

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長 殿
<b>【提出日】</b>	平成23年2月21日提出
<b>【発行者名】</b>	大和証券投資信託委託株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 石橋 俊朗
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	長谷川 英男 連絡場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
<b>【電話番号】</b>	03-5695-2111
<b>【届出の対象とした募集内 国投資信託受益証券に係る ファンドの名称】</b>	年金ダイワ日本株式インデックス
<b>【届出の対象とした募集内 国投資信託受益証券の金 額】</b>	継続申込期間（平成23年2月22日から平成24年2月22日まで） 5,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

年金ダイワ日本株式インデックス

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

### (3) 【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### (4) 【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

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

#### ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

#### ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5) 【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

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

申込手数料には、消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)が課されます。  
収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

平成23年2月22日から平成24年2月22日まで(継続申込期間)  
(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合に限り取得できます。

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

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

当ファンドは、積立投資専用です。

イ．取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結するものとします。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

取得申込金額に利息は付きません。

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産（収益の源泉）	株式
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	TOPIX

##### (注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「株式」...目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「インデックス型」...目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「株式一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」...目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス

<http://www.toushin.or.jp/> ) をご参照下さい。

#### < 信託金の限度額 >

- ・ 委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

## 1 わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

- 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
  - 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
  - ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
  - 株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

(注) ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

## ■ 東証株価指数（TOPIX）について

### ◆ 東証株価指数（TOPIX）とは

株式市場の動向を表す指標には、東証株価指数、日経平均株価、日経500種株価等があります。このうち、東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の第1部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするものです。

TOPIXは、1968年（昭和43年）1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年（昭和44年）7月1日から東京証券取引所が算出・公表しています（注1参照）。

### ◆ 東証株価指数（TOPIX）の特徴

東証第1部上場の全銘柄を対象としているため、市場全体の動きを確実に表します。

なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します（注2参照）。

（注1）TOPIXの算出方法：

毎日の指数 = 当日の時価総額 ÷ 基準時の時価総額 × 100

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

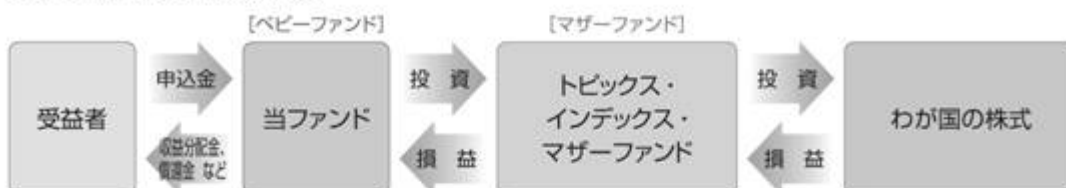
修正後の基準時価総額 = 修正前日の基準時価総額 ×  
(修正前日の時価総額 ± 修正額) ÷ 修正前日の時価総額

- ① TOPIX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う。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及び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する。
- ② （株）東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③ （株）東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用若しくは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ない。
- ④ （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ない。また（株）東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 本件インデックス・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するが、本件インデックス・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る。
- ⑥ 本件インデックス・ファンドは、（株）東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑦ （株）東京証券取引所は、本件インデックス・ファンドの購入者又は公衆に対し、本件インデックス・ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- ⑧ （株）東京証券取引所は、当社又は本件インデックス・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ない。
- ⑨ 以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は本件インデックス・ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

## ファンドの仕組み

### ●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資家のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



・運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

## 2

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

## 3

毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。収益分配金は、自動的に再投資されます。

### 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- ②原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

### ●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- ・指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- ・信託報酬、売買委託手数料等の費用負担
- ・株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- ・指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- ・株価指数先物と指数の動きの不一致（先物を利用した場合）
- ・株式および株価指数先物取引の最低取引単位の影響
- ・株式および株価指数先物の流動性低下時における売買対応の影響
- ・指数の構成銘柄の入れ替えおよび指数の算出方法の変更による影響



## (2) 【ファンドの沿革】

平成18年10月27日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（1）に基づき、次の業務を行いません。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
1	収益分配金、償還金など お申込金（3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（2）の委託者であり、次の業務を行いません。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図 2	損益 信託金（3）	
受託会社	住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約（2）の受託者であり、次の業務を行いません。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など
	損益 投資	
投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） など （ファミリーファンド方式で運用を行いません。）	

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

&lt; 委託会社の概況（平成22年12月末日現在） &gt;

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

## ・沿革

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

## ・大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

## 主要投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

## 投資態度

イ．投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ハ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。

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

## (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)に定めるものに限ります。）

#### 八．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたトピックス・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の有価証券（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することができます。

#### 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．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。）

3．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

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

#### 1．預金

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

#### 3．コール・ローン

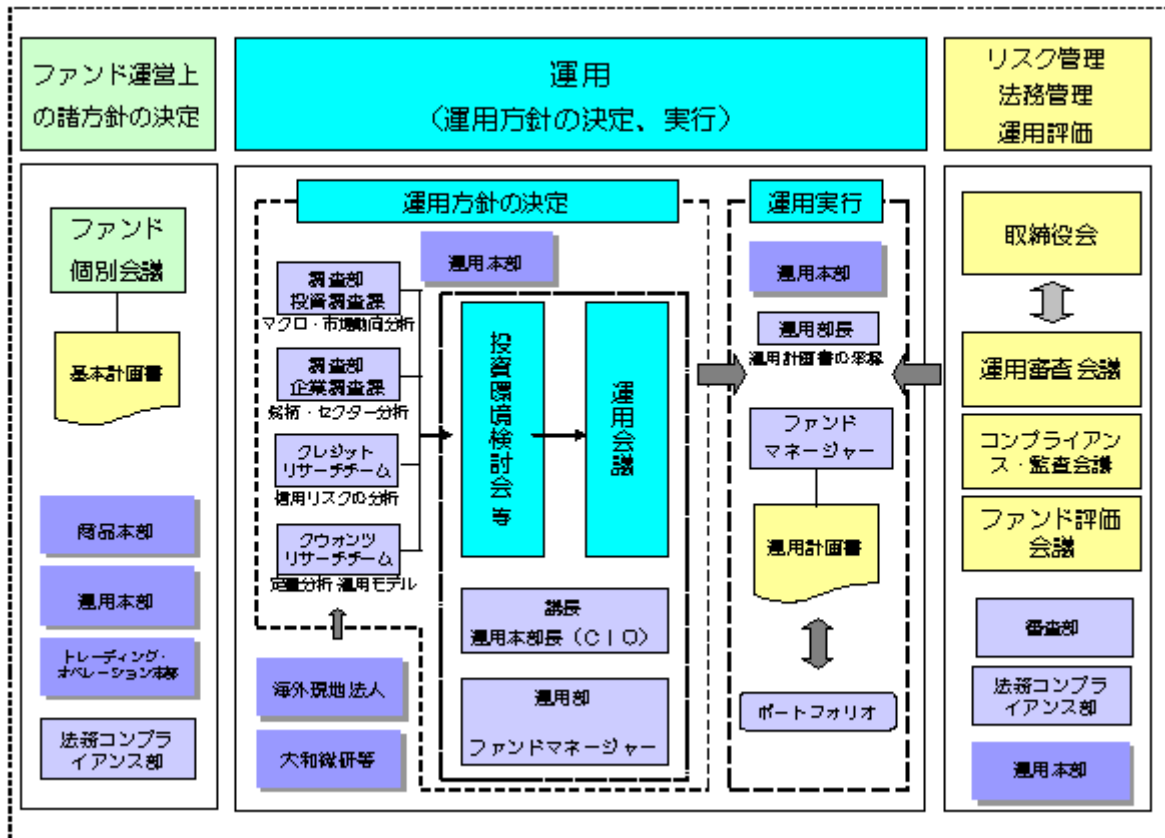
4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．投資環境の検討

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

#### ハ．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．運用本部長（CIO）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

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

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成22年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等（信託約款）

委託会社は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号イもしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

資金の借入れ（信託約款）

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

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< 参 考 > マザーファンド（トピックス・インデックス・マザーファンド）の概要

#### (1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないません。

イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないません。

ロ．ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### (2) 投資対象

委託会社は、信託金を、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。）で市場性のあるもの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．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 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。）
4. 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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

### (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

## 3 【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式など値動きのある証券に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### 株価指数先物取引の利用に伴うリスク

株価指数先物の価格は、対象指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている株価指数先物取引について損失が発生した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

#### その他

イ. 解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

## (2) 換金性が制限される場合

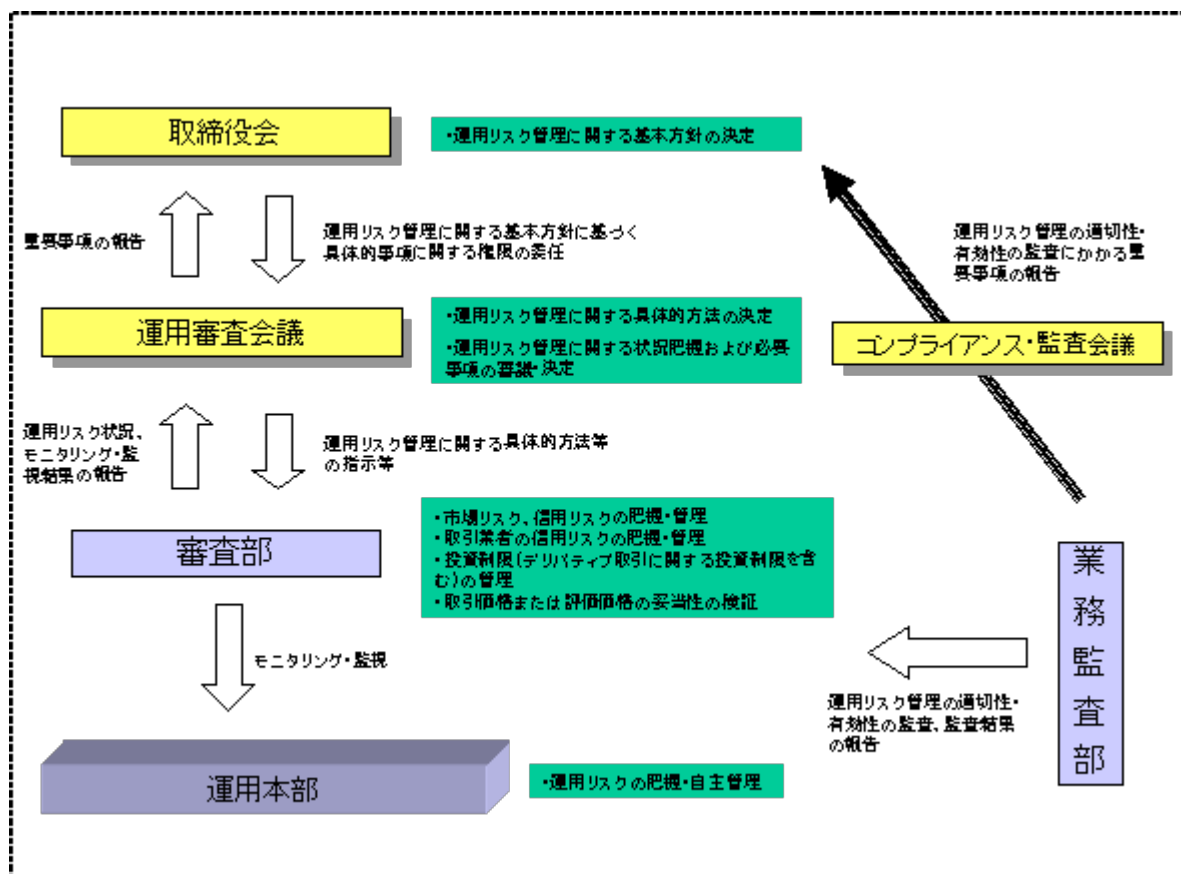
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

## (3) その他の留意点

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

## (4) リスク管理体制



## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。



取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.1785%（税抜0.17%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.084% （税抜0.08%）	年率0.063% （税抜0.06%）	年率0.0315% （税抜0.03%）

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

（ ） 「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示

することができません。

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかります。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

##### イ．収益分配金に対する課税

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

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

##### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

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

##### ハ．損益通算について

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

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

##### < 注1 > 個別元本について

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

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

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

## &lt;注2&gt; 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 上記は、平成22年12月末現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成22年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	644,737,203	99.98
内 日本	644,737,203	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	109,114	0.02
純資産総額	644,846,317	100.00

## （参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

## 投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	95,095,541,450	98.36
内 日本	95,095,541,450	98.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,586,761,726	1.64
純資産総額	96,682,303,176	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	1,541,120,000	1.59
内 日本	1,541,120,000	1.59

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

## (2) 【投資資産】（平成22年12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トピックス・インデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,337,351,594	0.46193 617,772,848	0.4821 644,737,203	- -	99.98%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.98%
合計	99.98%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,016,800	3,070 3,121,576,000	3,220 3,274,096,000	- -	3.39%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	5,913,600	408 2,416,607,100	439 2,596,070,400	- -	2.69%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	667,600	2,999 2,002,200,600	3,215 2,146,334,000	- -	2.22%
4	キヤノン 日本	株式 電気機器	492,000	3,905 1,921,260,000	4,210 2,071,320,000	- -	2.14%
5	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	591,200	2,625 1,552,231,800	2,892 1,709,750,400	- -	1.77%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	9,522,000	130 1,244,283,800	153 1,456,866,000	- -	1.51%
7	三菱商事 日本	株式 卸売業	625,300	1,952 1,220,668,900	2,198 1,374,409,400	- -	1.42%
8	ソニー 日本	株式 電気機器	444,900	2,642 1,175,755,600	2,927 1,302,222,300	- -	1.35%
9	武田薬品 日本	株式 医薬品	309,900	4,016 1,244,834,000	3,995 1,238,050,500	- -	1.28%
10	東京電力 日本	株式 電気・ガス業	582,900	2,309 1,346,068,300	1,983 1,155,890,700	- -	1.20%
11	任天堂 日本	株式 その他製品	45,300	23,582 1,068,273,100	23,830 1,079,499,000	- -	1.12%
12	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	293,200	3,809 1,116,988,800	3,675 1,077,510,000	- -	1.11%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	82,500	10,620 876,191,000	12,470 1,028,775,000	- -	1.06%
14	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	346,300	2,685 930,091,000	2,811 973,449,300	- -	1.01%
15	小松製作所 日本	株式 機械	392,700	1,924 755,571,600	2,457 964,863,900	- -	1.00%
16	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	6,456	146,000 942,576,000	141,800 915,460,800	- -	0.95%
17	三井物産 日本	株式 卸売業	674,600	1,196 807,278,000	1,341 904,638,600	- -	0.94%
18	パナソニック 日本	株式 電気機器	783,900	1,113 872,813,500	1,153 903,836,700	- -	0.93%

19	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先 物取引業	1,646,200	426 701,821,700	515 847,793,000	- -	0.88%
20	三菱地所 日本	株式 不動産業	547,000	1,321 723,013,000	1,506 823,782,000	- -	0.85%
21	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	999,000	714 713,497,300	773 772,227,000	- -	0.80%
22	日立 日本	株式 電気機器	1,777,000	376 668,152,000	433 769,441,000	- -	0.80%
23	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	137,400	5,230 718,602,000	5,280 725,472,000	- -	0.75%
24	東京海上HD 日本	株式 保険業	296,000	2,417 715,432,000	2,427 718,392,000	- -	0.74%
25	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	326,000	1,970 642,220,000	2,170 707,420,000	- -	0.73%
26	東芝 日本	株式 電気機器	1,562,000	408 637,296,000	442 690,404,000	- -	0.71%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	791,000	712 563,801,000	852 673,932,000	- -	0.70%
28	関西電力 日本	株式 電気・ガス業	322,300	2,160 696,261,300	2,004 645,889,200	- -	0.67%
29	新日本製鐵 日本	株式 鉄鋼	2,168,000	293 635,224,000	292 633,056,000	- -	0.65%
30	信越化学 日本	株式 化学	137,900	4,370 602,719,700	4,400 606,760,000	- -	0.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.36%
合計	98.36%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.52%
建設業	1.98%
食料品	2.90%
繊維製品	0.90%
パルプ・紙	0.37%
化学	5.80%
医薬品	4.08%
石油・石炭製品	0.87%
ゴム製品	0.59%
ガラス・土石製品	1.24%
鉄鋼	2.35%
非鉄金属	1.32%
金属製品	0.65%
機械	4.91%
電気機器	14.92%

輸送用機器	9.74%
精密機器	1.40%
その他製品	2.15%
電気・ガス業	4.65%
陸運業	3.47%
海運業	0.60%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	5.35%
卸売業	5.18%
小売業	3.47%
銀行業	9.40%
証券・商品先物取引業	1.58%
保険業	2.51%
その他金融業	0.72%
不動産業	2.44%
サービス業	1.66%
合計	98.36%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2011年3月	買建	172	1,526,843,742	1,541,120,000	1.59%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成18年10月27日)	1,000,000	-	1.0000	-
第1計算期間末 (平成19年11月30日)	81,855,912	81,855,912	0.9320	0.9320
第2計算期間末 (平成20年12月1日)	173,040,952	173,040,952	0.5128	0.5128

第3計算期間末 (平成21年11月30日)	361,629,918	361,629,918	0.5292	0.5292
平成21年12月末日	426,052,783	-	0.5723	-
平成22年1月末日	438,509,412	-	0.5685	-
2月末日	435,869,366	-	0.5644	-
3月末日	516,941,837	-	0.6231	-
4月末日	538,439,801	-	0.6285	-
5月末日	499,133,592	-	0.5606	-
6月末日	496,359,098	-	0.5362	-
7月末日	518,741,391	-	0.5411	-
8月末日	509,049,179	-	0.5127	-
9月末日	545,801,925	-	0.5327	-
10月末日	550,943,584	-	0.5209	-
第4計算期間末 (平成22年11月30日)	583,936,066	583,936,066	0.5526	0.5526
12月末日	644,846,317	-	0.5775	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	6.8
第2計算期間	45.0
第3計算期間	3.2
第4計算期間	4.4

[次△](#)



## (参考情報)

2010年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	5,775円
純資産総額	6.4億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.5%
3カ月間	8.4%
6カ月間	7.7%
1年間	0.9%
3年間	-35.7%
5年間	-
設定来	-42.3%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期				
	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月				
分配金	0円	0円	0円	0円				

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

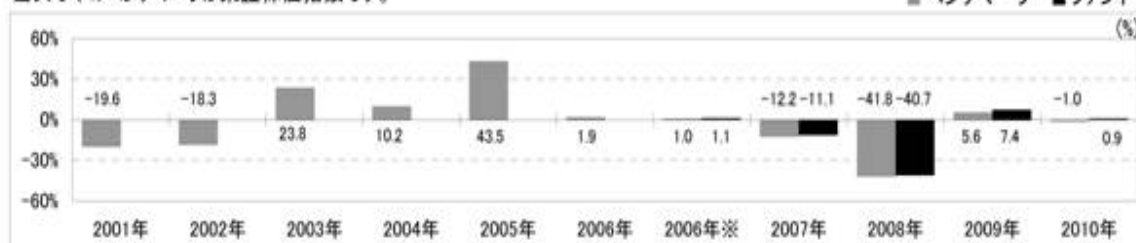
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,298	98.3%	電気機器	14.9%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
国内株式先物	1	1.6%	輸送用機器	9.7%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.7%
不動産投資信託等	-	-	銀行業	9.4%	本田技研	輸送用機器	2.2%
コール・ローン、その他	-	-	化学	5.8%	キヤノン	電気機器	2.1%
合計	1,299	-	情報・通信業	5.4%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.8%
株式市場・上場別構成			卸売業	5.2%	TOPIX先物 2303月	-	1.6%
一部(東証・大証・名証)		98.3%	機械	4.9%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.5%
二部(東証・大証・名証)		-	電気・ガス業	4.6%	三菱商事	卸売業	1.4%
新興市場他		-	医薬品	4.1%	ソニー	電気機器	1.3%
その他		-	その他	34.3%	武田薬品	医薬品	1.3%
合計		98.3%	合計	98.3%	合計		19.3%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2006年※は設定日(10月27日)から年末、2010年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	88,134,563	1,304,551
第2計算期間	256,258,194	6,653,498
第3計算期間	366,384,982	20,413,545
第4計算期間	397,758,878	24,516,478

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権の取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって、受益権の取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

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

### 2 【換金（解約）手続等】

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

#### < 一部解約 >

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して4営業日目から受益者に支払います。

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

基準価額は、原則として委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は平成18年10月27日から平成19年11月30日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.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。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

前 の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 の3.または前 の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

#### 運用報告書

委託会社は、計算期間の末日ごとに、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

#### 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

##### 収益分配金にかかる請求権

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### 償還金にかかる請求権

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

##### 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

ただし、第3期計算期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）については、改正前の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づき、第4期計算期間（平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）については、改正後の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第4期計算期間（平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

#### 1 【財務諸表】

#### 年金ダイワ日本株式インデックス



年金ダイワ日本株式インデックス  
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 平成21年11月30日現在	第4期 平成22年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	541,788	631,463
親投資信託受益証券	361,552,073	583,800,903
未収入金	-	40,000
流動資産合計	362,093,861	584,472,366
資産合計	362,093,861	584,472,366
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	143,889	51,265
未払受託者報酬	54,872	83,140
未払委託者報酬	256,126	388,128
その他未払費用	9,056	13,767
流動負債合計	463,943	536,300
負債合計	463,943	536,300
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 683,406,145	<sup>1</sup> 1,056,648,545
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 321,776,227	<sup>2</sup> 472,712,479
（分配準備積立金）	87	254
元本等合計	361,629,918	583,936,066
純資産合計	361,629,918	583,936,066
負債純資産合計	362,093,861	584,472,366

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
営業収益		
受取利息	87	167
有価証券売買等損益	3,029,138	14,333,830
営業収益合計	3,029,225	14,333,997
営業費用		
受託者報酬	88,397	155,716
委託者報酬	412,722	726,985
その他費用	14,559	25,796
営業費用合計	515,678	908,497
営業利益	2,513,547	13,425,500
経常利益	2,513,547	13,425,500
当期純利益	2,513,547	13,425,500
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	691,612	709,910
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	164,393,756	321,776,227
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,872,264	11,346,835
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,872,264	11,346,835
剰余金減少額又は欠損金増加額	169,076,670	174,998,677
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	169,076,670	174,998,677
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	321,776,227	472,712,479

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第3期 自平成20年12月2日 至平成21年11月30日	第4期 自平成21年12月1日 至平成22年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券  同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  平成20年11月30日が休日のため、前計算期間末日を平成20年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第3期 平成21年11月30日現在	第4期 平成22年11月30日現在
1. 1 期首元本額	337,434,708円	683,406,145円
期中追加設定元本額	366,384,982円	397,758,878円
期中一部解約元本額	20,413,545円	24,516,478円
2. 計算期間末日における受益権の総数	683,406,145口	1,056,648,545口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は321,776,227円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は472,712,479円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第3期 自平成20年12月2日 至平成21年11月30日	第4期 自平成21年12月1日 至平成22年11月30日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(87円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は87円(1万口当たり0.00円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(167円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(47円)及び分配準備積立金(87円)より分配対象額は301円(1万口当たり0.00円)ですが、分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

（追加情報）

第4期計算期間（平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

#### 金融商品の状況に関する事項

区分	第4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

#### 金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 平成22年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	<p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	---

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第3期 平成21年11月30日現在		第4期 平成22年11月30日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	361,552,073	2,548,341	13,819,346
合計	361,552,073	2,548,341	13,819,346

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 第3期計算期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）

第3期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
該当事項はありません。

## 第4期計算期間（平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第4期 平成22年11月30日現在
該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

## （1口当たり情報）

	第3期 平成21年11月30日現在	第4期 平成22年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5292円 (5,292円)	0.5526円 (5,526円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考

親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	1,265,555,828	583,800,903	
親投資信託受益証券 合計		1,265,555,828	583,800,903	
合計		1,265,555,828	583,800,903	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成21年11月30日現在		平成22年11月30日現在	
	金額（円）		金額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		1,698,124,245		1,818,834,278
株式	3	85,334,744,080		91,225,627,750
新株予約権証券		1,150,000		-
派生商品評価勘定		2,446,077		61,166,178
未収入金		-		443,587
未収配当金		427,340,176		504,038,275
前払金		178,765,000		-
差入委託証拠金		49,590,000		-
流動資産合計		87,692,159,578		93,610,110,068
資産合計		87,692,159,578		93,610,110,068
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		105,037,520		2,494,511
前受金		-		91,911,000
未払金		43,680,000		-
未払解約金		23,100,000		387,775,000
流動負債合計		171,817,520		482,180,511
負債合計		171,817,520		482,180,511
純資産の部				
元本等				
元本	1	198,496,539,943		201,865,410,927
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	110,976,197,885		108,737,481,370
元本等合計		87,520,342,058		93,127,929,557
純資産合計		87,520,342,058		93,127,929,557
負債純資産合計		87,692,159,578		93,610,110,068

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成20年12月2日 至平成21年11月30日	自平成21年12月1日 至平成22年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び新株予約権証券  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式及び新株予約権証券  同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	先物取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	164,435,605,491円	198,496,539,943円
同期中における追加設定元本額	44,844,778,480円	18,482,977,114円
同期中における一部解約元本額	10,783,844,028円	15,114,106,130円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
適格機関投資家専用投信1号	1,865,599,483円	1,827,977,064円
トピックス・インデックスファンド	12,114,450,876円	11,355,152,914円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	39,228,078,906円	37,540,919,907円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	1,122,437,137円	1,053,248,340円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）	396,469,094円	408,819,017円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）	6,785,644,364円	6,624,272,198円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）	434,024,202円	406,311,668円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	9,047,353,050円	8,944,337,173円
DCダイワ日本株式インデックス	50,336,517,999円	55,387,545,369円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,815,398,970円	1,870,711,058円
ダイワ・ライフ・バランス50	109,223,884円	217,055,087円
ダイワ・ライフ・バランス70	80,039,516円	181,688,938円
年金ダイワ日本株式インデックス	820,031,920円	1,265,555,828円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	13,399,559円	16,553,954円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,247,286円	14,675,588円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,141,095円	919,041円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	501,523,853円	500,282,197円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,555,428,274円	3,473,643,223円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA（国内株式型）	1,997,968,426円	2,075,331,030円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	113,355,088円	115,778,941円



ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	765,792,706円	797,303,991円
ダイワ世界分散バランスファンド 30VA(国内株式型)	363,504,608円	373,445,348円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	4,311,225,285円	4,062,250,479円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	603,930,494円	596,105,462円
ダイワ・バランスファンド35V A	37,306,738,546円	35,877,519,420円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	2,590,086,746円	2,410,471,798円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	6,235,966,966円	5,582,048,617円
ダイワ・バランスファンド25V A(適格機関投資家専用)	2,752,784,244円	3,033,655,709円
ダイワ国内バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	56,722円	533,316,921円
ダイワ国内バランスファンド30 VA(適格機関投資家専用)	68,052円	460,974,143円
ダイワライフスタイル25	148,914,351円	177,432,821円
ダイワライフスタイル50	417,210,659円	504,129,905円
ダイワライフスタイル75	364,827,526円	416,798,965円
DC・ダイワ・トピックス・イン デックス(確定拠出年金専用ファ ンド)	12,291,100,056円	13,759,178,813円
計	198,496,539,943円	201,865,410,927円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	198,496,539,943口	201,865,410,927口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は110,976,197,885円であり ます。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は108,737,481,370円であり ます。
4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。
	株式 56,500,000円	株式 434,700,000円

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
----	-------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

	(3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	--

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成21年11月30日現在		平成22年11月30日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	85,334,744,080	10,733,060,054	1,314,435,928
新株予約権証券	1,150,000	1,150,000	-
合計	85,335,894,080	10,731,910,054	1,314,435,928

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年9月25日から平成21年11月30日まで、及び平成22年9月22日から平成22年11月30日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成20年12月2日から平成21年11月30日まで)

## 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

種 類	平成21年11月30日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数先物取引				
買 建	2,881,985,000	-	2,780,400,000	101,585,000
合計	2,881,985,000	-	2,780,400,000	101,585,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)

## 株式関連

種 類	平成22年11月30日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数先物取引				
買 建	1,768,509,000	-	1,827,540,000	59,031,000
合計	1,768,509,000	-	1,827,540,000	59,031,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## (1口当たり情報)

	平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4409円 (4,409円)	0.4613円 (4,613円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	42,000	173	7,266,000	
日本水産	105,900	247	26,157,300	
マル八二チロホールディングス	182,000	133	24,206,000	
サカタのタネ	12,600	1,055	13,293,000	
ホクト	9,200	1,876	17,259,200	
ショーボンドHD	8,300	1,672	13,877,600	
ミライト・ホールディングス	21,600	575	12,420,000	
日鉄鉱業	26,000	308	8,008,000	
三井松島	59,000	148	8,732,000	
国際石油開発帝石	900	430,500	387,450,000	
日本海洋掘削	2,500	2,475	6,187,500	
関東天然瓦斯	12,000	422	5,064,000	
石油資源開発	14,100	2,926	41,256,600	
東急建設	33,970	244	8,288,680	
コムシスホールディングス	44,500	801	35,644,500	
ミサワホーム	12,700	398	5,054,600	
高松コンストラクショングP	7,500	1,090	8,175,000	
東建コーポレーション	3,410	2,630	8,968,300	
大成建設	423,000	189	79,947,000	
大林組	269,000	348	93,612,000	
清水建設	254,000	336	85,344,000	
長谷工コーポレーション	563,500	75	42,262,500	
鹿島建設	394,000	209	82,346,000	
不動テトラ	84,400	52	4,388,800	
鉄建建設	68,000	76	5,168,000	
安藤建設	44,000	103	4,532,000	
太平工業	19,000	365	6,935,000	
西松建設	130,000	104	13,520,000	
前田建設	58,000	251	14,558,000	
奥村組	86,000	303	26,058,000	
東鉄工業	13,000	528	6,864,000	
戸田建設	97,000	294	28,518,000	
熊谷組	86,000	64	5,504,000	
北野建設	28,000	206	5,768,000	
三井ホーム	13,000	375	4,875,000	
矢作建設	13,000	459	5,967,000	
大東建託	34,600	5,180	179,228,000	
NIPPO	21,000	545	11,445,000	
前田道路	27,000	616	16,632,000	
日本道路	32,000	189	6,048,000	
東亜建設	88,000	94	8,272,000	
東洋建設	141,000	44	6,204,000	
五洋建設	102,000	129	13,158,000	
住友林業	61,900	655	40,544,500	
日本基礎技術	22,900	174	3,984,600	
巴コーポレーション	16,500	263	4,339,500	
パナホーム	31,000	488	15,128,000	
大和ハウス	221,000	945	208,845,000	
ライト工業	26,100	183	4,776,300	

積水ハウス	267,000	795	212,265,000
ユアテック	17,000	287	4,879,000
四電工	13,000	320	4,160,000
中電工	14,100	897	12,647,700
関電工	41,000	506	20,746,000
きんでん	59,000	720	42,480,000
東京エネシス	11,000	491	5,401,000
トーエネック	15,000	423	6,345,000
日本電設工業	17,000	778	13,226,000
協和エクシオ	32,300	745	24,063,500
新日本空調	10,000	474	4,740,000
日本工営	34,000	229	7,786,000
日本電話施設	20,000	254	5,080,000
九電工	18,000	491	8,838,000
三機工業	22,000	520	11,440,000
日揮	89,000	1,621	144,269,000
中外炉工業	30,000	280	8,400,000
太平電業	13,000	632	8,216,000
高砂熱学	26,400	633	16,711,200
NEC ネットズエスアイ	8,100	987	7,994,700
朝日工業社	15,000	335	5,025,000
大気社	14,000	1,354	18,956,000
ダイダン	15,000	384	5,760,000
日比谷総合設	12,900	706	9,107,400
東芝プラントシステム	14,000	1,042	14,588,000
日本製粉	50,000	384	19,200,000
日清製粉G本社	80,500	1,014	81,627,000
昭和産業	39,000	221	8,619,000
鳥越製粉	9,800	732	7,173,600
協同飼料	46,000	98	4,508,000
中部飼料	9,600	507	4,867,200
日本配合飼料	40,000	98	3,920,000
日本甜菜糖	53,000	200	10,600,000
三井製糖	37,000	306	11,322,000
日本M&Aセンター	22	307,500	6,765,000
アコーディア・ゴルフ	238	74,000	17,612,000
パソナグループ	68	60,100	4,086,800
テンプホールディングス	12,300	725	8,917,500
森永製菓	88,000	187	16,456,000
中村屋	23,000	405	9,315,000
江崎グリコ	31,000	958	29,698,000
名糖産業	5,000	1,089	5,445,000
不二家	57,000	157	8,949,000
山崎製パン	64,000	979	62,656,000
モロゾフ	24,000	268	6,432,000
森永乳業	75,000	325	24,375,000
ヤクルト	47,100	2,375	111,862,500
明治ホールディングス	26,200	3,640	95,368,000
雪印メグミルク	17,200	1,421	24,441,200
プリマハム	59,000	92	5,428,000
日本ハム	62,000	1,001	62,062,000
伊藤ハム	50,000	270	13,500,000
丸大食品	41,000	247	10,127,000
米久	9,500	620	5,890,000
S Foods	7,000	660	4,620,000

スタジオアリス	5,300	766	4,059,800
シミック	190	22,850	4,341,500
システナ	94	78,300	7,360,200
NECフィールドینگ	7,700	957	7,368,900
新日鉄ソリューションズ	7,000	1,632	11,424,000
総合警備保障	30,800	881	27,134,800
日本駐車場開発	1,276	3,735	4,765,860
カカクコム	58	409,000	23,722,000
エムスリー	34	422,000	14,348,000
ディー・エヌ・エー	32,400	2,444	79,185,600
博報堂DYHLDGS	11,590	4,200	48,678,000
ぐるなび	50	119,600	5,980,000
PGMホールディングス	179	53,900	9,648,100
サッポロホールディングス	128,000	339	43,392,000
アサヒビール	165,400	1,630	269,602,000
麒麟HD	362,000	1,166	422,092,000
宝ホールディングス	77,000	490	37,730,000
オエノンホールディングス	31,000	194	6,014,000
メルシャン	35,000	163	5,705,000
養命酒	9,000	779	7,011,000
三国コカ・コ・ラ	11,700	730	8,541,000
コカ・コーラウエスト	27,300	1,394	38,056,200
コカコーラセントラルジャパン	10,600	1,081	11,458,600
ダイドードリンコ	3,800	2,840	10,792,000
伊藤園	22,500	1,349	30,352,500
キーコーヒー	8,700	1,431	12,449,700
日清オイリオグループ	40,000	369	14,760,000
不二製油	21,300	1,136	24,196,800
J-オイルミルズ	37,000	225	8,325,000
ローソン	26,400	3,710	97,944,000
サンエー	2,800	3,030	8,484,000
カワチ薬品	5,700	1,577	8,988,900
エービーシー・マート	9,200	2,837	26,100,400
アスクル	5,800	1,665	9,657,000
ゲオ	128	88,800	11,366,400
ポイント	6,670	3,675	24,512,250
伊藤忠食品	2,200	2,640	5,808,000
くらコーポレーション	4,300	1,339	5,757,700
キャンドゥ	52	71,000	3,692,000
エレマテック	6,700	1,053	7,055,100
パル	2,400	2,966	7,118,400
エディオン	28,600	657	18,790,200
サーラコーポレーション	13,500	433	5,845,500
バルス	42	85,500	3,591,000
あみやき亭	16	233,900	3,742,400
双日	530,500	162	85,941,000
アルフレッサホールディングス	20,400	3,470	70,788,000
ハニーズ	7,240	1,186	8,586,640
キッコーマン	73,000	901	65,773,000
味の素	240,000	826	198,240,000
キューピー	44,200	1,019	45,039,800
ハウス食品	32,300	1,318	42,571,400
カゴメ	31,700	1,478	46,852,600
焼津水産化工	5,800	835	4,843,000
アリアケジャパン	8,000	1,258	10,064,000

ニチレイ	101,000	357	36,057,000
横浜冷凍	18,800	531	9,982,800
東洋水産	38,000	1,766	67,108,000
日清食品HD	31,400	2,886	90,620,400
永谷園	9,000	831	7,479,000
フジッコ	10,000	977	9,770,000
ロックフィールド	5,300	1,223	6,481,900
日本たばこ産業	1,839	285,400	524,850,600
わらべや日洋	5,800	962	5,579,600
片倉工業	11,000	764	8,404,000
グンゼ	63,000	294	18,522,000
昭栄	15,600	645	10,062,000
アルペン	5,900	1,393	8,218,700
ビックカメラ	181	33,600	6,081,600
DCMホールディングス	39,500	439	17,340,500
あいホールディングス	21,600	299	6,458,400
J.フロントリテイリング	186,000	466	86,676,000
ドトール・日レスHD	13,800	1,065	14,697,000
マツモトキヨシHLDGS	14,800	1,688	24,982,400
ココカラファイン	7,800	1,651	12,877,800
三越伊勢丹HD	155,800	959	149,412,200
東洋紡績	310,000	141	43,710,000
ユニチカ	214,000	71	15,194,000
富士紡ホールディングス	48,000	128	6,144,000
日清紡ホールディングス	54,000	862	46,548,000
倉敷紡績	91,000	144	13,104,000
ダイワボウHD	77,000	231	17,787,000
シキボウ	64,000	118	7,552,000
日東紡績	73,000	202	14,746,000
トヨタ紡織	27,900	1,466	40,901,400
クリエイトSDH	3,000	1,701	5,103,000
バイタルKSKHD	15,700	586	9,200,200
UKCホールディングス	5,300	880	4,664,000
日本毛織	31,000	636	19,716,000
ダイドーリミテッド	14,600	680	9,928,000
野村不動産HLDGS	33,100	1,227	40,613,700
ヒューリック	22,700	622	14,119,400
帝国繊維	13,000	507	6,591,000
ブックオフコーポレーション	5,800	671	3,891,800
日本コークス工業	71,500	145	10,367,500
JFE商事HLDGS	54,000	341	18,414,000
あさひ	3,700	1,075	3,977,500
サークルKサンクス	17,200	1,161	19,969,200
日本調剤	1,170	2,875	3,363,750
コスモス薬品	3,600	2,628	9,460,800
シップヘルスケアHD	10,800	961	10,378,800
セブン&アイ・HLDGS	326,000	2,045	666,670,000
ツルハホールディングス	5,800	3,625	21,025,000
サンマルクホールディングス	2,600	3,095	8,047,000
トリドール	32	112,800	3,609,600
帝人	321,000	338	108,498,000
東レ	643,000	467	300,281,000
クラレ	122,700	1,155	141,718,500
旭化成	481,000	498	239,538,000
サカイオーベックス	44,000	124	5,456,000



稲葉製作所	6,100	715	4,361,500
三協・立山HLDGS	103,000	98	10,094,000
トーカロ	4,800	1,407	6,753,600
SUMCO	51,300	1,326	68,023,800
住江織物	26,000	153	3,978,000
日本バイリン	12,000	400	4,800,000
芦森工業	34,000	118	4,012,000
アツギ	94,000	104	9,776,000
セーレン	22,600	555	12,543,000
小松精練	28,000	330	9,240,000
ワコールホールディングス	52,000	1,133	58,916,000
ホギメディカル	4,500	3,705	16,672,500
サンエー・インターナショナル	5,700	960	5,472,000
レナウン	23,400	215	5,031,000
ITホールディングス	26,500	987	26,155,500
グリー	12,900	1,020	13,158,000
コーエーテクモHD	16,800	533	8,954,400
三菱総合研究所	3,600	1,870	6,732,000
特種東海製紙	57,000	165	9,405,000
ドワンゴ	44	157,200	6,916,800
マクロミル	46	155,500	7,153,000
ティーガイア	64	127,300	8,147,200
GMOペイメントゲートウェイ	23	167,500	3,852,500
ザッパラス	52	121,700	6,328,400
インターネットイニシアティブ	50	192,800	9,640,000
ソネットエンタテインメント	46	233,500	10,741,000
SRAホールディングス	6,100	801	4,886,100
JBISホールディングス	11,400	294	3,351,600
王子製紙	364,000	382	139,048,000
三菱製紙	137,000	92	12,604,000
北越紀州製紙	54,500	443	24,143,500
中越パルプ	40,000	138	5,520,000
大王製紙	36,000	522	18,792,000
日本製紙G本社	39,900	1,988	79,321,200
レンゴー	65,000	524	34,060,000
トーモク	30,000	210	6,300,000
ザ・パック	6,200	1,470	9,114,000
昭和電工	552,000	171	94,392,000
住友化学	567,000	359	203,553,000
住友精化	17,000	334	5,678,000
日産化学	60,300	1,004	60,541,200
クレハ	52,000	472	24,544,000
テイカ	16,000	270	4,320,000
石原産業	146,000	67	9,782,000
日本曹達	51,000	334	17,034,000
東ソー	206,000	235	48,410,000
トクヤマ	129,000	414	53,406,000
セントラル硝子	81,000	353	28,593,000
東亜合成	83,000	361	29,963,000
ダイソー	34,000	231	7,854,000
関東電化	19,000	608	11,552,000
電気化学	174,000	372	64,728,000
イビデン	48,400	2,300	111,320,000
信越化学	137,900	4,090	564,011,000
日本カ-バイド	23,000	227	5,221,000

堺化学	26,000	348	9,048,000
エア・ウォーター	66,000	991	65,406,000
大陽日酸	108,000	657	70,956,000
日本化学工業	35,000	186	6,510,000
日本パ - カライジング	20,000	1,098	21,960,000
高压ガス	12,000	455	5,460,000
四国化成	12,000	451	5,412,000
戸田工業	12,000	706	8,472,000
ステラ ケミファ	3,800	3,350	12,730,000
保土谷化学	21,000	297	6,237,000
日本触媒	67,000	789	52,863,000
大日精化	29,000	367	10,643,000
カネカ	101,000	499	50,399,000
協和発酵キリン	99,000	842	83,358,000
三菱瓦斯化学	129,000	513	66,177,000
三井化学	377,000	256	96,512,000
J S R	69,100	1,421	98,191,100
東京応化工業	15,200	1,548	23,529,600
三菱ケミカルH L D G S	478,500	481	230,158,500
日本合成化学	20,000	486	9,720,000
ダイセル化学	107,000	570	60,990,000
住友ベ - クライト	77,000	434	33,418,000
積水化学	171,000	575	98,325,000
日本ゼオン	78,000	674	52,572,000
アイカ工業	23,800	935	22,253,000
宇部興産	350,000	213	74,550,000
積水樹脂	13,000	785	10,205,000
タキロン	23,000	268	6,164,000
日立化成	35,400	1,551	54,905,400
リケンテクノス	17,000	243	4,131,000
大倉工業	24,000	211	5,064,000
積水化成品	20,000	327	6,540,000
群栄化学	24,000	216	5,184,000
日本化薬	58,000	794	46,052,000
イーピーエス	49	186,800	9,153,200
パナソニック電工 I S	2,100	2,234	4,691,400
野村総合研究所	44,200	1,688	74,609,600
ケネディクス	981	19,820	19,443,420
電通	75,400	2,258	170,253,200
インテージ	3,100	1,588	4,922,800
シンプレクスホールディング	147	40,100	5,894,700
日本精化	8,500	482	4,097,000
A D E K A	32,200	839	27,015,800
日油	71,000	364	25,844,000
ミヨシ油脂	39,000	129	5,031,000
ハリマ化成	8,000	471	3,768,000
花王	225,200	2,102	473,370,400
第一工業製薬	17,000	221	3,757,000
三洋化成	23,000	600	13,800,000
武田薬品	309,900	3,890	1,205,511,000
アステラス製薬	183,800	3,000	551,400,000
大日本住友製薬	60,000	725	43,500,000
塩野義製薬	121,200	1,530	185,436,000
田辺三菱製薬	68,000	1,318	89,624,000
わかもと製薬	16,000	244	3,904,000

あすか製薬	13,000	545	7,085,000
日本新薬	20,000	1,091	21,820,000
中外製薬	82,500	1,511	124,657,500
科研製薬	36,000	917	33,012,000
エーザイ	101,900	2,879	293,370,100
ロート製薬	38,000	917	34,846,000
小野薬品	41,200	3,700	152,440,000
久光製薬	23,300	3,330	77,589,000
持田製薬	34,000	855	29,070,000
大正製薬	65,000	1,741	113,165,000
参天製薬	25,600	2,879	73,702,400
扶桑薬品	34,000	231	7,854,000
日本ケミファ	17,000	257	4,369,000
ツムラ	22,700	2,570	58,339,000
テルモ	62,200	4,455	277,101,000
みらかホールディングス	20,200	2,972	60,034,400
キッセイ薬品工業	17,200	1,520	26,144,000
生化学工業	17,400	865	15,051,000
栄研化学	7,800	906	7,066,800
日水製薬	7,100	670	4,757,000
鳥居薬品	6,300	1,640	10,332,000
東和薬品	4,300	4,685	20,145,500
沢井製薬	5,500	7,150	39,325,000
ゼリア新薬工業	13,000	990	12,870,000
第一三共	278,300	1,811	504,001,300
キョーリン製薬HD	23,000	1,335	30,705,000
大幸薬品	3,600	1,275	4,590,000
大日本塗料	57,000	90	5,130,000
日本ペイント	70,000	623	43,610,000
関西ペイント	92,000	765	70,380,000
中国塗料	22,000	620	13,640,000
藤倉化成	11,200	504	5,644,800
太陽ホールディングス	5,900	2,425	14,307,500
D I C	310,000	166	51,460,000
サカタインクス	17,000	368	6,256,000
東洋インキ	73,000	375	27,375,000
アルプス技研	7,100	728	5,168,800
オリエンタルランド	22,200	7,580	168,276,000
ダスキン	23,100	1,481	34,211,100
パーク24	37,100	800	29,680,000
明光ネットワークジャパン	8,200	686	5,625,200
フジ・メディア・HD	814	117,100	95,319,400
ラウンドワン	23,500	425	9,987,500
リゾートトラスト	13,100	1,307	17,121,700
オービック	2,680	15,120	40,521,600
ヤフー	5,711	30,000	171,330,000
ビー・エム・エル	5,300	2,140	11,342,000
ワタベウェディング	4,000	867	3,468,000
トレンドマイクロ	34,800	2,585	89,958,000
もしもしホットライン	5,500	1,914	10,527,000
東急コミュニティー	2,500	2,318	5,795,000
リソー教育	1,092	3,915	4,275,180
日本オラクル	12,200	3,695	45,079,000
アルファシステムズ	2,700	1,454	3,925,800
フューチャーアーキテクト	137	34,400	4,712,800

ユー・エス・エス	10,710	6,060	64,902,600
オービックビジネスC	2,100	3,925	8,242,500
伊藤忠テクノソリューションズ	11,200	3,015	33,768,000
カルチュア・コンビニエンス	44,000	418	18,392,000
大塚商会	6,300	5,430	34,209,000
総合メディカル	1,900	2,113	4,014,700
セントラルスポーツ	4,900	865	4,238,500
電通国際情報S	7,200	503	3,621,600
ウェザーニューズ	2,600	1,311	3,408,600
富士フイルムHLDGS	177,000	2,812	497,724,000
コニカミノルタHLDGS	210,000	862	181,020,000
資生堂	137,200	1,749	239,962,800
ライオン	95,000	444	42,180,000
高砂香料	27,000	483	13,041,000
マンダム	8,800	2,153	18,946,400
ミルボン	4,600	2,393	11,007,800
ファンケル	16,500	1,152	19,008,000
コーセー	15,100	1,912	28,871,200
ドクターシーラボ	58	299,000	17,342,000
エステー	6,800	925	6,290,000
コニシ	6,800	936	6,364,800
長谷川香料	10,300	1,285	13,235,500
小林製薬	11,400	3,660	41,724,000
荒川化学工業	6,500	825	5,362,500
日本高純度化学	26	240,800	6,260,800
アース製薬	6,200	2,790	17,298,000
イハラケミカル	18,000	238	4,284,000
大成ラミック	3,300	2,124	7,009,200
クミアイ化学	19,000	270	5,130,000
日本農薬	18,000	401	7,218,000
昭和シェル石油	74,700	696	51,991,200
コスモ石油	228,000	237	54,036,000
ニチレキ	14,000	312	4,368,000
東燃ゼネラル石油	120,000	825	99,000,000
ユシロ化学	5,400	1,064	5,745,600
AOCホールディングス	23,500	412	9,682,000
出光興産	9,700	7,790	75,563,000
JXホールディングス	919,300	518	476,197,400
横浜ゴム	94,000	420	39,480,000
東洋ゴム	71,000	181	12,851,000
ブリヂストン	259,000	1,542	399,378,000
住友ゴム	57,800	849	49,072,200
オカモト	33,000	350	11,550,000
アキレス	84,000	114	9,576,000
フコク	4,100	730	2,993,000
ニッタ	7,900	1,436	11,344,400
東海ゴム工業	13,100	982	12,864,200
三ツ星ベルト	22,000	457	10,054,000
バンドー化学	31,000	298	9,238,000
鬼怒川ゴム	22,000	361	7,942,000
旭硝子	408,000	933	380,664,000
日本板硝子	363,000	196	71,148,000
有沢製作所	14,700	440	6,468,000
日本山村硝子	41,000	204	8,364,000
日本電気硝子	172,000	1,175	202,100,000

オハラ	4,000	1,061	4,244,000
住友大阪セメント	166,000	185	30,710,000
太平洋セメント	363,000	103	37,389,000
東海カーボン	80,000	463	37,040,000
日本カーボン	45,000	242	10,890,000
東洋炭素	4,200	4,565	19,173,000
ノリタケ	45,000	262	11,790,000
TOTO	121,000	558	67,518,000
日本碍子	100,000	1,245	124,500,000
日本特殊陶業	73,000	1,204	87,892,000
MARUWA	2,300	2,072	4,765,600
品川リフラクトリーズ	26,000	217	5,642,000
黒崎播磨	21,000	323	6,783,000
フジミインコーポレーテッド	8,400	1,245	10,458,000
ニチアス	42,000	401	16,842,000
新日本製鐵	2,168,000	277	600,536,000
住友金属工業	1,529,000	203	310,387,000
神戸製鋼所	1,145,000	190	217,550,000
日新製鋼	320,000	153	48,960,000
中山製鋼所	46,000	105	4,830,000
合同製鐵	48,000	168	8,064,000
JFEホールディングス	196,000	2,661	521,556,000
東京製鐵	45,300	847	38,369,100
共英製鋼	9,200	1,147	10,552,400
大和工業	18,900	2,405	45,454,500
東京鐵鋼	20,000	182	3,640,000
大阪製鐵	5,300	1,242	6,582,600
淀川製鋼所	63,000	323	20,349,000
東洋鋼鋳	20,000	438	8,760,000
住友鋼管	7,000	527	3,689,000
丸一鋼管	26,900	1,603	43,120,700
モリ工業	15,000	310	4,650,000
大同特殊鋼	137,000	449	61,513,000
日本高周波	42,000	95	3,990,000
日本金属工業	67,000	107	7,169,000
日本冶金工	45,000	234	10,530,000
山陽特殊鋼	41,000	432	17,712,000
愛知製鋼	43,000	507	21,801,000
日立金属	53,000	961	50,933,000
日本金属	26,000	146	3,796,000
大平洋金属	58,000	634	36,772,000
日本電工	33,000	618	20,394,000
栗本鉄工所	51,000	108	5,508,000
日本製鋼所	128,000	822	105,216,000
三菱製鋼	53,000	216	11,448,000
日本精線	8,000	429	3,432,000
日本軽金属	191,000	150	28,650,000
大紀アルミニウム	17,000	246	4,182,000
三井金属	239,000	254	60,706,000
東邦亜鉛	49,000	381	18,669,000
三菱マテリアル	517,000	259	133,903,000
住友鋳山	229,000	1,301	297,929,000
DOWAホールディングス	100,000	496	49,600,000
古河機金	155,000	93	14,415,000
大阪チタニウム	9,100	3,845	34,989,500

東邦チタニウム	13,500	2,135	28,822,500
住友軽金属	138,000	91	12,558,000
古河スカイ	35,000	218	7,630,000
古河電工	262,000	357	93,534,000
住友電工	292,700	1,095	320,506,500
フジクラ	126,000	370	46,620,000
昭和電線HLDGS	120,000	84	10,080,000
タツタ電線	23,000	189	4,347,000
日立電線	68,000	221	15,028,000
リョービ	48,000	341	16,368,000
アサヒHD	11,700	1,650	19,305,000
東洋製罐	58,600	1,506	88,251,600
ホッカンホールディングス	23,000	224	5,152,000
コロナ	4,900	737	3,611,300
横河ブリッジHLDGS	17,000	510	8,670,000
駒井ハルテック	24,000	164	3,936,000
三和ホールディングス	86,000	249	21,414,000
文化シャツタ -	29,000	183	5,307,000
住生活グループ	99,400	1,545	153,573,000
日本ファイルコン	8,400	411	3,452,400
ノーリツ	15,300	1,304	19,951,200
長府製作所	8,400	1,764	14,817,600
リンナイ	13,300	4,860	64,638,000
ユニプレス	10,200	1,470	14,994,000
日東精工	14,000	256	3,584,000
岡 部	20,600	350	7,210,000
日立ツール	5,800	901	5,225,800
東 プ レ	16,900	583	9,852,700
高周波熱錬	12,400	623	7,725,200
東京製綱	61,000	248	15,128,000
パイオラックス	3,900	1,742	6,793,800
日本発条	60,000	842	50,520,000
中央発條	13,000	302	3,926,000
三浦工業	13,700	2,023	27,715,100
タ ク マ	34,000	228	7,752,000
ツ ガ ミ	25,000	558	13,950,000
オークマ	57,000	560	31,920,000
東芝機械	53,000	383	20,299,000
ア マ ダ	118,000	572	67,496,000
アイダエンジニア	25,500	312	7,956,000
牧野フライス	40,000	616	24,640,000
オーエスジー	37,200	890	33,108,000
旭ダイヤモンド	18,000	1,452	26,136,000
森精機製作所	45,000	860	38,700,000
ディスコ	8,500	4,875	41,437,500
日東工器	5,200	2,055	10,686,000
豊田自動織機	71,300	2,467	175,897,100
大阪機工	38,000	120	4,560,000
オ - エム製作所	12,000	273	3,276,000
津田駒工業	31,000	154	4,774,000
島精機製作所	11,200	1,830	20,496,000
日阪製作所	11,000	963	10,593,000
ナブテスコ	31,400	1,545	48,513,000
三井海洋開発	7,300	1,407	10,271,100
S M C	24,600	13,300	327,180,000

新川	7,200	873	6,285,600
ホソカワミクロン	19,000	334	6,346,000
ユニオンツール	5,500	2,080	11,440,000
オイレス工業	8,900	1,375	12,237,500
サトー	8,800	1,004	8,835,200
小松製作所	392,700	2,318	910,278,600
住友重機械	213,000	514	109,482,000
日立建機	37,400	1,908	71,359,200
日 工	18,000	276	4,968,000
巴工業	3,900	1,106	4,313,400
井関農機	88,000	209	18,392,000
T O W A	9,700	619	6,004,300
丸山製作所	28,000	166	4,648,000
北川鉄工所	47,000	144	6,768,000
クボタ	347,000	758	263,026,000
東洋エンジニア	54,000	287	15,498,000
三菱化工機	31,000	165	5,115,000
月島機械	14,000	550	7,700,000
帝国電機製作所	3,500	1,577	5,519,500
新東工業	18,300	651	11,913,300
アイチ コーポレーション	16,900	315	5,323,500
小森コーポレーション	22,700	847	19,226,900
住友精密	21,000	347	7,287,000
荏原製作所	147,000	357	52,479,000
西島製作所	10,200	1,464	14,932,800
千代田化工建	59,000	727	42,893,000
ダイキン工業	86,500	3,005	259,932,500
オルガノ	15,000	581	8,715,000
ト - ヨ - カネツ	50,000	133	6,650,000
栗田工業	45,200	2,409	108,886,800
椿本チエイン	43,000	396	17,028,000
大同工業	26,000	154	4,004,000
日 機 装	29,000	679	19,691,000
木村化工機	8,900	551	4,903,900
新興プランテック	17,600	694	12,214,400
アネスト岩田	21,000	279	5,859,000
ダイフク	35,500	509	18,069,500
加藤製作所	29,000	171	4,959,000
タダノ	37,000	385	14,245,000
フジテック	25,000	377	9,425,000
シーケーディ	23,600	633	14,938,800
平和	17,000	1,177	20,009,000
理想科学工業	6,900	1,329	9,170,100
S A N K Y O	23,800	4,430	105,434,000
日本金銭機械	9,000	598	5,382,000
マースエンジニアリング	4,400	1,326	5,834,400
ダイコク電機	4,200	936	3,931,200
ア マ ノ	23,400	733	17,152,200
J U K I	55,000	148	8,140,000
サンデン	46,000	292	13,432,000
ブラザー工業	102,700	1,188	122,007,600
マックス	14,000	873	12,222,000
モリタホールディングス	15,000	468	7,020,000
グローリー	22,100	1,990	43,979,000
大和冷機工業	13,000	388	5,044,000

セガサミーホールディングス	83,100	1,410	117,171,000
日本ピストンリング	37,000	208	7,696,000
リケン	33,000	317	10,461,000
帝国ピストン	10,400	763	7,935,200
ホシザキ電機	15,800	1,476	23,320,800
大豊工業	6,600	693	4,573,800
日本精工	177,000	706	124,962,000
N T N	185,000	381	70,485,000
ジェイテクト	85,000	927	78,795,000
不二越	82,000	254	20,828,000
ミネベア	119,000	496	59,024,000
日本トムソン	28,000	614	17,192,000
T H K	53,000	1,735	91,955,000
ユースン精機	4,600	1,648	7,580,800
前澤給装工業	4,700	945	4,441,500
イーグル工業	11,000	738	8,118,000
日本ピラ - 工業	11,000	560	6,160,000
キッツ	34,200	362	12,380,400
日立	1,777,000	396	703,692,000
東芝	1,562,000	436	681,032,000
三菱電機	791,000	829	655,739,000
富士電機HLDGS	240,000	224	53,760,000
東洋電機製造	15,000	404	6,060,000
安川電機	88,000	725	63,800,000
シンフォニアテクノロジー	52,000	180	9,360,000
明電舎	81,000	357	28,917,000
オリジン電気	13,000	347	4,511,000
デンヨー	9,400	570	5,358,000
日立工機	22,100	715	15,801,500
三桜工業	9,900	675	6,682,500
マキタ	51,600	3,025	156,090,000
東芝テック	52,000	352	18,304,000
芝浦メカトロニクス	18,000	276	4,968,000
マブチモーター	11,200	4,025	45,080,000
日本電産	39,100	8,380	327,658,000
高岳製作所	34,000	335	11,390,000
ダイヘン	44,000	362	15,928,000
日新電機	15,000	413	6,195,000
大崎電気	12,000	640	7,680,000
オムロン	87,900	2,064	181,425,600
日東工業	12,800	863	11,046,400
I D E C	10,400	682	7,092,800
エルピーダメモリ	70,200	997	69,989,400
ジーエス・ユアサコーポ	154,000	561	86,394,000
メルコホールディングス	4,600	2,781	12,792,600
日本電気	1,026,000	231	237,006,000
富士通	761,000	537	408,657,000
沖電気	302,000	72	21,744,000
岩崎通信機	54,000	67	3,618,000
電気興業	27,000	350	9,450,000
サンケン電気	49,000	355	17,395,000
アイホン	6,000	1,270	7,620,000
ルネサスエレクトロニクス	21,400	814	17,419,600
セイコーエプソン	54,300	1,375	74,662,500
ワコム	166	116,100	19,272,600



アルバック	14,900	1,976	29,442,400
アクセル	3,300	1,952	6,441,600
ナナオ	7,000	1,701	11,907,000
日本信号	19,200	586	11,251,200
京三製作所	19,000	357	6,783,000
能美防災	12,000	475	5,700,000
マスプロ電工	8,100	685	5,548,500
日本無線	36,000	259	9,324,000
パナソニック	783,900	1,204	943,815,600
シャープ	355,000	805	285,775,000
アンリツ	36,000	580	20,880,000
富士通ゼネラル	20,000	445	8,900,000
日立国際電気	19,000	766	14,554,000
ソ ニ ー	444,900	2,971	1,321,797,900
T D K	44,600	5,390	240,394,000
帝国通信工業	28,000	188	5,264,000
三洋電機	608,000	136	82,688,000
ミツミ電機	28,700	1,518	43,566,600
タムラ製作所	27,000	225	6,075,000
アルプス電気	63,300	825	52,222,500
パイオニア	115,000	326	37,490,000
日本電波工業	6,600	1,422	9,385,200
ローランド ディー . ジー .	4,500	1,175	5,287,500
フオスタ - 電機	7,800	2,077	16,200,600
クラリオン	50,000	145	7,250,000
S M K	25,000	391	9,775,000
ヨコオ	9,200	484	4,452,800
東 光	40,000	128	5,120,000
ホシデン	20,100	844	16,964,400
ヒロセ電機	12,700	8,270	105,029,000
日本航空電子	19,000	606	11,514,000
T O A	12,000	411	4,932,000
ユニデン	29,000	242	7,018,000
アルパイン	16,200	1,127	18,257,400
スミダコーポレーション	5,800	836	4,848,800
アイコム	4,800	2,086	10,012,800
船井電機	7,300	2,844	20,761,200
横河電機	80,600	577	46,506,200
新電元工業	30,000	375	11,250,000
山武	21,900	1,910	41,829,000
日本光電工業	14,700	1,624	23,872,800
チ ノ ー	22,000	194	4,268,000
堀場製作所	13,900	2,230	30,997,000
アドバンテスト	54,600	1,722	94,021,200
エスベック	10,200	611	6,232,200
パナソニック電工 S U N X	8,900	457	4,067,300
キーエンス	17,600	21,120	371,712,000
日置電機	4,300	1,625	6,987,500
シスメックス	13,900	5,340	74,226,000
メガチップス	7,600	1,474	11,202,400
O B A R A	7,000	855	5,985,000
日本電産コパル電子	8,900	615	5,473,500
デンソー	173,400	2,733	473,902,200
コーセル	11,000	1,144	12,584,000
日立メディコ	8,000	647	5,176,000

オプテックス	6,200	1,125	6,975,000
千代田インテグレ	3,800	1,021	3,879,800
東光電気	7,000	433	3,031,000
スタンレー電気	53,400	1,496	79,886,400
岩崎電気	36,000	155	5,580,000
ウシオ電機	47,800	1,442	68,927,600
日本セラミック	5,500	1,239	6,814,500
新神戸電機	7,000	900	6,300,000
日本デジタル研究所	7,600	842	6,399,200
古河電池	7,000	537	3,759,000
図研	8,500	566	4,811,000
日本電子	33,000	279	9,207,000
カシオ	77,100	625	48,187,500
ファナック	82,500	11,990	989,175,000
日本シイエムケイ	17,300	375	6,487,500
エンプラス	4,600	1,180	5,428,000
ローム	39,400	5,050	198,970,000
浜松ホトニクス	30,700	2,749	84,394,300
三井ハイテック	11,600	450	5,220,000
新光電気工業	20,700	932	19,292,400
京セラ	65,800	8,540	561,932,000
太陽誘電	36,000	1,113	40,068,000
村田製作所	82,900	5,110	423,619,000
ユーシン	10,200	662	6,752,400
双葉電子工業	14,000	1,448	20,272,000
日東電工	68,200	3,475	236,995,000
北陸電気工業	37,000	156	5,772,000
パナソニック電工	74,000	1,085	80,290,000
東海理化電機	18,700	1,514	28,311,800
ニチコン	25,500	1,009	25,729,500
日本ケミコン	51,000	359	18,309,000
K O A	10,500	829	8,704,500
三井造船	309,000	193	59,637,000
日立造船	335,500	117	39,253,500
佐世保重工業	55,000	158	8,690,000
三菱重工業	1,324,000	301	398,524,000
川崎重工業	616,000	259	159,544,000
I H I	542,000	173	93,766,000
日本車輛	31,000	375	11,625,000
近畿車輛	14,000	408	5,712,000
日産自動車	999,000	785	784,215,000
いすゞ自動車	459,000	373	171,207,000
トヨタ自動車	1,016,800	3,220	3,274,096,000
日野自動車	100,000	413	41,300,000
三菱自動車工業	1,630,000	113	184,190,000
エフテック	3,100	1,353	4,194,300
武蔵精密工業	7,800	2,059	16,060,200
トヨタ車体	14,400	1,483	21,355,200
日産車体	31,000	661	20,491,000
関東自動車	12,900	606	7,817,400
新明和工業	38,000	335	12,730,000
極東開発工業	19,000	322	6,118,000
日信工業	16,300	1,423	23,194,900
トピー工業	68,000	192	13,056,000
ティラド	28,000	288	8,064,000

曙ブレーキ	37,700	488	18,397,600
タチエス	10,600	1,292	13,695,200
N O K	38,300	1,580	60,514,000
フタバ産業	23,700	570	13,509,000
カヤバ工業	50,000	554	27,700,000
シロキ工業	19,000	265	5,035,000
市光工業	22,000	171	3,762,000
大同メタル工業	14,000	597	8,358,000
プレス工業	38,000	351	13,338,000
カルソニックカンセイ	42,000	290	12,180,000
太平洋工業	18,000	400	7,200,000
ケーヒン	16,400	1,826	29,946,400
河西工業	11,000	389	4,279,000
アイシン精機	64,900	2,713	176,073,700
マ ッ ダ	614,000	233	143,062,000
ダイハツ	83,000	1,174	97,442,000
愛知機械	19,000	290	5,510,000
今仙電機製作所	5,800	1,123	6,513,400
本田技研	667,600	3,010	2,009,476,000
スズキ	165,300	2,024	334,567,200
富士重工業	250,000	620	155,000,000
ヤマハ発動機	120,000	1,200	144,000,000
ショーワ	18,000	564	10,152,000
小糸製作所	40,000	1,203	48,120,000
T B K	10,000	366	3,660,000
エクセディ	9,600	2,587	24,835,200
ミツバ	15,000	638	9,570,000
豊田合成	22,500	1,911	42,997,500
愛三工業	10,300	659	6,787,700
ヨ ロ ズ	5,000	1,365	6,825,000
エフ・シー・シー	11,700	1,839	21,516,300
新家工業	38,000	136	5,168,000
シマノ	32,500	4,035	131,137,500
タカタ	12,200	2,330	28,426,000
テイ・エス テック	15,300	1,525	23,332,500
小 野 建	7,700	673	5,182,100
佐鳥電機	6,100	567	3,458,700
カップクリエイト	5,800	1,870	10,846,000
伯東	5,400	725	3,915,000
ナガイレーベン	6,400	1,949	12,473,600
菱食	7,800	1,739	13,564,200
良品計画	9,100	3,275	29,802,500
三城ホールディングス	10,400	713	7,415,200
松田産業	6,400	1,331	8,518,400
メディパルHD	71,600	900	64,440,000
アズワン	5,600	1,468	8,220,800
シモジマ	6,400	1,055	6,752,000
ドウシシャ	4,200	1,802	7,568,400
コ ジ マ	10,600	493	5,225,800
コーナン商事	7,600	925	7,030,000
黒田電気	10,800	1,022	11,037,600
ネットワンシステムズ	198	109,600	21,700,800
ワタミ	9,300	1,548	14,396,400
ドン・キホーテ	12,200	2,415	29,463,000
メガネトップ	8,900	798	7,102,200

西松屋チェーン	17,400	805	14,007,000
ゼンショー	29,300	767	22,473,100
幸楽苑	5,400	1,162	6,274,800
サイゼリヤ	10,200	1,527	15,575,400
エクセル	4,900	955	4,679,500
ガリバーインターナショナル	2,200	3,815	8,393,000
ユナイテッドアローズ	7,600	1,186	9,013,600
ハイデイ日高	3,900	1,344	5,241,600
シークス	5,500	886	4,873,000
京都きもの友禅	5,900	879	5,186,100
コロワイド	27,000	417	11,259,000
壱番屋	2,800	2,239	6,269,200
マクニカ	3,800	1,900	7,220,000
スギホールディングス	12,500	1,880	23,500,000
島津製作所	95,000	620	58,900,000
J M S	15,000	283	4,245,000
スター精密	16,300	827	13,480,100
東京計器	39,000	115	4,485,000
日本電産トーソク	5,500	910	5,005,000
東京精密	16,000	1,214	19,424,000
ニコン	138,300	1,644	227,365,200
トプコン	20,200	470	9,494,000
オリンパス	93,600	2,355	220,428,000
理研計器	9,100	597	5,432,700
大日本スクリーン	88,000	546	48,048,000
キヤノン電子	7,400	2,170	16,058,000
タムロン	8,100	1,630	13,203,000
HOYA	181,600	1,974	358,478,400
ノーリツ鋼機	9,300	487	4,529,100
エー・アンド・デイ	9,900	331	3,276,900
キヤノン	492,000	3,945	1,940,940,000
リコー	238,000	1,181	281,078,000
日本電産コパル	6,600	1,382	9,121,200
日本電産サンキョー	19,000	654	12,426,000
シチズンホールディングス	87,900	510	44,829,000
リズム時計	46,000	134	6,164,000
SRIスポーツ	59	88,100	5,197,900
バンダイナムコHLDGS	92,400	807	74,566,800
フランスベッドHLDGS	61,000	103	6,283,000
パイロットコーポレーション	81	138,000	11,178,000
エイベックス・グループHD	15,300	1,205	18,436,500
トッパン・フォームズ	18,200	797	14,505,400
フジシールインターナショナル	8,500	1,744	14,824,000
タカラトミー	24,300	639	15,527,700
レック	3,600	1,270	4,572,000
アロン化成	10,000	360	3,600,000
プロネクサス	11,900	386	4,593,400
大建工業	37,000	205	7,585,000
きもと	8,700	682	5,933,400
凸版印刷	224,000	700	156,800,000
大日本印刷	241,000	1,054	254,014,000
共同印刷	33,000	181	5,973,000
日本写真印刷	14,900	1,837	27,371,300
藤森工業	6,800	1,050	7,140,000
前澤化成工業	8,700	684	5,950,800

アシックス	74,000	919	68,006,000
ツ ツ ミ	3,800	2,152	8,177,600
ジェイ エス ピー	6,000	1,102	6,612,000
ニ チ ハ	9,200	646	5,943,200
ローランド	8,300	899	7,461,700
エフピコ	4,100	4,375	17,937,500
小松ウオール工業	5,600	718	4,020,800
ヤマハ	64,000	983	62,912,000
河合楽器	39,000	166	6,474,000
クリナップ	9,700	494	4,791,800
ピジョン	5,900	2,804	16,543,600
天馬	8,400	869	7,299,600
パラマウントベッド	6,500	2,155	14,007,500
リンテック	16,800	1,955	32,844,000
信越ポリマー	17,700	456	8,071,200
東 リ	37,000	131	4,847,000
イトーキ	22,000	213	4,686,000
任 天 堂	45,300	22,730	1,029,669,000
三菱鉛筆	7,400	1,452	10,744,800
タカラスタンダ - ド	38,000	528	20,064,000
コ ク ヨ	42,000	643	27,006,000
ナカバヤシ	27,000	171	4,617,000
ニ フ コ	15,900	2,204	35,043,600
グローブライド	53,000	92	4,876,000
岡村製作所	32,000	467	14,944,000
日本バルカー	38,000	240	9,120,000
伊 藤 忠	544,300	776	422,376,800
丸 紅	682,000	543	370,326,000
スクロール	12,900	313	4,037,700
F & A アクアホールディングス	7,500	649	4,867,500
三陽商会	49,000	338	16,562,000
長瀬産業	43,000	934	40,162,000
蝶 理	65,000	96	6,240,000
豊田通商	87,600	1,359	119,048,400
オンワ - ドホールディングス	60,000	713	42,780,000
兼 松	196,000	72	14,112,000
美 津 濃	41,000	365	14,965,000
ファミリーマート	26,100	2,848	74,332,800
三井物産	674,600	1,307	881,702,200
日本紙パルプ	47,000	268	12,596,000
東京エレクトロン	62,200	5,250	326,550,000
日立ハイテクノロジーズ	23,900	1,769	42,279,100
カメイ	12,000	358	4,296,000
スターゼン	31,000	225	6,975,000
セイコーHD	43,000	297	12,771,000
山 善	33,200	374	12,416,800
住友商事	429,400	1,092	468,904,800
日本ユニシス	23,300	554	12,908,200
内田洋行	21,000	307	6,447,000
三菱商事	625,300	2,116	1,323,134,800
第一実業	24,000	284	6,816,000
キヤノンマーケティングJPN	26,400	1,178	31,099,200
西華産業	34,000	205	6,970,000
菱洋エレクトロ	11,300	814	9,198,200
ユアサ商事	103,000	77	7,931,000

神鋼商事	28,000	186	5,208,000
阪和興業	75,000	318	23,850,000
カナデン	12,000	471	5,652,000
菱電商事	17,000	461	7,837,000
ニプロ	15,700	1,635	25,669,500
フルサト工業	7,700	447	3,441,900
岩谷産業	92,000	238	21,896,000
すてきナイスグループ	40,000	169	6,760,000
昭光通商	47,000	124	5,828,000
兼松エレクトロニクス	6,700	796	5,333,200
三愛石油	20,000	365	7,300,000
稲畑産業	24,100	425	10,242,500
ゴ・ルドウイン	25,000	208	5,200,000
東京スタイル	34,000	605	20,570,000
ユニ・チャーム	45,400	3,270	148,458,000
デサント	28,000	417	11,676,000
東邦ホールディングス	23,900	1,044	24,951,600
サンゲツ	14,100	1,734	24,449,400
ミツウロコ	14,900	464	6,913,600
シナネン	20,000	325	6,500,000
伊藤忠エネクス	19,500	388	7,566,000
ザ・トーカイ	22,000	326	7,172,000
サンリオ	21,900	2,034	44,544,600
リョーサン	12,500	2,015	25,187,500
新光商事	7,900	634	5,008,600
トーヨー	21,000	291	6,111,000
三信電気	10,100	653	6,595,300
東陽テクニカ	11,500	791	9,096,500
モスフード サービス	10,200	1,470	14,994,000
加賀電子	8,200	940	7,708,000
三益半導体	7,000	820	5,740,000
木曽路	9,100	1,617	14,714,700
千趣会	15,200	482	7,326,400
ケーヨー	14,400	410	5,904,000
ユニハアー	10,200	1,049	10,699,800
上新電機	17,000	779	13,243,000
日本瓦斯	8,700	1,075	9,352,500
マルエツ	18,000	305	5,490,000
ロイヤルホールディングス	12,800	877	11,225,600
いなげや	9,000	861	7,749,000
島忠	15,100	1,664	25,126,400
チヨダ	10,400	979	10,181,600
ライフコーポレーション	5,300	1,210	6,413,000
カスミ	17,600	432	7,603,200
リンガーハット	6,900	961	6,630,900
AOKIホールディングス	7,600	1,322	10,047,200
オークワ	12,000	826	9,912,000
コメリ	10,600	1,744	18,486,400
青山商事	20,000	1,455	29,100,000
しまむら	8,000	7,640	61,120,000
CFSコーポレーション	10,000	404	4,040,000
高島屋	107,000	699	74,793,000
松屋	16,300	565	9,209,500
エイチ・ツー・オーテイリング	46,000	582	26,772,000
ニッセンHD	16,100	369	5,940,900

パルコ	20,900	694	14,504,600
丸井グループ	103,300	678	70,037,400
クレディセゾン	60,100	1,329	79,872,900
原信ナルスHLDGS	5,700	1,080	6,156,000
セディナ	84,100	142	11,942,200
ダイエー	38,600	323	12,467,800
イズミヤ	30,000	314	9,420,000
イオン	274,500	1,021	280,264,500
ユニー	64,400	757	48,750,800
イズミ	21,300	1,136	24,196,800
東武ストア	17,000	231	3,927,000
平和堂	16,100	1,008	16,228,800
フジ	9,200	1,602	14,738,400
ヤオコー	3,700	2,276	8,421,200
ゼビオ	9,500	1,688	16,036,000
ケーズホールディングス	17,900	2,179	39,004,100
Palta	5,100	1,564	7,976,400
新生銀行	423,000	73	30,879,000
あおぞら銀行	291,000	143	41,613,000
三菱UFJフィナンシャルG	5,913,600	396	2,341,785,600
りそなホールディングス	240,000	511	122,640,000
中央三井トラストHD	453,000	295	133,635,000
三井住友フィナンシャルG	591,200	2,569	1,518,792,800
第四銀行	101,000	239	24,139,000
北越銀行	89,000	153	13,617,000
西日本シティ銀行	264,000	231	60,984,000
札幌北洋ホール	116,000	347	40,252,000
千葉銀行	307,000	487	149,509,000
横浜銀行	534,000	405	216,270,000
常陽銀行	300,000	353	105,900,000
群馬銀行	178,000	418	74,404,000
武蔵野銀行	12,700	2,364	30,022,800
千葉興業銀行	15,700	429	6,735,300
筑波銀行	37,500	257	9,637,500
東京都民銀行	15,800	860	13,588,000
七十七銀行	130,000	399	51,870,000
青森銀行	66,000	212	13,992,000
秋田銀行	56,000	229	12,824,000
山形銀行	48,000	374	17,952,000
岩手銀行	5,400	3,735	20,169,000
東邦銀行	67,000	246	16,482,000
東北銀行	56,000	134	7,504,000
みちのく銀行	44,000	150	6,600,000
ふくおかフィナンシャルG	316,000	322	101,752,000
静岡銀行	241,000	704	169,664,000
十六銀行	93,000	243	22,599,000
スルガ銀行	82,000	717	58,794,000
八十二銀行	144,000	433	62,352,000
山梨中央銀行	49,000	344	16,856,000
大垣共立銀行	103,000	234	24,102,000
福井銀行	66,000	254	16,764,000
北國銀行	89,000	293	26,077,000
清水銀行	2,800	3,505	9,814,000
滋賀銀行	73,000	427	31,171,000
南都銀行	71,000	403	28,613,000

百五銀行	70,000	326	22,820,000
京都銀行	138,000	739	101,982,000
三重銀行	38,000	210	7,980,000
ほくほくフィナンシャルG	542,000	153	82,926,000
広島銀行	225,000	334	75,150,000
山陰合同銀行	47,000	553	25,991,000
中国銀行	63,000	951	59,913,000
鳥取銀行	31,000	173	5,363,000
伊予銀行	82,000	595	48,790,000
百十四銀行	91,000	303	27,573,000
四国銀行	56,000	241	13,496,000
阿波銀行	64,000	505	32,320,000
鹿児島銀行	50,000	510	25,500,000
大分銀行	52,000	284	14,768,000
宮崎銀行	54,000	202	10,908,000
肥後銀行	60,000	395	23,700,000
佐賀銀行	49,000	210	10,290,000
十八銀行	52,000	221	11,492,000
沖縄銀行	6,000	3,295	19,770,000
琉球銀行	16,600	933	15,487,800
住友信託	702,000	444	311,688,000
みずほ信託銀行	771,000	75	57,825,000
八千代銀行	4,400	1,860	8,184,000
みずほフィナンシャルG	9,522,000	133	1,266,426,000
紀陽ホールディングス	301,000	109	32,809,000
山口フィナンシャルG	77,000	746	57,442,000
芙蓉総合リース	7,600	2,457	18,673,200
興銀リース	11,300	1,944	21,967,200
東京センチュリーリース	18,500	1,236	22,866,000
SBIホールディングス	9,393	11,400	107,080,200
日本証券金融	34,600	553	19,133,800
大阪証券金融	21,600	158	3,412,800
長野銀行	39,000	158	6,162,000
名古屋銀行	73,000	239	17,447,000
愛知銀行	2,700	4,815	13,000,500
第三銀行	50,000	209	10,450,000
中京銀行	33,000	211	6,963,000
東日本銀行	42,000	151	6,342,000
愛媛銀行	50,000	217	10,850,000
トマト銀行	42,000	148	6,216,000
みなと銀行	82,000	133	10,906,000
京葉銀行	62,000	392	24,304,000
関西アーバン銀行	112,000	125	14,000,000
栃木銀行	40,000	403	16,120,000
北日本銀行	3,100	1,910	5,921,000
東和銀行	93,000	75	6,975,000
福島銀行	130,000	46	5,980,000
リコーリース	5,800	2,150	12,470,000
イオン クレジットサービス	35,600	1,080	38,448,000
アコム	16,700	979	16,349,300
プロミス	41,650	471	19,617,150
ジャックス	55,000	186	10,230,000
日立キャピタル	19,000	1,143	21,717,000
オリックス	40,620	7,150	290,433,000
三菱UFJリース	19,860	3,060	60,771,600



ジャフコ	11,400	2,006	22,868,400
トモニホールディングス	62,700	290	18,183,000
大和証券G本社	772,000	380	293,360,000
野村ホールディングス	1,646,200	482	793,468,400
みずほ証券	200,000	196	39,200,000
みずほインベストアズ証	184,000	78	14,352,000
岡三証券グループ	70,000	296	20,720,000
丸三証券	28,200	475	13,395,000
東洋証券	47,000	129	6,063,000
東海東京HD	90,000	307	27,630,000
水戸証券	32,000	134	4,288,000
いちよし証券	20,200	548	11,069,600
松井証券	48,800	522	25,473,600
NK S Jホールディングス	654,000	560	366,240,000
マネックスG	506	22,320	11,293,920
カブドットコム証券	35,700	317	11,316,900
極東証券	11,900	659	7,842,100
岩井コスモホールディング	9,100	530	4,823,000
フィデアホール	47,700	182	8,681,400
池田泉州HD	223,400	114	25,467,600
MS & AD	233,600	1,919	448,278,400
SONY FH	371	302,500	112,227,500
第一生命	3,127	120,200	375,865,400
富士火災	77,000	110	8,470,000
東京海上HD	296,000	2,367	700,632,000
T & Dホールディングス	143,100	1,901	272,033,100
三井不動産	369,000	1,482	546,858,000
三菱地所	547,000	1,412	772,364,000
平和不動産	66,000	226	14,916,000
東京建物	162,000	329	53,298,000
ダイビル	24,200	629	15,221,800
サンケイビル	17,100	453	7,746,300
東急不動産	160,000	375	60,000,000
京阪神不動産	12,700	361	4,584,700
住友不動産	188,000	1,802	338,776,000
東宝不動産	9,900	489	4,841,100
大京	137,000	143	19,591,000
テーオーシー	32,400	351	11,372,400
東京楽天地	18,000	297	5,346,000
レオパレス21	55,000	151	8,305,000
空港施設	12,200	326	3,977,200
住友不動産販売	3,040	3,630	11,035,200
ゴールドクレスト	7,430	1,791	13,307,130
東栄住宅	6,500	1,009	6,558,500
東急リバブル	9,200	953	8,767,600
飯田産業	6,600	799	5,273,400
アーネストワン	14,900	927	13,812,300
タカラレーベン	8,800	569	5,007,200
イオンモール	35,800	1,861	66,623,800
リサ・パートナーズ	144	35,700	5,140,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	577	73,600	42,467,200
東武鉄道	338,000	455	153,790,000
相鉄ホールディングス	124,000	259	32,116,000
東京急行	434,000	370	160,580,000
京浜急行	202,000	736	148,672,000

小田急電鉄	253,000	763	193,039,000
京王電鉄	206,000	566	116,596,000
京成電鉄	130,000	549	71,370,000
富士急行	25,000	416	10,400,000
新京成電鉄	19,000	347	6,593,000
東日本旅客鉄道	137,400	5,000	687,000,000
西日本旅客鉄道	736	293,300	215,868,800
東海旅客鉄道	685	646,000	442,510,000
アートコーポレーション	2,500	1,232	3,080,000
西日本鉄道	102,000	349	35,598,000
ハマキョウレックス	2,700	2,098	5,664,600
近畿鉄道	709,000	250	177,250,000
阪急阪神HLDGS	527,000	380	200,260,000
南海電鉄	164,000	337	55,268,000
京阪電鉄	176,000	337	59,312,000
名古屋鉄道	275,000	220	60,500,000
日本通運	315,000	334	105,210,000
ヤマトホールディングス	161,600	1,059	171,134,400
山九	96,000	330	31,680,000
日新	37,000	206	7,622,000
丸全昭和運輸	30,000	251	7,530,000
センコー	35,000	241	8,435,000
日本梱包運輸	24,000	897	21,528,000
福山通運	55,000	410	22,550,000
セイノーホールディングス	62,000	525	32,550,000
神奈川中央交通	14,000	403	5,642,000
日立物流	13,700	1,221	16,727,700
日本郵船	669,000	365	244,185,000
商船三井	386,000	575	221,950,000
川崎汽船	247,000	349	86,203,000
NSユニテッド海運	33,000	208	6,864,000
乾汽船	11,800	499	5,888,200
飯野海運	40,300	365	14,709,500
第一中央汽船	56,000	213	11,928,000
全日本空輸	1,056,000	296	312,576,000
三菱倉庫	57,000	1,061	60,477,000
三井倉庫	39,000	317	12,363,000
住友倉庫	59,000	430	25,370,000
渋沢倉庫	24,000	285	6,840,000
ヤマタネ	53,000	103	5,459,000
東陽倉庫	29,000	174	5,046,000
日本トランスシティ	21,000	261	5,481,000
安田倉庫	10,100	473	4,777,300
東洋埠頭	38,000	134	5,092,000
上組	87,000	645	56,115,000
郵船ロジスティクス	7,200	1,070	7,704,000
近鉄エクスプレス	7,400	2,139	15,828,600
バンテック	40	113,500	4,540,000
東京放送HD	42,500	1,080	45,900,000
日本テレビ放送網	6,810	11,010	74,978,100
テレビ朝日	202	116,400	23,512,800
スカパーJSATHD	633	28,190	17,844,270
テレビ東京HD	3,700	1,182	4,373,400
アイ・ティー・シーネットワーク	18,700	415	7,760,500
イー・アクセス	433	48,000	20,784,000

NECモバイリング	2,800	2,160	6,048,000
日本電信電話	333,200	3,790	1,262,828,000
KDDI	1,216	478,500	581,856,000
光通信	10,400	1,779	18,501,600
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,456	135,800	876,724,800
GMOインターネット	25,100	335	8,408,500
学研ホールディングス	44,000	162	7,128,000
ゼンリン	12,300	872	10,725,600
昭文社	7,400	577	4,269,800
角川グループHLDGS	7,700	2,040	15,708,000
東京電力	582,900	1,950	1,136,655,000
中部電力	243,300	1,978	481,247,400
関西電力	322,300	2,013	648,789,900
中国電力	109,100	1,667	181,869,700
北陸電力	81,100	2,024	164,146,400
東北電力	196,700	1,822	358,387,400
四国電力	80,100	2,435	195,043,500
九州電力	173,700	1,856	322,387,200
北海道電力	74,200	1,658	123,023,600
沖縄電力	5,100	3,805	19,405,500
電源開発	49,100	2,554	125,401,400
東京瓦斯	989,000	365	360,985,000
大阪瓦斯	797,000	313	249,461,000
東邦瓦斯	207,000	396	81,972,000
北海道瓦斯	31,000	240	7,440,000
西部瓦斯	97,000	204	19,788,000
静岡瓦斯	24,000	450	10,800,000
松竹	50,000	509	25,450,000
東宝	51,800	1,228	63,610,400
エイチ・アイ・エス	8,800	1,676	14,748,800
東映	35,000	358	12,530,000
NTTデータ	552	271,300	149,757,600
共立メンテナンス	4,700	1,154	5,423,800
建設技術研究所	8,000	445	3,560,000
アインファーマシーズ	2,800	2,842	7,957,600
東京テアトル	52,000	113	5,876,000
よみうりランド	24,000	281	6,744,000
東京都競馬	68,000	122	8,296,000
常磐興産	45,000	118	5,310,000
カナモト	13,000	443	5,759,000
東京ドーム	68,000	215	14,620,000
DTS	8,500	940	7,990,000
スクウェア・エニックス・HD	25,700	1,601	41,145,700
カプコン	17,200	1,277	21,964,400
日本空港ビルデング	25,100	1,233	30,948,300
トランス・コスモス	11,900	721	8,579,900
乃村工藝社	21,000	251	5,271,000
住商情報システム	8,700	1,220	10,614,000
藤田観光	24,000	382	9,168,000
日本管財	4,000	1,303	5,212,000
セコム	86,000	3,725	320,350,000
CSK	31,500	343	10,804,500
アイネス	12,600	511	6,438,600
メイテック	12,800	1,879	24,051,200
TKC	6,300	1,591	10,023,300

アサツー ディ・ケイ	13,700	2,067	28,317,900
富士ソフト	11,100	1,228	13,630,800
応用地質	9,300	648	6,026,400
NSD	16,100	864	13,910,400
コナミ	35,700	1,563	55,799,100
ベネッセホールディングス	26,000	3,830	99,580,000
イオンディライト	9,600	1,505	14,448,000
ニチイ学館	15,600	700	10,920,000
ダイセキ	12,900	1,571	20,265,900
日鐵商事	17,000	239	4,063,000
元気寿司	5,000	806	4,030,000
トラスコ中山	11,100	1,303	14,463,300
ヤマダ電機	35,420	5,320	188,434,400
オートバックスセブン	10,000	3,020	30,200,000
アークランドサカモト	5,000	918	4,590,000
ニトリホールディングス	15,250	7,370	112,392,500
グルメ杵屋	12,000	416	4,992,000
愛眼	9,000	442	3,978,000
吉野家ホールディングス	212	98,900	20,966,800
加藤産業	11,600	1,268	14,708,800
イエローハット	8,400	806	6,770,400
富士エレクトロニクス	5,100	1,104	5,630,400
松屋フーズ	4,000	1,280	5,120,000
JBCホールディングス	10,100	496	5,009,600
サガミチェーン	12,000	502	6,024,000
日伝	3,500	2,355	8,242,500
因幡電機産業	9,200	2,070	19,044,000
住金物産	42,000	176	7,392,000
プレナス	9,600	1,209	11,606,400
ミニストップ	6,500	1,224	7,956,000
アークス	10,300	1,148	11,824,400
パロー	16,300	641	10,448,300
ミスミグループ本社	26,500	1,894	50,191,000
ベルク	4,800	866	4,156,800
大庄	5,000	957	4,785,000
タキヒヨー	19,000	376	7,144,000
ファーストリテイリング	18,200	13,240	240,968,000
ソフトバンク	346,300	2,900	1,004,270,000
スズケン	32,200	2,445	78,729,000
サンドラッグ	14,700	2,275	33,442,500
ベルーナ	10,650	396	4,217,400
合計	119,215,496		91,225,627,750

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

トヨタ自動車 135,000株

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成22年12月30日

資産総額	645,116,072円	
負債総額	269,755円	
純資産総額（ - ）	644,846,317円	
発行済数量	1,116,703,540口	
1単位当たり純資産額（ / ）		0.5775円

(参考)トピックス・インデックス・マザーファンド  
純資産額計算書

平成22年12月30日

資産総額	97,039,493,063円	
負債総額	357,189,887円	
純資産総額（ - ）	96,682,303,176円	
発行済数量	200,531,326,611口	
1単位当たり純資産額（ / ）		0.4821円

#### 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成22年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

## ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成22年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	10	29,262
追加型株式投資信託	357	6,869,733
株式投資信託 合計	367	6,898,995
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,933,442
公社債投資信託 合計	17	2,933,442
総合計	384	9,832,438



## 3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

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

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

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,961,462	4,783,803
有価証券	28,233,112	26,970,072
前払金	453	136
前払費用	84,549	77,248
未収入金	20,722	3,858
未収消費税等	27,138	-
未収委託者報酬	5,273,080	7,030,430
未収収益	25,476	90,787
貯蔵品	38,909	30,324
繰延税金資産	227,536	566,334
その他	2,030	256,955
流動資産計	37,894,473	39,809,953
固定資産		
有形固定資産	1,252,162	1,186,818
建物（純額）	349,484	318,162
器具備品（純額）	900,893	757,333

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

（単位：千円）

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

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

## 重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	(1) 子会社及び関連会社株式 移動平均法による原価法によ り計上しております。 (2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく 時価法（評価差額は全部純資産 直入法により処理し、売却原価 は移動平均法により算定）を採 用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採 用しております。	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左
2. デリバティブの評価 基準及び評価方法	時価法により計上しておりま す。	同左
3. 固定資産の減価償却 の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 （リース資産を除く） 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通 りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアに ついては、社内における利用可能 期間（5年）に基づいておりま す。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。	(1) 有形固定資産及び投資不動産 （リース資産を除く） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 同左 (3) 長期前払費用 同左
4. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、 一般債権については貸倒実績率法 により、貸倒懸念債権及び破産更 生債権等については財務内容評価 法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与 の支給に備えるため、支給見込額 を計上しております。	(1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 同左



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

## 会計方針の変更

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

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

## 追加情報

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

## 注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成21年3月31日現在）	当事業年度 （平成22年3月31日現在）																
<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table data-bbox="215 1601 638 1736"> <tr><td>建物</td><td>776,838千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>1,691,069千円</td></tr> <tr><td>投資建物</td><td>675,647千円</td></tr> <tr><td>投資器具備品</td><td>26,929千円</td></tr> </table> <p>2 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 1,848,998千円</p> <p>3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して保証を行っております。</p>	建物	776,838千円	器具備品	1,691,069千円	投資建物	675,647千円	投資器具備品	26,929千円	<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table data-bbox="877 1601 1300 1736"> <tr><td>建物</td><td>815,365千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>1,938,369千円</td></tr> <tr><td>投資建物</td><td>688,305千円</td></tr> <tr><td>投資器具備品</td><td>27,339千円</td></tr> </table> <p>2 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 3,002,391千円</p> <p>3 同左</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。</p>	建物	815,365千円	器具備品	1,938,369千円	投資建物	688,305千円	投資器具備品	27,339千円
建物	776,838千円																
器具備品	1,691,069千円																
投資建物	675,647千円																
投資器具備品	26,929千円																
建物	815,365千円																
器具備品	1,938,369千円																
投資建物	688,305千円																
投資器具備品	27,339千円																

## （損益計算書関係）

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

効力発生日

平成22年 6 月28日

## （リース取引関係）

前事業年度 （自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日）	当事業年度 （自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）																										
<p>（借主側） リース取引開始日が平成20年 3 月31日以前の 所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額 相当額及び期末残高相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td></td> <td style="text-align: center;">器具備品</td> </tr> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">4,599千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">3,613千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残 高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低 いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>(2)未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td>1年以内</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過 リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に 占める割合が低いため、支払利子込み法により算 定しております。</p> <p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">1,314千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">1,314千円</td> </tr> </table> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法</p> <p>リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とす る定額法によっております。</p>		器具備品	取得価額相当額	4,599千円	減価償却累計額相当額	3,613千円	<hr/>		期末残高相当額	985千円	1年以内	985千円	1年超	- 千円	<hr/>		合計	985千円	支払リース料	1,314千円	減価償却費相当額	1,314千円	<p>（借主側） リース取引開始日が平成20年 3 月31日以前の所 有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額 相当額及び期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>(2)未経過リース料期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法</p> <p style="text-align: center;">同左</p>	支払リース料	985千円	減価償却費相当額	985千円
	器具備品																										
取得価額相当額	4,599千円																										
減価償却累計額相当額	3,613千円																										
<hr/>																											
期末残高相当額	985千円																										
1年以内	985千円																										
1年超	- 千円																										
<hr/>																											
合計	985千円																										
支払リース料	1,314千円																										
減価償却費相当額	1,314千円																										
支払リース料	985千円																										
減価償却費相当額	985千円																										

## （金融商品関係）

当事業年度（自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

##### ( ) デリバティブ取引

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

#### 信用リスクの管理

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

### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2.金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

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

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

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、( )で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### 資産

##### (1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

##### (3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

#### 負債

##### (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

#### デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	

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

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（\*1）外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

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

（追加情報）

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

（有価証券関係）

前事業年度（平成21年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

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



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

## 2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

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

## 3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

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

## 4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

	1年以内(千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超(千円)
その他 証券投資信託の 受益証券	-	376,553	1,729,191	-
合計	-	376,553	1,729,191	-

当事業年度(平成22年3月31日現在)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(貸借対照表計上額 737,012千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1)株式	76,077	55,101	20,975

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

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,172,137千円）、外貨建資産担保債券（貸借対照表計上額（貸倒引当金控除前）1,804,069千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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

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

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

#### 1. 取引の状況に関する事項

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

#### 2. 取引の時価等に関する事項（平成21年3月31日現在）

## 通貨関連

（単位：千

円）

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

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

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

## 通貨関連

（単位：千円）

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

## 株式関連

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

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

## (税効果会計関係)

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

<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 (調整) 40.69%</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 0.35</p> <p>受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.13</p> <p>住民税均等割 0.03</p> <p>評価性引当額 2.32</p> <p>その他 0.74</p> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 42.52</p>	<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>
---	---

## ( 関連当事者情報 )

前事業年度 ( 自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日 )

## ( 追加情報 )

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

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の子会社

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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

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

## 2. 親会社に関する注記

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

### (1 株当たり情報)

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

### (重要な後発事象)

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

[次へ](#)

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成22年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		6,449,461
有価証券		15,679,929
未収委託者報酬		6,749,851
貯蔵品		31,123
繰延税金資産		149,110
その他		499,217
流動資産計		29,558,694
固定資産		
有形固定資産	1	1,027,173
無形固定資産		2,186,747
投資その他の資産		
投資有価証券		10,171,248
その他	1	1,364,720
貸倒引当金		4,750
投資その他の資産合計		11,531,218
固定資産計		14,745,139
資産合計		44,303,833

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成22年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,238,233
未払法人税等		667,986
賞与引当金		202,000
その他	3	2,493,174
流動負債計		8,601,395
固定負債		
繰延税金負債		1,933,977
退職給付引当金		1,282,101
役員退職慰労引当金		44,910
固定負債計		3,260,989
負債合計		11,862,385
純資産の部		



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

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

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

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

	当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部 純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算 定）を採用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。
2. 固定資産の減価償却 の方法	(2) デリバティブ 時価法により計上しております。 (1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利 用可能期間（5年）に基づいております。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。
3. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実 績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財 務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見 込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく 当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社 の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、 能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が 確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づ く当中間会計期間末要支給額を計上しております。 (4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程 に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p>

## 会計方針の変更

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

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

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

## (中間損益計算書関係)

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

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### （1）金融商品に対する取組方針

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

##### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

### （3）金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### （ ）為替変動リスクの管理

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

##### （ ）価格変動リスクの管理

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

##### （ ）デリバティブ取引

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

#### 信用リスクの管理

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

### （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2．金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

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

(\*1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、( )で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### 資 産

##### (1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

##### (3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

#### 負 債

##### 未払金

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

#### デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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



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

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

#### 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額737,012千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

#### 2. その他有価証券

	中間貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
(1) 株式	57,359	55,101	2,257
(2) その他 証券投資信託の受益証券	4,413,951	4,074,189	339,762
小計	4,471,310	4,129,291	342,019
中間貸借対照表計上額が取 得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託の受益証券	19,470,717	20,244,591	773,874
小計	19,470,717	20,244,591	773,874
合計	23,942,028	24,373,883	431,854

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額1,172,137千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含まれておりません。

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当する取引はありません。

### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

株式関連

（単位：千円）

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

（セグメント情報等）

#### [ セグメント情報 ]

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

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

#### [ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

#### 1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

#### 2. 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

##### （2）有形固定資産

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

#### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

ん。

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

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

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

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

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

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

該当事項はありません。

## ( 追加情報 )

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

## ( 1 株当たり情報 )

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

## ( 重要な後発事象 )

該当事項はありません。

## （追加情報）

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

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

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

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

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成22年3月末日現在）

事業の内容

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

#### (2) 販売会社

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成22年3月末日現在）

事業の内容

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

### 2 【関係業務の概要】

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

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

### 3 【資本関係】

該当ありません。

#### <再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成22年3月末日現在）

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

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

### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

平成23年1月7日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金ダイワ日本株式インデックスの平成21年12月1日から平成22年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの平成22年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以 上

---

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月17日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

## 独立監査人の監査報告書

平成22年1月15日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金ダイワ日本株式インデックスの平成20年12月2日から平成21年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの平成21年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽 一 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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