	11,350,500

光通信	300	1,454	436,200
沖縄セルラー電話	4	168,000	672,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	218	137,500	29,975,000
ゼンリン	500	1,006	503,000
昭文社	900	556	500,400
角川グループHLDGS	300	2,111	633,300
東京電力	6,500	2,438	15,847,000
中部電力	3,700	2,300	8,510,000
関西電力	4,500	2,082	9,369,000
中国電力	1,800	1,770	3,186,000
北陸電力	1,100	1,945	2,139,500
東北電力	2,400	1,867	4,480,800
四国電力	1,100	2,505	2,755,500
九州電力	2,200	1,945	4,279,000
北海道電力	1,100	1,710	1,881,000
沖縄電力	200	4,850	970,000
電源開発	900	2,805	2,524,500
東京瓦斯	13,000	379	4,927,000
大阪瓦斯	11,000	318	3,498,000
東邦瓦斯	3,000	489	1,467,000
北海道瓦斯	3,000	238	714,000
西部瓦斯	2,000	248	496,000
静岡瓦斯	1,000	538	538,000
松竹	1,000	813	813,000
東宝	1,000	1,431	1,431,000
エイチ・アイ・エス	200	1,688	337,600
東映	1,000	453	453,000
NTTデータ	13	262,900	3,417,700
共立メンテナンス	300	1,287	386,100
セゾン情報システムズ	1,000	634	634,000
日本医療事務センター	1,200	382	458,400
ナガワ	400	457	182,800
よみうりランド	1,000	286	286,000
東京都競馬	3,000	127	381,000
東京ドーム	2,000	243	486,000
DTS	400	863	345,200
スクウェア・エニックス・HD	600	1,808	1,084,800
カブコン	400	1,440	576,000
日本空港ビルデング	500	1,232	616,000
トランス・コスモス	300	735	220,500
住商情報システム	300	1,223	366,900
藤田観光	1,000	349	349,000
セコム	1,200	4,045	4,854,000
CSKホールディングス	1,000	372	372,000
アイネス	400	641	256,400
メイテック	200	1,605	321,000
アサツー ディ・ケイ	200	1,784	356,800
富士ソフト	200	1,429	285,800
船井総合研究所	1,000	501	501,000
日システム	600	997	598,200
コナミ	700	1,571	1,099,700
ベネッセホールディングス	500	3,985	1,992,500
イオンディライト	200	1,160	232,000
ニチイ学館	500	849	424,500
ダイセキ	300	1,780	534,000

ステップ	1,000	455	455,000
トラスコ中山	400	1,295	518,000
ヤマダ電機	490	5,950	2,915,500
オートバックスセブン	200	2,588	517,600
ニトリ	300	7,000	2,100,000
パーカーコーポレーション	2,000	144	288,000
吉野家ホールディングス	3	99,600	298,800
加藤産業	300	1,501	450,300
イノテック	800	452	361,600
松屋フーズ	200	1,349	269,800
日伝	100	2,048	204,800
日本電計	800	309	247,200
ミロク情報サービス	3,000	222	666,000
因幡電機産業	100	2,087	208,700
王将フードサービス	200	2,510	502,000
住金物産	1,000	186	186,000
ココスジャパン	300	2,016	604,800
プレナス	200	1,272	254,400
パロー	600	723	433,800
ミスミグループ本社	500	1,494	747,000
藤久	400	1,400	560,000
マルコ	1,800	130	234,000
ファーストリテイリング	500	14,370	7,185,000
ソフトバンク	5,500	2,255	12,402,500
蔵王産業	1,300	509	661,700
スズケン	500	3,005	1,502,500
サンドラッグ	400	2,084	833,600
東京デリカ	1,400	315	441,000
ベルーナ	900	372	334,800
合計	1,960,754		1,569,584,755

(注) 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

エヌ・ティ・ティ・ドコモ

80株

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、前中間計算期間（平成21年2月17日から平成21年8月16日まで）の中間財務諸表については、あずさ監査法人により中間監査を受け、当中間計算期間（平成22年2月16日から平成22年8月15日まで）の中間財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となりました。

DI R日本株総合インデックス・ファンド

【中間財務諸表】

D I R 日本株総合インデックス・ファンド

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前中間計算期間末 平成21年8月16日現在	当中間計算期間末 平成22年8月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	130,390,268	105,392,500
株式	3 1,784,415,290	3 1,482,914,535
派生商品評価勘定	3,881,913	-
未収入金	671,371,910	-
未収配当金	1,772,760	1,212,260
未収利息	910	598
前払金	-	2,568,000
流動資産合計	2,591,833,051	1,592,087,893
資産合計		
2,591,833,051		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,710,512
前受金	4,440,000	-
未払解約金	706,399,400	-
未払受託者報酬	931,144	627,706
未払委託者報酬	7,316,404	4,932,250
その他未払費用	66,416	44,747
流動負債合計	719,153,364	7,315,215
負債合計		
719,153,364		
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,749,000,000	1 2,700,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2 876,320,313	2 1,115,227,322
（分配準備積立金）	640,288,996	624,668,786
元本等合計	1,872,679,687	1,584,772,678
純資産合計		
1,872,679,687		
負債純資産合計		
2,591,833,051		

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 平成21年2月17日 至 平成21年8月16日	当中間計算期間 自 平成22年2月16日 至 平成22年8月15日
営業収益		
受取配当金	30,707,265	17,283,986
受取利息	85,241	57,643
有価証券売買等損益	578,796,299	84,600,535
派生商品取引等損益	31,608,074	6,328,903
その他収益	36,760	33,984
営業収益合計	641,233,639	73,553,825
営業費用		
受託者報酬	931,144	627,706
委託者報酬	7,316,404	4,932,250
その他費用	66,416	44,747
営業費用合計	8,313,964	5,604,703
営業利益又は営業損失（ ）	632,919,675	79,158,528
経常利益又は経常損失（ ）	632,919,675	79,158,528
中間純利益又は中間純損失（ ）	632,919,675	79,158,528
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	231,533,812	437,767
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,276,511,988	1,039,466,794
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,174,433,412	3,835,767
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,174,433,412	3,835,767
剰余金減少額又は欠損金増加額	175,627,600	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	175,627,600	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	876,320,313	1,115,227,322

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	前中間計算期間 自 平成21年2月17日 至 平成21年8月16日	当中間計算期間 自 平成22年2月16日 至 平成22年8月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、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 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引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取引所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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	前中間計算期間末 平成21年8月16日現在	当中間計算期間末 平成22年8月15日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	4,903,000,000円 373,000,000円 2,527,000,000円	2,710,000,000円 - 円 10,000,000円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,749,000,000口	2,700,000,000口
3. 2 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は876,320,313円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,115,227,322円であります。
4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 11,280,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 11,208,000円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前中間計算期間 自 平成21年2月17日 至 平成21年8月16日	当中間計算期間 自 平成22年2月16日 至 平成22年8月15日
	該当事項はありません。	同左

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

種類	前中間計算期間末 平成21年8月16日 現在			当中間計算期間末 平成22年8月15日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	83,610,000	-	87,525,000	3,915,000	101,628,000	-	99,960,000	1,668,000
合計	83,610,000	-	87,525,000	3,915,000	101,628,000	-	99,960,000	1,668,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末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。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	前中間計算期間末 平成21年8月16日現在	当中間計算期間末 平成22年8月15日現在
1口当たり純資産額	0.6812円	0.5870円
(1万口当たり純資産額)	(6,812円)	(5,870円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成22年11月30日

資産総額	1,523,468,738円	
負債総額	8,515,818円	
純資産総額（ - ）	1,514,952,920円	
発行済数量	2,480,000,000口	
1単位当たり純資産額（ / ）		0.6109円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡

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な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得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。

(6) 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。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振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。

(8) 償還金

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なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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】

a. 資本金の額

平成22年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、3名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者である運用本部長（CIO）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

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として、証券投資信託の設定を行なうとともに「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）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成22年11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	10	30,022
追加型株式投資信託	358	6,749,735
株式投資信託 合計	368	6,779,757
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,868,241
公社債投資信託 合計	17	2,868,241
総合計	385	9,647,998

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「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。）並びに同規則第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）に基づいて作成しております。

なお、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しており、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「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。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表及び第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第52期事業年度に係る中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,961,462	4,783,803
有価証券	28,233,112	26,970,072
前払金	453	136
前払費用	84,549	77,248
未収入金	20,722	3,858
未収消費税等	27,138	-
未収委託者報酬	5,273,080	7,030,430
未収収益	25,476	90,787
貯蔵品	38,909	30,324
繰延税金資産	227,536	566,334
その他	2,030	256,955
流動資産計	37,894,473	39,809,953
固定資産		
有形固定資産	1	1,186,818
建物（純額）	349,484	318,162
器具備品（純額）	900,893	757,333

建設仮勘定		1,785		111,322
無形固定資産		1,980,730		1,751,209
ソフトウェア		1,967,944		1,558,342
ソフトウェア仮勘定		-		179,630
電話加入権		11,850		11,850
商標権		-		660
その他		936		725
投資その他の資産		8,317,769		10,657,920
投資有価証券		7,780,508		10,018,677
関係会社株式		737,012		737,012
出資金		178,806		178,806
従業員に対する長期貸付金		155,692		104,419
差入保証金		618,264		617,615
長期前払費用		8,394		8,402
投資不動産（純額）	1	579,162	1	489,861
貸倒引当金	3	1,740,069	3	1,496,873
固定資産計		11,550,663		13,595,948
資産合計		49,445,137		53,405,901

（単位：千円）

	前事業年度 （平成21年3月31日現在）	当事業年度 （平成22年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	48,999	46,289
未払金	5,335,193	7,304,929
未払収益分配金	32,233	31,110
未払償還金	278,950	261,645
未払手数料	2,896,691	3,847,895
その他未払金	2,212,318	3,164,277
未払費用	1,528,570	2,212,051
未払法人税等	442,052	692,446
未払消費税等	-	104,897
賞与引当金	223,000	838,400
その他	1,951	168,621
流動負債計	7,579,766	11,367,635
固定負債		
退職給付引当金	1,150,011	1,179,482
役員退職慰労引当金	62,520	39,300
繰延税金負債	1,767,537	1,963,856
固定負債計	2,980,068	3,182,638
負債合計	10,559,835	14,550,274
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		

資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金	9,659,553	9,085,103
利益剰余金合計	12,833,851	12,259,401
株主資本合計	39,503,851	38,929,401
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	618,549	18,061
繰延ヘッジ損益	-	55,712
評価・換算差額等合計	618,549	73,774
純資産合計	38,885,301	38,855,627
負債・純資産合計	49,445,137	53,405,901

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	67,765,880	63,362,142
その他営業収益	391,449	432,889
営業収益計	68,157,330	63,795,032
営業費用		
支払手数料	40,411,927	37,293,022
広告宣伝費	836,270	917,652
公告費	2,131	257
受益証券発行費	4,887	131
調査費	4,089,629	4,336,342
調査費	752,522	771,298
委託調査費	3,337,107	3,565,043
委託計算費	657,069	601,778
営業雑経費	1,828,907	1,793,369
通信費	264,500	284,273
印刷費	908,407	837,408
協会費	49,882	45,168
諸会費	11,279	11,118
その他営業雑経費	594,837	615,400
営業費用計	47,830,823	44,942,552
一般管理費		
給料	3,940,850	4,847,709
役員報酬	149,400	217,200
給料・手当	3,408,724	3,478,553
賞与	159,726	313,555
賞与引当金繰入額	223,000	838,400
福利厚生費	573,052	680,311
交際費	89,101	80,019
寄付金	630	-
旅費交通費	233,872	178,718
租税公課	328,325	166,974
不動産賃借料	730,467	731,728
退職給付費用	310,345	303,972
役員退職慰労引当金繰入額	26,700	37,500
固定資産減価償却費	1,012,489	941,172
諸経費	904,760	990,534
一般管理費計	8,150,595	8,958,640
営業利益	12,175,911	9,893,838

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	33,852	61,884
有価証券利息	350,432	87,447
受取利息	4,904	3,425
時効成立分配金・償還金	38,525	40,507
投資有価証券売却益	-	213,196
有価証券償還益	26,762	33,090
為替差益	721,935	-
その他	20,641	82,595
営業外収益計	1,197,054	522,147
営業外費用		
時効成立後支払分配金・償還金	127,439	101,945
貯蔵品廃棄損	74,887	44,214
投資有価証券売却損	-	263,840
為替差損	-	7,870
デリバティブ損失	885,196	-
貸倒引当金繰入額	2 621,387	-
その他	50,066	68,406
営業外費用計	1,758,977	486,276
経常利益	11,613,987	9,929,709
特別利益		
投資有価証券売却益	2,157	-
貸倒引当金戻入額	-	159,959
特別利益計	2,157	159,959
特別損失		
投資有価証券売却損	2,298	-
投資有価証券評価損	218,872	-
投資有価証券清算損	10,639	-
固定資産除売却損	1 11,886	1 16,233
減損損失	-	3 76,450
その他	4 42,274	-
特別損失計	285,971	92,683
税引前当期純利益	11,330,173	9,996,985
法人税、住民税及び事業税	4,648,684	4,592,433
法人税等調整額	168,125	516,225
法人税等合計	4,816,810	4,076,208
当期純利益	6,513,363	5,920,777

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	11,702,152	9,659,553
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777
当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	9,659,553	9,085,103
利益剰余金合計		
前期末残高	14,876,450	12,833,851
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777

当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	12,833,851	12,259,401

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	当事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
株主資本合計		
前期末残高	41,546,450	39,503,851
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777
当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	39,503,851	38,929,401
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	402,154	618,549
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	216,395	600,487
当期変動額合計	216,395	600,487
当期末残高	618,549	18,061
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	-	-
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	55,712
当期変動額合計	-	55,712
当期末残高	-	55,712
評価・換算差額等合計		
前期末残高	402,154	618,549
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	216,395	544,775
当期変動額合計	216,395	544,775
当期末残高	618,549	73,774
純資産合計		
前期末残高	41,144,295	38,885,301
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	216,395	544,775
当期変動額合計	2,258,994	29,674
当期末残高	38,885,301	38,855,627

重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	(1) 子会社及び関連会社株式 移動平均法による原価法によ り計上しております。 (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）を採 用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採 用しております。	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左
2. デリバティブの評価 基準及び評価方法	時価法により計上しておりま す。	同左
3. 固定資産の減価償却 の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 （リース資産を除く） 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通 りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 定額法によっております。 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）に基づいておりま す。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。	(1) 有形固定資産及び投資不動産 （リース資産を除く） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 同左 (3) 長期前払費用 同左
4. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、 一般債権については貸倒実績率法 により、貸倒懸念債権及び破産更 生債権等については財務内容評価 法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与 の支給に備えるため、支給見込額 を計上しております。	(1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 同左

5 . ヘッジ会計の方法	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金 同左</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 同左</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>
6 . リース取引の処理方法	<p>リース取引開始日が平成20年3月31日以前の、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・リース取引については、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おります。</p>	同左
7 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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処理によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p>	<p>(1) 消費税等の会計処理 同左</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 同左</p>

会計方針の変更

<p>前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)</p>	<p>当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)</p>
---	---

<p>（リース取引に関する会計基準）</p> <p>当事業年度より、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））を適用しております。</p> <p>なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理を適用しております。</p> <p>当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p>	
---	--

追加情報

前事業年度 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）	当事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）
	<p>（投資有価証券売却損益の計上区分の変更）</p> <p>従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。</p> <p>この結果、従来の方法と同一の方法によった場合と比べ、経常利益は50,644千円少なく計上されておりますが、税引前当期純利益に与える影響はありません。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成21年3月31日現在）	当事業年度 （平成22年3月31日現在）																																
<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">建物</td> <td style="width: 15%;">776,838千円</td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>1,691,069千円</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td>675,647千円</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td>26,929千円</td> <td></td> <td></td> </tr> </table> <p>2 関係会社項目 関係会社に対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あります。 未払金 1,848,998千円</p> <p>3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して保証を行っております。</p>	建物	776,838千円			器具備品	1,691,069千円			投資建物	675,647千円			投資器具備品	26,929千円			<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">建物</td> <td style="width: 15%;">815,365千円</td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>1,938,369千円</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td>688,305千円</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td>27,339千円</td> <td></td> <td></td> </tr> </table> <p>2 関係会社項目 関係会社に対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あります。 未払金 3,002,391千円</p> <p>3 同左</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。</p>	建物	815,365千円			器具備品	1,938,369千円			投資建物	688,305千円			投資器具備品	27,339千円		
建物	776,838千円																																
器具備品	1,691,069千円																																
投資建物	675,647千円																																
投資器具備品	26,929千円																																
建物	815,365千円																																
器具備品	1,938,369千円																																
投資建物	688,305千円																																
投資器具備品	27,339千円																																

（損益計算書関係）

前事業年度 （自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）	当事業年度 （自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日）
<p>1 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>固定資産除売却損</p> <p>器具備品 11,886千円</p> <p>2 貸倒引当金繰入額に関する注記 保有している外貨建資産担保債券の1銘柄について、清算事象が生じているため、当該銘柄の回収不能見込額を算定し、その見積金額を貸倒引当金として計上しております。 なお、貸倒引当金の計上基準については重要な会計方針に記載しております。</p> <p>4 特別損失の「その他」の主な内訳</p> <p>受益証券予備券廃棄損 21,160千円 ゴルフ会員権評価損 19,403千円</p>	<p>1 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>固定資産除売却損</p> <p>器具備品 1,439千円 ソフトウェア 14,793千円</p> <p>3 減損損失に関する注記 当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。 場所 千葉県浦安市 用途 賃貸等不動産（浦安寮） 種類 建物及び土地</p> <p>当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループングとしております。</p> <p>浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,450千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物7,750千円及び土地68,700千円であります。 なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。</p>

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	前事業年度末 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年6月20日 定時株主総会	普通株式	8,555	3,280	平成20年 3月31日	平成20年 6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成21年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

剰余金の配当の総額	6,495百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,490円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月22日

当事業年度（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

（単位：千株）

	前事業年度末 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月19日 定時株主総会	普通株式	6,495	2,490	平成21年 3月31日	平成21年 6月22日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成22年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

剰余金の配当の総額	11,216百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,300円
基準日	平成22年3月31日

効力発生日

平成22年6月28日

（リース取引関係）

前事業年度 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）	当事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）																										
<p>（借主側） リース取引開始日が平成20年3月31日以前の 所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>（1）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 style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td></td> <td style="text-align: center;">器具備品</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">4,599千円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">3,613千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2" style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>（2）未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2" style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>（3）支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: right;">支払リース料</td> <td style="text-align: right;">1,314千円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">1,314千円</td> </tr> </table> <p>（4）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>		器具備品	取得価額相当額	4,599千円	減価償却累計額相当額	3,613千円			期末残高相当額	985千円	1年以内	985千円	1年超	- 千円			合計	985千円	支払リース料	1,314千円	減価償却費相当額	1,314千円	<p>（借主側） リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>（1）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> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>（2）未経過リース料期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>（3）支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: right;">支払リース料</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>（4）減価償却費相当額の算定方法 同左</p>	支払リース料	985千円	減価償却費相当額	985千円
	器具備品																										
取得価額相当額	4,599千円																										
減価償却累計額相当額	3,613千円																										
期末残高相当額	985千円																										
1年以内	985千円																										
1年超	- 千円																										
合計	985千円																										
支払リース料	1,314千円																										
減価償却費相当額	1,314千円																										
支払リース料	985千円																										
減価償却費相当額	985千円																										

（金融商品関係）

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式、債券であり

ます。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。債券は外貨建資産担保債券を保有しており、発行体の信用リスク及び為替変動リスクに晒されております。

未払手数料は投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引は為替予約及び株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。このうち株式先物取引についてはヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っており、外貨建資産担保債券について為替予約を利用してヘッジしております。

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

() デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合のみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2.金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスク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、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

	貸借対照表 計上 額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,783,803	4,783,803	-
(2) 未収委託者報酬	7,030,430	7,030,430	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	34,012,542	34,012,542	-
資産計	45,826,776	45,826,776	-
(1) 未払手数料	3,847,895	3,847,895	-
(2) その他未払金	3,164,277	3,164,277	-
(3) 未払費用(*1)	1,696,832	1,696,832	-
負債計	8,709,004	8,709,004	-
デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(7,985)	(7,985)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(159,516)	(159,516)	-
デリバティブ取引計	(167,501)	(167,501)	-

(*1) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(*2) 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並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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ます。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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」をご参照下さい。

<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

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	

外貨建資産担保債券(*1)	311,905
非上場株式	1,172,137
(2) 子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	737,012
(3) 長期差入保証金	617,615

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積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ものであるため、時価開示の対象としておりません。

(*1) 外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	4,783,803	-	-	-
未収委託者報酬	7,030,430	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期 があるもの	-	746,330	1,547,596	-
合計	11,814,233	746,330	1,547,596	-

外貨建資産担保債券311,905千円は清算事象が生じており、償還予定額を見込めないため上記表には含めておりません。

(追加情報)

当事業年度より、平成20年3月10日公表の「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準委員会 企業会計基準第10号)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第19号)を適用しております。

(有価証券関係)

前事業年度(平成21年3月31日現在)

1. その他有価証券で時価のあるもの

	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (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			
(1)株式	55,101	67,520	12,418
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	1,732,000	1,815,427	83,427
小計	1,787,101	1,882,948	95,846
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	3,766,074	2,627,319	1,138,755

小計	3,766,074	2,627,319	1,138,755
合計	5,553,176	4,510,267	1,042,909

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
売却額(千円)	190,340
売却益の合計額(千円)	2,157
売却損の合計額(千円)	2,298

3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

	貸借対照表計上額 (千円)
子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	737,012
小計	737,012
その他有価証券	
非上場株式	1,172,137
外貨建資産担保債券	2,098,103
MMF・中期国債ファンド	28,233,112
小計	31,503,352
合計	32,240,364

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

	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)
その他 証券投資信託の 受益証券	-	376,553	1,729,191	-
合計	-	376,553	1,729,191	-

当事業年度(平成22年3月31日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(貸借対照表計上額 737,012千円)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。

2. その他有価証券

	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			
(1)株式	76,077	55,101	20,975

(2)その他 証券投資信託の受益証券	4,728,727	4,379,317	349,410
小計	4,804,805	4,434,419	370,385
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	29,207,737	29,608,576	400,839
小計	29,207,737	29,608,576	400,839
合計	34,012,542	34,042,996	30,453

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,172,137千円）、外貨建資産担保債券（貸借対照表計上額（貸倒引当金控除前）1,804,069千円）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。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

種類	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
その他 証券投資信託の受益証券	13,871,201	213,196	263,840
合計	13,871,201	213,196	263,840

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 取引の状況に関する事項

前事業年度 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
<p>(1) 取引の内容及び利用目的 当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。</p> <p>(2) 取引に対する取組方針 為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。</p> <p>(3) 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。</p> <p>(4) 取引に係るリスク管理体制 為替予約取引開始にあたっては、事前に取締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。</p>

2. 取引の時価等に関する事項（平成21年3月31日現在）

通貨関連

（単位：千

円）

区分	デリバティブ 取引の種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1 年超		
市場取引 以外の取引	為替予約 取引 売建 米ドル	410,852	-	1,622	1,622
合計		410,852	-	1,622	1,622

（注）時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

通貨関連

（単位：千円）

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	280,388	-	7,985	7,985
合計		280,388	-	7,985	7,985

（注）時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ会 計の方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
繰延ヘッ ジ処理	株価指数先物取引 売建 TOPIX	投資 有価証券	2,303,784	-	159,516	東京証券取引所 から公表された 価格によってい る。
合計			2,303,784	-	159,516	

（退職給付関係）

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,150,011千円 退職給付引当金 1,150,011千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 168,703千円 その他 141,642千円 退職給付費用 310,345千円 なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は118,690千円であります。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,179,482千円 退職給付引当金 1,179,482千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 175,249千円 その他 128,723千円 退職給付費用 303,972千円 なお、「その他」の128,723千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。</p>

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 886,012 貸倒引当金 708,034 退職給付引当金 467,939 その他有価証券評価差額金 424,359 投資有価証券評価損 303,843 株式譲渡損繰延 287,965 出資金評価損 126,163 未払事業税 108,049 賞与引当金 90,738 器具備品 38,093 役員退職慰労引当金 25,439 未払社会保険料 11,283 その他 31,981</p> <p>繰延税金資産小計 3,509,905 評価性引当額 2,210,636 繰延税金資産合計 1,299,269</p> <p>繰延税金負債</p> <p>株式譲渡益繰延 2,837,113 その他 2,156 繰延税金負債合計 2,839,269 繰延税金負債の純額 1,540,000</p>	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 915,392 貸倒引当金 609,077 退職給付引当金 479,931 賞与引当金 302,163 株式譲渡損繰延 287,965 投資有価証券評価損 225,062 外貨建有価証券換算差額 176,654 未払事業税 163,956 出資金評価損 126,163 その他有価証券評価差額金 65,652 未払社会保険料 44,836 繰延ヘッジ損益 38,221 器具備品 38,093 役員退職慰労引当金 15,991 その他 27,316</p> <p>繰延税金資産小計 3,516,480 評価性引当額 2,139,543 繰延税金資産合計 1,376,937</p> <p>繰延税金負債</p> <p>株式譲渡益繰延 2,772,301 その他 2,156 繰延税金負債合計 2,774,458 繰延税金負債の純額 1,397,521</p>

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率 (調整)	40.69%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.35
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.13
住民税均等割	0.03
評価性引当額	2.32
その他	0.74
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.52

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

(関連当事者情報)

前事業年度(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

(追加情報)

当事業年度より、平成18年10月17日公表の「関連当事者の開示に関する会計基準」(企業会計基準第11号)及び「関連当事者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13号)を適用しております。

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証	711,260	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,915,828	未払手数料	2,154,948
同一の親会社をもつ会社	大和証券エスエムピーシー(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	980,553	未払手数料	58,506
							為替予約	17,314,889	-	-

同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	1,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	544,950	その他未払金	197,190
-------------	---------	--------	-------	---------	---	-----------	-----------	---------	--------	---------

(注) 1. 上記(ア)～(イ)の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。
- (3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (4) (株)大和総研との取引金額には、(株)大和総研ホールディングス(旧・(株)大和総研)分社化前の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社(東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

当事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証	598,500	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	22,043,473	未払手数料	2,870,857
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	676,687	未払手数料	64,597
							為替予約	3,946,508	-	-

- (注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として、代行手数料を支払っております。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。
3. 大和証券エスエムピーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケット(株)に商号変更しております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 14,907.00円 1株当たり当期純利益 2,496.95円 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、潜在株式が存在しないため記載していません。	1株当たり純資産額 14,895.63円 1株当たり当期純利益 2,269.77円 同左

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当期純利益(千円)	6,513,363	5,920,777
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
該当事項はありません。	同左

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

当中間会計期間末
(平成22年9月30日)

資産の部

流動資産

現金・預金		6,449,461
有価証券		15,679,929
未収委託者報酬		6,749,851
貯蔵品		31,123
繰延税金資産		149,110
その他		499,217

流動資産計		29,558,694
-------	--	------------

固定資産

有形固定資産	1	1,027,173
無形固定資産		2,186,747
投資その他の資産		
投資有価証券		10,171,248
その他	1	1,364,720
貸倒引当金		4,750

投資その他の資産合計		11,531,218
------------	--	------------

固定資産計		14,745,139
-------	--	------------

資産合計		44,303,833
------	--	------------

(単位:千円)

当中間会計期間末
(平成22年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		5,238,233
未払法人税等		667,986
賞与引当金		202,000
その他	3	2,493,174

流動負債計		8,601,395
-------	--	-----------

固定負債

繰延税金負債		1,933,977
退職給付引当金		1,282,101
役員退職慰労引当金		44,910

固定負債計		3,260,989
-------	--	-----------

負債合計		11,862,385
------	--	------------

純資産の部

株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	5,495,206
利益剰余金合計	5,869,503
株主資本合計	32,539,503
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	256,133
繰延ヘッジ損益	158,077
評価・換算差額等合計	98,055
純資産合計	32,441,448
負債・純資産合計	44,303,833

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		35,840,980
その他営業収益		182,006
営業収益計		36,022,986
営業費用		
支払手数料		20,637,131
その他営業費用		4,755,940
営業費用計		25,393,071
一般管理費	1	4,061,645
営業利益		6,568,268
営業外収益	2	141,078
営業外費用	1, 3	151,930
経常利益		6,557,417
特別利益	4	614,232
特別損失		16,401
税引前中間純利益		7,155,248
法人税、住民税及び事業税		1,924,484
法人税等調整額		404,004
中間純利益		4,826,760

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

		当中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)
株主資本		
資本金		
前期末残高		15,174,272
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高		11,495,727
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高		11,495,727
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高		374,297
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高		2,800,000
当中間期変動額		
別途積立金の取崩		2,800,000
当中間期変動額合計		2,800,000
当中間期末残高		-
繰越利益剰余金		
前期末残高		9,085,103
当中間期変動額		
別途積立金の取崩		2,800,000
剰余金の配当		11,216,657
中間純利益		4,826,760
当中間期変動額合計		3,589,897
当中間期末残高		5,495,206

(単位:千円)

当中間会計期間
(自 平成22年 4月 1日
至 平成22年 9月30日)

利益剰余金合計	
前期末残高	12,259,401
当中間期変動額	
剰余金の配当	11,216,657
中間純利益	4,826,760
当中間期変動額合計	6,389,897
当中間期末残高	5,869,503
株主資本合計	
前期末残高	38,929,401
当中間期変動額	
剰余金の配当	11,216,657
中間純利益	4,826,760
当中間期変動額合計	6,389,897
当中間期末残高	32,539,503
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	18,061
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	238,071
当中間期変動額合計	238,071
当中間期末残高	256,133
繰延ヘッジ損益	
前期末残高	55,712
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	213,790
当中間期変動額合計	213,790
当中間期末残高	158,077
評価・換算差額等合計	
前期末残高	73,774
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	24,281
当中間期変動額合計	24,281
当中間期末残高	98,055
純資産合計	
前期末残高	38,855,627
当中間期変動額	
剰余金の配当	11,216,657
中間純利益	4,826,760
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	24,281
当中間期変動額合計	6,414,178
当中間期末残高	32,441,448

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

	当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 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）を採用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。
2. 固定資産の減価償却 の方法	(2) デリバティブ 時価法により計上しております。 (1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産 定額法によっております。 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）に基づいております。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。
3. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実 績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財 務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見 込額の当中間会計期間負担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、当社の退職金規程に基づく 当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社 の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、 能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が 確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づ く当中間会計期間末要支給額を計上しております。 (4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程 に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>
5. 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	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p>

会計方針の変更

<p>当中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)</p>
<p>(資産除去債務に関する会計基準) 当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。 なお、当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

<p>当中間会計期間末 (平成22年 9月30日)</p>	
<p>1. 減価償却累計額 有形固定資産 投資不動産</p>	<p>2,859,040千円 721,987千円</p>
<p>2. 債務保証 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,336,230千円に対して保証を行っております。</p>	
<p>3. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。</p>	

(中間損益計算書関係)

<p>当中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)</p>	
<p>1. 減価償却実施額</p>	

有形固定資産	119,658千円
無形固定資産	317,892千円
投資不動産	6,342千円
2. 営業外収益の主要項目	
受取配当金	67,527千円
有価証券利息	13,996千円
時効成立分配金・償還金	37,338千円
3. 営業外費用の主要項目	
時効成立後分配金・償還金	92,732千円
為替差損	18,809千円
4. 特別利益の主要項目	
貸倒引当金戻入額	614,232千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数（千株）	当中間会計期間 増加株式数（千株）	当中間会計期間 減少株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

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 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年6月25日 定時株主総会	普通株式	11,216	4,300	平成22年 3月31日	平成22年 6月28日

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されており、株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払金は主に投資信託の販売に係る手数料及び連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であり、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、ヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の中間財務諸表作成の基本となる重要な事項「4．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

（ ）デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2．金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスク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、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 現金・預金	6,449,461	6,449,461	-
(2) 未収委託者報酬	6,749,851	6,749,851	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	23,942,028	23,942,028	-
資産計	37,141,341	37,141,341	-
未払金	5,238,233	5,238,233	-
負債計	5,238,233	5,238,233	-
デリバティブ取引(*1)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(33,670)	(33,670)	-
デリバティブ取引計	(33,670)	(33,670)	-

(*1) 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並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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ます。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負 債

未払金

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」をご参照下さい。

<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

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	737,012

(3) 差入保証金	614,389
-----------	---------

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積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ものであるため、時価開示の対象としておりません。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	6,449,461	-	-	-
未収委託者報酬	6,749,851	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期 があるもの	-	712,226	3,285,860	-
合計	13,199,313	712,226	3,285,860	-

(有価証券関係)

当中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額737,012千円)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。

2. その他有価証券

	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			
(1) 株式	57,359	55,101	2,257
(2) その他 証券投資信託の受益証券	4,413,951	4,074,189	339,762
小計	4,471,310	4,129,291	342,019
中間貸借対照表計上額が取 得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託の受益証券	19,470,717	20,244,591	773,874
小計	19,470,717	20,244,591	773,874
合計	23,942,028	24,373,883	431,854

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額1,172,137千円)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」には含まれておりません。

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当する取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的処 理方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,106,965	-	33,670	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
	合計		2,106,965	-	33,670	

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益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。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益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。

（2）有形固定資産

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

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

ん。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当中間会計期間より、「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。

（1株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日）	
1株当たり純資産額	12,436.70円
1株当たり中間純利益金額	1,850.37円
(注) 1 . 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。	
2 . 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。	
中間純利益(千円)	4,826,760
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,826,760
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

（追加情報）

当社及び株式会社大和証券グループ本社（以下、総称して「大和証券グループ」）は、株式会社新生銀行傘下で、インドにおいてアセットマネジメント事業を行っているShinsei Asset Management (India) Private Limited（以下、「SAMI」）及びShinsei Trustee Company (India) Private Limited（以下、「STC」）の全株式を株式会社新生銀行及びその他の株主から取得することを決定しており、本件について、平成22年10月までにインド金融当局及び中央銀行からの承認を取得いたしました。

今後、最終的な取得手続を経た上で、SAMI及びSTCは大和証券グループの100%子会社になる予定です。

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。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。）、

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。）、

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。以下において同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、若しくは取引の公正を害し、又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】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成22年12月20日付で、Shinsei Asset Management (India) Pvt. Ltd.およびShinsei Trustee Company (India) Pvt. Ltd.への出資を行い、当該2社を子会社といたしました。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成22年3月末日現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 （平成22年3月 末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注）
大和証券キャピタル・マーケット株式会社	255,700	

（注）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

3 【資本関係】

該当ありません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成22年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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ある旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・ 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・ 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。
- 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - ・ 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・ 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- 次の事項を記載することがあります。
 - ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ファンドの形態等を記載することがあります。
- 図案を採用することがあります。
- ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用することがあります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成22年3月19日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	山元 太志 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I R日本株総合インデックス・ファンドの平成21年2月17日から平成22年2月15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 R日本株総合インデックス・ファンドの平成22年2月15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。

大和証券投資信託委託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

(注1) 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月1日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I R日本株総合インデックス・ファンドの平成22年2月16日から平成22年8月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間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、我が国におけ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。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I R日本株総合インデックス・ファンドの平成22年8月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月16日から平成22年8月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託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

（注1） 上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）](#)へ

独立監査人の監査報告書

平成22年6月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51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、大和証券投資信託委託株式会社の平成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

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月17日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森 公 高 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福 井 淳 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	梅 津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間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、我が国におけ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。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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、大和証券投資信託委託株式会社の平成22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22年4月1日から平成22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。

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成21年4月3日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	山元 太志 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I R日本株総合インデックス・ファンドの平成20年2月16日から平成21年2月16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、D I R日本株総合インデックス・ファンドの平成21年2月16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。

大和証券投資信託委託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

(注1) 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年10月2日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I R日本株総合インデックス・ファンドの平成21年2月17日から平成21年8月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間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、我が国におけ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。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I R日本株総合インデックス・ファンドの平成21年8月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成21年2月17日から平成21年8月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託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

（注1）上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）](#)へ

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50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、大和証券投資信託委託株式会社の平成21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

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