

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年 1 月15日
【計算期間】	第30期（自 平成25年 4 月16日 至 平成25年10月15日）
【ファンド名】	ドイチェ・日本株式ファンド（トピックス連動型）
【発行者名】	ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 関崎 司
【本店の所在の場所】	東京都千代田区永田町二丁目11番 1 号 山王パークタワー
【事務連絡者氏名】	出仙 学恭
【連絡場所】	東京都千代田区永田町二丁目11番 1 号 山王パークタワー
【電話番号】	03(5156)5000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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】

ファンドの目的

当ファンドは、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

信託金の限度額

2,000億円を限度とします。

ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

基本的性格

当ファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表 >

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

< 商品分類の定義について >

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づく定義は以下の通りです。

1. 「単位型投信・追加型投信」の区分のうち、「追加型投信」とは、一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
2. 「投資対象地域」の区分のうち、「国内」とは、目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
3. 「投資対象資産（収益の源泉）」の区分のうち、「株式」とは、目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
4. 「補足分類」の区分のうち、「インデックス型」とは、目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

なお、上記は当ファンドに該当する分類について記載したものです。上記以外の商品分類の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

< 属性区分表 >

投資対象資産	決算 頻度	投資対象 地域	投資 形態	為替 ヘッジ	対象イン デックス	特殊型
株式 一般	年 1 回	グローバル	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ ベア型
大型株 中小型株		日本				
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性()	年 2 回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	条件付 運用型
	年 4 回	欧州				
	年 6 回 (隔月)	アジア				
	年 12 回 (毎月)	オセアニア				
不動産投信	年 12 回 (毎月)	中南米	ファンド ・オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	ロング・ ショート型 ² ₂ ¹ ₃
その他資産 ()	日々	アフリカ				
資産複合()	その他 ()	中近東（中東）				
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング				
					その他 ()	絶対収益 追求型 その他 ()

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 属性区分の定義について >

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づく定義は以下の通りです。

1. 「投資対象資産」の区分のうち、「株式 一般」とは、目論見書または投資信託約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものであって、大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのものをいいます。
2. 「決算頻度」の区分のうち、「年 2 回」とは、目論見書または投資信託約款において、年 2 回決算する旨の記載があるものをいいます。
3. 「投資対象地域」の区分のうち、「日本」とは、目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
4. 「対象インデックス」の区分のうち、「TOPIX」とは、対象インデックスをTOPIXとするものをいいます。

なお、上記は当ファンドに該当する属性について記載したものです。上記以外の属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

ファンドの特色

1. 東京証券取引所一部上場の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）に連動した投資成果を目指すインデックス・ファンドです。

TOPIX（東証株価指数）の指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所といたします。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。

当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。(株)東京証券取引所は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

２．運用の指図に関する権限を、ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社に委託します。

市況動向及び資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

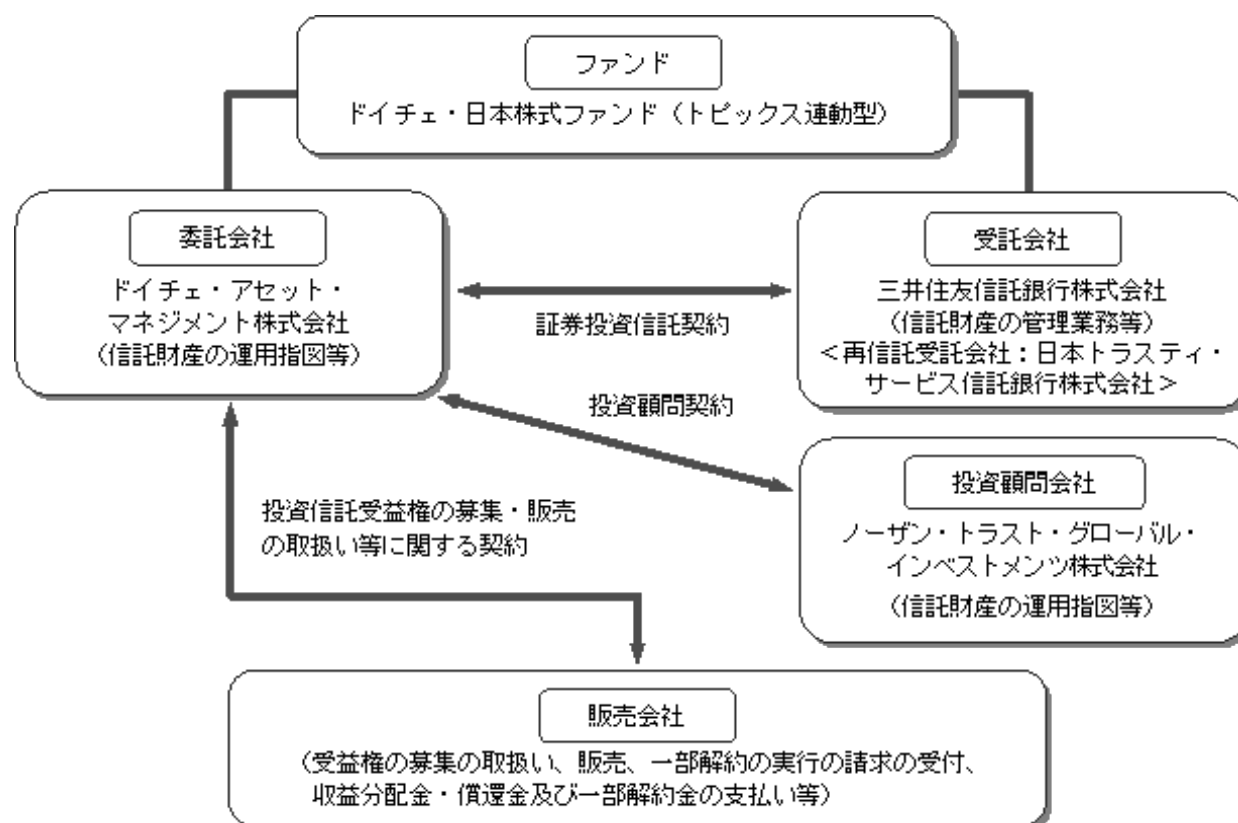
(2)【ファンドの沿革】

平成10年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

平成12年12月1日 ファンド名称の変更（「BT日本株式ファンド（トピックス連動型）」より「ドイチェ・日本株式ファンド（トピックス連動型）」に変更）

(3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



委託会社及びファンドの関係法人

委託会社及びファンドの関係法人の名称、ファンドの運営上の役割は次の通りです。

a．ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社（「委託会社」）

当ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、受託会社との信託契約の締結、目論見書・運用報告書の作成等を行います。

b．三井住友信託銀行株式会社（「受託会社」）

（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）

委託会社との間で「証券投資信託契約」を締結し、これに基づき、当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理、基準価額の計算、外国証券を保管・管理する外国の金融機関への指図等を行います。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。

c．「販売会社」

委託会社との間で「投資信託受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」を締結し、これに基づき、当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い等を行います。

d. ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社（「投資顧問会社」）

委託会社から運用の指図に関する権限の委託を受け、当ファンドの信託財産の運用指図等を行います。なお、委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

委託会社の概況

a. 資本金の額（2013年11月末現在）

3,078百万円

b. 沿革

1985年 モルガン グレンフェル インターナショナル アセット マネジメント（株）設立
 1987年 投資顧問業登録、投資一任業務認可取得
 1990年 ドイツ銀投資顧問（株）と合併し、ディービー モルガン グレンフェル アセット マネジメント（株）に社名を変更
 1995年 ディービー モルガン グレンフェル投信投資顧問（株）に社名を変更
 証券投資信託委託会社免許取得
 1996年 ドイチェ・モルガン・グレンフェル投信投資顧問（株）に社名を変更
 1999年 バンカース・トラスト投信投資顧問（株）と合併し、ドイチェ・アセット・マネジメント（株）に社名を変更
 2002年 チューリッヒ・スカダー投資顧問（株）と合併
 2005年 ドイチェ・アセット・マネジメント（株）とドイチェ信託銀行（株）の資産運用サービス業務を統合
 資産運用部門はドイチェ・アセット・マネジメント（株）に一本化

c. 大株主の状況（2013年11月末現在）

名 称： ドイチェ・アジア・パシフィック・ホールディングス・ピーティーイー・リミテッド
 住 所： シンガポール 048583 ワン ラフルズ クウェイ #17-10
 所有株式： 61,560株
 所有比率： 100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

運用方法

a. 投資対象

東証一部上場の株式を主要投資対象とします。

b. 投資態度

- 1) 主に、東証一部上場の株式に積極的に分散投資を行うことによって、長期的な収益の向上を目指します。
- 2) TOPIX（東証株価指数）に連動した投資成果を目指します。
- 3) 実質的な株式の組入れ率を高位に保つことを基本としますが、市況動向・資金動向等によってはコール・ローン等による現金運用部分を増加させることがあります。
- 4) 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。
- 5) ただし、市況動向や資金動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 6) 信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、外国為替予約、有価証券の貸付、信用取引、公社債の空売り、公社債の借入れ及び資金の借入れを行うことがあります。

(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。）に投資することを指図します。

- 1．株券または新株引受権証書
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券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．コマーシャル・ペーパー
- 7．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。）及び新株予約権証券
- 8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1．から上記7．までの証券の性質を有するもの
- 9．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。）
- 10．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 11．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。）
- 12．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 13．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。）
- 14．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15．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
- 16．外国の者に対する権利で上記15．の有価証券の性質を有するもの
- 17．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。）
- 18．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。）

なお、上記1．の証券または証書及び上記8．並びに上記13．の証券または証書のうち上記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、上記2．から上記5．までの証券及び上記8．並びに上記13．の証券または証書のうち上記2．から上記5．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記9．の証券及び上記10．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、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

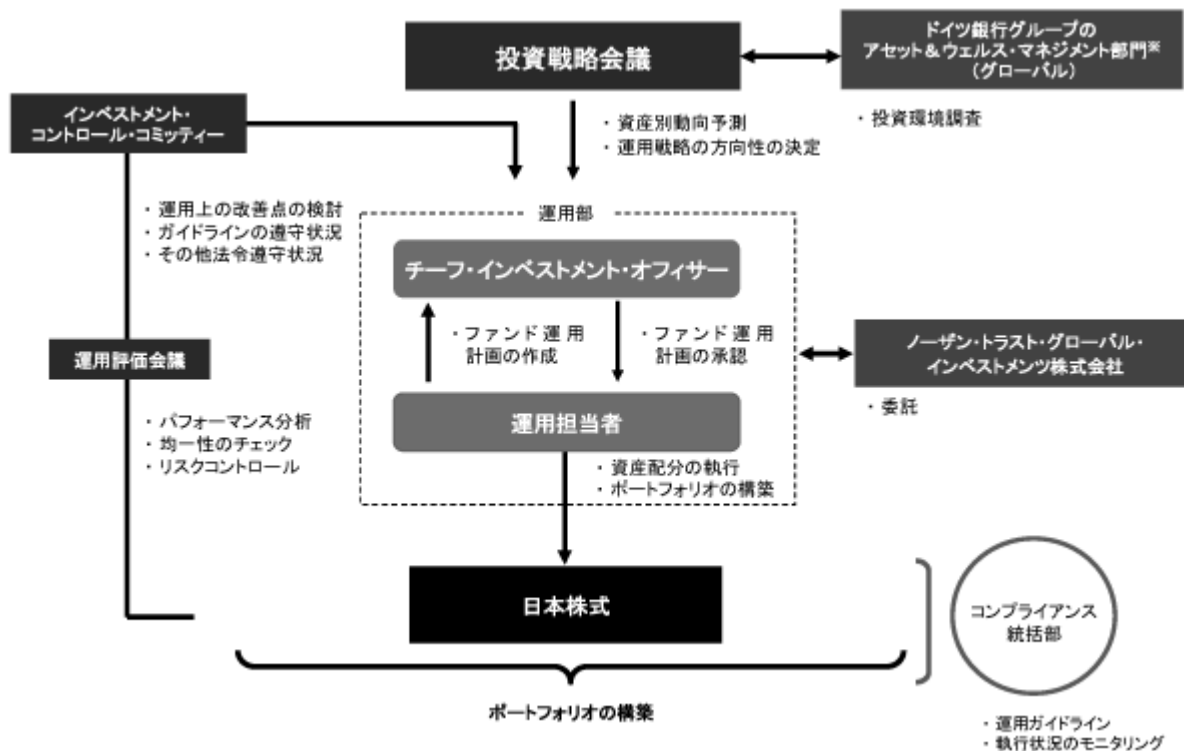
委託会社は、法令・規則等で認められる範囲で信託金を委託会社の関係会社が発行する有価証券により運用することを指図することができます。また、委託会社は、信託金による有価証券その他の資産の取得を委託会社の関係会社から行うことを指図することができます。

上記 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、上記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3)【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。

< 運用体制 >



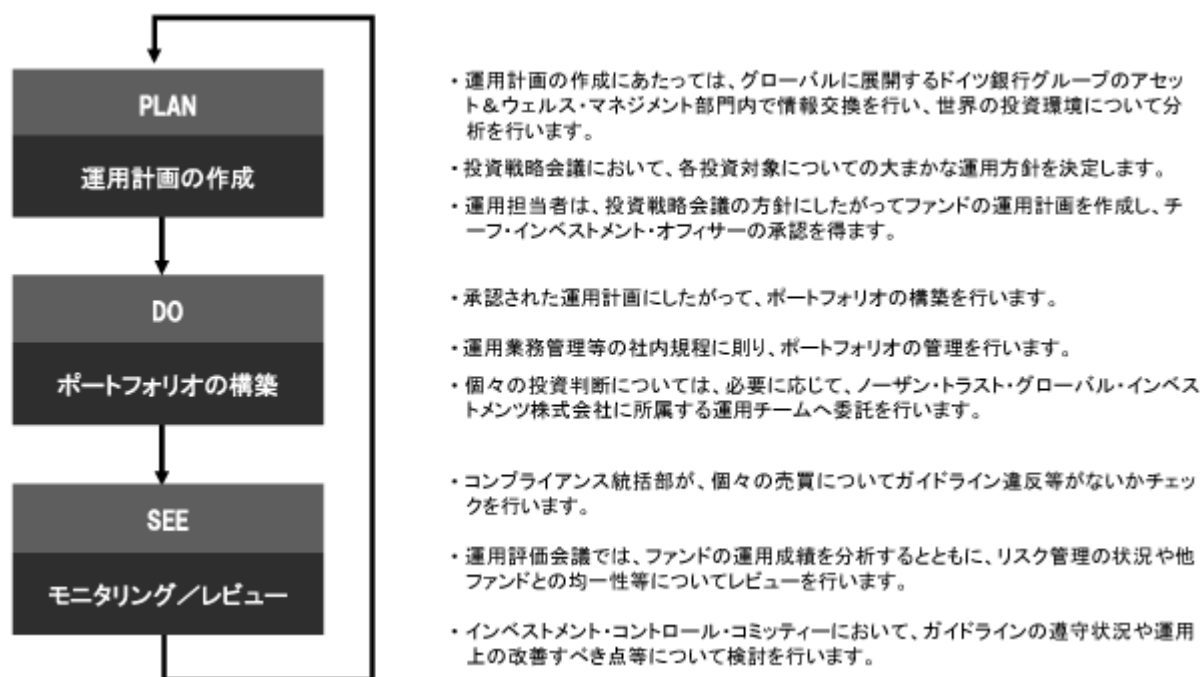
ドイツ銀行グループにおける資産運用ビジネスを担います。

委託会社は、当ファンドの運用指図に関する権限をノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社（所在地：東京都港区）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。運用計画の作成、法令等の遵守状況確認、運用評価及びリスク管理等のその他運用に関連する業務は、委託会社の運用部が行います。当該運用部における主な意思決定機関としては、投資戦略会議、運用評価会議、インベストメント・コントロール・コミッティーの3つがあります。これらはいずれもチーフ・インベストメント・オフィサーが主催し、各運用担当者及び必要に応じて関係部署の代表者が参加して行われます。

投資戦略会議では、投資環境予測や運用戦略の方向性の決定等、運用計画の作成に必要な基本的な事項を審議します。運用評価会議では、超過収益率の要因分析や投資行動、均一性等を含めて審議します。インベストメント・コントロール・コミッティーでは、顧客勘定における運用リスクに係る諸問題等を把握し、必要な意思決定を行います。これらの運用体制については、社内規程及び運用部部内規程により定められています。

運用委託先の管理体制については、当該委託先との継続的な情報交換及び定期的な訪問等を通じて、運用面、法令遵守面、業務執行面から評価を行います。評価結果は上述のインベストメント・コントロール・コミッティーに報告され、同コミッティーは必要に応じて適切な措置を行います。

< 運用の流れ >



< 内部管理及びファンドに係る意思決定を監督する組織 >

インベストメント・コントロール・コミッティーは、その活動内容等をエグゼクティブ・コミッティーに報告します。エグゼクティブ・コミッティーは代表取締役が議長を務め、委託会社の業務運営、リスク管理及び内部統制等に係る諸問題を把握し、取締役会決議事項については取締役会に対する諮問機関であるとともに、それ以外の事項については代表取締役が行う意思決定を補佐する機関としての役割を担います。さらに、コンプライアンス統括部は、運用部から独立した立場でガイドライン遵守状況及び利益相反取引等の検証を行います。また、独立したモニタリング活動として、すべての部門から独立した監査部が内部統制の有効性及び業務プロセスの効率性を検証し、経営陣に対して問題点の指摘、改善点の提案を行います。上記各組織については、その内部管理機能の有効性の観点から十分な人員を確保しております。

< 委託会社等によるファンドの関係法人に対する管理体制 >

当ファンドの受託会社に対する管理については、証券投資信託契約に基づく受託会社としての業務の適切な遂行及び全体的なサービスレベルを委託会社の業務部においてモニターしております。

運用委託先に対しては、運用委託に関する社内規程に基づき管理します。委託会社は、資産運用能力（運用パフォーマンス実績）、信用力、リスク管理能力（運用ガイドラインの遵守状況を含みます。）及び内部統制の状況（または内部監査の実施状況）の観点から、定期的に運用委託先を定量的・定性的に評価します。評価結果はインベストメント・コントロール・コミッティーに報告され、同コミッティーは評価結果を踏まえて運用委託先の契約継続の可否等を検討します。また重要な契約違反、エラーまたは問題点等が判明した場合、直ちに運用委託先に報告及び是正を求めるものとします。

（注）運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

年2回の毎決算時（原則として毎年4月15日及び10月15日。ただし、当該日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入と売買益等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。

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

（注）将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

< 信託約款で定める投資制限 >

a．株式への投資制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

b．外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30％以下とします。

c．投資する株式等の範囲

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの及び証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

d．投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。

e．信用取引の指図範囲

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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

上記の信用取引の指図は、当該売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売り付けに係る建玉の時価総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、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

f．公社債の空売りの指図範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

上記の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売り付けに係る公社債の時価総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、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

g．公社債の借入れ

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

上記の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の借入れに係る公社債の時価総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、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を決済するための指図をするものとします。

上記の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

h. 先物取引等の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）及び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。）及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。）並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うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並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うことの指図をすることができます。

イ. スワップ取引の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。

委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

j. 金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。

委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

k. 有価証券の貸付の指図及び範囲

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及び公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、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の50%を超えないものとします。

上記に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

委託会社は、有価証券の貸付にあたり担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

1. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

m. 外国為替予約の指図及び範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

上記の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

上記の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

n. 資金の借入れ

委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性をはかるため、信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

上記の資金借入額は、次に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当のために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内。
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内。

上記の借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

借入金の利息は信託財産中より支弁します。

< 法令で定める投資制限 >

同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律（以下「投信法」といいます。）第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、次のa.の数がb.の数を越えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

a. 委託会社が運用の指図を行うすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数

b. 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

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

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

3【投資リスク】

(1) 当ファンドの主なリスク及び留意点

当ファンドは、株式等の値動きのある証券に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元金が保証されているものではありません。当ファンドに生じた利益及び損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの基準価額は、主に以下のリスクにより変動し、損失を生じるおそれがあります。

なお、当ファンドは預貯金と異なります。

株価変動リスク

当ファンドは主に株式に投資しますので、ファンドの基準価額は組入れている株式の価格変動の影響を受けます。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、短期的または長期的に大きく下落することがあります。これによりファンドの基準価額が影響を受け損失を被ることがあります。

信用リスク

投資した株式について、発行者の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化を含む信用状況等の悪化は価格下落要因のひとつであり、これによりファンドの基準価額が影響を受け損失を被ることがあります。

流動性リスク

急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合、または市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、機動的に有価証券等を売買できないことがあります。このような場合には、当該有価証券等の価格の下落により、ファンドの基準価額が影響を受け損失を被ることがあります。

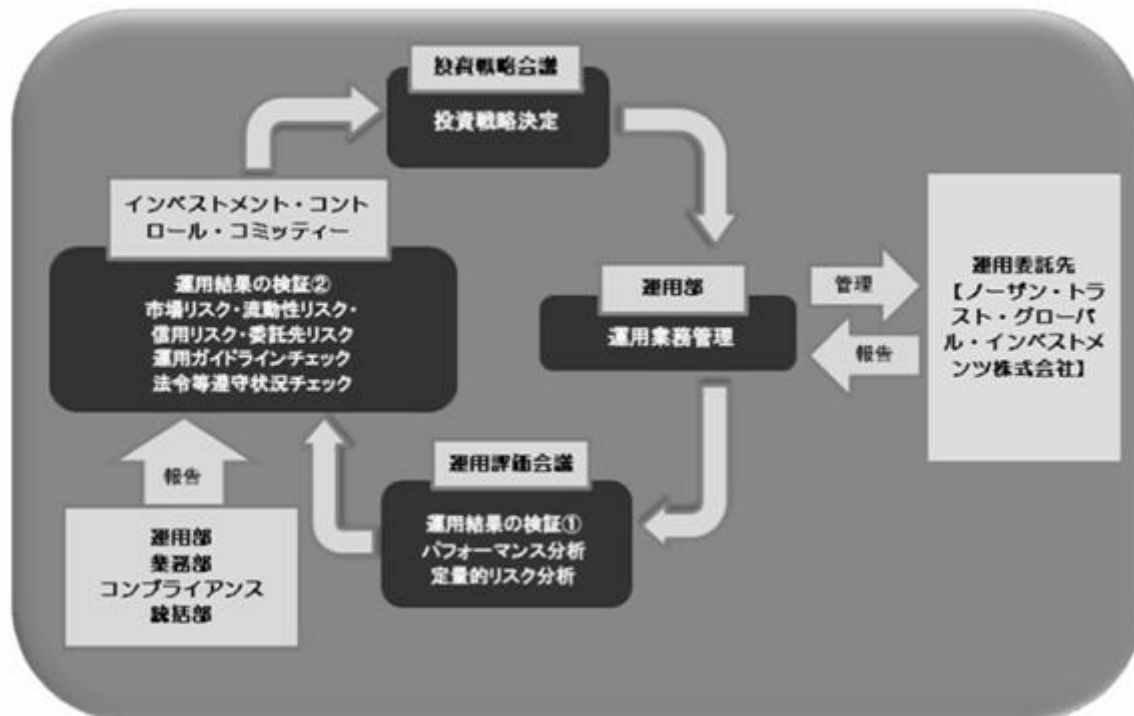
ベンチマークからの乖離リスク

当ファンドは、TOPIXに連動した投資成果を目指して運用を行いますが、主に資金の流出入と、実際に株式を売買する間の時間の差、株式売買委託手数料や信託報酬等の負担によって、基準価額がベンチマークから乖離することがあります。このため、TOPIXが下落した場合には、基準価額がTOPIXよりも大きく下落し、より大きな損失を被ることがあります。

その他の留意点

- ・当ファンドの追加設定（ファンドへの資金流入）及び一部解約（ファンドからの資金流出）による資金の流出入に伴い、基準価額が影響を受ける場合があります。大量の追加設定があった場合、原則として迅速に有価証券の組入れを行いますが、買付予定銘柄によっては流動性等の観点から買付終了までに時間がかかることがあります。同様に大量の解約があった場合にも解約資金を手当てするため保有証券を大量に売却しなければならないことがあります。その際には、市況動向や取引量等の状況によって、基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・委託会社は、証券取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、取得申込み・解約請求の受付を中止すること及び既に受付けた取得申込み・解約請求の受付を取消することができます。
- ・当ファンドの資産規模によっては、投資方針に沿った運用が効率的にできない場合があります。その場合には、適切な資産規模の場合と比較して収益性が劣る可能性があります。
- ・当ファンドは、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合等に必要な手続き等を経て繰上償還されることがあります。
- ・資金動向、市況動向その他の要因により、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ・法令・税制・会計制度等は今後変更される可能性もあります。
- ・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。
- ・分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合があり、その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。分配金の水準は、必

委託会社のリスク管理体制は以下の通りです。



(注) 投資リスクに対する管理体制は、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の基準価額に2.1%^{*}（税抜2.0%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

^{*} 消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。

(2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）に係る手数料はありません。

ただし、換金（解約）時に、一部解約の実行の請求を受付けた日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.3%を乗じて得た額）が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、引続き受益権を保有する受益者と解約者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

(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0.7875%^{*}（税抜0.75%）を乗じて得た額とし、その配分は以下の通りとします。

（年率、税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.34%	0.34%	0.07%

（注）委託会社及び受託会社の報酬は、ファンドから支払われます。信託報酬の販売会社への配分は、販売会社が行うファンドの募集の取扱い等に関する業務に対する代行手数料であり、ファンドから委託会社に支払われた後、委託会社より販売会社に対して支払われます。

^{*} 消費税が8%になった場合は、年率0.81%となります。

上記の信託報酬並びに当該信託報酬に係る消費税及び地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

当ファンドの運用指図を行うノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社に対する投資顧問報酬は、上記に基づいて委託会社が受ける報酬から毎計算期末または信託終了のとき支弁するものとし、その報酬額は、信託財産の純資産総額に年0.17%（税抜）以内の率を乗じて得た額とします。

(4)【その他の手数料等】

当ファンドは、以下の費用を受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（監査費用、法律顧問・税務顧問への報酬、印刷費用、郵送費用、公告費用、格付費用等を含みます。）及び受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

委託会社は、上記に定める信託事務の処理等に要する諸費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。この場合、委託会社は、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受ける際に、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。また、委託会社は、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、かかる諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もったうえで、実際の費用額にかかわらず固定率または固定金額にて信託財産からその支弁を受けることもできます。

上記において諸費用の上限、固定率または固定金額を定める場合、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、期中に、あらかじめ委託会社が定めた範囲内でかかる上限、固定率または固定金額を変更することができます。

上記において諸費用の固定率または固定金額を定める場合、かかる諸費用の額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に応じて計上されます。かかる諸費用は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支弁します。

なお、本書作成時点において、上記により定める上限は、信託財産の純資産総額に年率0.10%を乗じて得た額とします。

信託財産における組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等の証券取引に伴う手数料・税金は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料等に係る消費税等相当額、資産を外国で保管する場合の費用及び先物取引・オプション取引に要する費用等についても信託財産が負担するものとします。

(5)【課税上の取扱い】

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下の取扱いとなります。

個別元本方式について

追加型株式投資信託については、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数口座で同一ファンドを取得する場合は当該口座毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については下記「収益分配金について」をご参照下さい。）

収益分配金について

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「元本払戻金（特別分配金）」（受益者の元本の一部払戻しに相当する部分）の区別があります。

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

課税の取扱いについて

以下の内容は平成26年1月1日現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合等には内容が変更されることがあります。

a. 個人の受益者に対する課税

収益分配金の取扱い

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、原則として20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用があります。）または申告分離課税を選択することもできます。

一部解約金、償還金の取扱い

一部解約時及び償還時の差益については譲渡所得となり、原則として20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座において「源泉徴収あり」を選択した場合には、20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

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、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

＊少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

b．法人の受益者に対する課税

収益分配金、一部解約金、償還金の取扱い

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収され、法人の受取額となります。なお、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、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

（注1）上記のほか、販売会社によっては、受益権を買い取る場合があります。買取請求時の課税の取扱いについて、詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

（注2）課税上の取扱いの詳細については、税務専門家または税務署にご確認下さい。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成25年10月31日現在)

資産の種類	地域別(国名)	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	2,110,103,450	97.69
コール・ローン・その他の資産 (負債控除後)	-	49,852,637	2.31
合計(純資産総額)	-	2,159,956,087	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

< 評価額(上位30銘柄) >

(平成25年10月31日現在)

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 評価単価 (円)	簿価金額 評価金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	16,500	6,390.00 6,360.00	105,435,000 104,940,000	4.86
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナン シャル・グループ	銀行業	94,700	633.00 620.00	59,945,100 58,714,000	2.72
日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	9,500	4,835.00 4,715.00	45,932,500 44,792,500	2.07
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	6,100	7,240.00 7,300.00	44,164,000 44,530,000	2.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	10,800	3,920.00 3,915.00	42,336,000 42,282,000	1.96
日本	株式	みずほフィナンシ ャルグループ	銀行業	161,500	207.00 205.00	33,430,500 33,107,500	1.53
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	7,900	3,520.00 3,550.00	27,808,000 28,045,000	1.30
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,200	5,330.00 5,090.00	27,716,000 26,468,000	1.23
日本	株式	三菱地所	不動産業	9,000	2,809.00 2,797.00	25,281,000 25,173,000	1.17
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	5,000	4,685.00 4,665.00	23,425,000 23,325,000	1.08
日本	株式	キヤノン	電気機器	7,400	3,115.00 3,090.00	23,051,000 22,866,000	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	30,000	625.00 685.00	18,750,000 20,550,000	0.95
日本	株式	ファナック	電気機器	1,300	16,740.00 15,720.00	21,762,000 20,436,000	0.95
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	2,300	8,530.00 8,510.00	19,619,000 19,573,000	0.91
日本	株式	三井不動産	不動産業	6,000	3,325.00 3,235.00	19,950,000 19,410,000	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	9,700	1,990.00 1,982.00	19,303,000 19,225,400	0.89
日本	株式	K D D I	情報・通信業	3,600	5,280.00 5,310.00	19,008,000 19,116,000	0.89
日本	株式	セブン&アイ・ホー ルディングス	小売業	5,200	3,740.00 3,620.00	19,448,000 18,824,000	0.87
日本	株式	野村ホールディング ス	証券、商品先 物取引業	25,700	752.00 723.00	19,326,400 18,581,100	0.86
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	57,000	343.00 323.00	19,551,000 18,411,000	0.85
日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	10,300	1,559.00 1,560.00	16,057,700 16,068,000	0.74
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	16,200	1,001.00 982.00	16,216,200 15,908,400	0.74

日本	株式	アステラス製薬	医薬品	2,900	5,150.00 5,460.00	14,935,000 15,834,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,800	3,080.00 3,205.00	14,784,000 15,384,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	10,800	1,423.00 1,400.00	15,368,400 15,120,000	0.70
日本	株式	ソニー	電気機器	8,000	1,938.00 1,877.00	15,504,000 15,016,000	0.70
日本	株式	デンソー	輸送用機器	3,100	4,880.00 4,705.00	15,128,000 14,585,500	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	14,600	961.00 985.00	14,030,600 14,381,000	0.67
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	4,200	3,535.00 3,355.00	14,847,000 14,091,000	0.65
日本	株式	三菱電機	電気機器	13,000	1,081.00 1,075.00	14,053,000 13,975,000	0.65

（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評価金額の比率をいいます。

< 種類別及び業種別投資比率 >

（平成25年10月31日現在）

種類	国内 / 外国	業種	投資比率(%)
----	---------	----	---------

株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.41
		建設業	2.61
		食料品	3.94
		繊維製品	0.74
		パルプ・紙	0.27
		化学	5.23
		医薬品	4.24
		石油・石炭製品	0.58
		ゴム製品	0.86
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.82
		非鉄金属	1.00
		金属製品	0.66
		機械	5.07
		電気機器	11.26
		輸送用機器	11.64
		精密機器	1.23
		その他製品	1.31
		電気・ガス業	2.37
		陸運業	3.86
		海運業	0.36
		空運業	0.59
		倉庫・運輸関連業	0.25
		情報・通信業	6.77
		卸売業	4.48
		小売業	4.08
		銀行業	9.76
		証券、商品先物取引業	1.76
		保険業	2.24
		その他金融業	1.37
		不動産業	3.72
		サービス業	2.10
		小計	
合計		97.69	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類別及び業種別の評価金額の比率をいいます。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

計算期間末 または各月末	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第11期計算期間末(平成16年 4月15日)	8,287	8,287	1.0135	1.0135
第12期計算期間末(平成16年10月15日)	7,672	7,672	0.9372	0.9372
第13期計算期間末(平成17年 4月15日)	7,492	7,492	0.9758	0.9758
第14期計算期間末(平成17年10月17日)	7,644	7,644	1.1872	1.1872
第15期計算期間末(平成18年 4月17日)	23,653	23,734	1.4648	1.4698
第16期計算期間末(平成18年10月16日)	14,543	14,595	1.4036	1.4086
第17期計算期間末(平成19年 4月16日)	9,353	9,384	1.4745	1.4795
第18期計算期間末(平成19年10月15日)	5,239	5,258	1.4192	1.4242
第19期計算期間末(平成20年 4月15日)	3,812	3,830	1.0792	1.0842
第20期計算期間末(平成20年10月15日)	2,830	2,830	0.8259	0.8259
第21期計算期間末(平成21年 4月15日)	2,509	2,509	0.7283	0.7283
第22期計算期間末(平成21年10月15日)	2,695	2,695	0.7920	0.7920
第23期計算期間末(平成22年 4月15日)	2,774	2,774	0.8799	0.8799
第24期計算期間末(平成22年10月15日)	2,267	2,267	0.7317	0.7317
第25期計算期間末(平成23年 4月15日)	2,208	2,208	0.7515	0.7515
第26期計算期間末(平成23年10月17日)	1,956	1,956	0.6854	0.6854
第27期計算期間末(平成24年 4月16日)	1,984	1,984	0.7283	0.7283
第28期計算期間末(平成24年10月15日)	1,734	1,734	0.6597	0.6597
第29期計算期間末(平成25年 4月15日)	2,443	2,443	1.0412	1.0412
第30期計算期間末(平成25年10月15日)	2,211	2,211	1.1042	1.1042
平成24年10月末	1,770	-	0.6769	-
平成24年11月末	1,849	-	0.7120	-
平成24年12月末	1,934	-	0.7841	-
平成25年 1月末	2,098	-	0.8568	-
平成25年 2月末	2,153	-	0.8886	-
平成25年 3月末	2,260	-	0.9503	-
平成25年 4月末	2,473	-	1.0698	-
平成25年 5月末	2,308	-	1.0428	-
平成25年 6月末	2,273	-	1.0411	-
平成25年 7月末	2,140	-	1.0378	-
平成25年 8月末	2,058	-	1.0139	-
平成25年 9月末	2,209	-	1.1015	-
平成25年10月末	2,159	-	1.1013	-

(注) 純資産総額は、百万円未満切捨て。

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第11期計算期間(平成15年10月16日～平成16年 4月15日)	0.0000
第12期計算期間(平成16年 4月16日～平成16年10月15日)	0.0000
第13期計算期間(平成16年10月16日～平成17年 4月15日)	0.0000
第14期計算期間(平成17年 4月16日～平成17年10月17日)	0.0000
第15期計算期間(平成17年10月18日～平成18年 4月17日)	0.0050
第16期計算期間(平成18年 4月18日～平成18年10月16日)	0.0050
第17期計算期間(平成18年10月17日～平成19年 4月16日)	0.0050
第18期計算期間(平成19年 4月17日～平成19年10月15日)	0.0050
第19期計算期間(平成19年10月16日～平成20年 4月15日)	0.0050
第20期計算期間(平成20年 4月16日～平成20年10月15日)	0.0000
第21期計算期間(平成20年10月16日～平成21年 4月15日)	0.0000
第22期計算期間(平成21年 4月16日～平成21年10月15日)	0.0000
第23期計算期間(平成21年10月16日～平成22年 4月15日)	0.0000
第24期計算期間(平成22年 4月16日～平成22年10月15日)	0.0000
第25期計算期間(平成22年10月16日～平成23年 4月15日)	0.0000
第26期計算期間(平成23年 4月16日～平成23年10月17日)	0.0000
第27期計算期間(平成23年10月18日～平成24年 4月16日)	0.0000
第28期計算期間(平成24年 4月17日～平成24年10月15日)	0.0000
第29期計算期間(平成24年10月16日～平成25年 4月15日)	0.0000
第30期計算期間(平成25年 4月16日～平成25年10月15日)	0.0000

【収益率の推移】

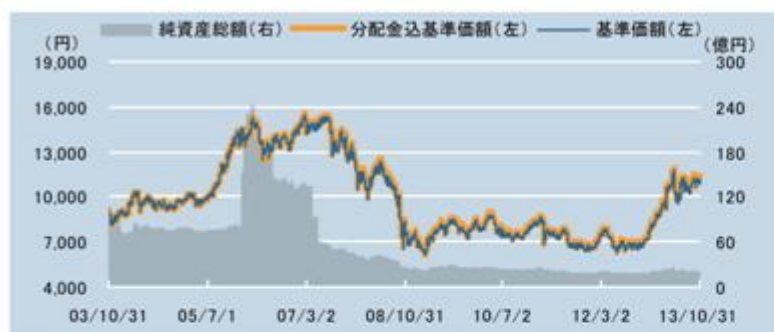
	収益率(%)
第11期計算期間(平成15年10月16日～平成16年 4月15日)	10.8
第12期計算期間(平成16年 4月16日～平成16年10月15日)	7.5
第13期計算期間(平成16年10月16日～平成17年 4月15日)	4.1
第14期計算期間(平成17年 4月16日～平成17年10月17日)	21.7
第15期計算期間(平成17年10月18日～平成18年 4月17日)	23.8
第16期計算期間(平成18年 4月18日～平成18年10月16日)	3.8
第17期計算期間(平成18年10月17日～平成19年 4月16日)	5.4
第18期計算期間(平成19年 4月17日～平成19年10月15日)	3.4
第19期計算期間(平成19年10月16日～平成20年 4月15日)	23.6
第20期計算期間(平成20年 4月16日～平成20年10月15日)	23.5
第21期計算期間(平成20年10月16日～平成21年 4月15日)	11.8
第22期計算期間(平成21年 4月16日～平成21年10月15日)	8.7
第23期計算期間(平成21年10月16日～平成22年 4月15日)	11.1
第24期計算期間(平成22年 4月16日～平成22年10月15日)	16.8
第25期計算期間(平成22年10月16日～平成23年 4月15日)	2.7
第26期計算期間(平成23年 4月16日～平成23年10月17日)	8.8
第27期計算期間(平成23年10月18日～平成24年 4月16日)	6.3
第28期計算期間(平成24年 4月17日～平成24年10月15日)	9.4
第29期計算期間(平成24年10月16日～平成25年 4月15日)	57.8
第30期計算期間(平成25年 4月16日～平成25年10月15日)	6.1

(注) 収益率は、小数第2位を四捨五入しております。

(参考情報)

基準日：2013年10月31日

基準価額・純資産の推移 (2003/10/31～2013/10/31)



※1 基準価額の推移は、信託報酬控除後の価額を表示しております。

※2 分配金込基準価額の推移は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。

なお、分配金込基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しております。

分配の推移

1万口当たり、税引前	
2013年10月	0円
2013年4月	0円
2012年10月	0円
2012年4月	0円
2011年10月	0円
設定来累計	400円

主要な資産の状況

組入上位10銘柄

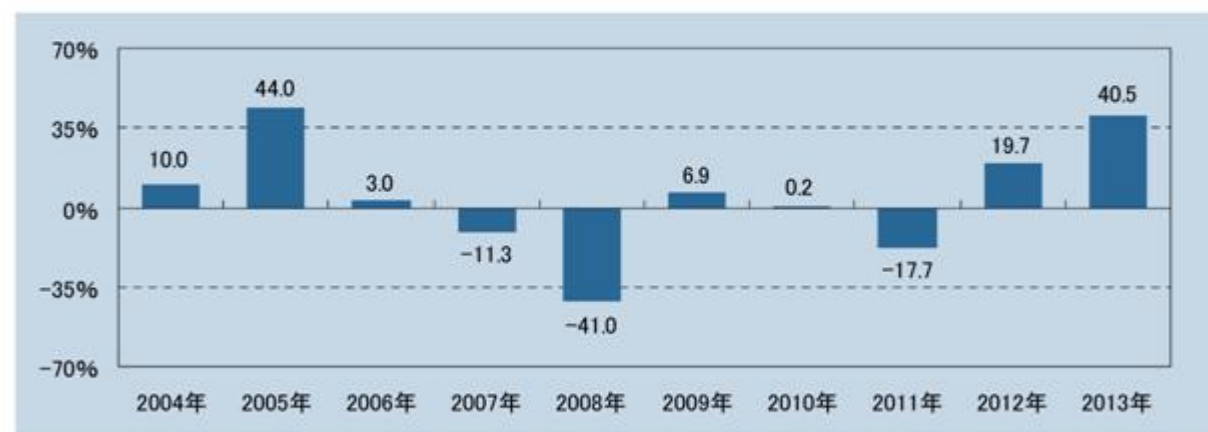
	銘柄	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	4.9
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.7
3	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.1
4	ソフトバンク	情報・通信業	2.1
5	本田技研工業	輸送用機器	2.0
6	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.5
7	日本たばこ産業	食料品	1.3
8	日本電信電話	情報・通信業	1.2
9	三菱地所	不動産業	1.2
10	武田薬品工業	医薬品	1.1

業種別構成比（上位5業種）

業種	比率(%)
輸送用機器	11.6
電気機器	11.3
銀行業	9.8
情報・通信業	6.8
化学	5.2

※ 比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移



※1 年間収益率の推移は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。

※2 2013年は10月末までの騰落率を表示しております。

(注1) 上記は過去の実績であり、将来の運用成果等を保証もしくは示唆するものではありません。

(注2) 最新の運用実績は、委託会社のホームページで開示されております。

(4)【設定及び解約の実績】

下記期間中の設定及び解約の実績は次の通りです。

	設定数量(口)	解約数量(口)
第11期計算期間(平成15年10月16日～平成16年 4月15日)	1,373,401,362	2,586,867,987
第12期計算期間(平成16年 4月16日～平成16年10月15日)	510,123,666	500,073,953
第13期計算期間(平成16年10月16日～平成17年 4月15日)	272,531,433	782,232,992
第14期計算期間(平成17年 4月16日～平成17年10月17日)	206,262,640	1,444,269,659
第15期計算期間(平成17年10月18日～平成18年 4月17日)	12,195,013,540	2,486,945,900
第16期計算期間(平成18年 4月18日～平成18年10月16日)	276,115,151	6,062,019,122
第17期計算期間(平成18年10月17日～平成19年 4月16日)	288,818,615	4,307,277,293
第18期計算期間(平成19年 4月17日～平成19年10月15日)	179,750,041	2,830,828,275
第19期計算期間(平成19年10月16日～平成20年 4月15日)	71,867,102	230,983,836
第20期計算期間(平成20年 4月16日～平成20年10月15日)	79,803,005	186,329,860
第21期計算期間(平成20年10月16日～平成21年 4月15日)	99,651,925	80,718,474
第22期計算期間(平成21年 4月16日～平成21年10月15日)	65,088,889	106,654,615
第23期計算期間(平成21年10月16日～平成22年 4月15日)	54,438,921	304,603,784
第24期計算期間(平成22年 4月16日～平成22年10月15日)	48,922,569	103,384,288
第25期計算期間(平成22年10月16日～平成23年 4月15日)	46,023,071	206,959,258
第26期計算期間(平成23年 4月16日～平成23年10月17日)	42,594,680	125,874,207
第27期計算期間(平成23年10月18日～平成24年 4月16日)	40,568,445	170,427,491
第28期計算期間(平成24年 4月17日～平成24年10月15日)	36,354,229	132,424,408
第29期計算期間(平成24年10月16日～平成25年 4月15日)	29,981,998	312,312,532
第30期計算期間(平成25年 4月16日～平成25年10月15日)	19,779,305	363,423,319

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

取得申込みの受付は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに取得申込みが行われ、かつ、当該取得申込みの受付に係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。なお、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付分として取扱います。

当ファンドは収益分配金の受取方法により、収益の分配時に収益分配金を受け取る「一般コース」と、収益分配金が原則として税引き後無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の2つのコースがあります。当ファンドの取得申込者は、取得申込みをする際に、「一般コース」か「自動けいぞく投資コース」か、どちらかのコースを申し出るものとします。ただし、申込取扱場所によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。

「自動けいぞく投資コース」を選択する場合、取得申込者は、当該販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって契約を締結します。なお、収益分配金を再投資せず受取りを希望される場合は、販売会社によっては再投資の停止を申し出ることができます。詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

また、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が、別途、販売会社との間で「定時定額購入サービス」等に関する契約等を締結した場合、当該契約等で規定する取得申込みの方法によるものとします。

販売会社によっては、当該契約または規定について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を用いることがあり、この場合、該当する別の名称に読み替えるものとします。なお、「定時定額購入サービス」等の取扱いの有無については、申込みの販売会社にお問合せ下さい。

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

申込単位は、販売会社が定める単位とします。ただし、収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。申込単位の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

申込価額は、取得申込受付日の基準価額とします。ただし、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日（決算日）の基準価額とします。基準価額については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

申込手数料は、取得申込受付日の基準価額に2.1%^{*}（税抜2.0%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

^{*} 消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。

申込代金については、原則として販売会社が定める日までに申込みの販売会社に支払うものとします。詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

取得申込みの受付の中止、既に受付けた取得申込みの受付の取消し等

- a. 信託財産の効率的な運用に資するため必要があると委託会社が判断する場合、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を制限または停止することができます。
- b. 委託会社は、証券取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込みの受付を中止すること及び既に受付けた取得申込みの受付を取消すことができます。

委託会社の照会先は以下の通りです。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

一部解約の実行の請求の受付は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに一部解約の実行の請求が行われ、かつ、当該請求の受付に係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。なお、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付分として取扱います。

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

解約単位は、販売会社が定める単位とします。解約単位の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

解約価額は、一部解約の実行の請求を受付けた日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.3%を乗じて得た額）を差し引いた額とします。

解約価額については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

「信託財産留保額」とは、引続き受益権を保有する受益者と解約者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

お手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた額となります。詳しくは、前記「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求を受付けた日から起算して4営業日目から販売会社の本・支店、営業所等にて支払われます。

委託会社は、証券取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること及び既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。その場合には、受益者は当該受付中止以前に行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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記 に準じて計算された価額とします。

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

（注）上記のほか、販売会社によっては受益権を買い取る場合があります。詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

委託会社の照会先は以下の通りです。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

< 基準価額の計算方法等について >

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

受益権1口当たりの純資産総額が基準価額です。なお、便宜上、1万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。基準価額は、原則として委託会社の営業日に日々算出されます。

基準価額については、販売会社または委託会社の下記照会先にお問合せ下さい。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

また、原則として日本経済新聞（朝刊）の「オープン基準価格」欄に、前日付の基準価額が掲載されます。（略称：日インデ）

< 運用資産の評価基準及び評価方法 >

株式	原則として、証券取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。
公社債等	法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって、時価評価します。
外貨建資産	原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により評価します。
外国為替予約取引	原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

(2)【保管】

当ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まりますので、保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託契約締結日（平成10年11月30日）から無期限とします。

(4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年4月16日から10月15日まで及び10月16日から翌年4月15日までとすることを原則とします。

上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託の終了

(イ) 委託会社は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、または運用体制の変更等のやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- (ハ) 上記(ロ)の公告及び書面には、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。
- (二) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(イ)の信託契約の解約をしません。
- (ホ) 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨及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この信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ヘ) 上記(ハ)から(ホ)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、上記(ハ)の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)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及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告及び書面には、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。
- (二) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 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、変更しない旨及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、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

信託契約に関する監督官庁の命令

- (イ) 委託会社は、監督官庁よりこの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。
- (ロ) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記 の規定にしたがいます。

委託会社の登録取消し等に伴う取扱い

- (イ) 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、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ロ) 上記(イ)の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、上記 (二)に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

運用報告書

委託会社は、法令に基づき、当該信託財産の計算期間の末日毎及び信託終了時に期中の運用経過、組入有価証券の内容及び有価証券の売買状況等を記載した運用報告書を作成し、これを販売会社を通じて当該信託財産に係る知れている受益者に対して交付します。

関係法人との契約の更改等

< 投資信託受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約 >

当初の契約の有効期間は原則として1年間とします。ただし、期間満了3ヵ月前までに、委託会社及び販売会社いずれからも、何らの意思表示のないときは、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。

< 投資顧問契約 >

3ヵ月以上前の書面による相手方への通知により、どちらの当事者も投資顧問契約を終了することができます。

委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

- (イ) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- (ロ) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

- (イ) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記の規定にしたがい、新受託会社を選任します。
- (ロ) 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託約款に関する疑義の取扱い

信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託会社と受託会社との協議により定めます。

再信託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1)収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社が支払いを決定した収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払いを開始します。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は原則として税引き後無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

受益者が収益分配金について支払開始日から5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するものとします。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、当ファンドの償還金を持分にに応じて請求する権利を有します。

償還金は、原則として信託終了日（信託終了日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに、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われた受益権に係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、）に支払いを開始します。

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

(3)受益権の一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社を通じて、販売会社が定める単位をもって一部解約を委託会社に請求する権利を有します。一部解約金は、原則として一部解約の実行の請求を受付けた日から起算して4営業日目から受益者に支払われます。

(4)反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要（5）その他」の「信託の終了」、または「信託約款の変更」のうちその内容が重大な変更を行う場合において、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い取るべき旨を請求することができます。

(5)帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの計算期間は6ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
3. 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30期計算期間（平成25年4月16日から平成25年10月15日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

ドイチェ・日本株式ファンド（トピックス連動型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第29期計算期間 (平成25年4月15日現在)	第30期計算期間 (平成25年10月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,523,564	39,722,570
株式	2,375,279,940	2,133,794,671
派生商品評価勘定	1,991,692	974,868
未収入金	40,621,787	29,748,899
未収配当金	20,418,847	15,939,245
未収利息	19	32
差入委託証拠金	1,860,000	2,835,000
流動資産合計	2,463,695,849	2,223,015,285
資産合計	2,463,695,849	2,223,015,285
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	445,327	310,890
前受金	2,989,500	768,400
未払金	1,210,903	-
未払解約金	6,708,935	-
未払受託者報酬	737,606	840,121
未払委託者報酬	7,165,321	8,161,119
その他未払費用	1,003,493	1,142,959
流動負債合計	20,261,085	11,223,489
負債合計	20,261,085	11,223,489
純資産の部		
元本等		
元本	2,346,780,125	2,003,136,111
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	96,654,639	208,655,685
（分配準備積立金）	469,012,757	415,589,032
元本等合計	2,443,434,764	2,211,791,796
純資産合計	2,443,434,764	2,211,791,796
負債純資産合計	2,463,695,849	2,223,015,285

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第29期計算期間 (自 平成24年10月16日 至 平成25年 4月15日)	第30期計算期間 (自 平成25年 4月16日 至 平成25年10月15日)
営業収益		
受取配当金	22,552,133	19,813,498
受取利息	14,061	7,177
有価証券売買等損益	901,060,512	130,703,664
派生商品取引等損益	20,773,784	977,388
その他収益	16,353	22,251
営業収益合計	944,416,843	151,523,978
営業費用		
受託者報酬	737,606	840,121
委託者報酬	7,165,321	8,161,119
その他費用	1,003,493	1,142,959
営業費用合計	8,906,420	10,144,199
営業利益	935,510,423	141,379,779
経常利益	935,510,423	141,379,779
当期純利益	935,510,423	141,379,779
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	45,036,541	16,544,075
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	894,805,505	96,654,639
剰余金増加額又は欠損金減少額	106,537,339	1,302,132
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	106,537,339	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,302,132
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,551,077	14,136,790
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	14,136,790
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,551,077	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	96,654,639	208,655,685

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式につきましては移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として、金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場)で評価しております。 計算期間の末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 (2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、日本証券業協会の公社債店頭売買参考統計値、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引については、個別法に基づき、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を用いております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第29期計算期間 (平成25年4月15日現在)	第30期計算期間 (平成25年10月15日現在)
1. 受益権の総数	2,346,780,125口	2,003,136,111口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0412円 (10,412円)	1.1042円 (11,042円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第29期計算期間 (自 平成24年10月16日 至 平成25年 4月15日)	第30期計算期間 (自 平成25年 4月16日 至 平成25年10月15日)
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に対して年率0.17%以内の額	同左
2. 分配金の計算方法	計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,975,927円)、収益調整金(1,082,997,378円)、分配準備積立金(447,036,830円)より、分配対象収益は、1,552,010,135円(1万口当たり6,613円)であります。今期は分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,073,938円)、収益調整金(928,119,934円)、分配準備積立金(397,515,094円)より、分配対象収益は、1,343,708,966円(1万口当たり6,708円)であります。今期は分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第29期計算期間 (自 平成24年10月16日 至 平成25年 4月15日)	第30期計算期間 (自 平成25年 4月16日 至 平成25年10月15日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。 当ファンドが行うデリバティブ取引については、有価証券の価格変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では2つの検証機能を有しています。1つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう1つはインベストメント・コントロール・コミッティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス統括部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、委託先リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミッティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミッティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用委託先管理業務を行っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第29期計算期間 (平成25年4月15日現在)	第30期計算期間 (平成25年10月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)売買目的有価証券 (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。 (3)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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

種類	第29期計算期間 (平成25年4月15日現在)	第30期計算期間 (平成25年10月15日現在)
株式	854,356,600	110,358,333
合計	854,356,600	110,358,333

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

区分	種類	第29期計算期間(平成25年4月15日現在)			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	64,216,500	-	65,772,000	1,555,500
	合計	64,216,500	-	65,772,000	1,555,500

区分	種類	第30期計算期間(平成25年10月15日現在)			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	74,800,100	-	75,474,000	673,900
	合計	74,800,100	-	75,474,000	673,900

(注1)時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
2. 先物取引の評価においては、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で評価しております。

(注2)デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第29期計算期間 (平成25年4月15日現在)	第30期計算期間 (平成25年10月15日現在)
	金額(円)	金額(円)
元本の推移		
期首元本額	2,629,110,659	2,346,780,125
期中追加設定元本額	29,981,998	19,779,305
期中一部解約元本額	312,312,532	363,423,319

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(ア)株式

銘柄	数量	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	1,000	265	265,000	
日本水産	1,900	205	389,500	
マルハニチロホールディングス	4,000	187	748,000	
サカタのタネ	400	1,335	534,000	
ホクト	200	1,817	363,400	
住石ホールディングス	500	151	75,500	
三井松島産業	1,000	152	152,000	
国際石油開発帝石	6,900	1,161	8,010,900	
石油資源開発	200	4,035	807,000	
ショーボンドホールディングス	200	4,400	880,000	
ミライト・ホールディングス	400	845	338,000	
安藤・間	900	333	299,700	
東急建設	750	550	412,500	
コムシスホールディングス	700	1,363	954,100	
ミサワホーム	200	1,595	319,000	
高松コンストラクショングループ	200	1,777	355,400	
東建コーポレーション	100	5,320	532,000	
ヤマウラ	500	285	142,500	

大成建設	8,000	492	3,936,000
大林組	4,000	603	2,412,000
清水建設	5,000	486	2,430,000
飛島建設	1,200	156	187,200
長谷工コーポレーション	2,000	698	1,396,000
鹿島建設	7,000	403	2,821,000
不動テトラ	1,500	170	255,000
鉄建建設	2,000	292	584,000
西松建設	2,000	308	616,000
三井住友建設	1,400	122	170,800
前田建設工業	1,000	673	673,000
奥村組	2,000	411	822,000
東鉄工業	200	2,092	418,400
戸田建設	2,000	327	654,000
熊谷組	2,000	222	444,000
大東建託	500	10,270	5,135,000
新日本建設	200	315	63,000
東亜建設工業	2,000	211	422,000
若築建設	1,000	119	119,000
東洋建設	800	308	246,400
五洋建設	2,500	278	695,000
住友林業	1,200	1,046	1,255,200
ヤマダ・エスバイエルホーム	1,000	145	145,000
巴コーポレーション	200	453	90,600
バナホーム	1,000	614	614,000
大和ハウス工業	4,000	1,833	7,332,000
ライト工業	400	768	307,200
積水ハウス	4,000	1,269	5,076,000
中電工	400	1,378	551,200
関電工	1,000	602	602,000
きんでん	1,000	1,079	1,079,000
住友電設	100	1,495	149,500
協和エクシオ	700	1,175	822,500
日揮	1,000	3,720	3,720,000
中外炉工業	1,000	250	250,000
高砂熱学工業	300	816	244,800
大気社	300	2,376	712,800
日比谷総合設備	200	1,168	233,600
東洋エンジニアリング	1,000	411	411,000
千代田化工建設	1,000	1,204	1,204,000
新興プランテック	400	798	319,200
日本製粉	1,000	482	482,000
日清製粉グループ本社	1,650	1,020	1,683,000
昭和産業	1,000	296	296,000
日本甜菜製糖	1,000	187	187,000
三井製糖	1,000	307	307,000
森永製菓	1,000	209	209,000
中村屋	1,000	403	403,000
不二家	1,000	193	193,000
山崎製パン	1,000	1,022	1,022,000
亀田製菓	100	2,810	281,000
カルビー	400	2,666	1,066,400
森永乳業	1,000	314	314,000
ヤクルト本社	800	4,860	3,888,000
明治ホールディングス	400	5,120	2,048,000
雪印メグミルク	400	1,386	554,400
プリマハム	1,000	204	204,000
日本ハム	1,000	1,389	1,389,000
伊藤ハム	1,000	413	413,000
丸大食品	1,000	310	310,000
サッポロホールディングス	3,000	439	1,317,000
アサヒグループホールディングス	2,900	2,760	8,004,000
キリンホールディングス	6,000	1,430	8,580,000
宝ホールディングス	1,000	894	894,000
オエノンホールディングス	1,000	255	255,000
コカ・コーラウエスト	500	1,972	986,000
コカ・コーライーストジャパン	400	1,568	627,200
サントリー食品インターナショナル	600	3,310	1,986,000

ダイードリンコ	100	4,130	413,000
伊藤園	500	2,275	1,137,500
キーコーヒー	200	1,538	307,600
日清オイリオグループ	1,000	335	335,000
不二製油	400	1,692	676,800
J・オイルミルズ	1,000	299	299,000
キッコーマン	1,000	1,694	1,694,000
味の素	3,000	1,339	4,017,000
キユーピー	900	1,455	1,309,500
ハウス食品グループ本社	500	1,519	759,500
カゴメ	600	1,681	1,008,600
アリアケジャパン	200	2,297	459,400
ニチレイ	1,000	516	516,000
東洋水産	1,000	2,932	2,932,000
日清食品ホールディングス	600	3,985	2,391,000
日本たばこ産業	8,000	3,520	28,160,000
わらべや日洋	100	1,823	182,300
なとり	100	948	94,800
片倉工業	200	1,215	243,000
ゲンゼ	2,000	260	520,000
東洋紡	7,000	188	1,316,000
ユニチカ	6,000	60	360,000
富士紡ホールディングス	1,000	207	207,000
日清紡ホールディングス	1,000	849	849,000
倉敷紡績	1,000	169	169,000
シキボウ	1,000	124	124,000
ダイドーリミテッド	500	676	338,000
帝人	6,000	226	1,356,000
東レ	11,000	619	6,809,000
アツギ	1,000	117	117,000
セーレン	600	659	395,400
ワコールホールディングス	1,000	1,029	1,029,000
ホギメディカル	100	5,430	543,000
レナウン	700	130	91,000
T S Iホールディングス	700	689	482,300
三陽商会	1,000	262	262,000
オンワードホールディングス	1,000	840	840,000
特種東海製紙	2,000	203	406,000
王子ホールディングス	5,000	496	2,480,000
日本製紙	700	1,573	1,101,100
三菱製紙	2,000	89	178,000
北越紀州製紙	1,000	476	476,000
大王製紙	1,000	655	655,000
レンゴー	1,000	546	546,000
ザ・バック	100	1,763	176,300
クラレ	2,200	1,116	2,455,200
旭化成	8,000	732	5,856,000
コープケミカル	1,000	138	138,000
昭和電工	10,000	134	1,340,000
住友化学	9,000	365	3,285,000
日本化成	1,000	140	140,000
日産化学工業	1,100	1,450	1,595,000
ラサ工業	1,000	209	209,000
クレハ	1,000	363	363,000
石原産業	2,000	90	180,000
日本曹達	1,000	594	594,000
東ソー	4,000	399	1,596,000
トクヤマ	2,000	383	766,000
セントラル硝子	2,000	335	670,000
東亜合成	2,000	458	916,000
電気化学工業	3,000	408	1,224,000
信越化学工業	2,400	5,880	14,112,000
堺化学工業	1,000	327	327,000
エア・ウォーター	1,000	1,409	1,409,000
大陽日酸	2,000	640	1,280,000
日本化学工業	1,000	161	161,000
ステラ ケミファ	100	1,670	167,000
日本触媒	1,000	1,222	1,222,000

大日精化工業	1,000	420	420,000
カネカ	2,000	632	1,264,000
三菱瓦斯化学	2,000	825	1,650,000
三井化学	5,000	264	1,320,000
J S R	1,400	1,707	2,389,800
東京応化工業	300	2,114	634,200
三菱ケミカルホールディングス	7,500	459	3,442,500
ダイセル	2,000	857	1,714,000
住友ベークライト	1,000	353	353,000
積水化学工業	3,000	989	2,967,000
日本ゼオン	1,000	1,266	1,266,000
アイカ工業	400	2,001	800,400
宇部興産	8,000	202	1,616,000
旭有機材工業	2,000	220	440,000
日立化成	500	1,489	744,500
日本化薬	1,000	1,391	1,391,000
日本精化	100	644	64,400
A D E K A	800	1,167	933,600
日油	1,000	654	654,000
花王	3,500	3,080	10,780,000
大日本塗料	1,000	164	164,000
日本ペイント	1,000	1,659	1,659,000
関西ペイント	1,000	1,271	1,271,000
藤倉化成	900	516	464,400
太陽ホールディングス	100	2,950	295,000
D I C	5,000	282	1,410,000
東洋インキ S C ホールディングス	1,000	490	490,000
富士フイルムホールディングス	2,900	2,317	6,719,300
資生堂	2,400	1,726	4,142,400
ライオン	2,000	588	1,176,000
マンダム	200	3,455	691,000
ミルボン	100	4,125	412,500
ファンケル	500	1,172	586,000
コーセー	300	2,817	845,100
ドクターシーラボ	1	289,000	289,000
ポーラ・オルビスホールディングス	200	3,520	704,000
コニシ	100	1,941	194,100
長谷川香料	200	1,423	284,600
小林製薬	200	5,540	1,108,000
荒川化学工業	100	931	93,100
メック	100	395	39,500
日本高純度化学	1	212,900	212,900
アース製薬	100	3,620	362,000
大成ラミック	200	2,428	485,600
アキレス	1,000	156	156,000
有沢製作所	500	622	311,000
日東電工	1,100	5,610	6,171,000
きもと	100	1,052	105,200
藤森工業	100	3,075	307,500
前澤化成工業	300	1,042	312,600
エフビコ	100	7,510	751,000
信越ポリマー	700	345	241,500
ニフコ	400	2,628	1,051,200
日本バルカー工業	1,000	271	271,000
ユニ・チャーム	700	6,050	4,235,000
協和発酵キリン	1,000	1,041	1,041,000
武田薬品工業	5,000	4,685	23,425,000
アステラス製薬	2,900	5,150	14,935,000
大日本住友製薬	1,100	1,337	1,470,700
塩野義製薬	2,100	2,097	4,403,700
田辺三菱製薬	1,300	1,381	1,795,300
中外製薬	1,200	2,049	2,458,800
エーザイ	1,700	3,890	6,613,000
ロート製薬	1,000	1,371	1,371,000
小野薬品工業	700	5,800	4,060,000
久光製薬	400	5,510	2,204,000
参天製薬	500	4,950	2,475,000
扶桑薬品工業	1,000	318	318,000

ツムラ	400	2,904	1,161,600
日医工	200	2,351	470,200
キッセイ薬品工業	400	2,275	910,000
生化学工業	400	1,277	510,800
栄研化学	100	1,811	181,100
鳥居薬品	100	2,558	255,800
東和薬品	100	5,030	503,000
沢井製薬	200	7,270	1,454,000
第一三共	4,400	1,786	7,858,400
キョーリン製薬ホールディングス	400	2,120	848,000
大塚ホールディングス	2,700	2,695	7,276,500
大正製薬ホールディングス	300	6,600	1,980,000
日本コークス工業	1,500	127	190,500
昭和シェル石油	1,400	1,071	1,499,400
コスモ石油	4,000	173	692,000
東燃ゼネラル石油	2,000	914	1,828,000
ビービー・カストロール	200	456	91,200
富士石油	700	371	259,700
出光興産	100	8,430	843,000
JXホールディングス	14,900	483	7,196,700
横浜ゴム	1,000	989	989,000
東洋ゴム工業	1,000	634	634,000
ブリヂストン	4,200	3,535	14,847,000
住友ゴム工業	1,200	1,404	1,684,800
オカモト	1,000	312	312,000
ニッタ	200	2,145	429,000
東海ゴム工業	300	968	290,400
バンドー化学	1,000	397	397,000
日東紡績	1,000	430	430,000
旭硝子	7,000	606	4,242,000
日本板硝子	7,000	124	868,000
日本電気硝子	2,000	471	942,000
住友大阪セメント	3,000	389	1,167,000
太平洋セメント	8,000	427	3,416,000
東海カーボン	1,000	345	345,000
日本カーボン	1,000	191	191,000
東洋炭素	100	1,916	191,600
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	260	260,000
TOTO	2,000	1,359	2,718,000
日本碍子	2,000	1,479	2,958,000
日本特殊陶業	1,000	2,222	2,222,000
フジインコーポレーテッド	200	1,326	265,200
ニチアス	1,000	677	677,000
ニチハ	200	1,349	269,800
新日鐵住金	57,000	343	19,551,000
神戸製鋼所	19,000	177	3,363,000
合同製鐵	1,000	189	189,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	3,400	2,507	8,523,800
日新製鋼ホールディングス	600	1,422	853,200
東京製鐵	800	601	480,800
共英製鋼	200	1,718	343,600
大和工業	300	3,740	1,122,000
大阪製鐵	100	1,936	193,600
淀川製鋼所	1,000	437	437,000
丸一鋼管	500	2,458	1,229,000
モリ工業	1,000	391	391,000
大同特殊鋼	2,000	568	1,136,000
日本冶金工業	1,000	307	307,000
山陽特殊製鋼	1,000	537	537,000
愛知製鋼	1,000	521	521,000
日立金属	1,000	1,287	1,287,000
大平洋金属	1,000	365	365,000
日本電工	1,000	289	289,000
栗本鐵工所	1,000	282	282,000
三菱製鋼	1,000	310	310,000
日本軽金属ホールディングス	3,600	150	540,000
三井金属鉱業	4,000	247	988,000
東邦亜鉛	1,000	293	293,000

三菱マテリアル	8,000	385	3,080,000
住友金属鉱山	3,000	1,341	4,023,000
DOWAホールディングス	1,000	942	942,000
古河機械金属	3,000	218	654,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	200	2,021	404,200
東邦チタニウム	400	780	312,000
UACJ	1,384	325	449,800
古河電気工業	5,000	217	1,085,000
住友電気工業	4,600	1,453	6,683,800
フジクラ	2,000	402	804,000
昭和電線ホールディングス	2,000	113	226,000
タツタ電線	300	711	213,300
リョービ	1,000	448	448,000
アサヒホールディングス	200	1,607	321,400
宮地エンジニアリンググループ	1,000	202	202,000
トーカロ	200	1,566	313,200
アルファＣｏ	300	1,047	314,100
SUMCO	1,000	798	798,000
東洋製罐グループホールディングス	1,000	1,969	1,969,000
三和ホールディングス	1,000	616	616,000
三協立山	200	1,930	386,000
LIXILグループ	1,900	2,042	3,879,800
ノーリツ	300	2,187	656,100
長府製作所	200	2,267	453,400
リンナイ	200	7,250	1,450,000
岡部	300	1,223	366,900
東プレ	200	1,375	275,000
高周波熱錬	300	916	274,800
東京製綱	2,000	167	334,000
日本発條	1,000	1,014	1,014,000
三益半導体工業	200	842	168,400
日本製鋼所	2,000	555	1,110,000
三浦工業	300	2,658	797,400
オークマ	1,000	846	846,000
東芝機械	1,000	508	508,000
アマダ	2,000	885	1,770,000
アイダエンジニアリング	700	925	647,500
富士機械製造	300	900	270,000
牧野フライス製作所	1,000	707	707,000
オーエスジー	700	1,655	1,158,500
旭ダイヤモンド工業	400	973	389,200
DMG森精機	800	1,692	1,353,600
ディスコ	100	5,660	566,000
日東工器	200	1,850	370,000
津田駒工業	1,000	159	159,000
島精機製作所	200	2,180	436,000
やまびこ	100	3,040	304,000
ナブテスコ	700	2,478	1,734,600
三井海洋開発	100	3,025	302,500
SMC	400	23,490	9,396,000
新川	200	661	132,200
ユニオンツール	100	2,152	215,200
オイレス工業	200	2,237	447,400
サトーホールディングス	300	1,937	581,100
小松製作所	6,200	2,372	14,706,400
住友重機械工業	4,000	447	1,788,000
日立建機	700	2,214	1,549,800
井関農機	1,000	326	326,000
TOWA	200	548	109,600
北川鉄工所	1,000	194	194,000
クボタ	7,000	1,439	10,073,000
東京機械製作所	1,000	120	120,000
新東工業	300	740	222,000
澁谷工業	100	1,966	196,600
アイチ コーポレーション	700	534	373,800
小森コーポレーション	500	1,494	747,000
荏原製作所	3,000	519	1,557,000
西島製作所	100	864	86,400

ダイキン工業	1,800	5,460	9,828,000
トーヨーカネツ	1,000	287	287,000
栗田工業	700	2,049	1,434,300
椿本チエイン	1,000	652	652,000
木村化工機	200	567	113,400
ダイフク	500	1,185	592,500
タダノ	1,000	1,266	1,266,000
C K D	400	930	372,000
平和	300	1,716	514,800
理想科学工業	100	2,221	222,100
S A N K Y O	400	4,725	1,890,000
日本金銭機械	100	2,276	227,600
マースエンジニアリング	100	1,913	191,300
ダイコク電機	100	2,198	219,800
アマノ	500	1,000	500,000
J U K I	1,000	181	181,000
サンデン	1,000	388	388,000
蛇の目ミシン工業	2,000	82	164,000
グローリー	400	2,418	967,200
セガサミーホールディングス	1,400	2,786	3,900,400
日本ピストンリング	1,000	179	179,000
リケン	1,000	426	426,000
T P R	200	1,884	376,800
ホシザキ電機	300	3,450	1,035,000
日本精工	3,000	1,113	3,339,000
N T N	3,000	452	1,356,000
ジェイテクト	1,400	1,359	1,902,600
不二越	1,000	468	468,000
T H K	800	2,105	1,684,000
ユーシン精機	100	1,829	182,900
前澤工業	200	381	76,200
キッツ	1,000	428	428,000
日立工機	600	754	452,400
マキタ	800	5,420	4,336,000
日立造船	1,000	785	785,000
三菱重工業	21,000	588	12,348,000
I H I	8,000	398	3,184,000
イビデン	900	1,582	1,423,800
コニカミノルタ	3,000	830	2,490,000
ブラザー工業	1,900	1,130	2,147,000
ミネベア	2,000	524	1,048,000
日立製作所	31,000	625	19,375,000
東芝	25,000	426	10,650,000
三菱電機	13,000	1,081	14,053,000
富士電機	4,000	412	1,648,000
安川電機	1,000	1,361	1,361,000
シンフォニアテクノロジー	1,000	168	168,000
明電舎	2,000	359	718,000
デンヨー	100	1,232	123,200
東芝テック	1,000	590	590,000
マブチモーター	200	5,200	1,040,000
日本電産	700	8,390	5,873,000
東光高岳ホールディングス	100	1,724	172,400
ダイヘン	1,000	401	401,000
J V C ケンウッド	1,000	179	179,000
オムロン	1,300	3,755	4,881,500
日東工業	300	1,579	473,700
I D E C	400	891	356,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,000	638	1,276,000
メルコホールディングス	100	1,371	137,100
日本電気	16,000	226	3,616,000
富士通	12,000	383	4,596,000
沖電気工業	5,000	204	1,020,000
サンケン電気	1,000	536	536,000
ルネサスエレクトロニクス	300	507	152,100
セイコーエプソン	800	1,813	1,450,400
ワコム	1,000	954	954,000
アルバック	300	934	280,200

E I Z O	200	2,492	498,400
日本信号	400	751	300,400
パナソニック	14,800	961	14,222,800
シャープ	7,000	286	2,002,000
アンリツ	700	1,203	842,100
ソニー	8,100	1,938	15,697,800
T D K	800	4,090	3,272,000
ミツミ電機	700	662	463,400
タムラ製作所	1,000	258	258,000
アルプス電気	1,200	785	942,000
バイオニア	1,700	173	294,100
日本電波工業	200	886	177,200
ローランド ディー・ジー・	100	2,787	278,700
フォスター電機	200	1,965	393,000
東光	1,000	335	335,000
ホシデン	600	512	307,200
ヒロセ電機	200	15,190	3,038,000
ユニデン	1,000	233	233,000
アルパイン	500	1,079	539,500
アイコム	100	2,255	225,500
船井電機	200	1,066	213,200
横河電機	1,200	1,413	1,695,600
アズビル	500	2,253	1,126,500
日本光電工業	300	3,875	1,162,500
堀場製作所	300	3,500	1,050,000
アドバンテスト	1,000	1,150	1,150,000
エスベック	100	741	74,100
キーエンス	300	37,100	11,130,000
日置電機	100	1,377	137,700
シスメックス	500	6,400	3,200,000
メガチップス	200	1,604	320,800
O B A R A G R O U P	100	2,576	257,600
日本電産コパル電子	100	509	50,900
コーセル	200	1,197	239,400
オプテックス	100	1,500	150,000
千代田インテグレ	100	1,442	144,200
スタンレー電気	1,200	2,185	2,622,000
岩崎電気	1,000	209	209,000
ウシオ電機	900	1,192	1,072,800
日本デジタル研究所	100	1,116	111,600
日本電子	1,000	454	454,000
カシオ計算機	1,300	923	1,199,900
ファナック	1,300	16,740	21,762,000
日本シイエムケイ	500	271	135,500
エンブラス	100	5,870	587,000
ローム	700	4,005	2,803,500
浜松ホトニクス	600	3,720	2,232,000
三井ハイテック	400	701	280,400
新光電気工業	600	972	583,200
京セラ	2,100	4,975	10,447,500
太陽誘電	700	1,192	834,400
村田製作所	1,400	7,510	10,514,000
ユーシン	200	780	156,000
双葉電子工業	400	1,289	515,600
北陸電気工業	1,000	138	138,000
ニチコン	400	1,016	406,400
日本ケミコン	1,000	480	480,000
K O A	200	923	184,600
スター精密	300	944	283,200
大日本スクリーン製造	1,000	550	550,000
キヤノン電子	200	1,839	367,800
キヤノン	7,400	3,115	23,051,000
リコー	4,000	1,083	4,332,000
東京エレクトロン	1,100	5,440	5,984,000
トヨタ紡織	400	1,312	524,800
ユニプレス	300	1,893	567,900
豊田自動織機	1,200	4,315	5,178,000
デンソー	3,200	4,880	15,616,000

東海理化電機製作所	300	2,142	642,600
三井造船	6,000	205	1,230,000
佐世保重工業	1,000	99	99,000
川崎重工業	10,000	416	4,160,000
日産自動車	16,200	1,001	16,216,200
いすゞ自動車	7,000	631	4,417,000
トヨタ自動車	16,500	6,390	105,435,000
日野自動車	2,000	1,433	2,866,000
三菱自動車工業	3,200	1,041	3,331,200
武蔵精密工業	200	2,476	495,200
極東開発工業	200	1,260	252,000
日信工業	400	1,800	720,000
トピー工業	1,000	217	217,000
ティラド	1,000	322	322,000
曙ブレーキ工業	800	470	376,000
タチエス	200	1,554	310,800
N O K	700	1,499	1,049,300
フタバ産業	600	399	239,400
カヤバ工業	1,000	615	615,000
プレス工業	1,000	447	447,000
カルソニックカンセイ	1,000	513	513,000
太平洋工業	300	727	218,100
ケーヒン	400	1,629	651,600
アイシン精機	1,100	4,270	4,697,000
マツダ	21,000	443	9,303,000
ダイハツ工業	1,000	1,824	1,824,000
今仙電機製作所	100	1,404	140,400
本田技研工業	10,800	3,920	42,336,000
スズキ	2,700	2,346	6,334,200
富士重工業	4,000	2,815	11,260,000
ヤマハ発動機	2,100	1,399	2,937,900
ショーワ	400	1,371	548,400
エクセディ	300	2,546	763,800
豊田合成	400	2,434	973,600
愛三工業	200	969	193,800
エフ・シー・シー	300	2,257	677,100
シマノ	500	8,580	4,290,000
タカタ	300	2,533	759,900
テイ・エス テック	300	4,000	1,200,000
テルモ	1,000	4,765	4,765,000
島津製作所	1,000	964	964,000
東京精密	300	1,773	531,900
ニコン	2,500	1,783	4,457,500
トプコン	400	1,576	630,400
オリンパス	1,700	3,110	5,287,000
タムロン	100	2,110	211,000
H O Y A	3,200	2,313	7,401,600
エー・アンド・デイ	100	578	57,800
シチズンホールディングス	1,600	698	1,116,800
セイコーホールディングス	1,000	415	415,000
ニプロ	800	925	740,000
パラマウントベッドホールディングス	100	3,255	325,500
前田工繊	100	1,213	121,300
バンダイナムコホールディングス	1,400	1,875	2,625,000
フランスベッドホールディングス	1,000	197	197,000
パイロットコーポレーション	100	3,700	370,000
トッパン・フォームズ	400	969	387,600
フジシールインターナショナル	200	2,906	581,200
タカラトミー	500	502	251,000
アーク	700	255	178,500
プロネクス	100	600	60,000
凸版印刷	4,000	792	3,168,000
大日本印刷	4,000	1,054	4,216,000
日本写真印刷	200	1,613	322,600
アシックス	1,100	1,661	1,827,100
ツツミ	100	2,304	230,400
ローランド	200	1,096	219,200
ヤマハ	1,100	1,438	1,581,800

クリナップ	100	851	85,100
ビジョン	200	4,995	999,000
リンテック	400	2,094	837,600
イトーキ	200	517	103,400
任天堂	700	11,270	7,889,000
三菱鉛筆	100	2,399	239,900
タカラスタANDARD	1,000	790	790,000
コクヨ	900	765	688,500
美津濃	1,000	566	566,000
アデランス	200	1,366	273,200
東京電力	11,100	531	5,894,100
中部電力	3,800	1,424	5,411,200
関西電力	5,300	1,309	6,937,700
中国電力	1,600	1,546	2,473,600
北陸電力	1,400	1,412	1,976,800
東北電力	3,200	1,275	4,080,000
四国電力	1,100	1,682	1,850,200
九州電力	2,800	1,458	4,082,400
北海道電力	1,200	1,367	1,640,400
沖縄電力	100	3,460	346,000
電源開発	800	3,310	2,648,000
東京瓦斯	15,000	544	8,160,000
大阪瓦斯	12,000	423	5,076,000
東邦瓦斯	3,000	515	1,545,000
北海道瓦斯	1,000	265	265,000
西部瓦斯	2,000	245	490,000
静岡瓦斯	500	650	325,000
東武鉄道	7,000	512	3,584,000
相鉄ホールディングス	3,000	365	1,095,000
東京急行電鉄	8,000	692	5,536,000
京浜急行電鉄	3,000	917	2,751,000
小田急電鉄	4,000	961	3,844,000
京王電鉄	4,000	698	2,792,000
京成電鉄	2,000	1,031	2,062,000
東日本旅客鉄道	2,400	8,530	20,472,000
西日本旅客鉄道	1,100	4,250	4,675,000
東海旅客鉄道	1,100	13,040	14,344,000
西日本鉄道	2,000	381	762,000
近畿日本鉄道	11,000	363	3,993,000
阪急阪神ホールディングス	7,000	553	3,871,000
南海電気鉄道	3,000	366	1,098,000
京阪電気鉄道	3,000	399	1,197,000
名古屋鉄道	5,000	287	1,435,000
日本通運	5,000	499	2,495,000
ヤマトホールディングス	2,300	2,153	4,951,900
山九	2,000	328	656,000
センコー	1,000	497	497,000
日本梱包運輸倉庫	400	1,638	655,200
日本石油輸送	1,000	222	222,000
福山通運	1,000	625	625,000
セイノーホールディングス	1,000	1,007	1,007,000
日立物流	300	1,363	408,900
日本郵船	11,000	329	3,619,000
商船三井	6,000	443	2,658,000
川崎汽船	7,000	235	1,645,000
N S ユナイテッド海運	1,000	313	313,000
乾汽船	200	401	80,200
飯野海運	500	669	334,500
第一中央汽船	2,000	121	242,000
日本航空	1,500	5,800	8,700,000
A N A ホールディングス	23,000	217	4,991,000
日新	1,000	284	284,000
三菱倉庫	1,000	1,420	1,420,000
三井倉庫	1,000	537	537,000
住友倉庫	1,000	605	605,000
安田倉庫	100	1,171	117,100
上組	2,000	844	1,688,000
キューソー流通システム	200	1,033	206,600

郵船ロジスティクス	300	1,140	342,000
近鉄エクスプレス	100	3,575	357,500
東海運	100	288	28,800
N E C ネットエスアイ	200	2,453	490,600
新日鉄住金ソリューションズ	200	1,995	399,000
I T ホールディングス	500	1,224	612,000
グリー	800	772	617,600
コーエーテクモホールディングス	500	1,034	517,000
ネクソン	1,000	1,251	1,251,000
ブロードリーフ	100	2,223	222,300
ドワンゴ	200	1,855	371,000
マクロミル	400	602	240,800
ティーガイア	200	961	192,200
ザッパラス	2	70,000	140,000
インターネットイニシアティブ	200	2,737	547,400
S R A ホールディングス	100	1,093	109,300
パナソニック インフォメーションシステム	100	2,362	236,200
フェイス	30	1,060	31,800
野村総合研究所	700	3,500	2,450,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,100	2,081	2,289,100
オービック	500	3,065	1,532,500
ヤフー	8,700	494	4,297,800
トレンドマイクロ	600	3,730	2,238,000
日本オラクル	300	3,620	1,086,000
フューチャーアーキテクト	100	570	57,000
シーエーシー	100	867	86,700
オービックビジネスコンサルタント	100	3,280	328,000
伊藤忠テクノソリューションズ	100	3,465	346,500
アイティフォー	100	407	40,700
大塚商会	100	12,760	1,276,000
サイボウズ	1	28,370	28,370
ネットワンシステムズ	600	719	431,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	300	2,586	775,800
日本ユニシス	500	861	430,500
兼松エレクトロニクス	100	1,279	127,900
東京放送ホールディングス	800	1,292	1,033,600
日本テレビホールディングス	1,200	1,819	2,182,800
テレビ朝日	400	2,305	922,000
スカパー J S A T ホールディングス	1,400	522	730,800
テレビ東京ホールディングス	100	1,695	169,500
日本電信電話	5,300	5,330	28,249,000
K D D I	3,600	5,280	19,008,000
光通信	100	6,560	656,000
N T T ドコモ	10,400	1,559	16,213,600
G M O インターネット	600	1,281	768,600
ゼンリン	300	1,128	338,400
昭文社	400	601	240,400
K A D O K A W A	100	3,335	333,500
インプレスホールディングス	300	143	42,900
松竹	1,000	992	992,000
東宝	700	2,113	1,479,100
エヌ・ティ・ティ・データ	800	3,275	2,620,000
D T S	200	1,647	329,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	1,655	662,000
カプコン	300	1,925	577,500
S C S K	300	2,455	736,500
アイネス	300	600	180,000
T K C	100	1,637	163,700
富士ソフト	200	1,860	372,000
N S D	300	1,132	339,600
コナミ	500	2,365	1,182,500
J B C C ホールディングス	100	926	92,600
ソフトバンク	6,100	7,240	44,164,000
双日	6,300	194	1,222,200
アルフレッサ ホールディングス	300	5,140	1,542,000
横浜冷凍	500	786	393,000
あい ホールディングス	400	1,207	482,800
ダイワボウホールディングス	2,000	171	342,000

バイタルケーエスケー・ホールディングス	300	729	218,700
U K C ホールディングス	100	1,929	192,900
T O K A I ホールディングス	500	351	175,500
シップヘルスケアホールディングス	200	4,130	826,000
小野建	100	1,176	117,600
伯東	200	939	187,800
ナガイレーベン	100	1,534	153,400
三菱食品	200	2,697	539,400
松田産業	100	1,430	143,000
メディパルホールディングス	1,500	1,201	1,801,500
アドヴァン	200	1,193	238,600
アズワン	100	2,097	209,700
ドウシシャ	200	1,390	278,000
黒田電気	100	1,375	137,500
丸文	300	439	131,700
ハピネット	200	762	152,400
エクセル	100	1,154	115,400
ガリバーインターナショナル	590	585	345,150
シークス	100	1,223	122,300
マクニカ	100	2,643	264,300
伊藤忠商事	10,100	1,192	12,039,200
丸紅	10,000	761	7,610,000
長瀬産業	900	1,178	1,060,200
蝶理	100	1,160	116,000
豊田通商	1,300	2,652	3,447,600
三共生興	500	337	168,500
兼松	3,000	131	393,000
三井物産	10,800	1,423	15,368,400
日本紙パルプ商事	1,000	323	323,000
日立ハイテクノロジーズ	400	2,168	867,200
山善	700	638	446,600
住友商事	7,400	1,332	9,856,800
内田洋行	1,000	288	288,000
三菱商事	9,800	1,990	19,502,000
キヤノンマーケティングジャパン	400	1,322	528,800
西華産業	1,000	239	239,000
佐藤商事	100	587	58,700
菱洋エレクトロ	400	901	360,400
ユアサ商事	2,000	198	396,000
阪和興業	2,000	452	904,000
岩谷産業	2,000	402	804,000
すてきナイスグループ	1,000	240	240,000
稲畑産業	600	979	587,400
東邦ホールディングス	500	1,850	925,000
サンゲツ	300	2,529	758,700
ミツウロコグループホールディングス	400	478	191,200
シナネン	1,000	379	379,000
伊藤忠エネクス	500	519	259,500
サンリオ	300	5,780	1,734,000
リョーサン	300	1,841	552,300
新光商事	200	850	170,000
三信電気	300	637	191,100
東陽テクニカ	200	1,175	235,000
モスフードサービス	300	1,884	565,200
加賀電子	200	826	165,200
ヤマタネ	1,000	188	188,000
日鉄住金物産	1,080	314	339,120
トラスコ中山	200	2,026	405,200
オートバックスセブン	600	1,470	882,000
加藤産業	200	2,032	406,400
イエローハット	200	1,798	359,600
富士エレクトロニクス	200	1,338	267,600
因幡電機産業	200	2,988	597,600
ミスミグループ本社	500	2,867	1,433,500
スズケン	400	3,335	1,334,000
ローソン	500	7,610	3,805,000
サンエー	200	2,879	575,800
カワチ薬品	100	2,000	200,000

エービーシー・マート	100	4,830	483,000
アスクル	100	2,512	251,200
ゲオホールディングス	200	936	187,200
アダストリアホールディングス	100	4,345	434,500
バル	100	2,424	242,400
エディオン	500	483	241,500
ハニーズ	220	1,079	237,380
アルペン	100	2,032	203,200
ジェイアイエヌ	100	3,315	331,500
ビックカメラ	3	46,500	139,500
D C Mホールディングス	600	707	424,200
MonotaRO	200	2,799	559,800
J．フロント リテイリング	3,000	769	2,307,000
ドトール・日レスホールディングス	300	1,655	496,500
マツモトキヨシホールディングス	200	3,285	657,000
スタートトゥデイ	300	2,680	804,000
ココカラファイン	100	2,995	299,500
三越伊勢丹ホールディングス	2,200	1,375	3,025,000
クリエイトSDホールディングス	100	3,575	357,500
丸善CH Iホールディングス	100	289	28,900
ブックオフコーポレーション	100	673	67,300
日本調剤	20	2,719	54,380
セブン&アイ・ホールディングス	5,300	3,740	19,822,000
ツルハホールディングス	100	8,090	809,000
サンマルクホールディングス	100	4,955	495,500
トリドール	200	943	188,600
カップバ・クリエイトホールディングス	200	1,836	367,200
ライトオン	300	891	267,300
良品計画	100	9,250	925,000
三城ホールディングス	300	452	135,600
コナカ	200	881	176,200
コーナン商事	300	1,020	306,000
ワタミ	300	1,584	475,200
ドン・キホーテ	400	6,300	2,520,000
西松屋チェーン	400	742	296,800
ゼンショーホールディングス	700	1,106	774,200
サイゼリヤ	300	1,219	365,700
ユニテッドアローズ	100	3,885	388,500
ハイデイ日高	100	2,143	214,300
コロワイド	500	976	488,000
壱番屋	100	4,125	412,500
スギホールディングス	200	4,260	852,000
ヨンドシーホールディングス	100	1,254	125,400
ファミリーマート	400	4,200	1,680,000
木曽路	100	1,828	182,800
千趣会	200	863	172,600
ケーヨー	300	461	138,300
日本瓦斯	200	1,139	227,800
ベスト電器	1,000	149	149,000
ロイヤルホールディングス	200	1,533	306,600
島忠	300	2,423	726,900
チヨダ	200	2,043	408,600
ライフコーポレーション	100	1,618	161,800
カスミ	300	601	180,300
A O K Iホールディングス	200	3,365	673,000
コメリ	200	2,547	509,400
青山商事	400	2,564	1,025,600
しまむら	100	10,450	1,045,000
高島屋	2,000	924	1,848,000
松屋	300	1,227	368,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,000	776	776,000
ニッセンホールディングス	800	317	253,600
バルコ	300	942	282,600
丸井グループ	1,900	911	1,730,900
井筒屋	1,000	86	86,000
ダイエー	850	303	257,550
イズミヤ	1,000	459	459,000
イオン	4,600	1,330	6,118,000

ユニーグループ・ホールディングス	1,400	592	828,800
イズミ	300	3,100	930,000
平和堂	400	1,535	614,000
フジ	200	1,784	356,800
ヤオコー	100	3,620	362,000
ゼビオ	200	2,153	430,600
ケースホールディングス	300	2,619	785,700
アインファーマシーズ	100	4,220	422,000
ヤマダ電機	5,500	262	1,441,000
アークランドサカモト	100	1,549	154,900
ニトリホールディングス	250	8,750	2,187,500
吉野家ホールディングス	500	1,117	558,500
ブレナス	100	2,065	206,500
ミニストップ	100	1,547	154,700
アークス	200	1,886	377,200
パロー	300	1,441	432,300
ファーストリテイリング	300	34,200	10,260,000
サンドラッグ	300	4,965	1,489,500
ベルーナ	600	497	298,200
じもとホールディングス	1,100	200	220,000
新生銀行	12,000	228	2,736,000
あおぞら銀行	5,000	293	1,465,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	95,600	633	60,514,800
りそなホールディングス	12,200	508	6,197,600
三井住友トラスト・ホールディングス	25,000	501	12,525,000
三井住友フィナンシャルグループ	9,600	4,835	46,416,000
第四銀行	2,000	341	682,000
北越銀行	2,000	215	430,000
西日本シティ銀行	5,000	272	1,360,000
千葉銀行	5,000	713	3,565,000
横浜銀行	8,000	547	4,376,000
常陽銀行	5,000	521	2,605,000
群馬銀行	3,000	570	1,710,000
武蔵野銀行	200	3,460	692,000
千葉興業銀行	300	765	229,500
筑波銀行	900	337	303,300
東京都民銀行	200	1,091	218,200
七十七銀行	2,000	488	976,000
青森銀行	2,000	259	518,000
秋田銀行	1,000	254	254,000
山形銀行	1,000	419	419,000
岩手銀行	100	4,535	453,500
東邦銀行	1,000	301	301,000
東北銀行	1,000	145	145,000
みちのく銀行	2,000	200	400,000
ふくおかフィナンシャルグループ	4,000	444	1,776,000
静岡銀行	3,000	1,100	3,300,000
十六銀行	2,000	374	748,000
スルガ銀行	1,000	1,642	1,642,000
八十二銀行	2,000	607	1,214,000
山梨中央銀行	1,000	419	419,000
大垣共立銀行	2,000	278	556,000
福井銀行	2,000	212	424,000
北國銀行	2,000	356	712,000
滋賀銀行	1,000	552	552,000
南都銀行	1,000	395	395,000
百五銀行	1,000	399	399,000
京都銀行	2,000	848	1,696,000
紀陽銀行	500	1,311	655,500
三重銀行	1,000	198	198,000
ほくほくフィナンシャルグループ	9,000	201	1,809,000
広島銀行	4,000	417	1,668,000
山陰合同銀行	1,000	752	752,000
中国銀行	1,000	1,417	1,417,000
伊予銀行	1,000	1,012	1,012,000
百十四銀行	1,000	369	369,000
四国銀行	1,000	227	227,000
阿波銀行	1,000	520	520,000

鹿児島銀行	1,000	668	668,000
大分銀行	1,000	342	342,000
宮崎銀行	1,000	290	290,000
肥後銀行	1,000	558	558,000
佐賀銀行	2,000	207	414,000
十八銀行	1,000	236	236,000
沖縄銀行	100	3,990	399,000
琉球銀行	300	1,158	347,400
八千代銀行	100	2,865	286,500
セブン銀行	4,500	350	1,575,000
みずほフィナンシャルグループ	163,200	207	33,782,400
山口フィナンシャルグループ	1,000	947	947,000
長野銀行	1,000	173	173,000
名古屋銀行	1,000	353	353,000
北洋銀行	2,200	428	941,600
第三銀行	2,000	163	326,000
中京銀行	1,000	175	175,000
東日本銀行	1,000	232	232,000
愛媛銀行	1,000	239	239,000
みなと銀行	1,000	171	171,000
京葉銀行	1,000	510	510,000
関西アーバン銀行	3,000	115	345,000
栃木銀行	1,000	378	378,000
東和銀行	3,000	92	276,000
福島銀行	1,000	85	85,000
トモニホールディングス	200	370	74,000
池田泉州ホールディングス	1,100	490	539,000
S B Iホールディングス	1,600	1,271	2,033,600
日本アジア投資	1,000	89	89,000
ジャフコ	200	5,020	1,004,000
大和証券グループ本社	13,000	879	11,427,000
野村ホールディングス	26,000	752	19,552,000
岡三証券グループ	1,000	862	862,000
丸三証券	500	810	405,000
東洋証券	1,000	340	340,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,600	816	1,305,600
いちよし証券	300	1,438	431,400
松井証券	900	1,070	963,000
マネックスグループ	1,400	378	529,200
カブドットコム証券	800	525	420,000
極東証券	200	1,688	337,600
岩井コスモホールディングス	200	1,343	268,600
N K S Jホールディングス	2,800	2,437	6,823,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	3,800	2,456	9,332,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,100	1,768	1,944,800
第一生命保険	6,700	1,335	8,944,500
東京海上ホールディングス	4,900	3,080	15,092,000
T & Dホールディングス	4,300	1,193	5,129,900
全国保証	100	4,310	431,000
クレディセゾン	1,100	2,680	2,948,000
芙蓉総合リース	100	3,895	389,500
興銀リース	200	2,561	512,200
東京センチュリーリース	300	3,130	939,000
日本証券金融	600	736	441,600
アイフル	2,500	466	1,165,000
ポケットカード	200	840	168,000
リコーリース	100	2,740	274,000
イオンフィナンシャルサービス	500	3,180	1,590,000
アコム	2,400	365	876,000
ジャックス	1,000	482	482,000
オリエントコーポレーション	2,500	250	625,000
日立キャピタル	300	2,375	712,500
オリックス	7,600	1,615	12,274,000
三菱UFJリース	3,200	529	1,692,800
日本取引所グループ	1,500	2,238	3,357,000
N E Cキャピタルソリューション	100	2,467	246,700
日本駐車場開発	31	7,580	234,980

ヒューリック	1,800	1,525	2,745,000
野村不動産ホールディングス	600	2,427	1,456,200
フージャースホールディングス	200	781	156,200
東急不動産ホールディングス	3,211	951	3,053,661
パーク 2 4	800	1,930	1,544,000
三井不動産	6,000	3,325	19,950,000
三菱地所	9,000	2,809	25,281,000
平和不動産	300	1,783	534,900
東京建物	3,000	925	2,775,000
ダイビル	300	1,279	383,700
住友不動産	3,000	4,640	13,920,000
大京	2,000	303	606,000
テーオーシー	700	836	585,200
レオパレス 2 1	1,400	707	989,800
フジ住宅	100	692	69,200
空港施設	200	902	180,400
住友不動産販売	140	3,250	455,000
ゴールドクレスト	100	2,689	268,900
東栄住宅	200	2,490	498,000
飯田産業	200	2,155	431,000
アーネストワン	200	2,490	498,000
タカラレーベン	800	340	272,000
イオンモール	700	2,731	1,911,700
トーセイ	300	791	237,300
エヌ・ティ・ティ都市開発	800	1,288	1,030,400
サンフロンティア不動産	100	1,193	119,300
ランドビジネス	100	447	44,700
日本空港ビルデング	500	2,383	1,191,500
日本工営	1,000	453	453,000
日本 M & A センター	100	7,150	715,000
アコーディア・ゴルフ	600	1,155	693,000
パソナグループ	1	79,700	79,700
エス・エム・エス	100	2,070	207,000
テンブホールディングス	200	2,494	498,800
クックパッド	100	3,600	360,000
N E C フィールディング	300	1,119	335,700
総合警備保障	600	1,936	1,161,600
カカクコム	800	2,253	1,802,400
新日本科学	100	1,392	139,200
ツクイ	200	1,099	219,800
エムスリー	3	268,200	804,600
ディー・エヌ・エー	700	2,010	1,407,000
博報堂 D Y ホールディングス	2,400	752	1,804,800
ぐるなび	100	2,131	213,100
一休	1	150,400	150,400
P G M ホールディングス	200	952	190,400
J P ホールディングス	500	461	230,500
イービーエス	2	93,800	187,600
ケネディクス	1,600	514	822,400
電通	1,300	3,750	4,875,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	80	2,006	160,480
イオンファンタジー	100	1,521	152,100
ネクシィーズ	100	391	39,100
みらかホールディングス	400	4,345	1,738,000
サニックス	200	1,114	222,800
オリエンタルランド	400	16,380	6,552,000
ダスキン	500	1,983	991,500
明光ネットワークジャパン	200	1,215	243,000
ラウンドワン	400	567	226,800
リゾートトラスト	300	3,470	1,041,000
もしもしホットライン	300	1,155	346,500
リソー教育	300	666	199,800
ユー・エス・エス	1,600	1,425	2,280,000
リロ・ホールディング	100	4,575	457,500
エイチ・アイ・エス	100	5,660	566,000
イチネンホールディングス	100	686	68,600
東京都競馬	1,000	438	438,000
東京ドーム	1,000	742	742,000

トランス・コスモス	200	1,679	335,800	
日本管財	200	1,770	354,000	
セコム	1,400	5,980	8,372,000	
メイテック	200	2,651	530,200	
アサツー ディ・ケイ	300	2,658	797,400	
応用地質	100	1,735	173,500	
船井総合研究所	300	771	231,300	
ベネッセホールディングス	300	3,590	1,077,000	
イオンディライト	100	1,896	189,600	
ニチイ学館	400	954	381,600	
ダイセキ	400	1,995	798,000	
合計			2,133,794,671	

(イ)株式以外の有価証券
該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

(3)注記表(デリバティブ取引に関する注記) 取引の時価等に関する事項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25年10月31日現在)

資産総額	2,162,084,120円
負債総額	2,128,033円
純資産総額(-)	2,159,956,087円
発行済数量	1,961,231,135口
1 単位当たり純資産額(/)	1.1013円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1．名義書換について

該当事項はありません。

2．受益者に対する特典

該当事項はありません。

3．内国投資信託受益権の譲渡制限の内容

譲渡制限は設けておりません。ただし、受益権の譲渡の手続き及び受益権の譲渡の対抗要件は以下によるものとします。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めた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。

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、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

4．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。

5．償還金

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われた受益権に係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て）に支払います。

6．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係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、信託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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金等

資本金の額

3,078百万円（平成25年11月末現在）

発行する株式の総数

200,000株（平成25年11月末現在）

発行済株式総数

61,560株（平成25年11月末現在）

最近5年間における資本金の額の増減

平成21年5月29日 資本金を金2,328百万円から金3,078百万円へ増額

(2) 委託会社の機構

委託会社は、取締役会及び監査役会をおきます。

取締役及び監査役は、株主総会の決議をもって選任され、その員数はそれぞれ3名以上とします。

取締役会は、取締役全員で組織され、経営に関するすべての重要事項及び法令または定款によって定められた事項につき意思決定を行います。

取締役の任期は、選任後2年以内に終了する最終の事業年度に関する定時株主総会終結の時までとし、補欠または増員のために選任された取締役の任期は、他の取締役の残存任期と同一とします。

監査役会は、監査役全員で組織され、委託会社の会計監査及び業務監査を行います。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する最終の事業年度に関する定時株主総会終結の時までとし、補欠のために選任された監査役の任期は、前任者の任期の残存期間とします。

(投資信託の運用プロセス)

四半期毎に行われる投資戦略会議において、ドイツ銀行グループのアセット&ウェルス・マネジメント部門（グローバル）からの情報を参考にしつつ、各投資対象についての市場見通し並びに大まかな運用方針を決定します。

運用担当者は、投資戦略会議の方針にしたがって各ファンドの運用計画を作成し、チーフ・インベストメント・オフィサーの承認を得ます。その際、必要に応じてグループ内の投資環境調査やモデルポートフォリオを参考にします。

承認された運用計画にしたがって、運用担当者は売買を指示し、ポートフォリオの構築を行います。その際ファンドによっては、外部運用機関と投資助言契約もしくは運用委託契約を結んだ上で運用を行う場合があります。

コンプライアンス統括部が、個々の売買についてガイドライン違反等がないか速やかにチェックを行います。

運用評価会議では、各ファンドの運用成績を分析するとともに、運用に際して取っているアクティブリスクの状況や他ファンドとの均一性についてレビューを行い、今後の運用へのフィードバックを行います。

インベストメント・コントロール・コミッティーにおいて、ガイドラインの遵守状況や運用上の改善すべき点等について検討を行います。

コンプライアンス統括部は、運用部から独立した立場で、取引の妥当性のチェック及び利益相反取引のチェックを行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行っています。

平成25年11月末現在、委託会社の運用するファンドは102本、純資産総額は723,675百万円です（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類別の本数及び純資産総額は下記の通りです。

種類			本数	純資産総額
公募	単位型	株式投資信託	1本	12,878百万円
	追加型	株式投資信託	81本	655,256百万円
私募	追加型	株式投資信託	20本	55,542百万円
合計			102本	723,675百万円

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）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てにより記載しております。

- 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、事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
預金	2	5,405,779	2	5,273,856
前払費用		18,343		19,328
未収委託者報酬		893,246		865,843
未収運用受託報酬		42,463		10,170
未収投資助言報酬		65,848		51,383
未収収益		483,364		945,999
立替金		42,538		42,343
為替予約		9,613		737
繰延税金資産		-		456,500
流動資産合計		6,961,199		7,666,161
固定資産				
無形固定資産				
ソフトウェア	1	17,303	1	7,057
無形固定資産合計		17,303		7,057
投資その他の資産				
投資有価証券		16,926		16,217
長期差入保証金		200		200
敷金		10,312		9,301
繰延税金資産		-		82,336
投資その他の資産合計		27,438		108,056
固定資産合計		44,742		115,113
資産合計		7,005,942		7,781,275

（単位:千円）

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	105,165	189,040
未払収益分配金	3	3
未払償還金	1,508	1,508
未払手数料	449,694	435,263
その他未払金	63,043	79,656
未払費用	2 1,266,297	2 999,473
未払法人税等	20,093	95,234
未払消費税等	1,902	16,299
賞与引当金	57,021	69,377
事務所退去損失引当金	-	29,535
為替予約	17,622	8,755
流動負債合計	1,982,354	1,924,147
固定負債		
退職給付引当金	796,757	572,361
長期未払費用	182,835	170,105
賞与引当金	-	103,986
固定負債合計	979,592	846,453
負債合計	2,961,946	2,770,601
純資産の部		
株主資本		
資本金	3,078,000	3,078,000
資本剰余金		
資本準備金	1,830,000	1,830,000
資本剰余金合計	1,830,000	1,830,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	863,920	102,532
利益剰余金合計	863,920	102,532
株主資本合計	4,044,079	5,010,532
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	83	142
評価・換算差額等合計	83	142
純資産合計	4,043,995	5,010,674
負債純資産合計	7,005,942	7,781,275

(2)【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	6,658,303	6,714,400
運用受託報酬	206,509	131,072
投資助言報酬	97,851	95,529
その他営業収益	2,390,932	1,602,115
営業収益合計	9,353,596	8,543,118
営業費用		
支払手数料	3,479,040	3,436,882
広告宣伝費	167,121	196,803
公告費	1,160	1,160
調査費	93,973	97,927
委託調査費	439,257	480,591
情報機器関連費	153,277	124,231
委託計算費	181,578	253,926
通信費	8,966	8,618
印刷費	94,129	101,980
協会費	5,869	9,945
諸会費	998	383
諸経費	35,081	32,379
営業費用合計	4,660,455	4,744,831
一般管理費		
役員報酬	60,675	58,275
給料・手当	962,162	963,813
賞与	407,628	530,810
交際費	109,753	90,151
寄付金	397	2,500
旅費交通費	85,716	65,845
租税公課	27,248	20,295
不動産賃借料	185,062	143,664
退職給付費用	99,947	93,290
固定資産減価償却費	10,348	10,246
福利厚生費	231,130	267,868
業務委託費	1 803,486	1 867,422
退職金	4,256	12,297
諸経費	92,362	72,225
一般管理費合計	3,080,177	3,198,705
営業利益	1,612,964	599,581
営業外収益		
その他	1,628	2,252
営業外収益合計	1,628	2,252
営業外費用		
為替差損	20,698	2,910
その他	5,973	120
営業外費用合計	26,671	3,030
経常利益	1,587,920	598,803
特別損失		

割増退職金	-	54,397
事務所退去損失引当金繰入額	-	29,535
特別損失合計	-	83,933
税引前当期純利益	1,587,920	514,869
法人税、住民税及び事業税	5,810	87,341
法人税等調整額	-	538,924
法人税等合計	5,810	451,582
当期純利益	1,582,110	966,452

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

		前事業年度 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日)
株主資本			
資本金			
	当期首残高	3,078,000	3,078,000
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期変動額合計	-	-
	当期末残高	3,078,000	3,078,000
資本剰余金			
資本準備金			
	当期首残高	1,830,000	1,830,000
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期変動額合計	-	-
	当期末残高	1,830,000	1,830,000
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金			
	当期首残高	2,446,030	863,920
	当期変動額		
	当期純利益	1,582,110	966,452
	当期変動額合計	1,582,110	966,452
	当期末残高	863,920	102,532
株主資本合計			
	当期首残高	2,461,969	4,044,079
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期純利益	1,582,110	966,452
	当期変動額合計	1,582,110	966,452
	当期末残高	4,044,079	5,010,532
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金			
	当期首残高	126	83
	当期変動額		
	株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	210	226
	当期変動額合計	210	226
	当期末残高	83	142
評価・換算差額等合計			
	当期首残高	126	83
	当期変動額		
	株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	210	226
	当期変動額合計	210	226
	当期末残高	83	142
純資産合計			
	当期首残高	2,462,096	4,043,995
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期純利益	1,582,110	966,452
	株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	210	226
	当期変動額合計	1,581,899	966,678
	当期末残高	4,043,995	5,010,674

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) その他有価証券

時価のあるもの

当事業年度末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。

２．固定資産の減価償却の方法

(1) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における見込利用可能期間（５年）に基づく定額法を採用しております。

３．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

４．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。但し、当事業年度の計上額はありません。

(2) 賞与引当金

従業員等に対する賞与の支払及び親会社の運営する株式報酬制度に係る将来の費用負担に備えるため、当社所定の計算基準により算出した支払見込額の当事業年度負担分を計上しております。

(3) 事務所退去損失引当金

不動産賃貸借契約に基づき使用する事務所等の一部退去に伴う資産除去費用に関連して負担する支払に備えるため、支払見込額を計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

数理計算上の差異は、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を翌期から費用処理することとしております。

また、前事業年度末まで、役員の退職時に支出が予測される役員退職慰労金支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上し、退職給付引当金に含めて表示しておりましたが、平成24年9月の取締役会にて制度廃止の旨の決議が行われました。制度廃止を受けその後、全額が支給されたため当事業年度末において残高はありません。

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建の金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

６．リース取引の処理方法

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。

７．その他財務諸表のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の処理方法

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

（貸借対照表関係）

- 1 無形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
ソフトウェア	71,351 千円	81,597 千円

- 2 各科目に含まれている関係会社に対するものは以下のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
預金	3,699,915 千円	4,069,209 千円
未払費用	222,626 千円	240,209 千円

（損益計算書関係）

- 1 関係会社に対するものは以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
業務委託費	203,756 千円	198,535 千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	61,560	-	-	61,560

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	61,560	-	-	61,560

（リース取引関係）

リース取引に関する会計基準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

（借主側）

(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

（単位:千円）

	前事業年度（平成24年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
有形固定資産 （器具備品）	319,248	266,463	52,785
有形固定資産 （建物附属設備）	653,359	385,875	267,484
合計	972,608	652,339	320,269

（単位:千円）

	当事業年度（平成25年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
有形固定資産 （器具備品）	364,822	333,257	31,564
有形固定資産 （建物附属設備）	653,585	416,748	236,837
合計	1,018,407	750,006	268,401

(2) 未経過リース料期末残高相当額

（単位:千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
1年以内	61,085	41,799
1年超	211,307	174,393
合計	272,392	216,193

(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（単位:千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
支払リース料	71,463	67,280
減価償却費相当額	34,141	50,601
支払利息相当額	4,119	1,813

(4) 減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法

減価償却費相当額の算定方法

- ・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

- ・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は顧客資産について投資助言・代理及び投資運用業務等を行っており、業務上必要と認められる場合以外は、自己勘定による資金運用は行っておりません。預金については全て決済性の当座預金であります。また、銀行借入や社債等による資金調達は行っておりません。

デリバティブについても、外貨建営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当座預金並びに営業債権である未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬及び未収収益は、取引先の信用リスクに晒されています。預金に関するリスクは、当社の社内規程に従い、取引先の信用リスクのモニタリングを行っており、営業債権に関するリスクは、取引先毎の期日管理及び残高管理を実施し、主要な取引先の信用状況を定期的に把握する体制としております。

投資有価証券は当社設定の投資信託に対するシードマネーであり、業務上の必要性から保有しているもので、主に短期の日本国債やコールローンで運用されており、市場価格の変動リスク、市場の流動性リスクは限定的であります。

外貨建営業債権及び債務は為替変動リスクに晒されており、通貨別に把握された為替の変動リスクに対して先物為替予約によりリスクの回避を実施しております。

デリバティブ取引の執行・管理については、社内規程に基づいて取引、記帳及び取引先との残高照合等を行っております。

営業債務に関する流動性リスクについては、経理部において資金繰りをモニタリングしております。

上記、信用、市場、為替リスクに関する事項は、社内規程に基づいて定期的に社内委員会に報告され、審議、検討を行っております。また、流動性リスクに関する事項につきましても逐次、社内担当役員に報告されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、以下のとおりであります。

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	5,405,779	5,405,779	-
(2)未収委託者報酬	893,246	893,246	-
(3)未収運用受託報酬	42,463	42,463	-
(4)未収投資助言報酬	65,848	65,848	-
(5)未収収益	483,364	483,364	-
(6)投資有価証券 その他の有価証券	16,926	16,926	-
資産計	6,907,629	6,907,629	-
(1)未払手数料	449,694	449,694	-
(2)未払費用	1,266,297	1,266,297	-
(3)長期未払費用	182,835	182,835	-
負債計	1,898,827	1,898,827	-
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	(8,009)	(8,009)	-
デリバティブ取引計	(8,009)	(8,009)	-

（*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) 預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収投資助言報酬及び(5) 未収収益

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。

(6) 投資有価証券

投資有価証券はその他有価証券に区分されており、時価については、基準価額によっております。

また、有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照下さい。

負 債

(1) 未払手数料及び(2) 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。

(3) 長期未払費用

時価については、支払見込額に基づく現在価値によっております。

デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照下さい。

(注) 2. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超
預金	5,405,779	-	-
未収委託者報酬	893,246	-	-
未収運用受託報酬	42,463	-	-
未収投資助言報酬	65,848	-	-
未収収益	483,364	-	-
投資有価証券 その他の有価証券	-	10	16,916
合計	6,890,703	10	16,916

当事業年度（平成25年3月31日）

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	5,273,856	5,273,856	-
(2)未収委託者報酬	865,843	865,843	-
(3)未収運用受託報酬	10,170	10,170	-
(4)未収投資助言報酬	51,383	51,383	-
(5)未収収益	945,999	945,999	-
(6)投資有価証券 その他の有価証券	16,217	16,217	-
資産計	7,163,470	7,163,470	-
(1)預り金	189,040	189,040	-
(2)未払手数料	435,263	435,263	-
(3)未払費用	999,473	999,473	-
(4)未払法人税等	95,234	95,234	-
(5)長期未払費用	170,105	170,105	-
負債計	1,889,116	1,889,116	-
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	(8,018)	(8,018)	-
デリバティブ取引計	(8,018)	(8,018)	-

(*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) 預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収投資助言報酬及び(5) 未収収益

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。

(6) 投資有価証券

投資有価証券はその他の有価証券に区分されており、時価については、基準価額によっております。

また、有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照下さい。

負 債

(1) 預り金、(2) 未払手数料、(3) 未払費用及び(4) 未払法人税等

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

(5) 長期未払費用

時価については、支払見込額に基づく現在価値によっております。

デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照下さい。

(注) 2. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超
預金	5,273,856	-	-
未収委託者報酬	865,843	-	-
未収運用受託報酬	36,182	-	-
未収投資助言報酬	51,383	-	-
未収収益	919,986	-	-
投資有価証券			
その他の有価証券	-	-	15,039
合計	7,147,253	-	15,039

(注) 償還期間が見込めないものについては表中に記載を行わず、除外しております。

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日）

(単位:千円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他	15,036	15,010	26
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	1,889	2,000	110
合計		16,926	17,010	83

当事業年度（平成25年3月31日）

(単位:千円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他	16,217	15,988	229
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	-	-	-
合計		16,217	15,988	229

2. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,109	78	-
合計	1,109	78	-

(デリバティブ取引関係)

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ないデリバティブ取引について、取引の対象物は通貨のみであり、貸借対照表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。

前事業年度（平成24年3月31日）

通貨関連（時価の算定方法は、先物為替相場によっております。）

（単位：千円）

区分		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	694,468	-	7,488	7,488
	買建				
	米ドル	436,620	-	10,134	10,134
	ユーロ	506,097	-	9,257	9,257
	シンガポールドル	30,080	-	355	355
合計		1,667,267	-	8,009	8,009

当事業年度（平成25年3月31日）

通貨関連（時価の算定方法は、先物為替相場によっております。）

（単位：千円）

区分		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	553,397	-	5,418	5,418
	買建				
	ユーロ	620,475	-	3,337	3,337
	シンガポールドル	55,763	-	737	737
合計		1,229,636	-	8,018	8,018

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、退職一時金制度と確定拠出年金制度を採用しております。加えて、一部の従業員を対象とした特別慰労金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

（単位:千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
(1) 退職給付債務	235,824	238,321
(2) 未積立退職給付債務	235,824	238,321
(3) 未認識数理計算上の差異	28,233	25,435
(4) 貸借対照表計上額純額 (2)+(3)	207,590	212,886
(5) 特別退職慰労引当金	589,166	359,475
(6) 退職給付引当金 (4)+(5)	796,757	572,361

3. 退職給付費用に関する事項

（単位:千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
(1) 勤務費用	36,912	44,568
(2) 利息費用	3,167	3,301
(3) その他（退職給付債務の対象外の退職費用）	45,965	39,208
(4) 数理計算上の差異の費用処理額	1,509	6,185
退職給付費用小計	87,556	93,264
(5) 割増退職金	12,391	26
退職給付費用合計	99,947	93,290

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(2) 割引率

前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
1.40%	0.90%

(3) 数理計算上の差異の処理年数

5年

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	（単位：千円）	
	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
繰延税金資産		
賞与引当金	21,674	64,252
事務所退去損失引当金	-	11,226
未払費用	574,778	410,176
未払事業税	5,429	8,729
長期未払費用	-	61,969
退職給付引当金	302,847	206,142
税務上の繰越欠損金	64,911	-
減価償却超過額	46,358	37,415
その他	513	311
繰延税金資産小計	1,016,512	800,219
評価性引当額	1,016,512	261,295
繰延税金資産合計	-	538,924
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	87
繰延税金負債合計	-	87
繰延税金資産の純額	-	538,836

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

	（単位：%）	
	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
法定実効税率	40.7	38.0
（調整）		
交際費否認額	2.8	6.7
役員賞与否認額	1.4	11.2
評価性引当額	44.9	142.2
住民税均等割	0.4	1.1
その他	0.1	0.0
税効果会計適用後の法人税の負担率	0.4	87.7

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は資産運用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

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、記載しておりません。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社の主要な顧客は一般投資家であり、損益計算書の営業収益の10%以上を占める顧客が存在しないため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、記載しておりません。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社の主要な顧客は一般投資家であり、損益計算書の営業収益の10%以上を占める顧客が存在しないため、記載を省略しております。

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

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

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

該当事項はありません。

関連当事者情報

１．関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

前事業年度（自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	Deutsche Bank Aktiengesellschaft	ドイツ フランクフルト	2,379,519 千ユーロ	銀行業	(被所有) 間接100%	資金預入、 サービスの提供	*1 資金の預入 *2 IT、管理部門 サービス	- 219,712	預金 未払費用	3,699,915 222,626

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	Deutsche Bank Aktiengesellschaft	ドイツ フランクフルト	2,379,519 千ユーロ	銀行業	(被所有) 間接100%	資金預入、 サービスの提供	*1 資金の預入 *2 IT、管理部門 サービス	- 198,535	預金 未払費用	4,069,209 240,209

上記金額のうち、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

*1 当座預金口座を開設しております。

*2 当該会社とのサービス契約ないし、当社のＩＴ環境、総務購買部門等の管理部門業務に関連し支出した費用の計上を行っております。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	ドイツ証券株式会社	東京都 千代田区	72,728 百万円	証券業	なし	サービスの提供 役員の兼任	*1 IT、管理部門 サービス	409,942	未払費用	553,130
同一の親会社を持つ会社	ドイツ銀不動産 有限会社	東京都 千代田区	46 百万円	不動産 管理業	なし	サービスの提供 役員の兼任	*2 不動産賃借料	182,840	未払費用	79,079
同一の親会社を持つ会社	RREEF America L.L.C.	米国 ウィルミントン	10 千ドル	投資 運用業	なし	サービスの提供	*3 その他営業 収益	1,987,975	未収収益	399,469

同一の親会社を持つ会社	DWS Investment GmbH	ドイツ フランクフルト	115,000 千ユーロ	投資 運用業	なし	運用の再委託 サービスの提供	*2 委託調査 *3 その他営業 収益	270,502 176,515	未払費用 未収収益	111,010 45,349
同一の親会社を持つ会社	DWS Investment S.A.	ルクセンブルク	30,677 千ユーロ	投資 運用業	なし	サービスの提供	*3 その他営業 収益 *4 運用受託報酬	102,699 54,782	- -	- -

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	ドイツ証券株式会社	東京都 千代田区	72,728 百万円	証券業	なし	サービスの提供 役員の兼任	*1 IT、管理部門 サービス	398,082	未払費用	227,840
同一の親会社を持つ会社	ドイツ銀不動産 有限会社	東京都 千代田区	46 百万円	不動産 管理業	なし	サービスの提供 役員の兼任	*2 不動産賃借料	141,862	未払費用	24,143
同一の親会社を持つ会社	RREEF America L.L.C.	米国 ウィルミントン	10 千ドル	投資 運用業	なし	サービスの提供	*3 その他営業 収益	1,190,429	未収収益	667,059
同一の親会社を持つ会社	DWS Investment GmbH	ドイツ フランクフルト	115,000 千ユーロ	投資 運用業	なし	運用の再委託 サービスの提供	*2 委託調査 *3 その他営業 収益	328,358 271,074	未払費用 未収収益	141,761 195,228

上記金額のうち、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

- *1 当該会社とのサービス契約ないし、当社のIT環境、総務購買部門等の管理部門業務に関連し支出した費用の計上を行っております。
- *2 当該会社とのサービス契約に基づき、発生した費用の計上を行っております。
- *3 当該会社とのサービス契約に基づき、予め定められた料率で計算された収益の計上を行っております。
- *4 当該会社との契約に基づき、予め定められた料率で計算された収益の計上を行っております。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

Deutsche Bank Aktiengesellschaft フランクフルト証券取引所に上場
ニューヨーク証券取引所に上場

（1株当たり情報）

項目	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
----	-----------------------	-----------------------

1株当たり純資産額	65,691.94 円	81,394.97 円
1株当たり当期純利益金額	25,700.29 円	15,699.35 円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益金額（千円）	1,582,110	966,452
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株主に係る当期純利益金額（千円）	1,582,110	966,452
期中平均株式数（株）	61,560	61,560

[次へ](#)

1. 中間財務諸表の作成方法について

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)第38条及び第57条の規定に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

中間財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てにより記載しております。

2. 監査証明について

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、当中間会計期間(平成25年4月1日から平成25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る中間監査を受けております。

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25年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
預金		6,582,629
前払費用		15,294
未収委託者報酬		798,905
未収運用受託報酬		16,374
未収投資助言報酬		11,555
未収収益		1,121,050
立替金		31,486
繰延税金資産		619,055
為替予約		13,574
流動資産計		9,209,927
固定資産		
無形固定資産	1	1,954
投資その他の資産		
繰延税金資産		92,814
その他		28,067
固定資産計		122,835
資産合計		9,332,763
負債の部		
流動負債		
預り金		71,138
未払金		
未払手数料		403,314
その他未払金		51,527
未払費用		1,112,548
未払法人税等		707,521
未払消費税等	2	34,795
賞与引当金		239,439
事務所退去損失引当金		83,360
為替予約		94
流動負債計		2,703,740
固定負債		
長期未払費用		266,926
退職給付引当金		579,379
賞与引当金		136,459
固定負債計		982,765
負債合計		3,686,506
純資産の部		
株主資本		
資本金		3,078,000
資本剰余金		
資本準備金		1,830,000
資本剰余金計		1,830,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		738,202
利益剰余金計		738,202

株主資本計	5,646,202
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	54
評価・換算差額等合計	54
純資産合計	5,646,256
負債・純資産合計	9,332,763

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

当中間会計期間	
(自 平成25年4月1日	
至 平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	4,058,468
運用受託報酬	42,513
投資助言報酬	21,399
その他営業収益	1,680,660
営業収益計	5,803,043
営業費用	
支払手数料	2,105,042
その他営業費用	624,889
営業費用計	2,729,932
一般管理費	1 1,833,065
営業利益	1,240,044
営業外収益	2,611
営業外費用	2 29,209
経常利益	1,213,446
特別損失	3 59,337
税引前中間純利益	1,154,108
法人税、住民税及び事業税	691,416
法人税等調整額	172,978
法人税等合計	518,438
中間純利益	635,670

重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 時価のあるもの 当中間会計期間末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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却の方法	無形固定資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。但し、当中間会計期間末の計上額はありません。 (2) 賞与引当金 支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 事務所退去損失引当金 不動産賃貸借契約に基づき使用する事務所等の一部退去に伴う資産除去費用に関連して負担する支払に備えるため、支払見込額を計上しております。 (4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。数理計算上の差異は、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を翌期から費用処理することとしております。
5. 外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建の金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. その他中間財務諸表のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成25年9月30日)
1 無形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。 ソフトウェア 86,700千円 2 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺の上、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1 減価償却実施額 無形固定資産 5,103千円

2 営業外費用の主要項目	
為替差損	10,755千円
事務処理損失	18,454千円
3 特別損失の主要項目	
事務所退去損失引当金繰入額	53,824千円
割増退職金	5,513千円

(リース取引関係)

当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)			
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。			
ファイナンス・リース取引（借主側）			
リース取引に関する会計基準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			
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中間会計期間末残高相当額			
	器具備品	建物附属設備	合計
取得価額相当額	393,859 千円	653,585 千円	1,047,445 千円
減価償却累計額相当額	362,663 千円	432,018 千円	794,681 千円
中間会計期間末残高相当額	31,196 千円	221,567 千円	252,764 千円
2. 未経過リース料中間会計期間末残高相当額			
1 年以内	40,932 千円		
1 年超	155,856 千円		
合計	196,788 千円		
3. 支払リース料、減価償却費相当額、支払利息相当額			
支払リース料	21,695 千円		
減価償却費相当額	18,618 千円		
支払利息相当額	1,365 千円		
4. 減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法			
(1) 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。			
(2) 利息相当額の算定方法			
リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。			

(金融商品関係)

当中間会計期間末（平成25年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成25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、以下のとおりであります。

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1)預金	6,582,629	6,582,629	-
(2)未収委託者報酬	798,905	798,905	-
(3)未収運用受託報酬	16,374	16,374	-
(4)未収投資助言報酬	11,555	11,555	-
(5)未収収益	1,121,050	1,121,050	-
(6)投資有価証券 その他の有価証券	17,387	17,387	-
資産計	8,547,903	8,547,903	-
(1)未払手数料	403,314	403,314	-
(2)未払費用	1,112,548	1,112,548	-
(3)未払法人税等	707,521	707,521	-
(4)長期未払費用	266,926	266,926	-
負債計	2,490,312	2,490,312	-
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	13,480	13,480	-
デリバティブ取引計	13,480	13,480	-

(*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、合計で正味の債権となる項目については、正の値で示しております。

(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)預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、(4)未収投資助言報酬及び(5)未収収益

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。

(6)投資有価証券

投資有価証券は其他有価証券に区分されており、時価については、基準価額によっております。

また、有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照下さい。

負 債

(1)未払手数料、(2)未払費用及び(3)未払法人税等

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

(4)長期未払費用

時価については、支払見込額に基づく現在価値によっております。

デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照下さい。

(有価証券関係)

当中間会計期間末（平成25年9月30日）

その他有価証券

(単位:千円)

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	その他	17,188	17,100	88
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	198	200	1
合計		17,387	17,300	87

当期中に売却したその他有価証券

(単位:千円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,175	287	-
合計	1,175	287	-

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間末（平成25年9月30日）

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ないデリバティブ取引について、取引の対象物は通貨のみであり、中間貸借対照表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（時価の算定方法は、先物為替相場によっております。）

（単位：千円）

区分		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	521,991	-	8,509	8,509
	買建				
	ユーロ	624,892	-	5,983	5,983
	米ドル	149,674	-	918	918
	シンガポールドル	68,703	-	94	94
合計		1,365,262	-	13,480	13,480

（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25年4月1日 至 平成25年9月30日）

当社は資産運用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25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客へ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

本邦の外部顧客へ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

当社は有形固定資産を保有していないため、記載しておりません。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社の主要な顧客は一般投資家であり、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める顧客が存在しないため記載を省略しております。

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25年4月1日 至 平成25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25年4月1日 至 平成25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25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	当中間会計期間末 (平成25年9月30日)
１株当たり純資産額	91,719円57銭
１株当たり中間純利益金額	10,326円03銭

- （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、潜在株式が存在してい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。

	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
中間純利益金額(千円)	635,670
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	635,670
普通株式の期中平均株式数(株)	61,560

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟その他重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

受託会社

名 称 三井住友信託銀行株式会社
 資本金の額 342,037百万円（平成25年3月末現在）
 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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考>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25年9月末現在）
 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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

関係業務の概要 受託会社より委託を受け、当ファンドの信託事務の一部（信託財産の管理等）を行います。

販売会社

名称	資本金の額	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円 （平成25年9月末現在）	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社S B I証券	47,937百万円 （平成25年9月末現在）	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。
いちよし証券株式会社	14,577百万円 （平成25年10月末現在）	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円 （平成25年9月末現在）	
楽天証券株式会社	7,495百万円 （平成25年3月末現在）	
アイエヌジー生命保険株式会社	32,400百万円 （平成25年9月末現在）	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

新規申込みの取扱いを行いません。

投資顧問会社

名 称 ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社
 資本金の額 495百万円（平成25年11月末現在）
 事業の内容 金融商品取引法に定める投資運用業、投資助言・代理業及び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

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理、基準価額の計算、外国証券を保管・管理する外国の金融機関への指図等を行います。

販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い等を行います。

投資顧問会社

委託会社から運用の指図に関する権限の委託を受け、当ファンドの運用指図等を行います。

3【資本関係】

委託会社と他の関係法人との間に資本関係はありません。

第3【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

平成25年 7 月12日 有価証券報告書

平成25年 7 月12日 有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成25年11月20日

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進
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」に掲げられているドイチェ・日本株式ファンド（トピックス連動型）の平成25年4月16日から平成25年10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。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ドイチェ・日本株式ファンド（トピックス連動型）の平成25年10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。

利害関係

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（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。

２． 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年 6 月14日

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
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 野 島 浩 一 郎
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」に掲げられているドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

（ ）上記は、当社が、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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月 6 日

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
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 野島 浩一郎

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、「経理の状況」に掲げられているドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（ ）上記は、当社が、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。

[前へ](#)