

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成24年2月22日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 石橋 俊朗

【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

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

【電話番号】 03-5695-2111

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】 年金ダイワ日本株式インデックス

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 継続申込期間（平成24年2月23日から平成25年2月21日まで）
5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

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24年2月23日から平成25年2月21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^(注)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：

$$\text{毎日の指数} = \text{当日の時価総額} \div \text{基準時の時価総額} \times 100$$

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

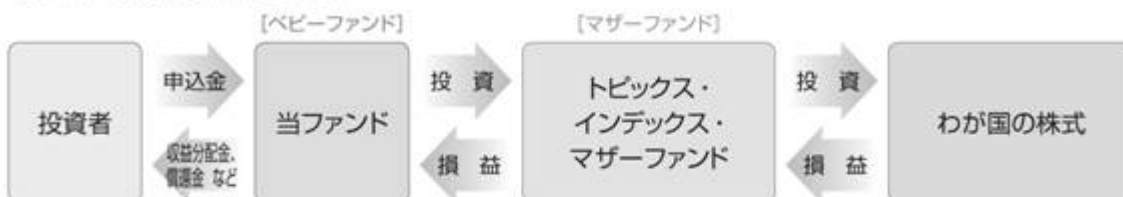
$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

- 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、ノウハウ及び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並びに特定日のTOPIXの指数値について、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、(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。
- ⑥ (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負わない。
- ⑦ (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。
- ⑧ 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いません。

ファミリーファンド方式とは、投資者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時、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、ファンドの特色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いません。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
1	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>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</p>
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
運用指図 2	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（2）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>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</p>
受託会社	住友信託銀行株式会社（4） 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
	<p>信託契約（2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>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</p>
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ないます。）

（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。
- 4：関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。
- 委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（平成23年12月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

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

・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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。
- 二．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。）
 - ハ．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

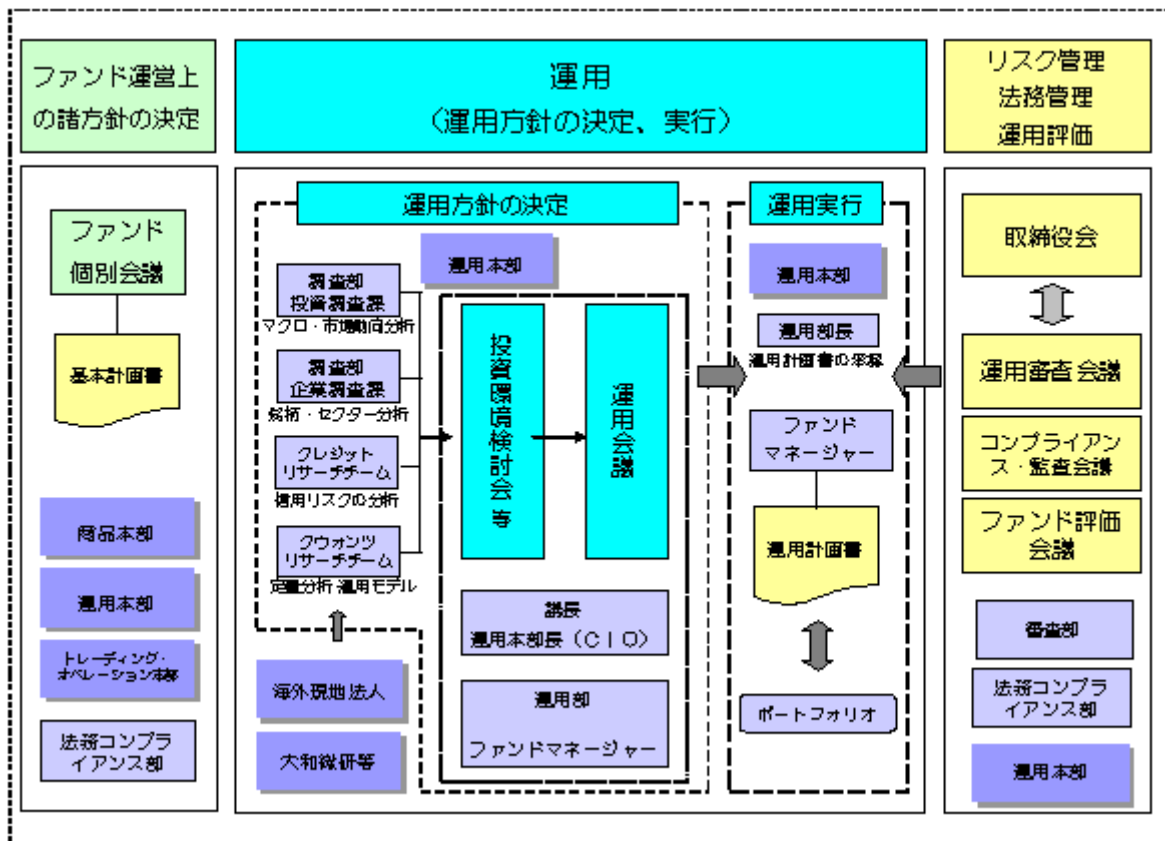
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 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）

C I O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

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、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取っています。

上記の運用体制は平成23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、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者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

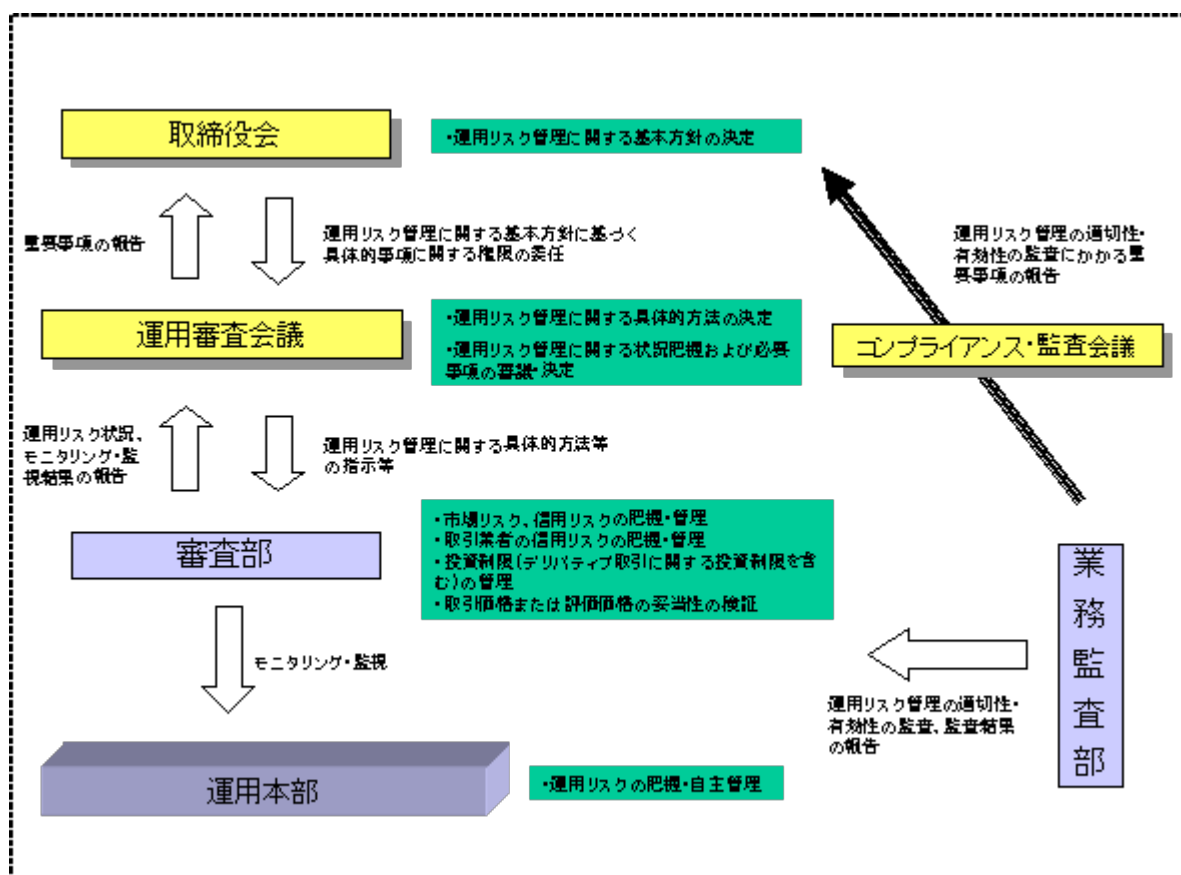
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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合わせる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な費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

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

（ ）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

信託財産に関する租税、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せん。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、配当所得として課税され、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25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%）
平成26年1月1日から	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）

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25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

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

投資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。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資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、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資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。

投資者が元本払戻金（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元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資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。

投資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投資者の個別元本と同額の場合または当該投資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投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（ ）上記は、平成23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23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	719,652,737	99.98
内 日本	719,652,737	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	118,278	0.02
純資産総額	719,771,015	100.00

(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。

(2) 【投資資産】（平成23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

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	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	1,797,783,507 718,074,632	0.3994	0.4003 719,652,737	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。

ハ．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。

(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)

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
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
平成22年12月末日	644,846,317	-	0.5775	-
平成23年1月末日	669,240,796	-	0.5847	-
2月末日	699,103,580	-	0.6113	-
3月末日	682,838,531	-	0.5641	-
4月末日	668,614,917	-	0.5531	-
5月末日	691,784,899	-	0.5445	-
6月末日	717,976,259	-	0.5518	-
7月末日	726,702,559	-	0.5462	-
8月末日	686,230,572	-	0.5007	-
9月末日	702,031,689	-	0.4996	-
10月末日	719,566,537	-	0.5010	-
第5計算期間末 (平成23年11月30日)	701,141,147	701,141,147	0.4777	0.4777
12月末日	719,771,015	-	0.4786	-

【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
第5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
第5計算期間	13.6

(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
第5計算期間	464,858,243	53,854,727

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成23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(%)
株式	80,421,475,960	97.15
内 日本	80,421,475,960	97.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,361,795,934	2.85
純資産総額	82,783,271,894	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）	2,446,080,000	2.95
内 日本	2,446,080,000	2.95

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

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

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

(2) 投資資産（平成23年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

	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 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,039,400	2,683.71 2,789,456,540	2,565.00 2,666,061,000	3.22
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,036,200	335.26 2,023,744,060	327.00 1,973,837,400	2.38
3	キヤノン	日本	株式	電気機器	501,700	3,383.08 1,697,295,177	3,410.00 1,710,797,000	2.07
4	本田技研	日本	株式	輸送用機器	682,500	2,372.63 1,619,322,245	2,348.00 1,602,510,000	1.94
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	367,000	3,763.51 1,381,210,000	3,935.00 1,444,145,000	1.74
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	603,300	2,123.02 1,280,821,291	2,144.00 1,293,475,200	1.56

7	武田薬品	日本	株式	医薬品	316,900	3,661.21 1,160,239,501	3,380.00 1,071,122,000	1.29
8	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	10,220,800	112.83 1,153,303,062	104.00 1,062,963,200	1.28
9	ファナック	日本	株式	電気機器	84,200	11,147.00 938,577,975	11,780.00 991,876,000	1.20
10	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	6,572	146,324.88 961,647,167	141,500.00 929,938,000	1.12
11	三菱商事	日本	株式	卸売業	580,900	1,740.48 1,011,048,602	1,555.00 903,299,500	1.09
12	三井物産	日本	株式	卸売業	687,600	1,275.85 877,277,002	1,197.00 823,057,200	0.99
13	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	362,700	2,705.09 981,138,647	2,267.00 822,240,900	0.99
14	日立	日本	株式	電気機器	1,814,000	390.57 708,503,400	404.00 732,856,000	0.89
15	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	2,000	369,674.01 739,348,021	362,000.00 724,000,000	0.87
16	小松製作所	日本	株式	機械	401,900	1,733.42 696,661,950	1,799.00 723,018,100	0.87
17	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	332,900	2,150.37 715,859,712	2,145.00 714,070,500	0.86
18	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	1,018,700	665.68 678,138,112	692.00 704,940,400	0.85
19	ソニー	日本	株式	電気機器	506,300	1,530.96 775,128,200	1,382.00 699,706,600	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	140,500	4,556.48 640,186,300	4,900.00 688,450,000	0.83
21	三菱地所	日本	株式	不動産業	559,000	1,237.10 691,541,600	1,150.00 642,850,000	0.78
22	K D D I	日本	株式	情報・通信業	1,244	623,918.01 776,154,011	495,000.00 615,780,000	0.74
23	パナソニック	日本	株式	電気機器	926,700	752.65 697,488,996	654.00 606,061,800	0.73
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	808,000	685.59 553,959,610	738.00 596,304,000	0.72
25	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	187,400	2,893.01 542,151,644	3,130.00 586,562,000	0.71
26	信越化学	日本	株式	化学	151,500	3,907.91 592,049,500	3,790.00 574,185,000	0.69
27	東芝	日本	株式	電気機器	1,706,000	323.77 552,360,000	315.00 537,390,000	0.65
28	国際石油開発帝石	日本	株式	鉱業	1,101	507,515.36 558,774,416	485,000.00 533,985,000	0.65
29	東京海上HD	日本	株式	保険業	303,000	1,906.64 577,712,190	1,705.00 516,615,000	0.62
30	伊藤忠	日本	株式	卸売業	634,400	815.44 517,319,500	782.00 496,100,800	0.60

(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	97.15%
合計	97.15%

(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	0.12%
鉱業	0.73%
建設業	2.34%
食料品	3.61%
繊維製品	0.94%
パルプ・紙	0.41%
化学	5.92%
医薬品	5.02%
石油・石炭製品	0.88%
ゴム製品	0.76%
ガラス・土石製品	1.15%
鉄鋼	1.82%
非鉄金属	1.13%
金属製品	0.67%
機械	4.90%
電気機器	13.37%
輸送用機器	9.26%
精密機器	1.33%
その他製品	1.62%
電気・ガス業	3.15%
陸運業	4.11%
海運業	0.39%
空運業	0.29%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.58%
卸売業	5.27%
小売業	4.28%
銀行業	9.05%
証券、商品先物取引業	0.93%
保険業	2.09%
その他金融業	0.77%
不動産業	2.12%
サービス業	1.90%
合計	97.15%

(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 2012年3月	買建	336	2,473,335,6552	446,080,000	2.95%

(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。

[次へ](#)

（参考情報）

2011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	4,786円
純資産総額	7.1億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	-4.2%
6カ月間	-13.3%
1年間	-17.1%
3年間	-10.2%
5年間	-52.7%
設定来	-52.1%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 07年11月	第2期 08年12月	第3期 09年11月	第4期 10年11月	第5期 11年11月				
分配金	0円	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。

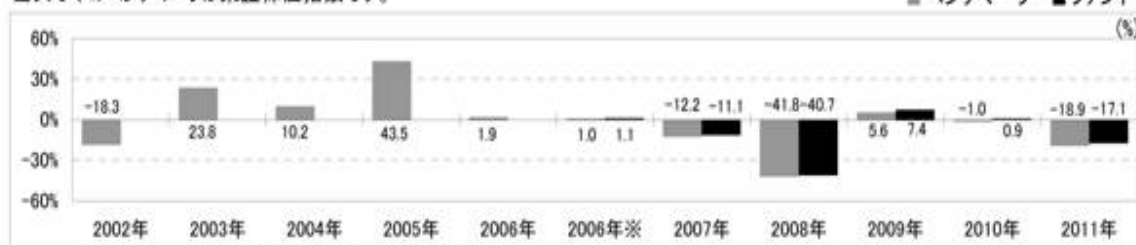
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,300	97.1%	電気機器	13.4%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.2%
国内株式先物	1	3.0%	輸送用機器	9.3%	TOPIX先物 2403月	-	3.0%
不動産投資信託等	-	-	銀行業	9.0%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.4%
コール・ローン、その他	-	2.9%	情報・通信業	6.6%	キヤノン	電気機器	2.1%
合計	1,301	-	化学	5.9%	本田技研	輸送用機器	1.9%
株式 市場・上場別構成			卸売業	5.3%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
一部(東証・大証・名証)		97.1%	医薬品	5.0%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.6%
二部(東証・大証・名証)		-	機械	4.9%	武田薬品	医薬品	1.3%
新興市場他		-	小売業	4.3%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.3%
その他		-	その他	33.5%	ファナック	電気機器	1.2%
合計		97.1%	合計	97.1%	合計		19.6%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■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、2011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。

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ないません。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ないません。

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。

・お電話によるお問い合わせ先（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るべき旨を請求することができます。

運用報告書

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

公告

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

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）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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）及び第5期計算期間（平成22年12月1日から平成23年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【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4期 平成22年11月30日現在	第5期 平成23年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	631,463	849,747
親投資信託受益証券	583,800,903	701,019,557
未収入金	40,000	-
流動資産合計	584,472,366	701,869,304
資産合計	584,472,366	701,869,304
負債の部		
流動負債		
未払解約金	51,265	94,201
未払受託者報酬	83,140	108,682
未払委託者報酬	388,128	507,258
その他未払費用	13,767	18,016
流動負債合計	536,300	728,157
負債合計	536,300	728,157
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 1,056,648,545	¹ 1,467,652,061
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 472,712,479	² 766,510,914
（分配準備積立金）	254	254
元本等合計	583,936,066	701,141,147
純資産合計	583,936,066	701,141,147
負債純資産合計	584,472,366	701,869,304

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期	第5期
	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
営業収益		
受取利息	167	258
有価証券売買等損益	14,333,830	103,421,346
営業収益合計	14,333,997	103,421,088
営業費用		
受託者報酬	155,716	212,958
委託者報酬	726,985	994,049
その他費用	25,796	35,314
営業費用合計	908,497	1,242,321
営業利益又は営業損失（ ）	13,425,500	104,663,409
経常利益又は経常損失（ ）	13,425,500	104,663,409
当期純利益又は当期純損失（ ）	13,425,500	104,663,409
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	709,910	1,133,105
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	321,776,227	472,712,479
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,346,835	24,032,589
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,346,835	24,032,589
剰余金減少額又は欠損金増加額	174,998,677	214,300,720
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	174,998,677	214,300,720
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	472,712,479	766,510,914

(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4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第5期 自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
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

(貸借対照表に関する注記)

区分	第4期 平成22年11月30日現在	第5期 平成23年11月30日現在
1. 1 期首元本額	683,406,145円	1,056,648,545円
期中追加設定元本額	397,758,878円	464,858,243円
期中一部解約元本額	24,516,478円	53,854,727円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,056,648,545口	1,467,652,061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472,712,479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766,510,914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4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第5期 自 平成22年12月1日 至 平成23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（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）であります。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（0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（172円）及び分配準備積立金（254円）より分配対象額は426円（1万口当たり0.00円）であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第5期 自 平成22年12月1日 至 平成23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。	同左
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。	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。	同左
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。	同左

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	第5期 平成23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。	同左
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)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。	(1)有価証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

(追加情報)

第4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第5期 自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
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。	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第4期 平成22年11月30日現在	第5期 平成23年11月30日現在
	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	13,819,346	102,512,646
合計	13,819,346	102,512,646

（デリバティブ取引に関する注記）

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	第5期 平成23年11月30日現在
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第5期 自 平成22年12月1日 至 平成23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4期 平成22年11月30日現在	第5期 平成23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）	0.5526円 (5,526円)	0.4777円 (4,777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	1,754,742,321	701,019,557	
親投資信託受益証券 合計		1,754,742,321	701,019,557	
合計		1,754,742,321	701,019,557	

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22年11月30日現在		平成23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		1,818,834,278		2,107,306,890
株式	3	91,225,627,750		79,663,342,555
派生商品評価勘定		61,166,178		2,047,829
未収入金		443,587		13,351,015
未収配当金		504,038,275		579,288,117
前払金		-		36,454,000
流動資産合計		93,610,110,068		82,401,790,406
資産合計		93,610,110,068		82,401,790,406
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		2,494,511		41,550,352
前受金		91,911,000		-
未払金		-		407,856,227
未払解約金		387,775,000		38,200,000
流動負債合計		482,180,511		487,606,579
負債合計		482,180,511		487,606,579
純資産の部				
元本等				
元本	1	201,865,410,927		205,035,658,182
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	108,737,481,370		123,121,474,355
元本等合計		93,127,929,557		81,914,183,827
純資産合計		93,127,929,557		81,914,183,827
負債純資産合計		93,610,110,068		82,401,790,406

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21年12月1日 至平成22年11月30日	自平成22年12月1日 至平成23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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	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22年11月30日現在	平成23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	198,496,539,943円	201,865,410,927円
同期中における追加設定元本額	18,482,977,114円	19,572,419,561円
同期中における一部解約元本額	15,114,106,130円	16,402,172,306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	1,827,977,064円	2,166,113,764円
トピックス・インデックスファンド	11,355,152,914円	10,515,654,250円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	37,540,919,907円	34,848,763,098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	1,053,248,340円	874,956,562円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	408,819,017円	413,145,012円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	6,624,272,198円	6,729,476,076円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	406,311,668円	395,488,289円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	8,944,337,173円	8,787,991,571円
DCダイワ日本株式インデックス	55,387,545,369円	60,508,521,981円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,870,711,058円	2,413,289,209円
ダイワ・ライフ・バランス50	217,055,087円	1,001,092,232円
ダイワ・ライフ・バランス70	181,688,938円	763,040,454円
年金ダイワ日本株式インデックス	1,265,555,828円	1,754,742,321円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	16,553,954円	18,469,036円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	14,675,588円	19,012,899円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	919,041円	1,548,073円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	500,282,197円	479,797,970円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,473,643,223円	3,619,442,756円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	2,075,331,030円	2,092,447,602円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	115,778,941円	119,251,952円

ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	797,303,991円	813,328,821円
ダイワ世界分散バランスファンド 30VA(国内株式型)	373,445,348円	374,139,595円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	4,062,250,479円	4,165,537,556円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	596,105,462円	615,498,415円
ダイワ・バランスファンド35V A	35,877,519,420円	33,146,326,670円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	2,410,471,798円	2,572,885,536円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	5,582,048,617円	5,438,517,962円
ダイワ・バランスファンド25V A(適格機関投資家専用)	3,033,655,709円	3,021,942,080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)	533,316,921円	576,398,066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)	460,974,143円	706,526,826円
ダイワライフスタイル25	177,432,821円	212,395,585円
ダイワライフスタイル50	504,129,905円	592,840,851円
ダイワライフスタイル75	416,798,965円	462,467,105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)	13,759,178,813円	14,814,608,007円
計	201,865,410,927円	205,035,658,182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	201,865,410,927口	205,035,658,182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108,737,481,370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123,121,474,355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 434,700,000円	株式 447,700,000円

(金融商品に関する注記)

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	自平成22年12月1日 至平成23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。	同左

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。	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（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	同左
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。	同左

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	平成23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。	同左
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>

（追加情報）

自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
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。	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月30日現在	平成23年11月30日現在
	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	1,314,435,928	2,919,462,830
合計	1,314,435,928	2,919,462,830

（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22年9月22日から平成22年11月30日まで、及び平成23年9月21日から平成23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）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成22年11月30日 現在				平成23年11月30日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,768,509,000	-	1,827,540,000	59,031,000	2,287,114,000	-	2,247,975,000	39,139,000
合計	1,768,509,000	-	1,827,540,000	59,031,000	2,287,114,000	-	2,247,975,000	39,139,000

（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22年11月30日現在	平成23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）	0.4613円 (4,613円)	0.3995円 (3,995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	39,000	175	6,825,000	
日本水産	111,100	258	28,663,800	
マル八ニチロホールディングス	197,000	135	26,595,000	
サカタのタネ	14,100	1,083	15,270,300	
ホクト	9,100	1,645	14,969,500	
ショーボンドHD	7,900	1,649	13,027,100	
ミライト・ホールディングス	25,000	597	14,925,000	
住石ホールディングス	55,600	65	3,614,000	
日鉄鉱業	24,000	304	7,296,000	
三井松島	63,000	137	8,631,000	
国際石油開発帝石	1,092	504,000	550,368,000	
日本海洋掘削	3,000	2,476	7,428,000	
関東天然瓦斯	10,000	407	4,070,000	
石油資源開発	13,200	3,085	40,722,000	
東急建設	31,030	188	5,833,640	
コムシスホールディングス	45,500	772	35,126,000	
ミサワホーム	10,300	525	5,407,500	
高松コンストラクションGP	7,500	1,131	8,482,500	
東建コーポレーション	3,320	2,848	9,455,360	
大成建設	458,000	197	90,226,000	
大 林 組	272,000	318	86,496,000	
清水建設	275,000	311	85,525,000	
長谷工コーポレーション	583,500	49	28,591,500	
鹿島建設	424,000	229	97,096,000	
不動テトラ	71,400	152	10,852,800	
鉄建建設	68,000	86	5,848,000	
安藤建設	49,000	90	4,410,000	
太平工業	16,000	417	6,672,000	
西松建設	123,000	123	15,129,000	
前田建設	60,000	277	16,620,000	
奥 村 組	85,000	309	26,265,000	
東鉄工業	12,000	650	7,800,000	
イチケン	16,000	126	2,016,000	
戸田建設	96,000	278	26,688,000	
熊 谷 組	78,000	66	5,148,000	
北野建設	30,000	169	5,070,000	
三井ホーム	11,000	381	4,191,000	
矢作建設	14,200	402	5,708,400	
大東建託	33,600	6,810	228,816,000	
N I P P O	20,000	661	13,220,000	
前田道路	26,000	751	19,526,000	
日本道路	26,000	196	5,096,000	
東亜建設	85,000	134	11,390,000	
東洋建設	143,000	75	10,725,000	
五洋建設	117,500	239	28,082,500	
福 田 組	21,000	259	5,439,000	
住友林業	60,100	649	39,004,900	
日本基礎技術	18,400	233	4,287,200	
日成ビルド工業	37,000	182	6,734,000	
エス・パイ・エル	56,000	208	11,648,000	
巴コーポレーション	19,800	263	5,207,400	

パナホーム	31,000	527	16,337,000
大和ハウス	222,000	916	203,352,000
ライト工業	22,900	367	8,404,300
積水ハウス	254,000	665	168,910,000
ユアテック	15,000	371	5,565,000
四電工	10,000	319	3,190,000
中電工	15,200	823	12,509,600
関電工	48,000	325	15,600,000
きんでん	59,000	626	36,934,000
東京エネシス	15,000	410	6,150,000
トーエネック	16,000	351	5,616,000
日本電設工業	17,000	699	11,883,000
協和エクシオ	29,200	739	21,578,800
新日本空調	12,900	399	5,147,100
日本工営	30,000	297	8,910,000
日本電話施設	20,000	253	5,060,000
九電工	17,000	460	7,820,000
三機工業	25,000	377	9,425,000
日揮	84,000	1,889	158,676,000
中外炉工業	32,000	263	8,416,000
太平電業	15,000	588	8,820,000
高砂熱学	27,500	632	17,380,000
三晃金属	17,000	230	3,910,000
NEC ネットズエスアイ	7,800	1,168	9,110,400
朝日工業社	12,000	316	3,792,000
大気社	13,900	1,779	24,728,100
ダイダン	15,000	478	7,170,000
日比谷総合設	11,900	780	9,282,000
東芝プラントシステム	15,000	832	12,480,000
日本製粉	55,000	341	18,755,000
日清製粉G本社	82,000	916	75,112,000
昭和産業	43,000	236	10,148,000
鳥越製粉	8,300	698	5,793,400
協同飼料	62,000	83	5,146,000
中部飼料	9,900	474	4,692,600
日本配合飼料	43,000	105	4,515,000
日本甜菜糖	60,000	149	8,940,000
三井製糖	35,000	267	9,345,000
ネクスト	8,300	290	2,407,000
日本M&Aセンター	20	422,500	8,450,000
アコーディア・ゴルフ	356	59,300	21,110,800
パソナグループ	93	79,400	7,384,200
テンプホールディングス	13,900	728	10,119,200
森永製菓	86,000	184	15,824,000
中村屋	25,000	400	10,000,000
江崎グリコ	34,000	907	30,838,000
名糖産業	5,500	983	5,406,500
不二家	66,000	168	11,088,000
山崎製パン	65,000	1,019	66,235,000
モロゾフ	23,000	271	6,233,000
カルビー	5,100	3,665	18,691,500
森永乳業	75,000	292	21,900,000
ヤクルト	48,000	2,360	113,280,000
明治ホールディングス	27,300	3,320	90,636,000
雪印メグミルク	19,100	1,484	28,344,400

プリマハム	53,000	117	6,201,000
日本ハム	70,000	957	66,990,000
伊藤ハム	53,000	295	15,635,000
丸大食品	41,000	269	11,029,000
米 久	9,700	679	6,586,300
S Foods	6,000	606	3,636,000
スタジオアリス	4,900	1,105	5,414,500
シミック	3,600	1,261	4,539,600
システナ	131	53,300	6,982,300
NECフィールドینگ	6,600	942	6,217,200
新日鉄ソリューションズ	5,900	1,567	9,245,300
総合警備保障	30,400	807	24,532,800
日本駐車場開発	1,237	3,495	4,323,315
カカクコム	13,300	2,916	38,782,800
新日本科学	17,000	194	3,298,000
エムスリー	67	379,500	25,426,500
ディー・エヌ・エー	37,700	2,357	88,858,900
博報堂DYHLDGS	10,460	4,160	43,513,600
ぐるなび	7,400	862	6,378,800
サッポロホールディングス	158,000	290	45,820,000
アサヒグループホールディング	167,500	1,697	284,247,500
キリンHD	360,000	933	335,880,000
宝ホールディングス	82,000	483	39,606,000
オエノンホールディングス	35,000	179	6,265,000
養命酒	11,000	726	7,986,000
三国コカ・コ・ラ	8,400	688	5,779,200
コカ・コーラウエスト	30,700	1,300	39,910,000
コカコーラセントラルジャパン	11,300	1,000	11,300,000
ダイトードリンク	4,200	3,015	12,663,000
伊藤園	25,900	1,335	34,576,500
日清オイリオグループ	35,000	311	10,885,000
不二製油	22,100	1,101	24,332,100
J・オイルミルズ	35,000	215	7,525,000
ローソン	24,300	4,575	111,172,500
サンエー	2,500	2,982	7,455,000
キリン堂	5,000	474	2,370,000
カワチ薬品	6,000	1,496	8,976,000
エービーシー・マート	10,800	2,837	30,639,600
アスクル	8,100	1,046	8,472,600
ゲオホールディングス	137	82,800	11,343,600
ポイント	6,920	3,180	22,005,600
伊藤忠食品	1,600	2,665	4,264,000
くらコーポレーション	5,300	966	5,119,800
キャンドゥ	77	84,600	6,514,200
エレマテック	6,200	1,276	7,911,200
パル	2,650	2,984	7,907,600
エディオン	32,000	593	18,976,000
サーラコーポレーション	16,000	454	7,264,000
あみやき亭	19	194,500	3,695,500
ひらまつ	58	66,800	3,874,400
双日	533,500	119	63,486,500
ゲンキー	1,400	1,691	2,367,400
アルフレッサホールディングス	20,700	2,820	58,374,000
ハニーズ	8,530	962	8,205,860
キッコーマン	76,000	843	64,068,000

味の素	236,000	917	216,412,000
キユーピー	42,600	1,056	44,985,600
ハウス食品	30,400	1,398	42,499,200
カゴメ	33,400	1,519	50,734,600
焼津水産化工	8,500	698	5,933,000
アリアケジャパン	9,200	1,456	13,395,200
ニチレイ	103,000	358	36,874,000
横浜冷凍	19,200	593	11,385,600
東洋水産	38,000	1,890	71,820,000
日清食品HD	33,900	2,951	100,038,900
永谷園	10,000	886	8,860,000
フジッコ	10,000	939	9,390,000
ロックフィールド	4,900	1,245	6,100,500
日本たばこ産業	1,988	364,500	724,626,000
わらべや日洋	5,300	949	5,029,700
片倉工業	12,000	730	8,760,000
グンゼ	66,000	220	14,520,000
昭栄	16,200	542	8,780,400
アルペン	4,900	1,311	6,423,900
アルコニックス	2,900	1,593	4,619,700
ビックカメラ	288	41,850	12,052,800
DCMホールディングス	41,900	582	24,385,800
MonotaRO	6,400	775	4,960,000
あいホールディングス	12,100	336	4,065,600
J.フロントリテイリング	196,000	335	65,660,000
ドトール・日レスHD	13,800	981	13,537,800
マツモトキヨシHLDGS	14,300	1,502	21,478,600
ココカラファイン	8,700	2,049	17,826,300
三越伊勢丹HD	160,600	742	119,165,200
東洋紡績	364,000	103	37,492,000
ユニチカ	241,000	41	9,881,000
富士紡ホールディングス	41,000	157	6,437,000
日清紡ホールディングス	55,000	640	35,200,000
倉敷紡績	83,000	148	12,284,000
ダイワボウHD	83,000	179	14,857,000
シキボウ	70,000	90	6,300,000
日東紡績	66,000	326	21,516,000
トヨタ紡織	28,800	843	24,278,400
クリエイトSDH	3,800	1,581	6,007,800
バイタルKSKHD	17,100	610	10,431,000
UKCホールディングス	4,500	697	3,136,500
TOKAIホールディングス	50,800	402	20,421,600
日本毛織	28,000	555	15,540,000
ダイドーリミテッド	11,100	703	7,803,300
野村不動産HLDGS	38,600	1,175	45,355,000
ヒューリック	24,300	857	20,825,100
帝国繊維	7,000	497	3,479,000
ブックオフコーポレーション	6,000	646	3,876,000
日本コークス工業	80,500	100	8,050,000
JFE商事HLDGS	49,000	319	15,631,000
あさひ	5,200	1,581	8,221,200
サークルKサンクス	16,500	1,249	20,608,500
日本調剤	1,220	2,541	3,100,020
コスモス薬品	3,900	3,740	14,586,000
シップヘルスケアHD	10,300	1,806	18,601,800

セブン&アイ・HLDGS	330,000	2,127	701,910,000
ツルハホールディングス	7,200	4,020	28,944,000
サンマルクホールディングス	2,500	2,990	7,475,000
トリドール	9,900	746	7,385,400
帝人	348,000	231	80,388,000
東レ	607,000	570	345,990,000
クラレ	132,800	1,085	144,088,000
旭化成	484,000	459	222,156,000
サカイオーベックス	43,000	109	4,687,000
稲葉製作所	5,300	902	4,780,600
三協・立山HLDGS	123,000	102	12,546,000
トーカロ	5,100	1,690	8,619,000
SUMCO	55,000	631	34,705,000
住江織物	35,000	139	4,865,000
日本バイリン	11,000	314	3,454,000
芦森工業	39,000	102	3,978,000
アツギ	65,000	95	6,175,000
セーレン	21,900	459	10,052,100
小松精練	15,000	336	5,040,000
ワコールホールディングス	50,000	998	49,900,000
ホギメディカル	5,300	3,145	16,668,500
レナウン	34,900	151	5,269,900
TSIホールディングス	45,200	419	18,938,800
ITホールディングス	26,500	859	22,763,500
グリーン	34,800	2,546	88,600,800
コーエーテクモHD	16,900	622	10,511,800
三菱総合研究所	4,400	1,346	5,922,400
ボルテージ	2,000	941	1,882,000
特種東海製紙	64,000	182	11,648,000
ドワンゴ	51	135,700	6,920,700
マクロミル	10,200	822	8,384,400
ティーガイア	57	149,600	8,527,200
GMOペイメントゲートウェイ	23	350,000	8,050,000
ザッパラス	63	68,600	4,321,800
インターネットイニシアティブ	49	293,400	14,376,600
ソネットエンタテインメント	46	290,300	13,353,800
SRAホールディングス	5,100	761	3,881,100
JBSホールディングス	17,600	230	4,048,000
王子製紙	364,000	380	138,320,000
三菱製紙	176,000	71	12,496,000
北越紀州製紙	52,500	483	25,357,500
中越パルプ	48,000	124	5,952,000
大王製紙	37,000	539	19,943,000
日本製紙G本社	41,600	1,646	68,473,600
レンゴー	65,000	546	35,490,000
トーモク	23,000	203	4,669,000
ザ・パック	4,800	1,147	5,505,600
昭和電工	523,000	155	81,065,000
住友化学	580,000	288	167,040,000
住友精化	19,000	338	6,422,000
日産化学	66,300	712	47,205,600
ラサ工業	42,000	125	5,250,000
クレハ	60,000	369	22,140,000
テイカ	18,000	287	5,166,000
石原産業	154,000	88	13,552,000

日本曹達	53,000	319	16,907,000
東ソー	230,000	221	50,830,000
トクヤマ	139,000	256	35,584,000
セントラル硝子	80,000	369	29,520,000
東亜合成	101,000	324	32,724,000
ダイソー	38,000	255	9,690,000
関東電化	24,000	307	7,368,000
電気化学	182,000	297	54,054,000
イビデン	53,100	1,771	94,040,100
信越化学	150,200	3,805	571,511,000
日本カ-バイド	46,000	101	4,646,000
堺化学	27,000	305	8,235,000
エア・ウォーター	69,000	994	68,586,000
大陽日酸	110,000	554	60,940,000
日本化学工業	52,000	124	6,448,000
日本パ-カラライジング	20,000	969	19,380,000
高压ガス	12,000	455	5,460,000
チタン工業	13,000	399	5,187,000
四国化成	12,000	407	4,884,000
戸田工業	14,000	677	9,478,000
ステラケミファ	4,900	2,380	11,662,000
保土谷化学	24,000	239	5,736,000
日本触媒	63,000	828	52,164,000
大日精化	30,000	343	10,290,000
カネカ	104,000	410	42,640,000
協和発酵キリン	115,000	901	103,615,000
三菱瓦斯化学	144,000	449	64,656,000
三井化学	359,000	244	87,596,000
J S R	76,600	1,466	112,295,600
東京応化工業	14,700	1,596	23,461,200
三菱ケミカルH L D G S	519,500	437	227,021,500
日本合成化学	20,000	441	8,820,000
ダイセル	110,000	423	46,530,000
住友ベ-クライト	73,000	432	31,536,000
積水化学	169,000	570	96,330,000
日本ゼオン	77,000	643	49,511,000
アイカ工業	21,300	1,038	22,109,400
宇部興産	350,000	213	74,550,000
積水樹脂	12,000	702	8,424,000
タキロン	22,000	257	5,654,000
旭有機材	32,000	195	6,240,000
日立化成	36,500	1,457	53,180,500
大倉工業	22,000	247	5,434,000
積水化成品	24,000	295	7,080,000
日本化薬	59,000	765	45,135,000
イーピーエス	52	157,000	8,164,000
パナソニック電工I S	2,100	2,007	4,214,700
フェイス	464	8,250	3,828,000
野村総合研究所	43,900	1,683	73,883,700
ケネディクス	1,094	11,210	12,263,740
電通	75,700	2,194	166,085,800
インテージ	2,400	1,465	3,516,000
シンプレクスホールディング	202	28,500	5,757,000
日本精化	8,900	506	4,503,400
A D E K A	36,800	730	26,864,000

日油	66,000	387	25,542,000
ミヨシ油脂	66,000	103	6,798,000
ハリマ化成	7,300	638	4,657,400
花王	221,400	2,016	446,342,400
第一工業製薬	20,000	211	4,220,000
三洋化成	27,000	528	14,256,000
武田薬品	312,900	3,145	984,070,500
アステラス製薬	185,400	2,938	544,705,200
大日本住友製薬	61,000	788	48,068,000
塩野義製薬	132,500	894	118,455,000
田辺三菱製薬	83,600	1,195	99,902,000
わかもと製薬	22,000	243	5,346,000
あすか製薬	12,000	500	6,000,000
日本新薬	18,000	879	15,822,000
中外製薬	97,500	1,166	113,685,000
科研製薬	32,000	934	29,888,000
エーザイ	102,400	2,963	303,411,200
ロート製薬	35,000	972	34,020,000
小野薬品	40,400	3,980	160,792,000
久光製薬	26,000	3,080	80,080,000
持田製薬	29,000	825	23,925,000
参天製薬	27,800	2,901	80,647,800
扶桑薬品	40,000	202	8,080,000
日本ケミファ	17,000	292	4,964,000
ツムラ	22,800	2,123	48,404,400
日医工	15,300	1,724	26,377,200
テルモ	62,700	3,695	231,676,500
みらかホールディングス	21,700	2,935	63,689,500
キッセイ薬品工業	16,000	1,488	23,808,000
生化学工業	17,700	844	14,938,800
栄研化学	7,100	991	7,036,100
日水製薬	3,000	651	1,953,000
鳥居薬品	6,400	1,438	9,203,200
東和薬品	4,700	3,420	16,074,000
沢井製薬	5,500	8,160	44,880,000
ゼリア新薬工業	13,000	1,224	15,912,000
第一三共	281,300	1,373	386,224,900
キョーリン製薬HD	20,000	1,295	25,900,000
大幸薬品	6,500	855	5,557,500
大塚ホールディングス	163,800	2,102	344,307,600
大正製薬HD	20,000	5,190	103,800,000
大日本塗料	77,000	88	6,776,000
日本ペイント	76,000	545	41,420,000
関西ペイント	93,000	725	67,425,000
中国塗料	25,000	514	12,850,000
藤倉化成	13,000	366	4,758,000
太陽ホールディングス	7,000	1,950	13,650,000
D I C	326,000	127	41,402,000
サカタインクス	15,000	316	4,740,000
東洋インキSCホールディング	75,000	282	21,150,000
アルプス技研	5,900	681	4,017,900
サニックス	18,300	240	4,392,000
オリエンタルランド	22,600	8,030	181,478,000
ダスキン	23,500	1,491	35,038,500
パーク24	42,000	933	39,186,000

明光ネットワークジャパン	10,100	668	6,746,800
ファルコSDホールディングス	6,200	900	5,580,000
フジ・メディア・HD	811	105,100	85,236,100
ラウンドワン	29,000	452	13,108,000
リゾートトラスト	13,400	1,107	14,833,800
オービック	2,450	14,000	34,300,000
ヤフー	5,805	24,090	139,842,450
ビー・エム・エル	5,200	1,908	9,921,600
ワタベウェディング	5,200	629	3,270,800
トレンドマイクロ	35,700	2,324	82,966,800
もしもしホットライン	16,300	705	11,491,500
東急コミュニティー	2,000	2,403	4,806,000
リソー教育	1,065	4,360	4,643,400
日本オラクル	14,000	2,566	35,924,000
アルファシステムズ	4,200	1,011	4,246,200
フューチャーアーキテクト	141	30,400	4,286,400
ユー・エス・エス	10,370	6,660	69,064,200
伊藤忠テクノソリューションズ	9,600	3,325	31,920,000
テー・オー・ダブリュー	4,100	447	1,832,700
大塚商会	6,300	5,240	33,012,000
総合メディカル	1,700	2,608	4,433,600
セントラルスポーツ	4,200	957	4,019,400
電通国際情報S	7,600	758	5,760,800
ウェザーニューズ	2,600	2,356	6,125,600
富士フイルムHLDS	180,200	1,826	329,045,200
コニカミノルタHLDS	214,500	570	122,265,000
資生堂	140,600	1,417	199,230,200
ライオン	95,000	444	42,180,000
高砂香料	30,000	376	11,280,000
マンダム	9,000	1,951	17,559,000
ミルボン	4,800	2,435	11,688,000
ファンケル	22,400	1,072	24,012,800
コーセー	13,100	1,809	23,697,900
ドクターシーラボ	52	472,500	24,570,000
ポーラ・オルビスHD	9,000	1,964	17,676,000
エステー	6,900	977	6,741,300
コニシ	6,100	997	6,081,700
長谷川香料	10,900	1,228	13,385,200
小林製薬	11,000	3,880	42,680,000
荒川化学工業	9,500	625	5,937,500
日本高純度化学	32	227,000	7,264,000
アース製薬	5,300	2,880	15,264,000
イハラケミカル	16,000	263	4,208,000
大成ラミック	2,500	2,370	5,925,000
クミアイ化学	23,000	261	6,003,000
日本農薬	22,000	328	7,216,000
昭和シェル石油	78,300	506	39,619,800
コスモ石油	231,000	209	48,279,000
ニチレキ	14,000	378	5,292,000
東燃ゼネラル石油	116,000	872	101,152,000
ユシロ化学	6,600	883	5,827,800
AOCホールディングス	21,400	455	9,737,000
出光興産	9,800	8,050	78,890,000
JXホールディングス	927,700	481	446,223,700
横浜ゴム	101,000	421	42,521,000

東洋ゴム	65,000	178	11,570,000
ブリヂストン	262,100	1,752	459,199,200
住友ゴム	63,000	912	57,456,000
オカモト	30,000	329	9,870,000
アキレス	74,000	104	7,696,000
フコク	3,500	657	2,299,500
ニッタ	8,500	1,395	11,857,500
東海ゴム工業	15,500	904	14,012,000
三ツ星ベルト	23,000	407	9,361,000
バンドー化学	31,000	305	9,455,000
鬼怒川ゴム	19,000	683	12,977,000
旭硝子	412,000	644	265,328,000
日本板硝子	369,000	145	53,505,000
有沢製作所	17,800	304	5,411,200
日本山村硝子	39,000	182	7,098,000
日本電気硝子	163,000	770	125,510,000
オハラ	6,200	765	4,743,000
住友大阪セメント	171,000	219	37,449,000
太平洋セメント	498,000	147	73,206,000
東海カーボン	77,000	383	29,491,000
日本カーボン	43,000	213	9,159,000
東洋炭素	5,000	3,715	18,575,000
ノリタケ	43,000	225	9,675,000
TOTO	131,000	615	80,565,000
日本碍子	111,000	824	91,464,000
日本特殊陶業	72,000	970	69,840,000
MARUWA	2,300	3,400	7,820,000
品川リフラクトリーズ	25,000	208	5,200,000
黒崎播磨	22,000	257	5,654,000
フジインコーポレーテッド	8,800	898	7,902,400
ニチアス	37,000	417	15,429,000
新日本製鐵	2,199,000	183	402,417,000
住友金属工業	1,559,000	133	207,347,000
神戸製鋼所	1,173,000	120	140,760,000
日新製鋼	307,000	108	33,156,000
中山製鋼所	70,000	63	4,410,000
合同製鐵	53,000	188	9,964,000
JFEホールディングス	199,600	1,389	277,244,400
東京製鐵	43,900	644	28,271,600
共英製鋼	9,500	1,518	14,421,000
大和工業	19,100	2,095	40,014,500
大阪製鐵	5,800	1,350	7,830,000
淀川製鋼所	60,000	338	20,280,000
東洋鋼鈹	22,000	265	5,830,000
丸一鋼管	24,700	1,680	41,496,000
大同特殊鋼	139,000	496	68,944,000
日本金属工業	88,000	64	5,632,000
日本冶金工	76,500	118	9,027,000
山陽特殊製鋼	42,000	417	17,514,000
愛知製鋼	44,000	397	17,468,000
日立金属	54,000	847	45,738,000
日本金属	25,000	154	3,850,000
大平洋金属	64,000	383	24,512,000
日本電工	34,000	339	11,526,000
栗本鉄工所	53,000	150	7,950,000

日本製鋼所	134,000	501	67,134,000
三菱製鋼	52,000	203	10,556,000
日本精線	7,000	390	2,730,000
日本軽金属	206,000	100	20,600,000
三井金属	235,000	194	45,590,000
東邦亜鉛	53,000	300	15,900,000
三菱マテリアル	530,000	211	111,830,000
住友鉱山	217,000	1,015	220,255,000
DOWAホールディングス	103,000	503	51,809,000
古河機金	166,000	63	10,458,000
大阪チタニウム	8,800	3,815	33,572,000
東邦チタニウム	15,300	1,454	22,246,200
住友軽金属	216,000	71	15,336,000
古河スカイ	37,000	170	6,290,000
古河電工	276,000	172	47,472,000
住友電工	296,700	821	243,590,700
フジクラ	137,000	232	31,784,000
昭和電線HLDGS	141,000	70	9,870,000
タツタ電線	18,000	338	6,084,000
日立電線	81,000	160	12,960,000
リョービ	47,000	295	13,865,000
アサヒHD	11,600	1,538	17,840,800
東洋製罐	60,800	1,043	63,414,400
ホッカンホールディングス	21,000	223	4,683,000
コロナ	4,800	1,252	6,009,600
横河ブリッジHLDGS	21,000	473	9,933,000
駒井ハルテック	30,000	179	5,370,000
三和ホールディングス	89,000	234	20,826,000
文化シャツタ-	29,000	266	7,714,000
住生活グループ	109,700	1,447	158,735,900
日本フィルコン	10,700	388	4,151,600
ノーリツ	16,700	1,394	23,279,800
長府製作所	8,200	2,083	17,080,600
リンナイ	13,300	5,820	77,406,000
ユニプレス	12,600	2,086	26,283,600
日東精工	17,000	189	3,213,000
岡部	17,100	392	6,703,200
東プレ	15,900	739	11,750,100
高周波熱錬	12,900	576	7,430,400
東京製綱	66,000	158	10,428,000
パイオラックス	3,600	1,508	5,428,800
日本発条	60,300	685	41,305,500
三浦工業	12,400	2,200	27,280,000
タクマ	31,000	323	10,013,000
ツガミ	24,000	515	12,360,000
オークマ	54,000	571	30,834,000
東芝機械	49,000	412	20,188,000
アマダ	122,000	471	57,462,000
アイダエンジニア	23,600	393	9,274,800
牧野フライス	45,000	525	23,625,000
オーエスジー	37,600	988	37,148,800
旭ダイヤモンド	22,100	1,038	22,939,800
森精機製作所	45,800	727	33,296,600
ディスコ	8,600	4,010	34,486,000
日東工器	5,100	1,880	9,588,000

豊田自動織機	71,800	2,094	150,349,200
大阪機工	56,000	89	4,984,000
津田駒工業	33,000	135	4,455,000
島精機製作所	11,600	1,316	15,265,600
日阪製作所	12,000	820	9,840,000
ナブテスコ	35,500	1,655	58,752,500
三井海洋開発	7,200	1,269	9,136,800
S M C	25,000	12,520	313,000,000
新川	13,200	354	4,672,800
ホソカワミクロン	17,000	381	6,477,000
ユニオンツール	5,900	1,416	8,354,400
オイレス工業	9,300	1,441	13,401,300
サト - ホールディングス	9,000	930	8,370,000
ワイエイシイ	5,100	637	3,248,700
小松製作所	398,500	1,895	755,157,500
住友重機械	218,000	455	99,190,000
日立建機	44,200	1,326	58,609,200
日 工	14,000	269	3,766,000
巴工業	2,900	1,214	3,520,600
井関農機	94,000	170	15,980,000
T O W A	10,900	405	4,414,500
丸山製作所	28,000	168	4,704,000
北川鉄工所	51,000	138	7,038,000
クボタ	384,000	685	263,040,000
東洋エンジニア	50,000	277	13,850,000
三菱化工機	38,000	129	4,902,000
月島機械	13,000	587	7,631,000
帝国電機製作所	3,300	1,429	4,715,700
新東工業	18,600	704	13,094,400
アイチ コーポレーション	15,700	302	4,741,400
小森コーポレーション	30,600	474	14,504,400
住友精密	13,000	523	6,799,000
荏原製作所	143,000	275	39,325,000
西島製作所	10,500	987	10,363,500
千代田化工建	73,000	828	60,444,000
ダイキン工業	102,300	2,218	226,901,400
オルガノ	15,000	614	9,210,000
ト - ヨ - カネツ	57,000	145	8,265,000
栗田工業	45,700	2,032	92,862,400
椿本チエイン	43,000	410	17,630,000
日 機 装	27,000	643	17,361,000
木村化工機	12,600	309	3,893,400
新興プランテック	18,800	672	12,633,600
アネスト岩田	15,000	304	4,560,000
ダイフク	40,500	400	16,200,000
加藤製作所	24,000	209	5,016,000
タダノ	40,000	493	19,720,000
フジテック	21,000	418	8,778,000
シーケーディ	25,700	561	14,417,700
平和	16,000	1,367	21,872,000
理想科学工業	5,900	1,272	7,504,800
S A N K Y O	23,800	3,825	91,035,000
日本金銭機械	8,700	629	5,472,300
マースエンジニアリング	4,800	1,305	6,264,000
ダイコク電機	7,500	680	5,100,000

アマノ	23,500	682	16,027,000
JUKI	54,000	180	9,720,000
サンデン	46,000	228	10,488,000
ブラザー工業	104,300	1,021	106,490,300
マックス	12,000	894	10,728,000
モリタホールディングス	12,000	425	5,100,000
グローリー	24,100	1,612	38,849,200
大和冷機工業	9,000	411	3,699,000
セガサミーホールディングス	85,600	1,552	132,851,200
日本ピストンリング	36,000	139	5,004,000
リケン	30,000	290	8,700,000
TPR	8,800	805	7,084,000
ホシザキ電機	15,100	1,931	29,158,100
大豊工業	6,600	674	4,448,400
日本精工	180,000	497	89,460,000
NTN	188,000	298	56,024,000
ジェイテクト	77,800	742	57,727,600
不二越	84,000	351	29,484,000
ミネベア	128,000	338	43,264,000
日本トムソン	29,000	428	12,412,000
THK	54,300	1,507	81,830,100
ユーシン精機	4,400	1,400	6,160,000
前澤給装工業	3,600	1,052	3,787,200
イーグル工業	11,000	620	6,820,000
日本ピラ - 工業	9,000	502	4,518,000
キッツ	34,700	318	11,034,600
日立	1,798,000	423	760,554,000
東芝	1,690,000	347	586,430,000
三菱電機	802,000	712	571,024,000
富士電機	248,000	223	55,304,000
東洋電機製造	16,000	295	4,720,000
安川電機	98,000	639	62,622,000
シンフォニアテクノロジー	55,000	166	9,130,000
明電舎	84,000	272	22,848,000
オリジン電気	17,000	241	4,097,000
デンヨー	8,000	975	7,800,000
日立工機	23,400	560	13,104,000
三桜工業	10,200	548	5,589,600
マキタ	52,300	2,627	137,392,100
東芝テック	50,000	286	14,300,000
芝浦メカトロニクス	19,000	208	3,952,000
マブチモーター	10,700	3,385	36,219,500
日本電産	43,200	6,900	298,080,000
高岳製作所	41,000	177	7,257,000
ダイヘン	51,000	275	14,025,000
第一精工	2,600	2,279	5,925,400
日新電機	18,000	435	7,830,000
大崎電気	12,000	717	8,604,000
オムロン	89,700	1,605	143,968,500
日東工業	12,000	919	11,028,000
IDEC	11,900	774	9,210,600
エルピーダメモリ	112,600	368	41,436,800
ジーエス・ユアサコーポ	160,000	438	70,080,000
メルコホールディングス	4,800	2,043	9,806,400
日本電気	1,111,000	163	181,093,000

富士通	777,000	400	310,800,000
沖電気	328,000	62	20,336,000
岩崎通信機	66,000	66	4,356,000
電気興業	29,000	262	7,598,000
サンケン電気	45,000	257	11,565,000
アイホン	5,100	1,507	7,685,700
ルネサスエレクトロニクス	25,100	503	12,625,300
セイコーエプソン	55,600	1,058	58,824,800
ワコム	167	120,700	20,156,900
アルバック	16,700	1,027	17,150,900
アクセル	4,000	1,607	6,428,000
ナナオ	7,700	1,498	11,534,600
日本信号	18,900	426	8,051,400
京三製作所	18,000	305	5,490,000
能美防災	12,000	476	5,712,000
日本無線	17,000	172	2,924,000
パナソニック	917,600	727	667,095,200
シャープ	389,000	771	299,919,000
アンリツ	39,000	861	33,579,000
富士通ゼネラル	21,000	415	8,715,000
日立国際電気	21,000	606	12,726,000
ソニー	501,500	1,372	688,058,000
T D K	42,500	3,825	162,562,500
帝国通信工業	37,000	123	4,551,000
ミツミ電機	33,300	544	18,115,200
タムラ製作所	32,000	188	6,016,000
アルプス電気	66,600	526	35,031,600
パイオニア	118,300	368	43,534,400
日本電波工業	7,500	1,071	8,032,500
ローランド ディー・ジー	5,200	855	4,446,000
フォスタ - 電機	9,200	1,114	10,248,800
クラリオン	58,000	129	7,482,000
S M K	30,000	261	7,830,000
ヨコオ	8,000	395	3,160,000
東光	46,000	151	6,946,000
ホシデン	25,000	535	13,375,000
ヒロセ電機	13,600	7,030	95,608,000
日本航空電子	19,000	551	10,469,000
T O A	10,000	444	4,440,000
ユニデン	27,000	288	7,776,000
アルパイン	16,300	881	14,360,300
スミダコーポレーション	5,800	522	3,027,600
アイコム	5,200	1,990	10,348,000
船井電機	8,400	1,640	13,776,000
横河電機	89,100	714	63,617,400
新電元工業	29,000	320	9,280,000
山武	20,400	1,657	33,802,800
日本光電工業	16,000	1,765	28,240,000
堀場製作所	14,800	2,385	35,298,000
アドバンテスト	63,100	838	52,877,800
エスベック	10,800	467	5,043,600
パナソニック電工SUNX	9,100	388	3,530,800
キーエンス	17,800	19,420	345,676,000
日置電機	4,500	1,378	6,201,000
シスメックス	27,900	2,631	73,404,900

メガチップス	7,600	1,296	9,849,600
日本電産コパル電子	9,100	475	4,322,500
デンソー	197,500	2,150	424,625,000
コーセル	11,300	987	11,153,100
日立メディコ	6,000	803	4,818,000
オブテックス	5,900	960	5,664,000
千代田インテグレ	3,900	991	3,864,900
東光電気	10,000	335	3,350,000
スタンレー電気	54,100	1,109	59,996,900
岩崎電気	39,000	161	6,279,000
ウシオ電機	47,800	1,146	54,778,800
日本セラミック	4,800	1,402	6,729,600
新神戸電機	6,000	1,699	10,194,000
日本デジタル研究所	8,500	735	6,247,500
古河電池	8,000	354	2,832,000
図研	7,500	514	3,855,000
日本電子	36,000	204	7,344,000
カシオ	79,800	472	37,665,600
ファナック	83,600	12,270	1,025,772,000
日本シイエムケイ	21,700	274	5,945,800
エンプラス	4,700	1,369	6,434,300
ローム	39,000	3,620	141,180,000
浜松ホトニクス	30,400	2,792	84,876,800
新光電気工業	30,100	570	17,157,000
京セラ	66,600	6,760	450,216,000
太陽誘電	40,600	625	25,375,000
村田製作所	83,900	4,465	374,613,500
ユーシン	12,600	634	7,988,400
双葉電子工業	13,600	1,319	17,938,400
日東電工	69,200	3,110	215,212,000
北陸電気工業	44,000	113	4,972,000
東海理化電機	18,900	1,165	22,018,500
ニチコン	26,400	809	21,357,600
日本ケミコン	52,000	279	14,508,000
K O A	10,200	750	7,650,000
三井造船	322,000	116	37,352,000
日立造船	321,500	99	31,828,500
佐世保重工業	49,000	113	5,537,000
三菱重工業	1,339,000	318	425,802,000
川崎重工業	590,000	194	114,460,000
I H I	549,000	176	96,624,000
日本車輛	32,000	293	9,376,000
近畿車輛	17,000	236	4,012,000
日産自動車	1,010,200	690	697,038,000
いすゞ自動車	507,000	354	179,478,000
トヨタ自動車	1,028,900	2,509	2,581,510,100
日野自動車	116,000	463	53,708,000
三菱自動車工業	1,786,000	92	164,312,000
エフテック	4,200	841	3,532,200
武蔵精密工業	7,700	1,687	12,989,900
トヨタ車体	14,200	1,124	15,960,800
日産車体	22,000	748	16,456,000
関東自動車	12,000	627	7,524,000
新明和工業	37,000	269	9,953,000
日信工業	15,100	1,027	15,507,700

トピー工業	66,000	193	12,738,000
ティラド	32,000	250	8,000,000
曙ブレーキ	42,900	342	14,671,800
タチエス	10,300	1,290	13,287,000
N O K	38,500	1,322	50,897,000
フタバ産業	24,000	467	11,208,000
カヤバ工業	58,000	359	20,822,000
シロキ工業	18,000	198	3,564,000
市光工業	39,000	133	5,187,000
大同メタル工業	12,000	780	9,360,000
プレス工業	38,000	353	13,414,000
カルソニックカンセイ	48,000	433	20,784,000
太平洋工業	18,000	337	6,066,000
ケーヒン	17,500	1,188	20,790,000
河西工業	12,000	390	4,680,000
アイシン精機	65,200	2,260	147,352,000
富士機工	15,000	213	3,195,000
マ ッ ダ	678,000	137	92,886,000
ダイハツ	73,000	1,331	97,163,000
愛知機械	21,000	221	4,641,000
今仙電機製作所	5,800	943	5,469,400
本田技研	676,400	2,389	1,615,919,600
スズキ	167,300	1,608	269,018,400
富士重工業	256,000	435	111,360,000
ヤマハ発動機	131,300	1,046	137,339,800
ショーワ	20,200	417	8,423,400
小糸製作所	40,000	1,049	41,960,000
T B K	13,000	343	4,459,000
エクセディ	11,200	2,280	25,536,000
ミツバ	16,000	507	8,112,000
豊田合成	23,300	1,314	30,616,200
愛三工業	10,100	622	6,282,200
ヨ ロ ズ	4,600	1,621	7,456,600
エフ・シー・シー	13,100	1,628	21,326,800
新家工業	31,000	113	3,503,000
シマノ	30,000	3,710	111,300,000
タカタ	14,700	1,635	24,034,500
テイ・エス テック	17,300	1,065	18,424,500
小 野 建	5,000	627	3,135,000
佐島電機	5,100	454	2,315,400
カップクリエイト	6,350	1,750	11,112,500
伯東	3,100	698	2,163,800
ナガイレーベン	10,200	1,031	10,516,200
三菱食品	8,100	1,935	15,673,500
良品計画	8,600	3,495	30,057,000
三城ホールディングス	13,400	637	8,535,800
松田産業	7,000	1,160	8,120,000
メディパルHD	87,300	750	65,475,000
アズワン	4,900	1,576	7,722,400
シモジマ	7,500	962	7,215,000
ドウシシャ	4,000	2,019	8,076,000
コ ジ マ	10,200	507	5,171,400
コーナン商事	7,800	1,222	9,531,600
黒田電気	8,300	819	6,797,700
ネットワンシステムズ	177	197,300	34,922,100

ワタミ	9,700	1,878	18,216,600
ドン・キホーテ	15,000	2,634	39,510,000
メガネトップ	12,500	929	11,612,500
西松屋チェーン	19,100	583	11,135,300
ゼンショーホールディングス	29,800	1,026	30,574,800
幸楽苑	6,000	1,133	6,798,000
サイゼリヤ	12,200	1,261	15,384,200
ガリバーインターナショナル	2,720	3,225	8,772,000
ユナイテッドアローズ	8,800	1,351	11,888,800
ハイデイ日高	3,800	1,202	4,567,600
シークス	5,000	996	4,980,000
京都きもの友禅	5,200	909	4,726,800
コロワイド	28,000	512	14,336,000
田中商事	5,200	395	2,054,000
壱番屋	3,000	2,295	6,885,000
マクニカ	3,700	1,678	6,208,600
トップカルチャー	6,300	352	2,217,600
スギホールディングス	14,000	2,201	30,814,000
島津製作所	96,000	622	59,712,000
J M S	16,000	247	3,952,000
ブイ・テクノロジー	15	393,000	5,895,000
スター精密	14,300	710	10,153,000
東京計器	41,000	138	5,658,000
日本電産トーソク	4,700	950	4,465,000
東京精密	14,800	1,555	23,014,000
ニコン	140,000	1,771	247,940,000
トプコン	21,500	363	7,804,500
オリンパス	95,000	1,025	97,375,000
理研計器	7,500	565	4,237,500
大日本スクリーン	78,000	567	44,226,000
キヤノン電子	7,300	1,979	14,446,700
タムロン	7,400	2,022	14,962,800
HOYA	194,100	1,619	314,247,900
エー・アンド・デイ	11,600	309	3,584,400
キヤノン	497,300	3,420	1,700,766,000
リコー	245,000	682	167,090,000
日本電産コパル	8,600	868	7,464,800
日本電産サンキョー	20,000	521	10,420,000
シチズンホールディングス	101,000	438	44,238,000
リズム時計	56,000	129	7,224,000
SHOBI	5,200	417	2,168,400
SRIスポーツ	4,900	836	4,096,400
バンダイナムコHLDGS	85,800	1,104	94,723,200
フランスベッドHLDGS	75,000	130	9,750,000
パイロットコーポレーション	72	161,600	11,635,200
エイベックス・グループHD	15,900	870	13,833,000
トッパン・フォームズ	18,100	564	10,208,400
フジシールインターナショナル	9,600	1,424	13,670,400
タカラトミー	26,500	540	14,310,000
廣済堂	14,100	188	2,650,800
レック	3,200	998	3,193,600
プロネクサス	13,500	399	5,386,500
大建工業	38,000	224	8,512,000
きもと	8,400	543	4,561,200
凸版印刷	244,000	558	136,152,000

大日本印刷	245,000	744	182,280,000
共同印刷	37,000	189	6,993,000
日本写真印刷	16,900	962	16,257,800
藤森工業	6,700	1,129	7,564,300
宝印刷	7,600	575	4,370,000
前澤化成工業	7,900	808	6,383,200
アシックス	74,900	916	68,608,400
ツ ツ ミ	4,700	1,786	8,394,200
ジェイ エス ピー	5,600	1,066	5,969,600
ニ チ ハ	10,000	825	8,250,000
ローランド	11,900	657	7,818,300
エフピコ	3,700	5,010	18,537,000
小松ウオール工業	5,200	852	4,430,400
ヤマハ	61,900	729	45,125,100
河合楽器	39,000	144	5,616,000
クリナップ	12,700	488	6,197,600
ピジョン	7,400	3,030	22,422,000
天馬	10,100	693	6,999,300
兼松日産農林	26,000	160	4,160,000
リンテック	15,800	1,387	21,914,600
信越ポリマー	17,700	344	6,088,800
東 リ	32,000	140	4,480,000
イトーキ	32,300	168	5,426,400
任 天 堂	45,900	11,630	533,817,000
三菱鉛筆	7,300	1,353	9,876,900
タカラスタンダ - ド	38,000	611	23,218,000
コ ク ヨ	43,200	544	23,500,800
ナカバヤシ	32,000	186	5,952,000
ニ フ コ	18,300	2,073	37,935,900
グローブライド	69,000	79	5,451,000
岡村製作所	30,000	528	15,840,000
日本バルカー	34,000	188	6,392,000
伊 藤 忠	628,200	763	479,316,600
丸 紅	693,000	461	319,473,000
スクロール	15,100	260	3,926,000
高 島	23,000	214	4,922,000
F & A アクアホールディングス	8,400	737	6,190,800
三陽商会	60,000	181	10,860,000
長瀬産業	42,100	826	34,774,600
蝶 理	46,000	85	3,910,000
豊田通商	87,900	1,263	111,017,700
オンワ - ドホールディングス	52,000	545	28,340,000
三共生興	17,700	258	4,566,600
兼 松	163,000	73	11,899,000
美 津 濃	42,000	389	16,338,000
ファミリーマート	23,300	3,070	71,531,000
三井物産	681,400	1,182	805,414,800
日本紙パルプ	35,000	275	9,625,000
東京エレクトロン	67,700	4,090	276,893,000
日立ハイテクノロジーズ	24,300	1,674	40,678,200
カメイ	13,000	676	8,788,000
東都水産	32,000	129	4,128,000
スターゼン	29,000	225	6,525,000
セイコーHD	55,000	152	8,360,000
山 善	31,000	542	16,802,000

住友商事	462,800	1,007	466,039,600
日本ユニシス	23,800	480	11,424,000
内田洋行	29,000	212	6,148,000
三菱商事	575,700	1,551	892,910,700
第一実業	22,000	300	6,600,000
キヤノンマーケティングJPN	27,200	864	23,500,800
西華産業	24,000	210	5,040,000
菱洋エレクトロ	7,600	711	5,403,600
ユアサ商事	85,000	104	8,840,000
神鋼商事	20,000	179	3,580,000
阪和興業	80,000	328	26,240,000
カナデン	10,000	510	5,100,000
菱電商事	13,000	425	5,525,000
ニプロ	32,200	624	20,092,800
岩谷産業	86,000	266	22,876,000
すてきナイスグループ	43,000	162	6,966,000
昭光通商	56,000	119	6,664,000
極東貿易	20,000	178	3,560,000
イワキ	12,000	183	2,196,000
兼松エレクトロニクス	2,000	756	1,512,000
三愛石油	18,000	318	5,724,000
稲畑産業	21,000	442	9,282,000
ゴールドウイン	21,000	277	5,817,000
ユニ・チャーム	45,400	3,645	165,483,000
デサント	23,000	420	9,660,000
ヤマトインタ・ナショナル	6,600	351	2,316,600
東邦ホールディングス	27,100	985	26,693,500
サンゲツ	14,200	2,029	28,811,800
ミツウロコグループ	16,500	465	7,672,500
シナネン	18,000	348	6,264,000
伊藤忠エネクス	23,900	430	10,277,000
サンリオ	20,000	3,980	79,600,000
リョーサン	12,200	1,716	20,935,200
新光商事	8,000	600	4,800,000
トーヨー	13,000	304	3,952,000
三信電気	10,200	632	6,446,400
東陽テクニカ	11,000	796	8,756,000
モスフード サービス	9,500	1,519	14,430,500
加賀電子	7,200	796	5,731,200
三益半導体	8,400	626	5,258,400
木曽路	10,300	1,401	14,430,300
千趣会	14,800	520	7,696,000
ケーヨー	16,000	461	7,376,000
アデランス	13,500	805	10,867,500
上新電機	15,000	857	12,855,000
日本瓦斯	12,300	1,172	14,415,600
マルエツ	22,000	277	6,094,000
ロイヤルホールディングス	13,400	914	12,247,600
島忠	17,400	1,691	29,423,400
チヨダ	10,900	1,251	13,635,900
ライフコーポレーション	6,200	1,425	8,835,000
カスミ	17,700	495	8,761,500
リンガーハット	7,500	1,055	7,912,500
MR MAX	15,600	306	4,773,600
AOKIホールディングス	8,200	1,141	9,356,200

オークワ	13,000	1,280	16,640,000
コメリ	11,200	2,342	26,230,400
青山商事	22,300	1,239	27,629,700
しまむら	9,000	7,290	65,610,000
C F Sコーポレーション	11,500	334	3,841,000
高島屋	112,000	542	60,704,000
松屋	21,300	435	9,265,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	43,000	575	24,725,000
ニッセンHD	16,500	430	7,095,000
パルコ	16,900	576	9,734,400
丸井グループ	109,300	551	60,224,300
クレディセゾン	66,000	1,376	90,816,000
原信ナルスHLDGS	4,900	1,240	6,076,000
ダイエー	57,350	278	15,943,300
イズミヤ	33,000	384	12,672,000
イオン	277,600	1,048	290,924,800
ユニー	62,400	697	43,492,800
イズミ	23,800	1,139	27,108,200
東武ストア	17,000	254	4,318,000
平和堂	14,600	987	14,410,200
フジ	8,800	1,828	16,086,400
ヤオコー	3,500	2,621	9,173,500
ゼビオ	9,900	1,767	17,493,300
ケーズホールディングス	19,600	2,996	58,721,600
Paltac	6,800	1,456	9,900,800
新生銀行	633,000	76	48,108,000
あおぞら銀行	251,000	204	51,204,000
三菱UFJフィナンシャルG	5,978,000	328	1,960,784,000
りそなホールディングス	693,600	339	235,130,400
三井住友トラストHD	1,556,000	231	359,436,000
三井住友フィナンシャルG	596,800	2,089	1,246,715,200
第四銀行	102,000	256	26,112,000
北越銀行	84,000	157	13,188,000
西日本シティ銀行	269,000	224	60,256,000
札幌北洋ホール	122,500	264	32,340,000
千葉銀行	311,000	498	154,878,000
横浜銀行	503,000	363	182,589,000
常陽銀行	302,000	332	100,264,000
群馬銀行	177,000	430	76,110,000
武蔵野銀行	12,200	2,567	31,317,400
千葉興業銀行	15,200	410	6,232,000
筑波銀行	39,500	284	11,218,000
東京都民銀行	16,900	950	16,055,000
七十七銀行	132,000	297	39,204,000
青森銀行	61,000	240	14,640,000
秋田銀行	62,000	228	14,136,000
山形銀行	52,000	395	20,540,000
岩手銀行	5,700	3,630	20,691,000
東邦銀行	74,000	214	15,836,000
東北銀行	67,000	117	7,839,000
みちのく銀行	49,000	146	7,154,000
ふくおかフィナンシャルG	324,000	313	101,412,000
静岡銀行	235,000	790	185,650,000
十六銀行	104,000	255	26,520,000
スルガ銀行	77,000	701	53,977,000

八十二銀行	143,000	450	64,350,000
山梨中央銀行	52,000	321	16,692,000
大垣共立銀行	101,000	254	25,654,000
福井銀行	70,000	247	17,290,000
北國銀行	93,000	283	26,319,000
清水銀行	3,200	3,200	10,240,000
滋賀銀行	77,000	530	40,810,000
南都銀行	76,000	465	35,340,000
百五銀行	71,000	311	22,081,000
京都銀行	136,000	663	90,168,000
三重銀行	35,000	173	6,055,000
ほくほくフィナンシャルG	546,000	149	81,354,000
広島銀行	227,000	365	82,855,000
山陰合同銀行	45,000	551	24,795,000
中国銀行	63,000	1,054	66,402,000
鳥取銀行	29,000	151	4,379,000
伊予銀行	81,000	755	61,155,000
百十四銀行	91,000	363	33,033,000
四国銀行	60,000	309	18,540,000
阿波銀行	68,000	543	36,924,000
鹿児島銀行	46,000	533	24,518,000
大分銀行	54,000	226	12,204,000
宮崎銀行	54,000	186	10,044,000
肥後銀行	59,000	432	25,488,000
佐賀銀行	54,000	200	10,800,000
十八銀行	55,000	204	11,220,000
沖縄銀行	5,800	3,510	20,358,000
琉球銀行	15,800	956	15,104,800
八千代銀行	4,500	2,000	9,000,000
みずほフィナンシャルG	10,108,800	100	1,010,880,000
紀陽ホールディングス	301,000	119	35,819,000
山口フィナンシャルG	77,000	729	56,133,000
芙蓉総合リース	7,500	2,599	19,492,500
興銀リース	11,600	1,578	18,304,800
東京センチュリーリース	20,700	1,505	31,153,500
SBIホールディングス	8,709	6,080	52,950,720
日本証券金融	38,000	357	13,566,000
長野銀行	37,000	161	5,957,000
名古屋銀行	78,000	266	20,748,000
愛知銀行	3,200	4,675	14,960,000
第三銀行	60,000	159	9,540,000
中京銀行	44,000	196	8,624,000
東日本銀行	29,000	158	4,582,000
大光銀行	31,000	234	7,254,000
愛媛銀行	48,000	227	10,896,000
トマト銀行	46,000	126	5,796,000
みなと銀行	74,000	144	10,656,000
京葉銀行	61,000	386	23,546,000
関西アーバン銀行	117,000	130	15,210,000
栃木銀行	41,000	281	11,521,000
北日本銀行	3,900	1,810	7,059,000
東和銀行	72,000	96	6,912,000
福島銀行	135,000	38	5,130,000
リコーリース	6,100	1,782	10,870,200
イオン クレジットサービス	36,000	1,163	41,868,000

アコム	17,030	1,217	20,725,510
プロミス	42,950	796	34,188,200
ジャックス	52,000	234	12,168,000
オリコ	131,000	68	8,908,000
日立キャピタル	16,900	1,060	17,914,000
オリックス	41,310	6,340	261,905,400
三菱UFJリース	20,160	2,896	58,383,360
ジャフコ	11,400	1,385	15,789,000
トモニホールディングス	61,500	344	21,156,000
大和証券G本社	788,000	252	198,576,000
野村ホールディングス	1,716,200	248	425,617,600
岡三証券グループ	67,000	240	16,080,000
丸三証券	32,600	246	8,019,600
東洋証券	39,000	107	4,173,000
東海東京HD	90,000	212	19,080,000
水戸証券	47,000	100	4,700,000
いちよし証券	21,200	381	8,077,200
松井証券	53,100	354	18,797,400
NKSJホールディングス	166,000	1,504	249,664,000
マネックスG	850	11,890	10,106,500
カブドットコム証券	39,100	221	8,641,100
極東証券	10,000	434	4,340,000
岩井コスモホールディング	15,600	233	3,634,800
フィデアホール	53,300	205	10,926,500
池田泉州HD	320,800	118	37,854,400
MS&AD	235,900	1,486	350,547,400
SONY FH	76,800	1,246	95,692,800
第一生命	4,255	83,200	354,016,000
東京海上HD	299,500	1,832	548,684,000
T&Dホールディングス	290,900	734	213,520,600
三井不動産	352,000	1,218	428,736,000
三菱地所	554,000	1,262	699,148,000
平和不動産	93,500	152	14,212,000
東京建物	162,000	220	35,640,000
ダイビル	25,400	510	12,954,000
サンケイビル	18,800	306	5,752,800
東急不動産	166,000	295	48,970,000
京阪神ビルディング	8,900	348	3,097,200
住友不動産	190,000	1,491	283,290,000
東宝不動産	13,200	411	5,425,200
大京	129,000	146	18,834,000
テーオーシー	32,200	345	11,109,000
レオパレス21	70,900	173	12,265,700
空港施設	14,600	302	4,409,200
住友不動産販売	3,100	3,005	9,315,500
ゴールドクレスト	8,050	1,260	10,143,000
東栄住宅	6,000	776	4,656,000
東急リバブル	9,400	596	5,602,400
飯田産業	9,000	612	5,508,000
アーネストワン	13,100	777	10,178,700
タカラレーベン	12,000	427	5,124,000
イオンモール	36,300	1,768	64,178,400
タクトホーム	38	63,800	2,424,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	531	51,400	27,293,400
東武鉄道	465,000	389	180,885,000

相鉄ホールディングス	133,000	242	32,186,000
東京急行	472,000	370	174,640,000
京浜急行	208,000	676	140,608,000
小田急電鉄	260,000	725	188,500,000
京王電鉄	230,000	519	119,370,000
京成電鉄	135,000	535	72,225,000
東日本旅客鉄道	139,300	4,695	654,013,500
西日本旅客鉄道	69,700	3,185	221,994,500
東海旅客鉄道	693	614,000	425,502,000
西日本鉄道	99,000	365	36,135,000
近畿鉄道	721,000	285	205,485,000
阪急阪神HLDGS	536,000	313	167,768,000
南海電鉄	163,000	335	54,605,000
京阪電鉄	176,000	365	64,240,000
名古屋鉄道	278,000	207	57,546,000
日本通運	318,000	289	91,902,000
ヤマトホールディングス	162,500	1,222	198,575,000
山九	96,000	287	27,552,000
日新	31,000	180	5,580,000
丸全昭和運輸	30,000	239	7,170,000
センコー	33,000	287	9,471,000
日本梱包運輸	25,700	723	18,581,100
福山通運	47,000	430	20,210,000
セイノーホールディングス	62,000	551	34,162,000
神奈川中央交通	13,000	409	5,317,000
日立物流	16,300	1,283	20,912,900
日本郵船	650,000	169	109,850,000
商船三井	432,000	239	103,248,000
川崎汽船	273,000	130	35,490,000
NSユニテッド海運	60,000	104	6,240,000
乾汽船	13,800	250	3,450,000
飯野海運	43,200	352	15,206,400
第一中央汽船	72,000	98	7,056,000
全日本空輸	1,083,000	232	251,256,000
国際航業HLDGS	14,000	187	2,618,000
三菱倉庫	60,000	780	46,800,000
三井倉庫	41,000	273	11,193,000
住友倉庫	59,000	356	21,004,000
渋沢倉庫	24,000	210	5,040,000
ヤマタネ	58,000	112	6,496,000
東陽倉庫	18,000	164	2,952,000
日本トランスシティ	20,000	238	4,760,000
安田倉庫	8,100	463	3,750,300
東洋埠頭	37,000	120	4,440,000
上組	84,000	628	52,752,000
郵船ロジスティクス	7,100	979	6,950,900
近鉄エクスプレス	7,300	2,263	16,519,900
東京放送HD	47,900	928	44,451,200
日本テレビ放送網	6,690	10,390	69,509,100
テレビ朝日	193	116,700	22,523,100
スカパーJSAATHD	622	39,050	24,289,100
テレビ東京HD	6,400	1,063	6,803,200
アイ・ティー・シーネットワーク	10,700	469	5,018,300
イー・アクセス	716	17,180	12,300,880
NECモバイルリング	2,300	2,533	5,825,900

日本電信電話	363,500	3,775	1,372,212,500
K D D I	1,228	505,000	620,140,000
光通信	7,300	1,940	14,162,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,500	135,000	877,500,000
GMOインターネット	28,100	295	8,289,500
ゼンリン	13,000	696	9,048,000
昭文社	5,700	575	3,277,500
角川グループHLDGS	7,500	2,661	19,957,500
中部電力	269,600	1,454	391,998,400
関西電力	335,400	1,144	383,697,600
中国電力	118,800	1,309	155,509,200
北陸電力	86,900	1,368	118,879,200
東北電力	210,700	793	167,085,100
四国電力	77,900	2,142	166,861,800
九州電力	187,800	1,061	199,255,800
北海道電力	86,300	1,032	89,061,600
沖縄電力	7,400	3,265	24,161,000
電源開発	54,000	1,929	104,166,000
東京瓦斯	998,000	330	329,340,000
大阪瓦斯	812,000	294	238,728,000
東邦瓦斯	219,000	457	100,083,000
北海道瓦斯	39,000	260	10,140,000
西部瓦斯	145,000	205	29,725,000
静岡瓦斯	32,000	513	16,416,000
松竹	54,000	713	38,502,000
東宝	57,500	1,311	75,382,500
エイチ・アイ・エス	9,200	1,902	17,498,400
東映	36,000	347	12,492,000
NTTデータ	495	236,100	116,869,500
共立メンテナンス	4,700	1,291	6,067,700
建設技術研究所	6,800	513	3,488,400
アインファーマシーズ	4,400	3,420	15,048,000
東京テアトル	58,000	110	6,380,000
よみうりランド	23,000	242	5,566,000
東京都競馬	82,000	105	8,610,000
常磐興産	55,000	76	4,180,000
カナモト	12,000	494	5,928,000
東京ドーム	82,000	171	14,022,000
D T S	9,600	908	8,716,800
スクウェア・エニックス・HD	27,800	1,556	43,256,800
カプコン	15,500	1,943	30,116,500
日本空港ビルデング	26,300	1,111	29,219,300
トランス・コスモス	11,100	886	9,834,600
乃村工藝社	21,000	226	4,746,000
S C S K	17,400	1,240	21,576,000
藤田観光	34,000	272	9,248,000
日本管財	3,200	1,390	4,448,000
トーカイ	3,500	1,725	6,037,500
セコム	80,600	3,445	277,667,000
アイネス	13,200	542	7,154,400
丹青社	14,000	212	2,968,000
メイテック	13,800	1,467	20,244,600
T K C	7,000	1,546	10,822,000
アサツー ディ・ケイ	15,100	1,894	28,599,400
富士ソフト	11,900	1,290	15,351,000

応用地質	9,900	783	7,751,700
船井総合研究所	7,900	534	4,218,600
NSD	19,500	602	11,739,000
コナミ	36,400	2,286	83,210,400
ベネッセホールディングス	25,600	3,480	89,088,000
イオンディライト	9,900	1,623	16,067,700
ニチイ学館	18,100	872	15,783,200
ダイセキ	13,700	1,356	18,577,200
元気寿司	4,700	947	4,450,900
トラスコ中山	9,800	1,468	14,386,400
ヤマダ電機	38,310	5,500	210,705,000
オートバックスセブン	9,000	3,570	32,130,000
アークランドサカモト	5,700	1,312	7,478,400
ニトリホールディングス	15,200	7,190	109,288,000
愛眼	13,100	397	5,200,700
吉野家ホールディングス	208	101,000	21,008,000
加藤産業	12,100	1,578	19,093,800
イエローハット	7,500	1,328	9,960,000
富士エレクトロニクス	4,100	1,000	4,100,000
JBC Cホールディングス	9,300	511	4,752,300
サガミチェーン	12,000	503	6,036,000
日伝	3,000	2,593	7,779,000
因幡電機産業	8,500	2,198	18,683,000
住金物産	31,000	182	5,642,000
プレナス	9,200	1,212	11,150,400
ミニストップ	5,400	1,430	7,722,000
アークス	11,000	1,462	16,082,000
バロー	16,200	1,215	19,683,000
ミスミグループ本社	29,100	1,644	47,840,400
ベルク	3,900	1,122	4,375,800
大庄	6,500	952	6,188,000
タキヒヨー	13,000	431	5,603,000
ファーストリテイリング	18,500	12,320	227,920,000
ソフトバンク	359,100	2,547	914,627,700
スズケン	31,000	1,978	61,318,000
サンドラッグ	14,900	2,430	36,207,000
ベルーナ	10,800	575	6,210,000
合計	122,246,309		79,663,342,555

(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 100,000株 三菱UFJフィナンシャルG 600,000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23年12月30日

資産総額	719,937,853円
負債総額	166,838円
純資産総額（ - ）	719,771,015円
発行済数量	1,503,865,474口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.4786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23年12月30日

資産総額	82,875,459,760円
負債総額	92,187,866円
純資産総額（ - ）	82,783,271,894円
発行済数量	206,802,808,185口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.4003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23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23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	2	2,103
追加型株式投資信託	396	6,432,105
株式投資信託 合計	398	6,434,208
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,465,639
公社債投資信託 合計	17	2,465,639
総合計	415	8,899,847

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）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、第52期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）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は、あずさ監査法人により監査を受け、第52期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31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。

また、第53期事業年度に係る中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,783,803	1,820,358
有価証券	26,970,072	18,987,155
前払金	136	579
前払費用	77,248	24,840
未収入金	3,858	6,925
未収委託者報酬	7,030,430	6,933,076
未収収益	90,787	41,963
貯蔵品	30,324	23,337
繰延税金資産	566,334	286,080
その他	256,955	501,484
流動資産計	39,809,953	28,625,803
固定資産		
有形固定資産	1 1,186,818	1 967,190
建物（純額）	318,162	332,407

器具備品（純額）	757,333	634,782
建設仮勘定	111,322	-
無形固定資産	1,751,209	2,414,530
ソフトウェア	1,558,342	1,364,617
ソフトウェア仮勘定	179,630	1,037,069
電話加入権	11,850	11,850
商標権	660	396
その他	725	596
投資その他の資産	10,657,920	18,825,476
投資有価証券	10,018,677	12,339,547
関係会社株式	737,012	5,141,069
出資金	178,806	142,215
従業員に対する長期貸付金	104,419	99,889
差入保証金	617,615	609,781
長期前払費用	8,402	7,607
投資不動産（純額）	1 489,861	1 490,114
貸倒引当金	3 1,496,873	4,750
固定資産計	13,595,948	22,207,196
資産合計	53,405,901	50,833,000

（単位：千円）

	前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	46,289	46,454
未払金	7,304,929	6,501,119
未払収益分配金	31,110	27,599
未払償還金	261,645	119,838
未払手数料	3,847,895	3,725,807
その他未払金	2 3,164,277	2 2,627,872
未払費用	2,212,051	2,395,029
未払法人税等	692,446	895,379
未払消費税等	104,897	383,973
賞与引当金	838,400	263,000
その他	168,621	-
流動負債計	11,367,635	10,484,955
固定負債		
退職給付引当金	1,179,482	1,410,635
役員退職慰労引当金	39,300	59,160
繰延税金負債	1,963,856	1,977,913
固定負債計	3,182,638	3,447,708
負債合計	14,550,274	13,932,663
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		

資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	-
繰越利益剰余金	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計	12,259,401	10,248,473
株主資本合計	38,929,401	36,918,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	18,061	104,040
繰延ヘッジ損益	55,712	85,902
評価・換算差額等合計	73,774	18,137
純資産合計	38,855,627	36,900,336
負債・純資産合計	53,405,901	50,833,000

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,362,142	72,303,483
その他営業収益	432,889	345,390
営業収益計	63,795,032	72,648,873
営業費用		
支払手数料	37,293,022	41,437,322
広告宣伝費	917,652	967,991
公告費	257	1,256
受益証券発行費	131	3
調査費	4,336,342	6,192,360
調査費	771,298	831,159
委託調査費	3,565,043	5,361,200
委託計算費	601,778	718,414
営業雑経費	1,793,369	1,806,147
通信費	284,273	287,454
印刷費	837,408	674,758
協会費	45,168	47,465
諸会費	11,118	10,778
その他営業雑経費	615,400	785,691
営業費用計	44,942,552	51,123,496
一般管理費		
給料	4,847,709	4,192,794
役員報酬	217,200	157,200
給料・手当	3,478,553	3,545,655
賞与	313,555	226,939
賞与引当金繰入額	838,400	263,000
福利厚生費	680,311	619,459
交際費	80,019	68,476
寄付金	-	638
旅費交通費	178,718	266,082
租税公課	166,974	169,305
不動産賃借料	731,728	680,147
退職給付費用	303,972	334,864
役員退職慰労引当金繰入額	37,500	28,500
固定資産減価償却費	941,172	897,352
諸経費	990,534	1,170,318
一般管理費計	8,958,640	8,427,939
営業利益	9,893,838	13,097,437

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		61,884	1	573,514
有価証券利息		87,447		23,029
受取利息		3,425		2,673
時効成立分配金・償還金		40,507		149,120
投資有価証券売却益		213,196		38,591
有価証券償還益		33,090		-
その他		82,595		45,094
営業外収益計		522,147		832,022
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		101,945		98,613
貯蔵品廃棄損		44,214		25,533
投資有価証券売却損		263,840		7,515
為替差損		7,870		-
投資不動産管理費用		-		20,028
その他		68,406		36,603
営業外費用計		486,276		188,294
経常利益		9,929,709		13,741,165
特別利益				
貸倒引当金戻入額		159,959		614,232
特別利益計		159,959		614,232
特別損失				
固定資産除却損	2	16,233	2	1,067
ゴルフ会員権評価損		-		21,290
減損損失	3	76,450	3	35,468
その他		-		768
特別損失計		92,683		58,595
税引前当期純利益		9,996,985		14,296,802
法人税、住民税及び事業税		4,592,433		4,834,931
法人税等調整額		516,225		256,140
法人税等合計		4,076,208		5,091,072
当期純利益		5,920,777		9,205,730

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23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		
別途積立金の取崩	-	2,800,000
当期変動額合計	-	2,800,000
当期末残高	2,800,000	-
繰越利益剰余金		
前期末残高	9,659,553	9,085,103
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	2,800,000
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	789,072
当期末残高	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計		
前期末残高	12,833,851	12,259,401
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657

当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	2,010,927
当期末残高	12,259,401	10,248,473

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
株主資本合計		
前期末残高	39,503,851	38,929,401
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	2,010,927
当期末残高	38,929,401	36,918,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	618,549	18,061
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	600,487	85,978
当期変動額合計	600,487	85,978
当期末残高	18,061	104,040
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	-	55,712
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,712	141,615
当期変動額合計	55,712	141,615
当期末残高	55,712	85,902
評価・換算差額等合計		
前期末残高	618,549	73,774
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	544,775	55,636
当期末残高	73,774	18,137
純資産合計		
前期末残高	38,885,301	38,855,627
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	29,674	1,955,290
当期末残高	38,855,627	36,900,336

重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23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。	(1) 有形固定資産及び投資不動産 同左 (2) 無形固定資産 同左
4. 引当金の計上基準	(3) 長期前払費用 定額法によっております。 (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。	(3) 長期前払費用 同左 (1) 貸倒引当金 債権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 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。

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>(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>	<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 同左</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 同左</p> <p>(3) ヘッジ方針 同左</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 同左</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>	
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21年4月1日 至 平成22年3月31日)</p>	<p>当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)</p>
---	---

	<p>(資産除去債務に関する会計基準の適用)</p> <p>当事業年度より、「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。</p> <p>なお、当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p>
--	--

表示方法の変更

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
	<p>(損益計算書)</p> <p>1. 「有価証券償還益」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外収益に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。</p> <p>なお、当事業年度の、営業外収益の「その他」に含まれている「有価証券償還益」の金額は、3,185千円であります。</p> <p>2. 「投資不動産管理費用」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用の「その他」に含めて表示しておりましたが、重要性が増したため、当事業年度より、営業外費用の「投資不動産管理費用」として区分掲記しております。</p> <p>なお、前事業年度の営業外費用の「その他」に含まれている「投資不動産管理費用」の金額は、17,078千円であります。</p> <p>3. 「為替差損」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。なお、当事業年度の、営業外費用の「その他」に含まれている「為替差損」の金額は、8,906千円であります。</p>

追加情報

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
<p>(投資有価証券売却損益の計上区分の変更)</p> <p>従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。</p> <p>この結果、従来の方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22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23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> <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</p> <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 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598,500千円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <p>建物 854,118千円 器具備品 2,129,756千円 投資建物 700,991千円 投資器具備品 28,141千円</p> <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 2,591,913千円</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
<p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,439千円 ソフトウェア 14,793千円</p>	<p>1 関係会社項目 関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 受取配当金 460,584千円</p> <p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,067千円</p>

3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。
場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

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つのグルーピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,450千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物7,750千円及び土地68,700千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。

3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。
場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

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つのグルーピングとしております。

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（35,468千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物26,868千円及び土地8,600千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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

(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23年6月24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 9,182百万円
 配当の原資 利益剰余金
 1株当たり配当額 3,520円
 基準日 平成23年3月31日
 効力発生日 平成23年6月27日

(リース取引関係)

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
(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	
(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 該当事項はありません。	
(2)未経過リース料期末残高相当額 該当事項はありません。	
(3)支払リース料及び減価償却費相当額	

支払リース料	985千円
減価償却費相当額	985千円
(4)減価償却費相当額の算定方法	
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	

(金融商品関係)

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係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 其他有価証券	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31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。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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、株式であります。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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。

(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23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	1,820,358	1,820,358	-
(2) 未収委託者報酬	6,933,076	6,933,076	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	30,154,565	30,154,565	-
資産計	38,908,001	38,908,001	-
(1) 未払手数料	3,725,807	3,725,807	-
(2) その他未払金	2,627,872	2,627,872	-
(3) 未払費用（*1）	1,951,710	1,951,710	-
負債計	8,305,391	8,305,391	-
デリバティブ取引（*2）	183,430	183,430	-

（*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 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	5,141,069
(3) 長期差入保証金	609,781

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	1,820,358	-	-	-
未収委託者報酬	6,933,076	-	-	-
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	-	1,588,634	4,868,529	-
合計	8,753,434	1,588,634	4,868,529	-

（有価証券関係）

前事業年度（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

当事業年度(平成23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 5,141,069千円)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			
その他			
証券投資信託の受益証券	4,822,299	4,383,992	438,306
小計	4,822,299	4,383,992	438,306
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
(1)株式	54,283	55,101	818
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	25,277,982	25,890,888	612,906
小計	25,332,266	25,945,990	613,724

合計	30,154,565	30,329,983	175,417
----	------------	------------	---------

(注) 非上場株式(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22年4月1日至平成23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	21,607,835	38,591	7,515
合計	21,607,835	38,591	7,515

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(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		
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	2,303,784	-	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	

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

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	2,435,030	-	183,430	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
	合計		2,435,030	-	183,430	

(退職給付関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
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。	1. 採用している退職給付制度の概要 同左
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	2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,410,635千円 退職給付引当金 1,410,635千円
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	3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 191,300千円 その他 143,564千円
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。	退職給付費用 334,864千円 なお、「その他」の143,564千円は、確定 拠出年金への掛金支払額であります。

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
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	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
繰延税金資産 千円	繰延税金資産 千円
減損損失 915,392	減損損失 928,499
貸倒引当金 609,077	退職給付引当金 573,987
退職給付引当金 479,931	連結法人間取引(譲渡損) 294,850
賞与引当金 302,163	投資有価証券評価損 216,468
株式譲渡損繰延 287,965	未払事業税 212,062
投資有価証券評価損 225,062	出資金評価損 128,238
外貨建有価証券換算差額 176,654	その他有価証券評価差額金 125,395
未払事業税 163,956	賞与引当金 107,014
出資金評価損 126,163	器具備品 38,093
その他有価証券評価差額金 65,652	役員退職慰労引当金 24,072
未払社会保険料 44,836	未払社会保険料 11,722

繰延ヘッジ損益	38,221	その他	28,763
器具備品	38,093	繰延税金資産小計	2,689,169
役員退職慰労引当金	15,991	評価性引当額	1,547,609
その他	27,316	繰延税金資産合計	1,141,560
繰延税金資産小計	3,516,480	繰延税金負債	
評価性引当額	2,139,543	連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301
繰延税金資産合計	1,376,937	繰延ヘッジ損益	58,934
繰延税金負債		その他	2,156
株式譲渡益繰延	2,772,301	繰延税金負債合計	2,833,392
その他	2,156	繰延税金負債の純額	1,691,832
繰延税金負債合計	2,774,458		
繰延税金負債の純額	1,397,521		
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		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。		法定実効税率 （調整）	40.69%
		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21
		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.25
		住民税均等割	0.02
		評価性引当額	4.14
		その他	0.07
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60

(関連当事者情報)

前事業年度（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）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接 100.0	経営管理	債務保証	598,500	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

種類	会社等の名称	所在地	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)

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23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 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)
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	1,384,110	-	-
子会社	Daiwa Asset Management (India)Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 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。

(2) インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を1株につき72円86銭で引き受けております。

(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 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	21,941,957	未払手数料	2,760,790
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	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	-	-
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	1,085,626	未払費用	129,623

(注) 1. 上記の金額のうち、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。

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）

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31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。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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、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。

[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]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

[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]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

(追加情報)

当事業年度より、「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)

前事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	当事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
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	1株当たり純資産額 14,146.05円 1株当たり当期純利益 3,529.09円
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	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21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
当期純利益(千円)	5,920,777	9,205,730
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21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(追加情報)

前事業年度(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。

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

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、インド共和国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いたしました。

本件について、平成22年12月20日に買収手続きを完了した後、「SAMI」及び「STC」は、Daiwa Asset Management (India) Private Limited(以下、「DAMI」)及びDaiwa Trustee Company (India) Private Limited(以下、「DTC」)として商号を変更しました。その後、インドにおける外国資本規制上の最低払込金額を満たすために、平成23年1月31日に増資を行っております。「DAMI」及び「DTC」は大和証券グループの100%子会社であり、当社の取得原価、増資の引受、貸借対照表計上額並びに出資比率は下記のとおりであります。

(単位：千円)

	DAMI	DTC
取得原価	1,059,552	2,717
増資の引受	3,204,985	9,944
貸借対照表計上額(注) 関係会社株式	4,391,020	13,037
出資比率	91.0%	99.9%

(注)取得付随費用を算入した後の金額になります。

[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23年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		5,608,473
有価証券		9,013,133
未収委託者報酬		6,773,690
貯蔵品		12,758
繰延税金資産		197,087
その他		472,852
流動資産計		22,077,996
固定資産		
有形固定資産	1	870,049
無形固定資産		
ソフトウェア		2,237,473
その他		321,718
無形固定資産合計		2,559,192
投資その他の資産		
投資有価証券		17,664,932
その他	1	1,296,211
貸倒引当金		4,750
投資その他の資産合計		18,956,394
固定資産計		22,385,635
資産合計		44,463,632

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成23年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,629,444
未払費用		2,988,680
未払法人税等		981,739
賞与引当金		277,000
その他	3	306,598
流動負債計		10,183,463
固定負債		
繰延税金負債		1,436,117
退職給付引当金		1,566,148
役員退職慰労引当金		66,370
固定負債計		3,068,636
負債合計		13,252,099

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	4,745,092
利益剰余金合計	5,119,390
株主資本合計	31,789,390
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	817,480
繰延ヘッジ損益	239,622
評価・換算差額等合計	577,857
純資産合計	31,211,532
負債・純資産合計	44,463,632

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		37,977,881
その他営業収益		178,035
営業収益計		38,155,917
営業費用		
支払手数料		21,394,608
その他営業費用		5,556,258
営業費用計		26,950,866
一般管理費	1	4,367,716
営業利益		6,837,334
営業外収益	2	165,615
営業外費用	1, 3	123,075
経常利益		6,879,874
特別損失		4,756
税引前中間純利益		6,875,117
法人税、住民税及び事業税		2,890,995
法人税等調整額		68,802
中間純利益		4,052,924

(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23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)
株主資本		
資本金		
当期首残高		15,174,272
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高		11,495,727
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		11,495,727
資本剰余金合計		
当期首残高		11,495,727
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高		374,297
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高		9,874,176
当中間期変動額		
剰余金の配当		9,182,008
中間純利益		4,052,924
当中間期変動額合計		5,129,083
当中間期末残高		4,745,092

(単位:千円)

		当中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)
利益剰余金合計		
当期首残高		10,248,473
当中間期変動額		
剰余金の配当		9,182,008
中間純利益		4,052,924
当中間期変動額合計		5,129,083
当中間期末残高		5,119,390

株主資本合計	
当期首残高	36,918,473
当中間期変動額	
剰余金の配当	9,182,008
中間純利益	4,052,924
当中間期変動額合計	5,129,083
当中間期末残高	31,789,390
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	104,040
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）	713,440
当中間期変動額合計	713,440
当中間期末残高	817,480
繰延ヘッジ損益	
当期首残高	85,902
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）	153,719
当中間期変動額合計	153,719
当中間期末残高	239,622
評価・換算差額等合計	
当期首残高	18,137
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）	559,720
当中間期変動額合計	559,720
当中間期末残高	577,857
純資産合計	
当期首残高	36,900,336
当中間期変動額	
剰余金の配当	9,182,008
中間純利益	4,052,924
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	559,720
当中間期変動額合計	5,688,804
当中間期末残高	31,211,532

重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)
--	--

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

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

追加情報

当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)
<p>(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用) 当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
1. 減価償却累計額 有形固定資産 投資その他の資産	 3,036,275千円 727,880千円
2. 債務保証 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,240,890千円に対して保証を行っております。	
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。	

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
1. 減価償却実施額	

有形固定資産	131,539千円
無形固定資産	363,595千円
投資その他の資産	7,309千円
2. 営業外収益の主要項目	
受取配当金	46,562千円
投資有価証券売却益	44,885千円
時効成立分配金・償還金	33,386千円
法人税還付加算金	20,450千円
3. 営業外費用の主要項目	
投資有価証券償還損	67,771千円
為替差損	13,127千円
貯蔵品廃棄損	13,042千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 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23年6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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ます。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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ます。未払費用は主にファンド運用に係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「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、外貨建投資有価証券の一部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23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	5,608,473	5,608,473	-
(2) 未収委託者報酬	6,773,690	6,773,690	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	20,364,859	20,364,859	-
資産計	32,747,023	32,747,023	-
(1) 未払金	5,629,444	5,629,444	-
(2) 未払費用(*1)	2,636,853	2,636,853	-
負債計	8,266,298	8,266,298	-
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	(1,773)	(1,773)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(30,798)	(30,798)	-
デリバティブ取引計	(32,572)	(32,572)	-

(*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) 未払金、及び(2) 未払費用

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

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
非上場株式	1,172,137
子会社株式	5,141,069
長期差入保証金	540,246

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	5,608,473	-	-	-
未収委託者報酬	6,773,690	-	-	-
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	-	1,496,072	6,195,633	-
合計	12,382,163	1,496,072	6,195,633	-

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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 5,141,069千円）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 その他 証券投資信託の受益証券	3,556,521	3,405,918	150,602
小計	3,556,521	3,405,918	150,602
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの (1)株式	42,785	55,101	12,316
(2)その他 証券投資信託の受益証券	16,765,553	18,282,157	1,516,604
小計	16,808,338	18,337,259	1,528,920
合計	20,364,859	21,743,177	1,378,317

（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」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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

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	971,384	-	1,773	1,773
	合計	971,384	-	1,773	1,773

(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		
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	1,946,277	-	30,798	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
	合計		1,946,277	-	30,798	

(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23年4月1日 至 平成23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23年4月1日 至 平成23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。

[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23年 4 月 1 日 至 平成23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23年 4 月 1 日 至 平成23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23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月30日）

該当事項はありません。

（ 1 株当たり情報 ）

当中間会計期間 （自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月30日）	
1 株当たり純資産額	11,965.20円
1 株当たり中間純利益金額	1,553.72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)	4,052,924
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,052,924
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。

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

提出日前1年以内において、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に該当する事実はありません。

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

関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

資本金の額 342,037百万円（平成23年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (平成23年3月 末日現在)	事業の内容
住友信託銀行株式会社	342,037	(注1)
日本生命保険相互会社	1,100,000	(注2)

(注1) 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。

(注2) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。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ないます。

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23年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用することがあります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成24年1月13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22年12月1日から平成23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であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの平成23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23年6月2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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福 井 淳
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	梅 津 広

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23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23年11月29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 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 内田 和男 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、「委託会社等の経理の状況」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23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成23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23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(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（前期）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。