

【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5月6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5月7日から平成24年5月8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5月7日から平成24年5月8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

信託契約締結、当初設定、運用開始

平成 22年 7月 9日

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 2	損益 信託金(3)	
受託会社	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23年2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

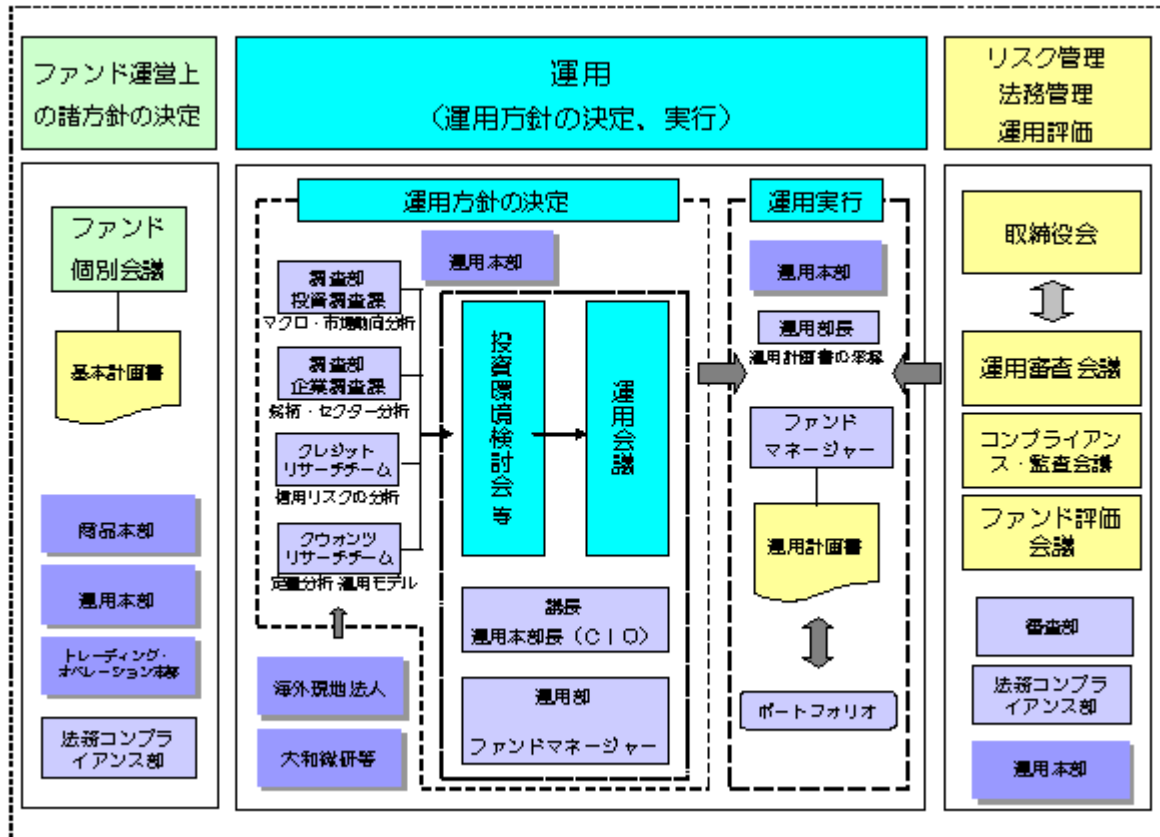
前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運

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23年2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

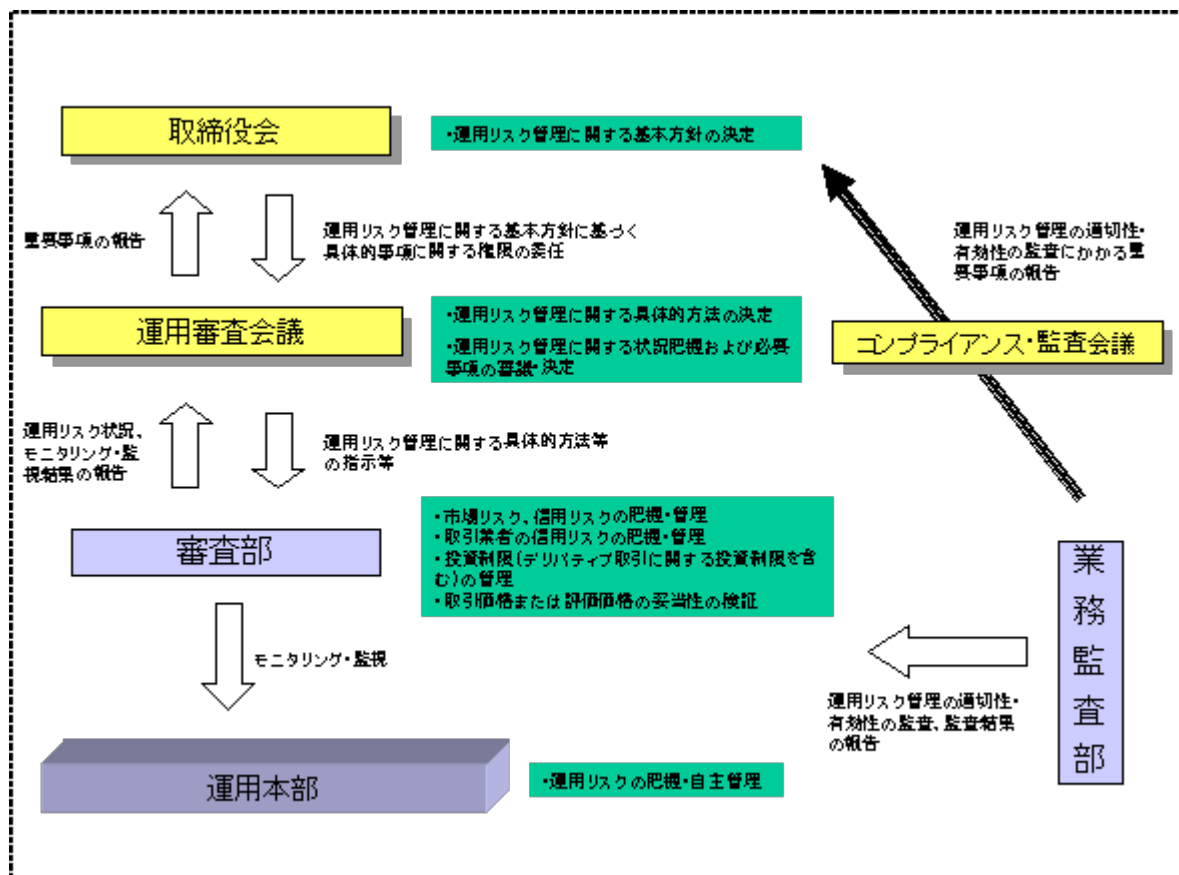
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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23年2月末現在のものですので、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23年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	1,529,575,980	92.62
内 日本	1,529,575,980	92.62
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	121,934,399	7.38
純資産総額	1,651,510,379	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）	114,120,000	6.91
内 日本	114,120,000	6.91

（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23年2月28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	3,910 59,823,000	3,820 58,446,000	- -	3.54%
2	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	195	154,200 30,069,000	153,500 29,932,500	- -	1.81%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	8,100	3,685 29,848,500	3,545 28,714,500	- -	1.74%
4	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	62,600	467 29,234,200	453 28,357,800	- -	1.72%
5	キヤノン 日本	株式 電気機器	5,900	3,920 23,128,000	3,940 23,246,000	- -	1.41%
6	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	6,300	3,070 19,341,000	3,085 19,435,500	- -	1.18%
7	三菱商事 日本	株式 卸売業	7,500	2,391 17,932,500	2,261 16,957,500	- -	1.03%
8	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	20,200	883 17,836,600	835 16,867,000	- -	1.02%
9	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	4,900	3,160 15,484,000	3,355 16,439,500	- -	1.00%
10	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	95,100	171 16,262,100	168 15,976,800	- -	0.97%
11	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	4,000	3,930 15,720,000	3,990 15,960,000	- -	0.97%

12	任天堂	日本	株式 その他製品	600	24,420 14,652,000	23,970 14,382,000	- -	0.87%
13	東京電力	日本	株式 電気・ガス業	6,800	2,094 14,239,200	2,114 14,375,200	- -	0.87%
14	ファナック	日本	株式 電気機器	1,100	12,620 13,882,000	12,680 13,948,000	- -	0.84%
15	武田薬品	日本	株式 医薬品	3,400	4,010 13,634,000	4,065 13,821,000	- -	0.84%
16	ソニー	日本	株式 電気機器	4,500	2,907 13,081,500	2,993 13,468,500	- -	0.82%
17	三井物産	日本	株式 卸売業	8,200	1,537 12,603,400	1,486 12,185,200	- -	0.74%
18	デンソー	日本	株式 輸送用機器	3,900	3,155 12,304,500	3,055 11,914,500	- -	0.72%
19	パナソニック	日本	株式 電気機器	10,800	1,116 12,052,800	1,101 11,890,800	- -	0.72%
20	小松製作所	日本	株式 機械	4,500	2,595 11,677,500	2,495 11,227,500	- -	0.68%
21	KDDI	日本	株式 情報・通信業	21	534,000 11,214,000	530,000 11,130,000	- -	0.67%
22	東芝	日本	株式 電気機器	19,000	532 10,108,000	535 10,165,000	- -	0.62%
23	三菱地所	日本	株式 不動産業	6,000	1,655 9,930,000	1,668 10,008,000	- -	0.61%
24	日立	日本	株式 電気機器	20,000	505 10,100,000	495 9,900,000	- -	0.60%
25	東日本旅客鉄道	日本	株式 陸運業	1,700	5,560 9,452,000	5,690 9,673,000	- -	0.59%
26	三菱電機	日本	株式 電気機器	10,000	993 9,930,000	967 9,670,000	- -	0.59%
27	国際石油開発帝石	日本	株式 鉱業	16	569,000 9,104,000	571,000 9,136,000	- -	0.55%
28	東京海上HD	日本	株式 保険業	3,400	2,692 9,152,800	2,679 9,108,600	- -	0.55%
29	信越化学	日本	株式 化学	1,900	4,735 8,996,500	4,695 8,920,500	- -	0.54%
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式 小売業	3,900	2,212 8,626,800	2,277 8,880,300	- -	0.54%

(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	92.62%
合計	92.62%

(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	0.65%
建設業	2.19%
食料品	2.57%
繊維製品	0.84%

パルプ・紙	0.33%
化学	5.40%
医薬品	3.63%
石油・石炭製品	0.83%
ゴム製品	0.60%
ガラス・土石製品	1.16%
鉄鋼	2.11%
非鉄金属	1.18%
金属製品	0.66%
機械	4.61%
電気機器	12.10%
輸送用機器	10.17%
精密機器	1.22%
その他製品	1.86%
電気・ガス業	3.60%
陸運業	2.85%
海運業	0.46%
空運業	0.23%
倉庫・運輸関連業	0.26%
情報・通信業	7.60%
卸売業	4.96%
小売業	4.17%
銀行業	7.37%
証券・商品先物取引業	1.25%
保険業	2.10%
その他金融業	0.97%
不動産業	2.19%
サービス業	2.35%
合計	92.62%

(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 2011年3月	買建	12	115,380,000	114,120,000	6.91%

(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
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
平成22年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	-
12月末日	1,582,755,075	-	0.6382	-
平成23年1月末日	1,604,859,997	-	0.6471	-
第11計算期間末 (平成23年2月15日)	1,671,032,055	1,695,832,055	0.6738	0.6838
2月末日	1,651,510,379	-	0.6659	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第11計算期間	0.0100

【収益率の推移】

	収益率（％）
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
第11計算期間	10.9

[次へ](#)

（参考情報）

2011年2月28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	6,659円
純資産総額	16億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.4%
3カ月間	10.6%
6カ月間	18.7%
1年間	8.4%
3年間	-22.8%
5年間	-39.2%
設定来	-27.3%



※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：100円 設定来分配金合計額：670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	第11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	11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	100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。

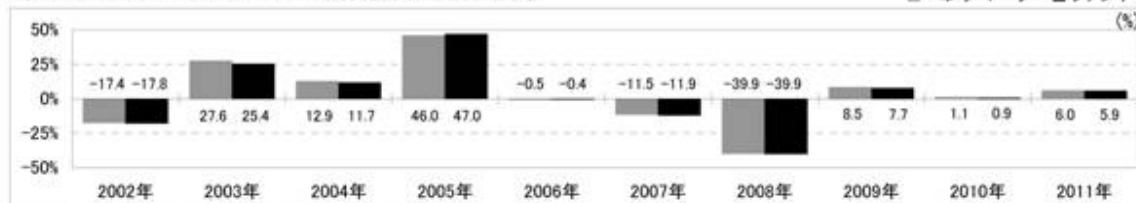
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	986	92.6%	電気機器	12.1%	TOPIX先物	-	6.9%
国内株式先物	1	6.9%	輸送用機器	10.2%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.6%	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	1.8%
コール・ローン、その他	-	7.4%	銀行業	7.4%	本田技研	輸送用機器	1.7%
合計	987	-	化学	5.4%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.7%
株式市場・上場別構成			卸売業	5.0%	キヤノン	電気機器	1.4%
一部(東証・大証・名証)		89.1%	機械	4.6%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.2%
二部(東証・大証・名証)		1.0%	小売業	4.2%	三菱商事	卸売業	1.0%
新興市場他		2.5%	医薬品	3.6%	日産自動車	輸送用機器	1.0%
その他		-	その他	32.6%	ソフトバンク	情報・通信業	1.0%
合計		92.6%	合計	92.6%	合計		21.3%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額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。

・2011年は2月28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
第11計算期間	0	230,000,000

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け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受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け付けたものとして、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け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け付けたものとして、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、）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、）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、以下「財務諸表等規則」という。）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、以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

ただし、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）については、改正前の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づき、第11期計算期間（平成22年2月16日から平成23年2月15日まで）については、改正後の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則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は、あずさ監査法人により監査を受け、第11期計算期間（平成22年2月16日から平成23年2月15日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により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。

1 【財務諸表】

DIR日本株総合インデックス・ファンド

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10期 平成22年2月15日現在	第11期 平成23年2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	131,165,108	148,348,935
株式	₃ 1,569,584,755	₃ 1,548,056,405
派生商品評価勘定	156,530	9,366,219
未収入金	52,806	2,344,435
未収配当金	1,433,930	1,412,910
差入委託証拠金	-	2,925,000
流動資産合計	1,702,393,129	1,712,453,904
資産合計	1,702,393,129	1,712,453,904
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	124,295	-
前受金	1,578,000	11,535,000
未払収益分配金	24,390,000	24,800,000
未払受託者報酬	645,915	569,685
未払委託者報酬	5,075,290	4,476,344
その他未払費用	46,423	40,820
流動負債合計	31,859,923	41,421,849
負債合計	31,859,923	41,421,849
純資産の部		
元本等		
元本	₁ 2,710,000,000	₁ 2,480,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	₂ 1,039,466,794	₂ 808,967,945
(分配準備積立金)	626,982,433	576,647,526
元本等合計	1,670,533,206	1,671,032,055
純資産合計	1,670,533,206	1,671,032,055
負債純資産合計	1,702,393,129	1,712,453,904

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期	第11期
	自 平成21年2月17日 至 平成22年2月15日	自 平成22年2月16日 至 平成23年2月15日
営業収益		
受取配当金	43,275,582	29,911,525
受取利息	144,578	120,690
有価証券売買等損益	425,303,444	129,422,135
派生商品取引等損益	25,056,862	12,992,595
その他収益	70,599	366,722
営業収益合計	493,851,065	172,813,667
営業費用		
受託者報酬	1,582,239	1,200,582
委託者報酬	12,432,393	9,433,669
その他費用	112,839	85,567
営業費用合計	14,127,471	10,719,818
営業利益	479,723,594	162,093,849
経常利益	479,723,594	162,093,849
当期純利益	479,723,594	162,093,849
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（ ）	238,516,409	4,985,929
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	1,206,421,609	88,219,071
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,206,421,609	88,219,071
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	186,193,600	-
分配金	1 24,390,000	1 24,800,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,039,466,794	808,967,945

(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10期 自 平成21年2月17日 至 平成22年2月15日	第11期 自 平成22年2月16日 至 平成23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）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ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
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、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10期 平成22年2月15日現在	第11期 平成23年2月15日現在
1. 1期首元本額	4,903,000,000円	2,710,000,000円
期中追加設定元本額	403,000,000円	- 円
期中一部解約元本額	2,596,000,000円	230,000,000円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,710,000,000口	2,480,000,000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1,039,466,794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808,967,945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 11,000,000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 12,336,000円
--------------------	--	--

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第10期 自 平成21年2月17日 至 平成22年2月15日	第11期 自 平成22年2月16日 至 平成23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(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。	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(27,676,805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(305,065,904円)及び分配準備積立金(573,770,721円)より分配対象額は906,513,430円(1万口当たり3,655.30円)であり、うち24,800,000円(1万口当たり90円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

第11期計算期間(平成22年2月16日から平成23年2月15日まで)より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

金融商品の状況に関する事項

区分	第11期 自 平成22年2月16日 至 平成23年2月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第11期 平成23年2月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 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、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第10期 平成22年2月15日現在		第11期 平成23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)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	1,569,584,755	202,576,553	129,318,213
合計	1,569,584,755	202,576,553	129,318,213

(デリバティブ取引に関する注記)

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）
取引の状況に関する事項

区 分	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。
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。
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。
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。
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。

取引の時価等に関する事項

株式関連

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

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。

第11期計算期間（平成22年2月16日から平成23年2月15日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	第11期 平成23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)
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	105,972,000	-	115,380,000	9,408,000
合計	105,972,000	-	115,380,000	9,408,000

(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。

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第10期 自 平成21年2月17日 至 平成22年2月15日	第11期 自 平成22年2月16日 至 平成23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10期 平成22年2月15日現在	第11期 平成23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)	0.6164円 (6,164円)	0.6738円 (6,738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	279	446,400	
マルハニチロホールディングス	4,000	151	604,000	
カネコ種苗	900	909	818,100	
ホクト	200	1,904	380,800	
国際石油開発帝石	16	569,000	9,104,000	
石油資源開発	300	3,820	1,146,000	
共立マテリアル	1,000	388	388,000	

東急建設	1,250	248	310,000
コムシスホールディングス	900	870	783,000
東建コーポレーション	130	3,300	429,000
大成建設	6,000	190	1,140,000
大林組	3,000	373	1,119,000
清水建設	4,000	343	1,372,000
長谷工コーポレーション	7,500	79	592,500
鹿島建設	6,000	218	1,308,000
不動テトラ	4,800	53	254,400
西松建設	3,000	112	336,000
大豊建設	3,000	85	255,000
前田建設	2,000	269	538,000
奥村組	1,000	317	317,000
浅沼組	4,000	57	228,000
戸田建設	2,000	322	644,000
熊谷組	4,000	62	248,000
青木あすなろ建設	1,000	400	400,000
大東建託	600	6,830	4,098,000
NIPPON	1,000	605	605,000
前田道路	1,000	736	736,000
東亜建設	4,000	109	436,000
五洋建設	2,500	148	370,000
大成温調	2,000	349	698,000
住友林業	1,000	724	724,000
日本基礎技術	1,400	241	337,400
パナホーム	1,000	552	552,000
大和ハウス	3,000	1,042	3,126,000
ライト工業	700	232	162,400
積水ハウス	3,000	819	2,457,000
TTK	1,000	368	368,000
シーキューブ	2,100	292	613,200
四電工	1,000	365	365,000
中電工	400	1,063	425,200
関電工	1,000	518	518,000
きんでん	1,000	764	764,000
日本電設工業	1,000	827	827,000
協和エクシオ	600	803	481,800
九電工	1,000	550	550,000
サンテック	1,000	290	290,000
日揮	1,000	2,032	2,032,000
高砂熱学	700	700	490,000
NEC ネットズエスアイ	300	1,143	342,900
明星工業	2,000	337	674,000
東芝プラントシステム	1,000	1,130	1,130,000
日本製粉	1,000	408	408,000
日清製粉G本社	1,000	1,071	1,071,000
協同飼料	3,000	107	321,000
ミクシィ	1	427,000	427,000
アコーディア・ゴルフ	6	69,300	415,800
パソナグループ	3	68,400	205,200
森永製菓	2,000	200	400,000
江崎グリコ	1,000	949	949,000
名糖産業	200	1,110	222,000
山崎製パン	1,000	944	944,000
コモ	600	1,499	899,400

森永乳業	1,000	345	345,000
ヤクルト	800	2,327	1,861,600
明治ホールディングス	400	3,820	1,528,000
日本ハム	1,000	1,171	1,171,000
伊藤ハム	1,000	315	315,000
シミック	10	26,550	265,500
S J I	12	18,100	217,200
N E Cフィールドディング	300	1,035	310,500
新日鉄ソリューションズ	300	1,944	583,200
総合警備保障	600	1,008	604,800
カカクコム	2	466,000	932,000
アイロムホールディングス	55	2,363	129,965
S B Sホールディングス	4	114,900	459,600
新日本科学	300	384	115,200
メッセージ	2	244,800	489,600
エムスリー	2	441,500	883,000
ディー・エヌ・エー	800	3,015	2,412,000
博報堂D Y H L D G S	230	5,120	1,177,600
ぐるなび	2	118,600	237,200
P G Mホールディングス	6	53,700	322,200
サッポロホールディングス	2,000	378	756,000
アサヒビール	2,100	1,582	3,322,200
キリンHD	4,000	1,175	4,700,000
宝ホールディングス	1,000	490	490,000
コカ・コーラウエスト	600	1,500	900,000
伊藤園	400	1,422	568,800
ジャパンフーズ	300	833	249,900
日清オイリオグループ	1,000	442	442,000
不二製油	500	1,208	604,000
J・オイルミルズ	2,000	274	548,000
ローソン	400	4,140	1,656,000
イオン九州	300	1,432	429,600
カワチ薬品	200	1,779	355,800
三井情報	21	14,900	312,900
エービーシー・マート	400	3,295	1,318,000
高千穂交易	100	971	97,100
アスクル	200	1,655	331,000
ゲオ	3	116,100	348,300
ポイント	120	4,000	480,000
日本マクドナルドH L D G	700	2,009	1,406,300
スターバックスコーヒーJ	13	49,300	640,900
エディオン	600	845	507,000
サーラコーポレーション	1,000	452	452,000
ウイン・インターナショナル	800	717	573,600
石光商事	1,700	381	647,700
東京エレクトロンデバイス	2	196,500	393,000
フィールズ	3	141,100	423,300
双日	6,100	194	1,183,400
コメ兵	1,000	431	431,000
セリア	4	198,900	795,600
アルフレッサホールディングス	300	3,290	987,000
ナフコ	300	1,452	435,600
大黒天物産	200	2,813	562,600
ハニーズ	340	1,074	365,160
キッコーマン	1,000	916	916,000

味の素	3,000	938	2,814,000
キユーピー	600	1,022	613,200
ハウス食品	500	1,367	683,500
カゴメ	600	1,530	918,000
アリアケジャパン	200	1,460	292,000
エバラ食品工業	1,000	1,340	1,340,000
ニチレイ	2,000	385	770,000
東洋水産	1,000	1,838	1,838,000
日本食品化工	1,000	466	466,000
日清食品HD	500	2,918	1,459,000
日本たばこ産業	22	337,000	7,414,000
片倉工業	200	825	165,000
グンゼ	1,000	367	367,000
昭栄	400	730	292,000
アルペン	200	1,644	328,800
ビックカメラ	9	34,400	309,600
DCMホールディングス	1,000	531	531,000
J. フロント リテイリング	3,000	439	1,317,000
ドトール・日レスHD	200	1,127	225,400
マツモトキヨシHLDGS	300	1,825	547,500
三越伊勢丹HD	1,900	1,010	1,919,000
東洋紡績	3,000	153	459,000
ユニチカ	3,000	81	243,000
日清紡ホールディングス	1,000	908	908,000
日東紡績	2,000	261	522,000
トヨタ紡織	800	1,419	1,135,200
日本毛織	1,000	736	736,000
野村不動産HLDGS	1,000	1,624	1,624,000
ブックオフコーポレーション	200	729	145,800
クロスプラス	300	775	232,500
JFE商事HLDGS	2,000	430	860,000
サークルKサンクス	500	1,377	688,500
セブン&アイ・HLDGS	3,900	2,212	8,626,800
ツルハホールディングス	100	4,120	412,000
帝人	4,000	421	1,684,000
東レ	7,000	620	4,340,000
クラレ	1,800	1,182	2,127,600
旭化成	7,000	578	4,046,000
三協・立山HLDGS	4,000	120	480,000
SUMCO	1,200	1,344	1,612,800
セーレン	500	631	315,500
ソトー	500	878	439,000
小松精練	1,000	372	372,000
ワコールホールディングス	1,000	1,129	1,129,000
ホギメディカル	100	3,805	380,500
サンエー・インターナショナル	200	1,041	208,200
レナウン	1,200	221	265,200
ITホールディングス	500	977	488,500
グリー	1,100	1,349	1,483,900
コーエーテクモHD	600	675	405,000
ドワンゴ	1	235,200	235,200
日本ベリサイン	9	39,550	355,950
ティーガイア	3	155,300	465,900
ソネットエンタテインメント	2	296,900	593,800
王子製紙	5,000	397	1,985,000

三菱製紙	4,000	103	412,000
北越紀州製紙	1,500	485	727,500
大王製紙	1,000	588	588,000
日本製紙G本社	500	2,237	1,118,500
レンゴー	1,000	558	558,000
昭和電工	8,000	185	1,480,000
住友化学	7,000	460	3,220,000
日本化成	2,000	219	438,000
日産化学	1,000	1,011	1,011,000
クレハ	1,000	469	469,000
石原産業	3,000	114	342,000
日本曹達	1,000	436	436,000
東ソー	3,000	301	903,000
トクヤマ	2,000	438	876,000
セントラル硝子	1,000	396	396,000
東亜合成	1,000	415	415,000
電気化学	3,000	419	1,257,000
イビデン	700	2,753	1,927,100
信越化学	1,900	4,735	8,996,500
エア・ウォーター	1,000	1,129	1,129,000
大陽日酸	2,000	758	1,516,000
ステラ ケミファ	100	3,765	376,500
日本触媒	1,000	994	994,000
大日精化	1,000	502	502,000
カネカ	2,000	604	1,208,000
協和発酵キリン	3,000	860	2,580,000
三菱瓦斯化学	2,000	637	1,274,000
三井化学	5,000	330	1,650,000
J S R	1,200	1,771	2,125,200
東京応化工業	300	1,890	567,000
三菱ケミカルHLDGS	7,000	631	4,417,000
ダイセル化学	2,000	579	1,158,000
住友ベークライト	1,000	559	559,000
積水化学	3,000	650	1,950,000
日本ゼオン	1,000	839	839,000
アイカ工業	500	1,039	519,500
宇部興産	5,000	274	1,370,000
日立化成	1,000	1,955	1,955,000
ニチバン	2,000	321	642,000
日本化薬	1,000	876	876,000
D . A . コンソーシアム	10	40,800	408,000
パナソニック電工I S	100	2,222	222,200
フェイス	32	11,900	380,800
野村総合研究所	1,000	1,956	1,956,000
電通	1,300	2,615	3,399,500
ワークスアプリケーションズ	7	54,500	381,500
松本油脂製薬	500	1,770	885,000
A D E K A	700	954	667,800
日油	1,000	426	426,000
新日本理化	4,900	121	592,900
花王	2,400	2,202	5,284,800
三洋化成	1,000	722	722,000
武田薬品	3,400	4,010	13,634,000
アステラス製薬	2,000	3,315	6,630,000
大日本住友製薬	1,900	809	1,537,100

塩野義製薬	1,700	1,577	2,680,900
田辺三菱製薬	2,800	1,437	4,023,600
日本新薬	1,000	1,123	1,123,000
中外製薬	2,600	1,594	4,144,400
科研製薬	1,000	1,064	1,064,000
エーザイ	1,300	2,963	3,851,900
ロート製薬	1,000	978	978,000
小野薬品	500	4,240	2,120,000
久光製薬	500	3,310	1,655,000
持田製薬	1,000	973	973,000
大正製薬	1,000	1,860	1,860,000
参天製薬	400	3,115	1,246,000
ツムラ	400	2,710	1,084,000
日医工	300	2,294	688,200
テルモ	1,000	4,370	4,370,000
みらかホールディングス	300	3,155	946,500
生化学工業	600	939	563,400
鳥居薬品	300	1,797	539,100
東和薬品	100	4,485	448,500
第一三共	3,100	1,854	5,747,400
キョーリン製薬HD	1,000	1,564	1,564,000
大日本塗料	4,000	127	508,000
日本ペイント	1,000	653	653,000
関西ペイント	1,000	809	809,000
D I C	4,000	215	860,000
東洋インキ	2,000	438	876,000
T & K T O K A	300	1,290	387,000
オリエンタルランド	400	8,000	3,200,000
ダスキン	400	1,578	631,200
パーク24	800	931	744,800
フジ・メディア・HD	11	128,900	1,417,900
ラウンドワン	700	492	344,400
リゾートトラスト	400	1,391	556,400
オービック	50	16,410	820,500
ヤフー	266	30,550	8,126,300
ビー・エム・エル	200	2,254	450,800
トレンドマイクロ	600	2,631	1,578,600
もしもしホットライン	200	1,829	365,800
リソー教育	58	5,290	306,820
日本オラクル	500	3,875	1,937,500
アルファシステムズ	200	1,459	291,800
フューチャーアーキテクト	6	40,700	244,200
シーエーシー	300	699	209,700
ソフトバンク・テクノ	500	720	360,000
ユー・エス・エス	170	6,680	1,135,600
オービックビジネスC	100	5,250	525,000
伊藤忠テクノソリューションズ	300	2,946	883,800
楽天	63	76,900	4,844,700
カルチュア・コンビニエンス	1,200	596	715,200
大塚商会	200	6,080	1,216,000
富士通ビー・エス・シー	700	920	644,000
電通国際情報S	200	645	129,000
A C C E S S	3	117,500	352,500
東映アニメーション	300	1,920	576,000
ジュピターテレコム	34	88,000	2,992,000

ハドソン	600	308	184,800
シダックス	1,200	346	415,200
エン・ジャパン	3	135,000	405,000
富士フイルムHLDGS	2,300	2,896	6,660,800
コニカミノルタHLDGS	2,500	759	1,897,500
資生堂	1,900	1,666	3,165,400
ライオン	1,000	445	445,000
高砂香料	1,000	505	505,000
ミルボン	200	2,163	432,600
ファンケル	500	1,186	593,000
コーセー	300	2,216	664,800
ドクターシーラボ	3	311,500	934,500
エステー	500	982	491,000
長谷川香料	200	1,359	271,800
小林製薬	200	3,880	776,000
タカラバイオ	3	201,700	605,100
寺岡製作所	1,000	400	400,000
昭和シエル石油	1,700	711	1,208,700
コスモ石油	4,000	291	1,164,000
東燃ゼネラル石油	2,000	931	1,862,000
ユシロ化学	100	1,400	140,000
AOCホールディングス	500	575	287,500
MORESCO	500	1,144	572,000
出光興産	200	9,260	1,852,000
JXホールディングス	11,400	583	6,646,200
横浜ゴム	2,000	420	840,000
東洋ゴム	2,000	216	432,000
ブリヂストン	3,600	1,607	5,785,200
住友ゴム	1,200	869	1,042,800
アキレス	2,000	127	254,000
ニッタ	200	1,697	339,400
クリエートメディック	300	844	253,200
東海ゴム工業	700	1,116	781,200
三ツ星ベルト	1,000	532	532,000
旭硝子	5,000	1,113	5,565,000
日本板硝子	4,000	219	876,000
有沢製作所	500	491	245,500
日本電気硝子	2,000	1,319	2,638,000
オハラ	200	1,104	220,800
住友大阪セメント	2,000	207	414,000
太平洋セメント	6,000	118	708,000
東海カーボン	1,000	502	502,000
東洋炭素	100	4,655	465,500
TOTO	2,000	661	1,322,000
日本碍子	2,000	1,438	2,876,000
日本特殊陶業	1,000	1,229	1,229,000
日本ミクロコーティング	1,400	133	186,200
フジインコーポレーテッド	200	1,309	261,800
ニチアス	1,000	503	503,000
新日本製鐵	30,000	306	9,180,000
住友金属工業	21,000	213	4,473,000
神戸製鋼所	14,000	235	3,290,000
日新製鋼	5,000	174	870,000
中山製鋼所	2,000	117	234,000
合同製鐵	1,000	181	181,000

J F Eホールディングス	2,700	2,735	7,384,500
東京製鐵	700	932	652,400
共英製鋼	300	1,397	419,100
大和工業	300	2,746	823,800
大阪製鐵	300	1,430	429,000
淀川製鋼所	1,000	366	366,000
東洋鋼鋳	1,000	543	543,000
丸一鋼管	300	1,876	562,800
大同特殊鋼	2,000	564	1,128,000
日本冶金工	1,000	247	247,000
山陽特殊鋼	1,000	552	552,000
愛知製鋼	1,000	607	607,000
日立金属	2,000	1,168	2,336,000
大平洋金属	1,000	785	785,000
日本電工	1,000	607	607,000
日本製鋼所	2,000	868	1,736,000
三菱製鋼	1,000	317	317,000
日亜鋼業	1,000	234	234,000
日本軽金属	3,000	185	555,000
大紀アルミニウム	1,000	269	269,000
三井金属	3,000	323	969,000
東邦亜鉛	1,000	468	468,000
三菱マテリアル	6,000	286	1,716,000
住友鋳山	3,000	1,526	4,578,000
D O W Aホールディングス	2,000	601	1,202,000
古河機金	3,000	99	297,000
大阪チタニウム	200	6,120	1,224,000
東邦チタニウム	300	2,583	774,900
古河スカイ	2,000	259	518,000
古河電工	3,000	372	1,116,000
住友電工	3,500	1,242	4,347,000
フジクラ	2,000	444	888,000
日立電線	2,000	238	476,000
リョービ	1,000	375	375,000
東洋製罐	1,000	1,597	1,597,000
三和ホールディングス	2,000	280	560,000
住生活グループ	1,400	1,925	2,695,000
ノーリツ	300	1,408	422,400
長府製作所	200	1,916	383,200
リンナイ	200	5,020	1,004,000
ユニプレス	300	2,085	625,500
東京製綱	1,000	296	296,000
サンコール	1,000	438	438,000
エイチワン	400	865	346,000
日本発条	1,000	991	991,000
三浦工業	200	2,324	464,800
オークマ	1,000	775	775,000
東芝機械	1,000	511	511,000
アマダ	2,000	751	1,502,000
富士機械製造	400	2,041	816,400
牧野フライス	1,000	767	767,000
オーエスジー	600	1,211	726,600
森精機製作所	600	1,087	652,200
ソディック	900	582	523,800
ディスコ	200	5,930	1,186,000

日東工器	200	2,110	422,000
豊田自動織機	1,400	2,817	3,943,800
島精機製作所	200	2,007	401,400
エヌ・ピー・シー	200	1,620	324,000
ナプテスコ	700	2,018	1,412,600
三井海洋開発	300	1,518	455,400
S M C	300	14,710	4,413,000
ユニオンツール	100	2,119	211,900
サトー	300	1,074	322,200
日本エアーテック	300	417	125,100
小松製作所	4,500	2,595	11,677,500
住友重機械	3,000	604	1,812,000
日立建機	1,000	2,063	2,063,000
井関農機	1,000	231	231,000
ハーモニック・ドライブ・シス	1	528,000	528,000
クボタ	6,000	916	5,496,000
東洋エンジニア	1,000	340	340,000
テセック	400	1,560	624,000
アイチ コーポレーション	600	378	226,800
小森コーポレーション	400	877	350,800
三精輸送機	1,000	420	420,000
荏原製作所	2,000	485	970,000
西島製作所	200	1,644	328,800
千代田化工建	2,000	771	1,542,000
ダイキン工業	1,300	2,815	3,659,500
栗田工業	600	2,445	1,467,000
椿本チエイン	1,000	502	502,000
新興プランテック	400	864	345,600
ダイフク	1,000	656	656,000
タダノ	1,000	454	454,000
シーケーディ	600	952	571,200
平和	600	1,393	835,800
SANKYO	400	4,685	1,874,000
日本金銭機械	300	691	207,300
マースエンジニアリング	200	1,519	303,800
ユニバーサルエンターテインメン	500	2,647	1,323,500
ダイコク電機	200	1,027	205,400
アマノ	400	802	320,800
サンデン	1,000	377	377,000
ブラザー工業	1,400	1,326	1,856,400
グローリー	400	1,957	782,800
セガサミーホールディングス	1,400	1,828	2,559,200
帝国ピストン	400	964	385,600
放電精密加工研	700	475	332,500
日本精工	3,000	819	2,457,000
N T N	3,000	462	1,386,000
ジェイテクト	1,800	1,239	2,230,200
不二越	2,000	435	870,000
ミネベア	2,000	496	992,000
T H K	700	2,265	1,585,500
ユーシン精機	100	1,705	170,500
キッツ	1,000	382	382,000
日立	20,000	505	10,100,000
東芝	19,000	532	10,108,000
三菱電機	10,000	993	9,930,000

富士電機HLDGS	5,000	282	1,410,000
安川電機	1,000	967	967,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	279	558,000
明電舎	1,000	394	394,000
日立工機	700	834	583,800
三桜工業	500	850	425,000
マキタ	600	3,695	2,217,000
東芝テック	2,000	402	804,000
マブチモーター	200	4,215	843,000
日本電産	700	7,760	5,432,000
ダイヘン	1,000	388	388,000
オムロン	1,100	2,249	2,473,900
エナジーサポート	2,000	209	418,000
不二電機工業	600	900	540,000
エルピーダメモリ	1,000	1,278	1,278,000
ジーエス・ユアサコーポ	2,000	620	1,240,000
メルコホールディングス	200	3,245	649,000
エスケーエレクトロニクス	5	63,600	318,000
日本電気	11,000	241	2,651,000
富士通	9,000	534	4,806,000
沖電気	4,000	71	284,000
サンケン電気	1,000	553	553,000
ルネサスエレクトロニクス	2,000	900	1,800,000
セイコーエプソン	900	1,362	1,225,800
ワコム	3	132,200	396,600
アルバック	300	1,956	586,800
アクセル	100	2,270	227,000
ナナオ	200	2,038	407,600
日本信号	600	685	411,000
京三製作所	1,000	455	455,000
星和電機	1,000	322	322,000
マスプロ電工	500	816	408,000
パナソニック	10,800	1,116	12,052,800
シャープ	5,000	910	4,550,000
アンリツ	1,000	806	806,000
富士通ゼネラル	1,000	496	496,000
ソニー	4,500	2,907	13,081,500
T D K	600	5,690	3,414,000
ミツミ電機	500	1,424	712,000
タムラ製作所	1,000	270	270,000
ザインエレクトロニクス	2	111,700	223,400
アルプス電気	1,000	1,137	1,137,000
パイオニア	1,900	417	792,300
日本電波工業	200	1,537	307,400
メイコー	200	1,588	317,600
日本トリム	150	1,816	272,400
クラリオン	2,000	172	344,000
ホシデン	500	914	457,000
ヒロセ電機	200	9,320	1,864,000
ユニデン	1,000	266	266,000
アルパイン	400	1,202	480,800
スミダコーポレーション	300	1,040	312,000
新コスモス電機	500	1,061	530,500
日本電産リード	400	1,214	485,600
精工技研	400	715	286,000

船井電機	200	2,713	542,600
横河電機	1,400	645	903,000
新電元工業	1,000	485	485,000
山武	400	2,072	828,800
日本光電工業	200	1,823	364,600
日本電子材料	400	618	247,200
堀場製作所	200	2,585	517,000
アドバンテスト	900	1,723	1,550,700
キーエンス	200	22,590	4,518,000
シスメックス	300	5,500	1,650,000
メガチップス	200	1,780	356,000
キョウデン	2,100	169	354,900
北川工業	300	922	276,600
デンソー	3,900	3,155	12,304,500
コーセル	300	1,285	385,500
スタンレー電気	900	1,488	1,339,200
ウシオ電機	700	1,678	1,174,600
ヘリオステクノH	700	246	172,200
富士通フロンテック	500	696	348,000
図研	400	672	268,800
日本電子	1,000	285	285,000
カシオ	1,300	710	923,000
ファナック	1,100	12,620	13,882,000
日本シイエムケイ	700	449	314,300
フクダ電子	200	2,540	508,000
エンプラス	200	1,133	226,600
ローム	500	5,790	2,895,000
浜松ホトニクス	400	3,270	1,308,000
新光電気工業	800	957	765,600
京セラ	800	8,710	6,968,000
太陽誘電	1,000	1,396	1,396,000
村田製作所	1,000	6,170	6,170,000
双葉電子工業	200	1,678	335,600
日東電工	800	4,850	3,880,000
指月電機	1,000	338	338,000
東海理化電機	500	1,596	798,000
ニチコン	600	1,228	736,800
日本タングステン	3,000	161	483,000
K O A	400	986	394,400
三井造船	4,000	226	904,000
日立造船	4,000	128	512,000
三菱重工業	15,000	352	5,280,000
川崎重工業	8,000	339	2,712,000
I H I	7,000	218	1,526,000
日本車輛	1,000	465	465,000
日産自動車	20,200	883	17,836,600
いすゞ自動車	8,000	390	3,120,000
トヨタ自動車	15,300	3,910	59,823,000
日野自動車	3,000	466	1,398,000
三菱自動車工業	25,000	118	2,950,000
武蔵精密工業	200	2,082	416,400
トヨタ車体	500	1,558	779,000
日産車体	1,000	680	680,000
関東自動車	500	700	350,000
極東開発工業	700	392	274,400

日信工業	400	1,569	627,600
トピー工業	2,000	246	492,000
曙ブレーキ	600	524	314,400
N O K	800	1,673	1,338,400
カヤバ工業	1,000	738	738,000
シロキ工業	1,000	351	351,000
カルソニックカンセイ	2,000	426	852,000
太平洋工業	1,000	540	540,000
ケーヒン	400	1,849	739,600
河西工業	1,000	608	608,000
アイシン精機	1,300	3,240	4,212,000
マ ッ ダ	8,000	220	1,760,000
ダイハツ	2,000	1,302	2,604,000
愛知機械	1,000	390	390,000
本田技研	8,100	3,685	29,848,500
スズキ	2,500	1,964	4,910,000
富士重工業	4,000	723	2,892,000
ヤマハ発動機	1,500	1,525	2,287,500
ショーワ	500	737	368,500
小糸製作所	1,000	1,478	1,478,000
エクセディ	300	2,771	831,300
豊田合成	600	1,917	1,150,200
愛三工業	500	858	429,000
エフ・シー・シー	300	2,041	612,300
シマノ	400	4,120	1,648,000
タカタ	400	2,706	1,082,400
テイ・エス テック	400	1,715	686,000
ア ト ム	1,600	263	420,800
小 野 建	400	757	302,800
カップクリエイト	150	2,009	301,350
コンドーテック	700	626	438,200
中山福	500	621	310,500
ライトオン	400	461	184,400
ナガイレーベン	200	2,057	411,400
菱食	300	1,880	564,000
良品計画	100	3,960	396,000
三城ホールディングス	400	852	340,800
松田産業	200	1,483	296,600
第一興商	500	1,606	803,000
メディバルHD	1,100	789	867,900
アドヴァン	500	694	347,000
萩原電気	700	822	575,400
ドウシシャ	200	1,936	387,200
ハウス ローゼ	100	1,285	128,500
コ ジ マ	500	606	303,000
コーナン商事	200	1,181	236,200
黒田電気	300	1,148	344,400
ネットワンシステムズ	3	135,400	406,200
ワタミ	200	1,732	346,400
ドン・キホーテ	400	2,951	1,180,400
スリーエフ	900	532	478,800
西松屋チェーン	300	765	229,500
ゼンショー	600	877	526,200
ジーエフシー	900	910	819,000
サイゼリヤ	200	1,609	321,800

PALTEK	1,300	390	507,000
アルゴグラフィックス	200	1,133	226,600
魚力	400	1,002	400,800
ガリバーインターナショナル	90	3,745	337,050
日本エム・ディ・エム	1,300	238	309,400
ユナイテッドアローズ	400	1,328	531,200
進和	300	991	297,300
ハイデイ日高	200	1,412	282,400
京都きもの友禅	200	939	187,800
マクニカ	200	2,091	418,200
白銅	300	998	299,400
スギホールディングス	400	2,010	804,000
島津製作所	2,000	702	1,404,000
スター精密	400	994	397,600
愛知時計	1,000	242	242,000
東京精密	300	1,635	490,500
ニコン	1,800	1,961	3,529,800
トプコン	700	453	317,100
オリンパス	1,200	2,478	2,973,600
大日本スクリーン	1,000	818	818,000
キャノン電子	300	2,414	724,200
タムロン	200	1,749	349,800
HOYA	2,000	1,950	3,900,000
キャノン	5,900	3,920	23,128,000
リコー	3,000	1,085	3,255,000
日本電産コパル	400	1,297	518,800
日本電産サンキョー	1,000	678	678,000
シチズンホールディングス	2,000	555	1,110,000
バンダイナムコHLDGS	1,000	943	943,000
フランスベッドHLDGS	1,000	115	115,000
エイベックス・グループHD	400	1,199	479,600
東京リスマチック	1,300	462	600,600
トッパン・フォームズ	800	832	665,600
フジシールインターナショナル	200	1,869	373,800
タカラトミー	500	690	345,000
廣済堂	300	122	36,600
三光合成	2,000	302	604,000
大建工業	2,000	237	474,000
凸版印刷	3,000	770	2,310,000
大日本印刷	3,000	1,133	3,399,000
日本写真印刷	300	2,196	658,800
アシックス	1,000	1,152	1,152,000
ツツミ	100	2,239	223,900
ジェイエスピー	400	1,485	594,000
ニチハ	500	824	412,000
エフピコ	100	5,040	504,000
ヤマハ	1,000	1,079	1,079,000
ピジョン	200	2,540	508,000
天馬	200	885	177,000
パラマウントベッド	200	2,220	444,000
キングジム	300	645	193,500
リンテック	400	2,448	979,200
任天堂	600	24,420	14,652,000
タカラスタンダード	1,000	558	558,000
コクヨ	700	685	479,500

ニフコ	300	2,329	698,700
岡村製作所	1,000	528	528,000
伊藤忠	7,100	892	6,333,200
丸紅	8,000	673	5,384,000
三陽商会	1,000	310	310,000
長瀬産業	1,000	1,084	1,084,000
豊田通商	1,700	1,642	2,791,400
オンワードホールディングス	1,000	774	774,000
三共生興	900	342	307,800
美津濃	1,000	401	401,000
ファミリーマート	400	3,150	1,260,000
三井物産	8,200	1,537	12,603,400
東京エレクトロン	800	5,540	4,432,000
日立ハイテクノロジーズ	700	2,115	1,480,500
OUGホールディングス	6,000	166	996,000
セイコーHD	1,000	301	301,000
住友商事	5,600	1,290	7,224,000
日本ユニシス	600	694	416,400
三菱商事	7,500	2,391	17,932,500
キヤノンマーケティングJPN	600	1,125	675,000
阪和興業	2,000	401	802,000
ニプロ	300	1,668	500,400
岩谷産業	1,000	267	267,000
すてきなイスグループ	1,000	182	182,000
イワキ	1,000	221	221,000
三愛石油	1,000	438	438,000
東京スタイル	1,000	648	648,000
ユニ・チャーム	900	3,160	2,844,000
キング	2,200	221	486,200
三栄コーポレーション	2,000	392	784,000
東邦ホールディングス	500	1,024	512,000
サンゲツ	200	1,996	399,200
シナネン	1,000	401	401,000
伊藤忠エネクス	1,000	498	498,000
ザ・トーカイ	1,000	344	344,000
サンリオ	500	2,634	1,317,000
ナガホリ	2,000	200	400,000
電響社	1,000	451	451,000
上原成商事	2,000	333	666,000
ユニヘアー	200	874	174,800
日本瓦斯	500	1,195	597,500
マルエツ	1,000	337	337,000
ロイヤルホールディングス	300	883	264,900
島忠	300	1,870	561,000
チヨダ	200	1,192	238,400
大塚家具	500	902	451,000
ライフコーポレーション	400	1,294	517,600
AOKIホールディングス	300	1,443	432,900
コメリ	300	2,078	623,400
青山商事	400	1,395	558,000
しまむら	200	7,490	1,498,000
高島屋	2,000	706	1,412,000
松屋	400	693	277,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	1,000	637	637,000
ニッセンHD	800	535	428,000

パルコ	600	783	469,800
丸井グループ	1,600	770	1,232,000
クレディセゾン	800	1,672	1,337,600
セディナ	4,500	181	814,500
イオン	3,600	1,044	3,758,400
ユニー	1,100	823	905,300
イズミ	700	1,261	882,700
フォーバル	1,500	292	438,000
平和堂	400	1,104	441,600
フジ	300	1,778	533,400
ヤオコー	200	2,539	507,800
ゼビオ	300	1,863	558,900
ケーズホールディングス	300	2,778	833,400
新生銀行	11,000	101	1,111,000
あおぞら銀行	8,000	182	1,456,000
三菱UFJフィナンシャルG	62,600	467	29,234,200
りそなホールディングス	10,900	423	4,610,700
中央三井トラストHD	8,000	349	2,792,000
三井住友フィナンシャルG	6,300	3,070	19,341,000
第四銀行	2,000	298	596,000
西日本シティ銀行	4,000	268	1,072,000
札幌北洋ホール	2,500	435	1,087,500
千葉銀行	4,000	555	2,220,000
横浜銀行	6,000	434	2,604,000
常陽銀行	3,000	378	1,134,000
群馬銀行	2,000	505	1,010,000
武蔵野銀行	200	2,636	527,200
東京都民銀行	400	1,248	499,200
七十七銀行	2,000	488	976,000
岩手銀行	100	4,060	406,000
みちのく銀行	2,000	179	358,000
ふくおかフィナンシャルG	4,000	363	1,452,000
静岡銀行	3,000	796	2,388,000
十六銀行	2,000	282	564,000
スルガ銀行	2,000	825	1,650,000
八十二銀行	2,000	512	1,024,000
山梨中央銀行	1,000	452	452,000
大垣共立銀行	2,000	283	566,000
福井銀行	1,000	265	265,000
北國銀行	2,000	297	594,000
滋賀銀行	1,000	473	473,000
南都銀行	2,000	441	882,000
百五銀行	1,000	392	392,000
京都銀行	2,000	791	1,582,000
ほくほくフィナンシャルG	7,000	183	1,281,000
広島銀行	3,000	369	1,107,000
山陰合同銀行	1,000	638	638,000
中国銀行	1,000	991	991,000
伊予銀行	2,000	748	1,496,000
百十四銀行	2,000	347	694,000
四国銀行	2,000	292	584,000
阿波銀行	1,000	517	517,000
鹿児島銀行	1,000	576	576,000
大分銀行	1,000	320	320,000
肥後銀行	1,000	485	485,000

十八銀行	2,000	268	536,000
住友信託	8,000	522	4,176,000
みずほ信託銀行	24,000	84	2,016,000
セブン銀行	7	182,300	1,276,100
みずほフィナンシャルG	95,100	171	16,262,100
紀陽ホールディングス	4,000	118	472,000
山口フィナンシャルG	1,000	852	852,000
芙蓉総合リース	200	3,205	641,000
興銀リース	200	2,190	438,000
東京センチュリーリース	600	1,607	964,200
S B Iホールディングス	105	12,230	1,284,150
日本証券金融	600	657	394,200
ポケットカード	800	340	272,000
名古屋銀行	1,000	278	278,000
愛知銀行	100	5,300	530,000
中京銀行	2,000	212	424,000
東日本銀行	2,000	217	434,000
みなと銀行	2,000	174	348,000
京葉銀行	2,000	439	878,000
関西アーバン銀行	5,000	151	755,000
東和銀行	3,000	122	366,000
リコーリース	200	2,378	475,600
イオン クレジットサービス	800	1,282	1,025,600
アコム	810	1,539	1,246,590
プロミス	650	744	483,600
ジャックス	1,000	269	269,000
日立キャピタル	500	1,358	679,000
オリックス	520	9,230	4,799,600
三菱UFJリース	410	3,400	1,394,000
ジャフコ	300	2,523	756,900
大和証券G本社	8,000	450	3,600,000
野村ホールディングス	16,000	532	8,512,000
みずほ証券	8,000	235	1,880,000
みずほインベストアズ証	6,000	90	540,000
岡三証券グループ	1,000	363	363,000
東海東京HD	2,000	311	622,000
光世証券	2,000	88	176,000
いちよし証券	400	624	249,600
松井証券	1,600	582	931,200
NK S Jホールディングス	8,000	634	5,072,000
だいこう証券ビジ	400	334	133,600
大阪証券取引所	2	432,500	865,000
マネックスG	16	23,430	374,880
カブドットコム証券	1,200	355	426,000
池田泉州HD	6,100	126	768,600
M S & A D	2,800	2,155	6,034,000
SONY F H	10	328,000	3,280,000
スパークス・グループ	36	12,040	433,440
エース交易	1,600	237	379,200
第一生命	44	150,100	6,604,400
富士火災	6,000	145	870,000
東京海上HD	3,400	2,692	9,152,800
T & Dホールディングス	1,600	2,431	3,889,600
三井不動産	4,000	1,706	6,824,000
三菱地所	6,000	1,655	9,930,000

平和不動産	1,000	266	266,000
東京建物	2,000	396	792,000
ダイビル	800	701	560,800
サンケイビル	600	560	336,000
東急不動産	3,000	455	1,365,000
住友不動産	2,000	2,159	4,318,000
東宝不動産	700	595	416,500
大京	3,000	168	504,000
テーオーシー	800	361	288,800
レオパレス21	1,400	133	186,200
フジ住宅	700	446	312,200
空港施設	900	400	360,000
住友不動産販売	200	4,350	870,000
ゴールドクレスト	260	2,235	581,100
リロ・ホールディング	300	1,565	469,500
東急リバブル	500	1,026	513,000
飯田産業	600	941	564,600
イオンモール	900	2,190	1,971,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	16	89,600	1,433,600
東武鉄道	4,000	460	1,840,000
相鉄ホールディングス	2,000	266	532,000
東京急行	5,000	381	1,905,000
京浜急行	3,000	671	2,013,000
小田急電鉄	3,000	776	2,328,000
京王電鉄	3,000	545	1,635,000
京成電鉄	2,000	585	1,170,000
富士急行	1,000	434	434,000
東日本旅客鉄道	1,700	5,560	9,452,000
西日本旅客鉄道	8	329,000	2,632,000
東海旅客鉄道	10	740,000	7,400,000
西日本鉄道	2,000	349	698,000
近畿鉄道	6,000	262	1,572,000
阪急阪神HLDGS	5,000	390	1,950,000
南海電鉄	3,000	341	1,023,000
京阪電鉄	3,000	344	1,032,000
名古屋鉄道	4,000	228	912,000
ビューテックノオリン	600	735	441,000
日本通運	5,000	341	1,705,000
ヤマトホールディングス	2,000	1,278	2,556,000
山九	2,000	392	784,000
日石輸送	2,000	215	430,000
福山通運	1,000	431	431,000
セイノーホールディングス	1,000	637	637,000
神奈川中央交通	1,000	425	425,000
日立物流	600	1,305	783,000
日本郵船	6,000	376	2,256,000
商船三井	6,000	574	3,444,000
川崎汽船	3,000	370	1,110,000
NSユニテッド海運	2,000	207	414,000
飯野海運	700	434	303,800
第一中央汽船	2,000	208	416,000
全日本空輸	12,000	302	3,624,000
パスコ	1,000	282	282,000
三菱倉庫	1,000	1,127	1,127,000
三井倉庫	1,000	363	363,000

住友倉庫	1,000	452	452,000
渋沢倉庫	1,000	287	287,000
伊勢湾海運	1,000	449	449,000
上組	1,000	718	718,000
郵船ロジスティクス	300	1,256	376,800
近鉄エクスプレス	200	2,605	521,000
東京放送HD	900	1,111	999,900
日本テレビ放送網	120	13,420	1,610,400
朝日放送	800	460	368,000
テレビ朝日	6	137,400	824,400
スカパーJ S A T H D	24	31,200	748,800
イー・アクセス	17	50,900	865,300
NECモバイルリング	100	2,861	286,100
日本電信電話	4,000	3,930	15,720,000
KDDI	21	534,000	11,214,000
光通信	300	2,110	633,000
沖縄セルラー電話	4	181,000	724,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	195	154,200	30,069,000
ゼンリン	500	984	492,000
昭文社	500	689	344,500
角川グループHLDGS	200	2,212	442,400
東京電力	6,800	2,094	14,239,200
中部電力	3,300	2,175	7,177,500
関西電力	4,000	2,128	8,512,000
中国電力	1,500	1,733	2,599,500
北陸電力	1,000	2,027	2,027,000
東北電力	2,100	1,874	3,935,400
四国電力	1,000	2,433	2,433,000
九州電力	2,000	1,872	3,744,000
北海道電力	1,000	1,728	1,728,000
沖縄電力	100	4,025	402,500
電源開発	800	2,529	2,023,200
東京瓦斯	12,000	370	4,440,000
大阪瓦斯	10,000	315	3,150,000
東邦瓦斯	3,000	429	1,287,000
北海道瓦斯	2,000	253	506,000
西部瓦斯	2,000	212	424,000
静岡瓦斯	1,000	468	468,000
松竹	1,000	656	656,000
東宝	1,000	1,357	1,357,000
エイチ・アイ・エス	200	2,251	450,200
東映	1,000	439	439,000
NTTデータ	13	305,500	3,971,500
共立メンテナンス	200	1,425	285,000
セゾン情報システムズ	300	1,342	402,600
日本医療事務センター	1,200	358	429,600
ナガワ	400	549	219,600
よみうりランド	1,000	317	317,000
東京都競馬	3,000	125	375,000
東京ドーム	1,000	208	208,000
DTS	300	983	294,900
スクウェア・エニックス・HD	500	1,496	748,000
カプコン	400	1,494	597,600
日本空港ビルデング	500	1,312	656,000
トランス・コスモス	300	900	270,000

住商情報システム	300	1,349	404,700
藤田観光	1,000	380	380,000
セコム	1,000	4,090	4,090,000
C S K	1,000	333	333,000
アイネス	400	692	276,800
メイテック	200	1,817	363,400
アサツー ディ・ケイ	300	2,343	702,900
富士ソフト	200	1,508	301,600
船井総合研究所	700	536	375,200
N S D	300	898	269,400
コナミ	700	1,654	1,157,800
ベネッセホールディングス	400	3,675	1,470,000
イオンディライト	300	1,566	469,800
ニチイ学館	500	756	378,000
ダイセキ	300	1,616	484,800
ステップ	1,000	520	520,000
トラスコ中山	300	1,443	432,900
ヤマダ電機	450	6,360	2,862,000
オートバックスセブン	200	3,245	649,000
ニトリホールディングス	250	7,530	1,882,500
パーカーコーポレーション	2,000	223	446,000
吉野家ホールディングス	3	110,500	331,500
加藤産業	300	1,450	435,000
イノテック	500	635	317,500
松屋フーズ	200	1,508	301,600
日 伝	100	2,351	235,100
日本電計	800	577	461,600
ミロク情報サービス	2,500	250	625,000
因幡電機産業	200	2,412	482,400
王将フードサービス	200	2,128	425,600
住金物産	2,000	228	456,000
ココスジャパン	300	1,612	483,600
プレナス	200	1,437	287,400
バ ロ ー	600	797	478,200
ミスミグループ本社	500	2,108	1,054,000
藤 久	400	1,318	527,200
マ ル コ	1,800	149	268,200
ファーストリテイリング	500	12,530	6,265,000
ソフトバンク	4,900	3,160	15,484,000
蔵王産業	800	621	496,800
スズケン	500	2,355	1,177,500
サンドラッグ	400	2,515	1,006,000
東京デリカ	1,400	396	554,400
ベルーナ	450	635	285,750
合計	1,783,363		1,548,056,405

(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（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成23年2月28日

資産総額	1,658,607,228円	
負債総額	7,096,849円	
純資産総額（ - ）	1,651,510,379円	
発行済数量	2,480,000,000口	
1単位当たり純資産額（ / ）		0.6659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します。）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23年2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23年2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	7	25,882
追加型株式投資信託	357	6,935,088
株式投資信託 合計	364	6,960,970
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,992,253
公社債投資信託 合計	17	2,992,253
総合計	381	9,953,223

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="text-align: right;">776,838千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,691,069千円</td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td style="text-align: right;">675,647千円</td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td style="text-align: right;">26,929千円</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="text-align: right;">815,365千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,938,369千円</td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td style="text-align: right;">688,305千円</td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td style="text-align: right;">27,339千円</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>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">4,599千円</td> </tr> <tr> <td>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"><hr/></td> </tr> <tr> <td>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>1年以内</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>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>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">1,314千円</td> </tr> <tr> <td>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	<hr/>		期末残高相当額	985千円	1年以内	985千円	1年超	- 千円	<hr/>		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>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td>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																										
<hr/>																											
期末残高相当額	985千円																										
1年以内	985千円																										
1年超	- 千円																										
<hr/>																											
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せ

ず。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）
(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。
(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。
(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。
(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。

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>

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

(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おりません。	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	<p>(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。 其他有価証券 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。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法により計上しております。</p>
2. 固定資産の減価償却 の方法	<p>(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</p> <p>(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。</p> <p>(3) 長期前払費用 定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <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。</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 に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>

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.（現Daiwa Asset Management (India) Private Limited）およびShinsei Trustee Company (India) Pvt. Ltd.（現Daiwa Trustee Company (India) Private Limited）への出資を行ない、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23年3月25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23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23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。

[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 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。

[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。