

**【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25年2月21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 白川 真  
**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
**【事務連絡者氏名】** 長谷川 英男  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
**【電話番号】** 03-5555-3111  
**【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25年2月22日から平成26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25年2月22日から平成26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、販売会社に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時までには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。一般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

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） | 補足分類    |
|-------------|--------|---------------|---------|
| 単位型投信       | 国内     | 株式            | インデックス型 |
| 追加型投信       | 海外     | 債券            |         |
|             | 内外     | 不動産投信         | 特殊型     |
|             |        | その他資産<br>( )  |         |
|             |        | 資産複合          |         |

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

| 投資対象資産                       | 決算頻度         | 投資対象地域      | 投資形態             | 対象インデックス   |
|------------------------------|--------------|-------------|------------------|------------|
| 株式                           | 年1回          | グローバル       |                  |            |
| 一般                           |              | 日本          |                  | 日経225      |
| 大型株                          | 年2回          | 北米          | ファミリー<br>ファンド    |            |
| 中小型株                         | 年4回          | 欧州          |                  | TOPIX      |
| 債券                           | 年6回<br>(隔月)  | アジア         |                  |            |
| 一般                           | 年12回<br>(毎月) | オセアニア       |                  |            |
| 公債                           | 日々           | 中南米         | ファンド・オブ・<br>ファンズ | その他<br>( ) |
| 社債                           | その他<br>( )   | アフリカ        |                  |            |
| その他債券                        |              | 中近東<br>(中東) |                  |            |
| クレジット属性<br>( )               |              | エマージング      |                  |            |
| 不動産投信                        |              |             |                  |            |
| その他資産<br>(投資信託証券)<br>(株式 一般) |              |             |                  |            |
| 資産複合<br>( )                  |              |             |                  |            |
| 資産配分固定型                      |              |             |                  |            |
| 資産配分変更型                      |              |             |                  |            |

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般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。

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

- ・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。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

# 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。
  - (a) 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。
  - (b) 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。
  - (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

## 運用プロセス



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

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

## ■ 東証株価指数（TOPIX）について

### ◆ 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

### ◆ 東証株価指数（TOPIX）の特徴

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

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

（注1）TOPIXの算出方法：

毎日の指数 = 当日の時価総額 ÷ 基準時の時価総額 × 100

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

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

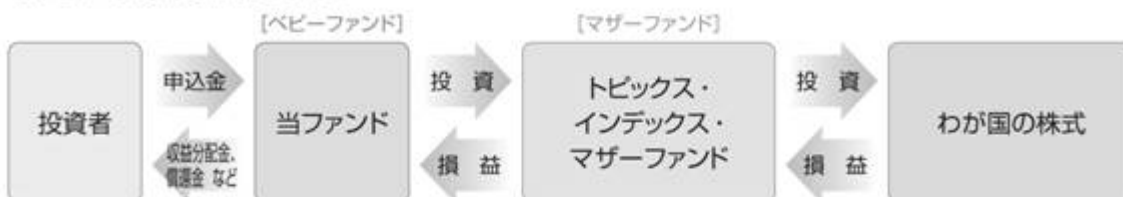
- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利、ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有する。
- ② (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができる。
- ③ (株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX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の指数値およ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の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、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、保証また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または公衆に対し、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、当社また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または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。



## 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、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<br/>一部解約請求に関する事務<br/>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<br/>信託財産の運用指図<br/>信託財産の計算<br/>運用報告書の作成 など</p>  |
| 受託会社   | 三井住友信託銀行株式会社<br>再信託受託会社：<br>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。委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br/>信託財産の計算 など</p> |
| 投資対象   | 損益 投資   |
|        | 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。

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24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。<br>(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<br>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<br>2,608,525 | %<br>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（T O P I X）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、三井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

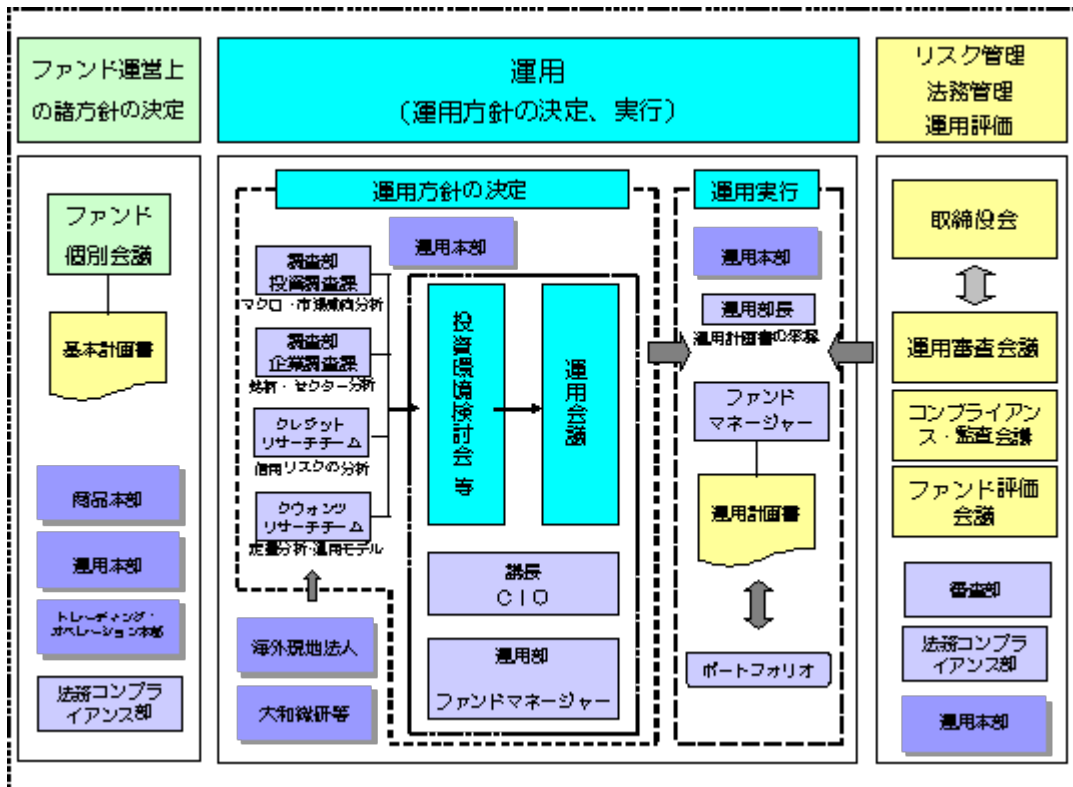
4．手形割引市場において売買される手形

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C I O（Chief Investment Officer）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

C I O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．C I O（Chief Investment Officer）（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．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

#### ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35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24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

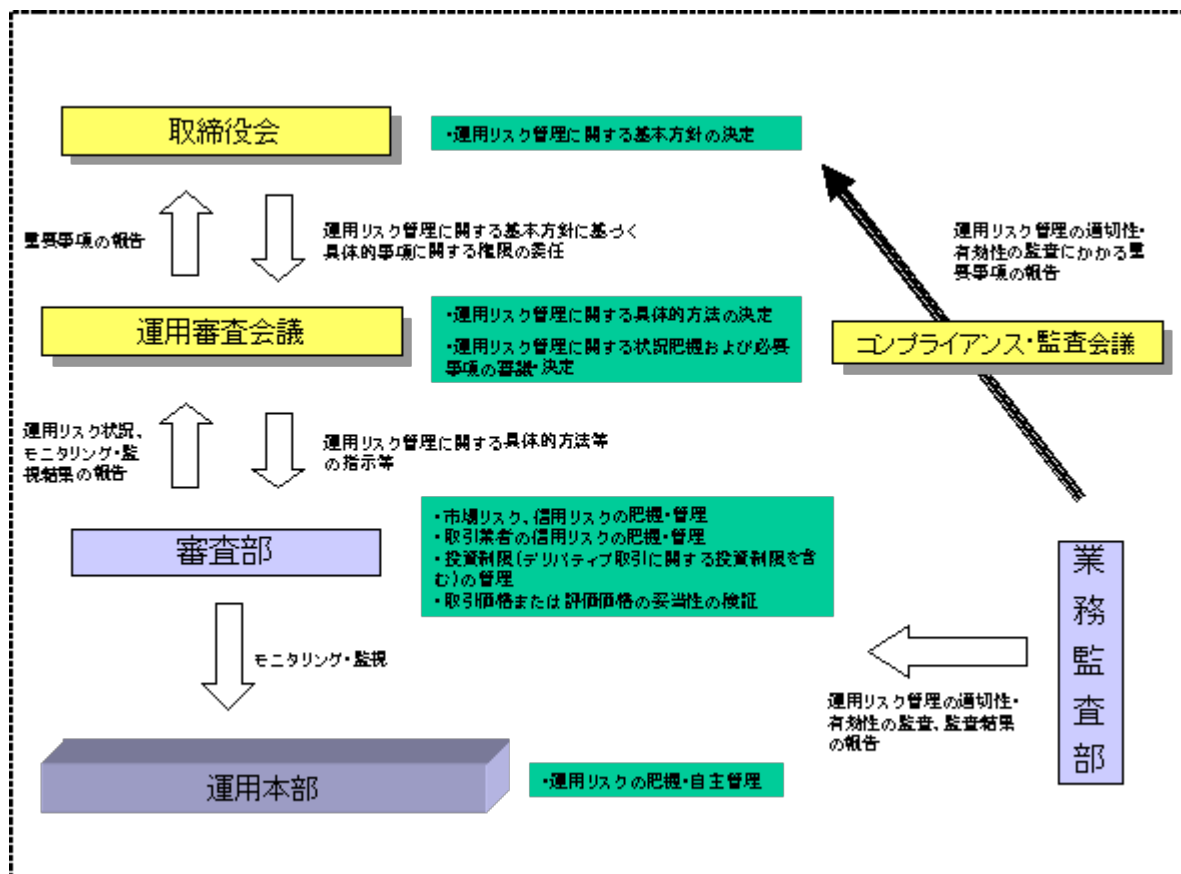
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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%<br>（税抜0.08%） | 年率0.063%<br>（税抜0.06%） | 年率0.0315%<br>（税抜0.03%） |

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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。

## &lt; マザーファンドより支弁する手数料等 &gt;

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。

## &lt; 注1 &gt; 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25年1月1日現在のものですので、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24年12月28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             | 1,108,302,899 | 99.98   |
| 内 日本                  | 1,108,302,899 | 99.98   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 189,333       | 0.02    |
| 純資産総額                 | 1,108,492,232 | 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24年12月28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<br>または<br>面金額            | 簿価単<br>価<br>簿価<br>(円)   | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|----------------------|----|-----------|--------------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 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 | 2,291,776,054<br>1,007,844,091 | 0.4397<br>1,108,302,899 | 0.4836<br>1,108,302,899 | 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<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|--|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
|  |                       |                       |                            |                            |

|                          |               |             |        |        |
|--------------------------|---------------|-------------|--------|--------|
| 第1計算期間末<br>(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<br>(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<br>(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<br>(平成22年11月30日) | 583,936,066   | 583,936,066 | 0.5526 | 0.5526 |
| 第5計算期間末<br>(平成23年11月30日) | 701,141,147   | 701,141,147 | 0.4777 | 0.4777 |
| 平成23年12月末日               | 719,771,015   | -           | 0.4786 | -      |
| 平成24年1月末日                | 762,784,067   | -           | 0.4959 | -      |
| 2月末日                     | 860,827,506   | -           | 0.5492 | -      |
| 3月末日                     | 904,909,221   | -           | 0.5673 | -      |
| 4月末日                     | 850,876,914   | -           | 0.5336 | -      |
| 5月末日                     | 797,524,519   | -           | 0.4775 | -      |
| 6月末日                     | 878,205,753   | -           | 0.5114 | -      |
| 7月末日                     | 856,199,066   | -           | 0.4890 | -      |
| 8月末日                     | 867,998,375   | -           | 0.4859 | -      |
| 9月末日                     | 909,812,905   | -           | 0.4948 | -      |
| 10月末日                    | 931,060,962   | -           | 0.4979 | -      |
| 第6計算期間末<br>(平成24年11月30日) | 994,840,569   | 994,840,569 | 0.5241 | 0.5241 |
| 12月末日                    | 1,108,492,232 | -           | 0.5771 | -      |

## 【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      |
| 第6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   |
| 第6計算期間 | 9.7    |

## (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  |
| 第6計算期間 | 571,631,321 | 141,136,727 |

(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24年12月28日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 株式                    | 95,158,546,930 | 98.12   |
| 内 日本                  | 95,158,546,930 | 98.12   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,826,443,834  | 1.88    |
| 純資産総額                 | 96,984,990,764 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類      | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|--------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引（買建） | 1,869,455,000 | 1.93    |
| 内 日本         | 1,869,455,000 | 1.93    |

(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24年12月28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、<br>口数<br>または<br>額<br>面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)         | 評価単価<br>時価<br>(円)         | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---------------|----|----|-------|------------------------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|
| 1 | トヨタ自動車        | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 1,031,300                    | 3,255.00<br>3,356,881,500 | 4,005.00<br>4,130,356,500 | 4.26            |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業   | 5,993,500                    | 388.00<br>2,325,478,000   | 461.00<br>2,763,003,500   | 2.85            |
| 3 | 本田技研          | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 677,200                      | 2,674.00<br>1,810,832,800 | 3,145.00<br>2,129,794,000 | 2.20            |

|    |              |    |    |                |            |                            |                            |      |
|----|--------------|----|----|----------------|------------|----------------------------|----------------------------|------|
| 4  | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業            | 598,400    | 2,603.00<br>1,557,635,200  | 3,115.00<br>1,864,016,000  | 1.92 |
| 5  | キヤノン         | 日本 | 株式 | 電気機器           | 498,400    | 2,861.00<br>1,425,922,400  | 3,340.00<br>1,664,656,000  | 1.72 |
| 6  | みずほフィナンシャルG  | 日本 | 株式 | 銀行業            | 10,190,000 | 135.00<br>1,375,650,000    | 157.00<br>1,599,830,000    | 1.65 |
| 7  | ファナック        | 日本 | 株式 | 電気機器           | 83,500     | 13,990.00<br>1,168,165,000 | 15,920.00<br>1,329,320,000 | 1.37 |
| 8  | 日本電信電話       | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 333,300    | 3,600.00<br>1,199,880,000  | 3,630.00<br>1,209,879,000  | 1.25 |
| 9  | 武田薬品         | 日本 | 株式 | 医薬品            | 313,400    | 3,735.00<br>1,170,549,000  | 3,855.00<br>1,208,157,000  | 1.25 |
| 10 | ソフトバンク       | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 362,200    | 3,235.00<br>1,171,717,000  | 3,140.00<br>1,137,308,000  | 1.17 |
| 11 | 三菱地所         | 日本 | 株式 | 不動産業           | 553,000    | 1,504.00<br>831,712,000    | 2,049.00<br>1,133,097,000  | 1.17 |
| 12 | 三菱商事         | 日本 | 株式 | 卸売業            | 617,500    | 1,549.57<br>956,864,907    | 1,647.00<br>1,017,022,500  | 1.05 |
| 13 | 日本たばこ産業      | 日本 | 株式 | 食料品            | 399,100    | 2,260.00<br>901,966,000    | 2,440.00<br>973,804,000    | 1.00 |
| 14 | 日立           | 日本 | 株式 | 電気機器           | 1,881,000  | 479.66<br>902,254,760      | 504.00<br>948,024,000      | 0.98 |
| 15 | 三井物産         | 日本 | 株式 | 卸売業            | 682,100    | 1,185.00<br>808,288,500    | 1,283.00<br>875,134,300    | 0.90 |
| 16 | 小松製作所        | 日本 | 株式 | 機械             | 391,600    | 1,670.00<br>653,972,000    | 2,184.00<br>855,254,400    | 0.88 |
| 17 | 東日本旅客鉄道      | 日本 | 株式 | 陸運業            | 147,800    | 5,024.09<br>742,561,957    | 5,580.00<br>824,724,000    | 0.85 |
| 18 | 日産自動車        | 日本 | 株式 | 輸送用機器          | 1,014,400  | 727.00<br>737,468,800      | 811.00<br>822,678,400      | 0.85 |
| 19 | 野村ホールディングス   | 日本 | 株式 | 証券・商品先物<br>取引業 | 1,620,700  | 305.00<br>494,313,500      | 503.00<br>815,212,100      | 0.84 |
| 20 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 6,502      | 128,300.00<br>834,206,600  | 124,000.00<br>806,248,000  | 0.83 |
| 21 | セブン&アイ・HLDGS | 日本 | 株式 | 小売業            | 329,900    | 2,330.00<br>768,667,000    | 2,437.00<br>803,966,300    | 0.83 |
| 22 | 信越化学         | 日本 | 株式 | 化学             | 150,500    | 4,630.00<br>696,815,000    | 5,230.00<br>787,115,000    | 0.81 |
| 23 | 三井不動産        | 日本 | 株式 | 不動産業           | 374,000    | 1,610.49<br>602,325,530    | 2,090.00<br>781,660,000    | 0.81 |
| 24 | 新日鐵住金        | 日本 | 株式 | 鉄鋼             | 3,550,000  | 175.05<br>621,429,594      | 210.00<br>745,500,000      | 0.77 |
| 25 | 東京海上HD       | 日本 | 株式 | 保険業            | 306,000    | 2,110.03<br>645,672,204    | 2,383.00<br>729,198,000    | 0.75 |
| 26 | アステラス製薬      | 日本 | 株式 | 医薬品            | 186,500    | 3,955.00<br>737,607,500    | 3,875.00<br>722,687,500    | 0.75 |
| 27 | KDDI         | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 112,100    | 5,770.00<br>646,817,000    | 6,090.00<br>682,689,000    | 0.70 |



|    |        |    |    |       |         |                         |                         |      |
|----|--------|----|----|-------|---------|-------------------------|-------------------------|------|
| 28 | デンソー   | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 197,600 | 2,780.00<br>549,328,000 | 2,973.00<br>587,464,800 | 0.61 |
| 29 | 三菱電機   | 日本 | 株式 | 電気機器  | 802,000 | 663.00<br>531,726,000   | 731.00<br>586,262,000   | 0.60 |
| 30 | ブリヂストン | 日本 | 株式 | ゴム製品  | 261,800 | 1,910.00<br>500,038,000 | 2,224.00<br>582,243,200 | 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        | 98.12% |
| 合計        | 98.12% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種         | 投資比率   |
|------------|--------|
| 水産・農林業     | 0.09%  |
| 鉱業         | 0.59%  |
| 建設業        | 2.64%  |
| 食料品        | 3.72%  |
| 繊維製品       | 0.83%  |
| パルプ・紙      | 0.29%  |
| 化学         | 5.62%  |
| 医薬品        | 4.69%  |
| 石油・石炭製品    | 0.75%  |
| ゴム製品       | 0.81%  |
| ガラス・土石製品   | 1.00%  |
| 鉄鋼         | 1.68%  |
| 非鉄金属       | 1.09%  |
| 金属製品       | 0.69%  |
| 機械         | 5.12%  |
| 電気機器       | 11.91% |
| 輸送用機器      | 11.02% |
| 精密機器       | 1.37%  |
| その他製品      | 1.36%  |
| 電気・ガス業     | 2.41%  |
| 陸運業        | 3.96%  |
| 海運業        | 0.31%  |
| 空運業        | 0.55%  |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.24%  |
| 情報・通信業     | 5.85%  |
| 卸売業        | 5.06%  |
| 小売業        | 4.03%  |
| 銀行業        | 10.18% |
| 証券、商品先物取引業 | 1.53%  |
| 保険業        | 2.44%  |
| その他金融業     | 0.99%  |
| 不動産業       | 3.29%  |
| サービス業      | 1.99%  |

|    |        |
|----|--------|
| 合計 | 98.12% |
|----|--------|

(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/<br>売建 | 数量  | 簿価             | 時価          | 投資<br>比率 |
|----------|----|-----------------|-----------|-----|----------------|-------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 日本 | TOPIX先物 2013年3月 | 買建        | 217 | 1,773,627,9251 | 869,455,000 | 1.93%    |

(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）

2012年12月28日現在  
基準価額・純資産の推移

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

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 5,771円 |
| 純資産総額 | 11億円   |

| 基準価額の騰落率 |        |
|----------|--------|
| 期間       | ファンド   |
| 1カ月間     | 10.1%  |
| 3カ月間     | 16.6%  |
| 6カ月間     | 12.8%  |
| 1年間      | 20.6%  |
| 3年間      | 0.8%   |
| 5年間      | -35.8% |
| 設定来      | -42.3% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 第1期    | 第2期    | 第3期    | 第4期    | 第5期    | 第6期    |  |  |  |
|-----|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--|--|--|
|     | 07年11月 | 08年12月 | 09年11月 | 10年11月 | 11年11月 | 12年11月 |  |  |  |
| 分配金 | 0円     | 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。

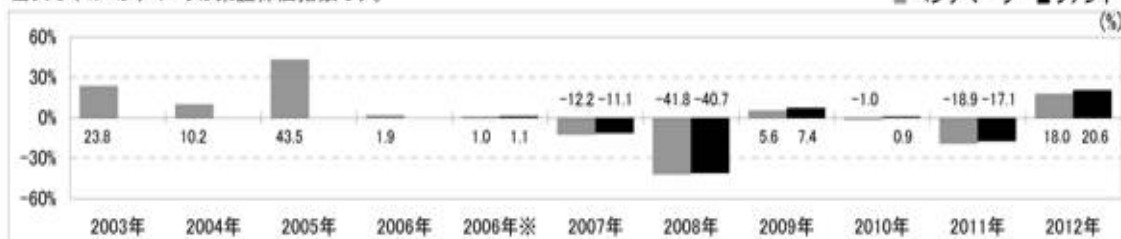
| 資産別構成        | 銘柄数   | 比率    | 株式東証33業種別構成 | 比率    | 組入上位10銘柄      | 業種名    | 比率    |
|--------------|-------|-------|-------------|-------|---------------|--------|-------|
| 国内株式         | 1,300 | 98.1% | 電気機器        | 11.9% | トヨタ自動車        | 輸送用機器  | 4.3%  |
| 国内株式先物       | 1     | 1.9%  | 輸送用機器       | 11.0% | 三菱UFJフィナンシャルG | 銀行業    | 2.8%  |
| 不動産投資信託等     | -     | -     | 銀行業         | 10.2% | 本田技研          | 輸送用機器  | 2.2%  |
| コール・ローン、その他  | -     | 1.9%  | 情報・通信業      | 5.8%  | TOPIX先物 2503月 | -      | 1.9%  |
| 合計           | 1,301 | -     | 化学          | 5.6%  | 三井住友フィナンシャルG  | 銀行業    | 1.9%  |
| 株式市場・上場別構成   |       |       | 機械          | 5.1%  | キャノン          | 電気機器   | 1.7%  |
| 一部(東証・大証・名証) |       | 98.1% | 卸売業         | 5.1%  | みずほフィナンシャルG   | 銀行業    | 1.6%  |
| 二部(東証・大証・名証) |       | -     | 医薬品         | 4.7%  | ファナック         | 電気機器   | 1.4%  |
| 新興市場他        |       | -     | 小売業         | 4.0%  | 日本電信電話        | 情報・通信業 | 1.2%  |
| その他          |       | -     | その他         | 34.6% | 武田薬品          | 医薬品    | 1.2%  |
| 合計           |       | 98.1% | 合計          | 98.1% | 合計            |        | 20.4% |

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■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、2012年は12月28日までの騰落率を表しています。

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

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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

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

### 2 【換金（解約）手続等】

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

#### < 一部解約 >

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般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合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

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

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

#### 信託約款の変更

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

#### 反対者の買取請求権

前 の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 の3.または前 の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取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6期計算期間（平成23年12月1日から平成24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5期<br>平成23年11月30日現在       | 第6期<br>平成24年11月30日現在       |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                            |                            |
| 流動資産            |                            |                            |
| コール・ローン         | 849,747                    | 1,990,155                  |
| 親投資信託受益証券       | 701,019,557                | 994,688,342                |
| 未収入金            | -                          | 750,000                    |
| 流動資産合計          | 701,869,304                | 997,428,497                |
| 資産合計            | 701,869,304                | 997,428,497                |
| <b>負債の部</b>     |                            |                            |
| 流動負債            |                            |                            |
| 未払解約金           | 94,201                     | 1,782,893                  |
| 未払受託者報酬         | 108,682                    | 137,990                    |
| 未払委託者報酬         | 507,258                    | 644,134                    |
| その他未払費用         | 18,016                     | 22,911                     |
| 流動負債合計          | 728,157                    | 2,587,928                  |
| 負債合計            | 728,157                    | 2,587,928                  |
| <b>純資産の部</b>    |                            |                            |
| 元本等             |                            |                            |
| 元本              | <sub>1</sub> 1,467,652,061 | <sub>1</sub> 1,898,146,655 |
| 剰余金             |                            |                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | <sub>2</sub> 766,510,914   | <sub>2</sub> 903,306,086   |
| （分配準備積立金）       | 254                        | 670                        |
| 元本等合計           | 701,141,147                | 994,840,569                |
| 純資産合計           | 701,141,147                | 994,840,569                |
| 負債純資産合計         | 701,869,304                | 997,428,497                |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第5期<br>自 平成22年12月1日<br>至 平成23年11月30日 | 第6期<br>自 平成23年12月1日<br>至 平成24年11月30日 |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|
| <b>営業収益</b>                               |                                      |                                      |
| 受取利息                                      | 258                                  | 426                                  |
| 有価証券売買等損益                                 | 103,421,346                          | 78,473,785                           |
| 営業収益合計                                    | 103,421,088                          | 78,474,211                           |
| <b>営業費用</b>                               |                                      |                                      |
| 受託者報酬                                     | 212,958                              | 263,825                              |
| 委託者報酬                                     | 994,049                              | 1,231,535                            |
| その他費用                                     | 35,314                               | 43,796                               |
| 営業費用合計                                    | 1,242,321                            | 1,539,156                            |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 104,663,409                          | 76,935,055                           |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 104,663,409                          | 76,935,055                           |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 104,663,409                          | 76,935,055                           |
| 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（ ） | 1,133,105                            | 3,636,179                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 472,712,479                          | 766,510,914                          |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 24,032,589                           | 72,991,367                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 24,032,589                           | 72,991,367                           |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 214,300,720                          | 283,085,415                          |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 214,300,720                          | 283,085,415                          |
| 分配金                                       | 1 -                                  | 1 -                                  |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 766,510,914                          | 903,306,086                          |

## (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6期<br>自 平成23年12月1日<br>至 平成24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<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。 |

## (追加情報)

| 第6期<br>自 平成23年12月1日<br>至 平成24年11月30日  |
|---|
| 第6期計算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から、「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。 |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区分                  | 第5期<br>平成23年11月30日現在                            | 第6期<br>平成24年11月30日現在                            |
|---------------------|---|---|
| 1. 1 期首元本額          | 1,056,648,545円                                  | 1,467,652,061円                                  |
| 期中追加設定元本額           | 464,858,243円                                    | 571,631,321円                                    |
| 期中一部解約元本額           | 53,854,727円                                     | 141,136,727円                                    |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 1,467,652,061口                                  | 1,898,146,655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766,510,914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903,306,086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5期<br>自 平成22年12月1日<br>至 平成23年11月30日   | 第6期<br>自 平成23年12月1日<br>至 平成24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（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。 | 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（424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（324円）及び分配準備積立金（246円）より分配可能額は994円（1万口当たり0.01円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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6期<br>自 平成23年12月1日<br>至 平成24年11月30日  |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>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。  |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。                                      |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第6期<br>平成24年11月30日現在   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第5期<br>平成23年11月30日現在     | 第6期<br>平成24年11月30日現在     |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 102,512,646              | 75,694,124               |
| 合計        | 102,512,646              | 75,694,124               |

## （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5期<br>平成23年11月30日現在 | 第6期<br>平成24年11月30日現在 |
|----------------------|----------------------|
| 該当事項はありません。          | 該当事項はありません。          |

## （関連当事者との取引に関する注記）

|   |
|---|
| 第6期<br>自 平成23年12月1日<br>至 平成24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。 |

## （1口当たり情報）

|                           | 第5期<br>平成23年11月30日現在 | 第6期<br>平成24年11月30日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 0.4777円<br>(4,777円)  | 0.5241円<br>(5,241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<br>(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 | 2,265,288,869 | 994,688,342 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                      |               | 994,688,342 |    |
| 合計           |                      |               | 994,688,342 |    |

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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザー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23年11月30日現在 |                 | 平成24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         |               | 2,107,306,890   |               | 1,491,890,434   |
| 株式              | 3             | 79,663,342,555  |               | 87,306,694,586  |
| 派生商品評価勘定        |               | 2,047,829       |               | 111,107,835     |
| 未収入金            |               | 13,351,015      |               | 1,459,978       |
| 未収配当金           |               | 579,288,117     |               | 617,160,318     |
| 前払金             |               | 36,454,000      |               | -               |
| 流動資産合計          |               | 82,401,790,406  |               | 89,528,313,151  |
| 資産合計            |               | 82,401,790,406  |               | 89,528,313,151  |
| 負債の部            |               |                 |               |                 |
| 流動負債            |               |                 |               |                 |
| 派生商品評価勘定        |               | 41,550,352      |               | 36,573          |
| 前受金             |               | -               |               | 111,650,000     |
| 未払金             |               | 407,856,227     |               | -               |
| 未払解約金           |               | 38,200,000      |               | 345,130,000     |
| 流動負債合計          |               | 487,606,579     |               | 456,816,573     |
| 負債合計            |               | 487,606,579     |               | 456,816,573     |
| 純資産の部           |               |                 |               |                 |
| 元本等             |               |                 |               |                 |
| 元本              | 1             | 205,035,658,182 |               | 202,871,820,683 |
| 剰余金             |               |                 |               |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2             | 123,121,474,355 |               | 113,800,324,105 |
| 元本等合計           |               | 81,914,183,827  |               | 89,071,496,578  |
| 純資産合計           |               | 81,914,183,827  |               | 89,071,496,578  |
| 負債純資産合計         |               | 82,401,790,406  |               | 89,528,313,151  |

## 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23年12月1日<br>至平成24年11月30日   |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 株式<br>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。<br>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<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。                             |
| 3. 収益及び費用の計上基準         | 受取配当金<br>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。  |

(追加情報)

| 自 平成23年12月1日<br>至 平成24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から、「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。 |  |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                              | 平成23年11月30日現在    | 平成24年11月30日現在    |
|----------------------------------|------------------|------------------|
| 1. 1 期首                          | 平成22年12月1日       | 平成23年12月1日       |
| 期首元本額                            | 201,865,410,927円 | 205,035,658,182円 |
| 期中追加設定元本額                        | 19,572,419,561円  | 17,367,824,410円  |
| 期中一部解約元本額                        | 16,402,172,306円  | 19,531,661,909円  |
| 期末元本額の内訳                         |                  |                  |
| ファンド名                            |                  |                  |
| 適格機関投資家専用投信1号                    | 2,166,113,764円   | 1,999,213,418円   |
| トピックス・インデックスファンド                 | 10,515,654,250円  | 9,893,912,445円   |
| ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA           | 34,848,763,098円  | 27,692,990,478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 | 874,956,562円     | 803,268,613円     |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)     | 413,145,012円     | 410,275,341円     |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)     | 6,729,476,076円   | 6,704,263,527円   |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)     | 395,488,289円     | 395,891,409円     |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)     | 8,787,991,571円   | 8,847,675,913円   |
| DCダイワ日本株式インデックス                  | 60,508,521,981円  | 64,132,222,771円  |
| ダイワ・ライフ・バランス30                   | 2,413,289,209円   | 2,793,312,409円   |
| ダイワ・ライフ・バランス50                   | 1,001,092,232円   | 2,005,204,715円   |
| ダイワ・ライフ・バランス70                   | 763,040,454円     | 1,469,912,395円   |
| 年金ダイワ日本株式インデックス                  | 1,754,742,321円   | 2,265,288,869円   |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020               | 18,469,036円      | 22,180,642円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030               | 19,012,899円      | 31,199,443円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040               | 1,548,073円       | 2,711,468円       |
| ダイワ世界分散バランスファンド15VA              | 479,797,970円     | 494,018,413円     |
| ダイワ世界分散バランスファンド20VA              | 3,619,442,756円   | 3,578,278,361円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)       | 2,092,447,602円   | 2,049,956,477円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド25VA              | 119,251,952円     | 122,374,344円     |
| ダイワ世界分散バランスファンド30VA              | 813,328,821円     | 821,876,905円     |



|                                   |   |   |
|-----------------------------------|---|---|
| ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)        | 374,139,595円  | 377,508,590円  |
| ダイワ世界バランスファンド40VA                 | 4,165,537,556円  | 3,907,652,531円  |
| ダイワ世界バランスファンド60VA                 | 615,498,415円  | 576,160,755円  |
| ダイワ・バランスファンド35VA                  | 33,146,326,670円   | 32,424,620,924円   |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA             | 2,572,885,536円  | 2,447,372,862円  |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA             | 5,438,517,962円  | 5,189,505,560円  |
| ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)       | 3,021,942,080円  | 2,855,457,223円  |
| ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)      | 576,398,066円  | 542,310,526円  |
| ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)      | 706,526,826円  | 638,265,921円  |
| ダイワライフスタイル25                      | 212,395,585円  | 234,380,832円  |
| ダイワライフスタイル50                      | 592,840,851円  | 661,630,591円  |
| ダイワライフスタイル75                      | 462,467,105円  | 496,945,567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) | 14,814,608,007円   | 15,983,980,445円   |
| 計                                 | 205,035,658,182円  | 202,871,820,683円  |
| 2. 期末日における受益権の総数                  | 205,035,658,182口  | 202,871,820,683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123,121,474,355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113,800,324,105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。<br>株式 447,700,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。<br>株式 579,700,000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23年12月1日<br>至 平成24年11月30日   |
|-------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>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。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。  |

|                                |  |
|--------------------------------|--|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>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。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |
|--------------------------------|--|

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成24年11月30日現在   |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類 | 平成23年11月30日現在          | 平成24年11月30日現在          |
|-----|------------------------|------------------------|
|     | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式  | 2,919,462,830          | 1,879,146,530          |
| 合計  | 2,919,462,830          | 1,879,146,530          |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年9月21日から平成23年11月30日まで、及び平成24年9月20日から平成24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23年11月30日 現在 |           |               |             | 平成24年11月30日 現在 |           |               |             |
|--------------|----------------|-----------|---------------|-------------|----------------|-----------|---------------|-------------|
|              | 契約額等<br>（円）    | うち<br>1年超 | 時価<br>（円）     | 評価損益<br>（円） | 契約額等<br>（円）    | うち<br>1年超 | 時価<br>（円）     | 評価損益<br>（円） |
| 市場取引         |                |           |               |             |                |           |               |             |
| 株価指数<br>先物取引 |                |           |               |             |                |           |               |             |
| 買 建          | 2,287,114,000  | -         | 2,247,975,000 | 39,139,000  | 1,638,130,000  | -         | 1,749,440,000 | 111,310,000 |
| 合計           | 2,287,114,000  | -         | 2,247,975,000 | 39,139,000  | 1,638,130,000  | -         | 1,749,440,000 | 111,310,000 |

## (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。

原則として期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、期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23年11月30日現在       | 平成24年11月30日現在       |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 0.3995円<br>(3,995円) | 0.4391円<br>(4,391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             | 43,000  | 182     | 7,826,000   |    |
| 日本水産           | 109,500 | 146     | 15,987,000  |    |
| マルハニチロホールディングス | 188,000 | 137     | 25,756,000  |    |
| サカタのタネ         | 14,100  | 1,069   | 15,072,900  |    |
| ホクト            | 9,200   | 1,647   | 15,152,400  |    |
| ショーボンドHD       | 8,200   | 2,489   | 20,409,800  |    |
| ミライト・ホールディングス  | 25,700  | 646     | 16,602,200  |    |
| 日鉄鉱業           | 25,000  | 341     | 8,525,000   |    |
| 三井松島           | 66,000  | 133     | 8,778,000   |    |
| 国際石油開発帝石       | 1,103   | 442,000 | 487,526,000 |    |
| 日本海洋掘削         | 2,800   | 2,356   | 6,596,800   |    |
| 関東天然瓦斯         | 12,000  | 437     | 5,244,000   |    |
| 石油資源開発         | 13,100  | 2,872   | 37,623,200  |    |
| 間組             | 35,700  | 196     | 6,997,200   |    |
| 東急建設           | 41,200  | 158     | 6,509,600   |    |
| コムシスホールディングス   | 45,000  | 969     | 43,605,000  |    |
| ミサワホーム         | 11,100  | 1,179   | 13,086,900  |    |
| 高松コンストラクションGP  | 7,500   | 1,305   | 9,787,500   |    |
| 東建コーポレーション     | 3,560   | 3,755   | 13,367,800  |    |
| 大成建設           | 468,000 | 224     | 104,832,000 |    |
| 大林組            | 275,000 | 389     | 106,975,000 |    |
| 清水建設           | 281,000 | 248     | 69,688,000  |    |
| 長谷工コーポレーション    | 588,500 | 54      | 31,779,000  |    |
| 鹿島建設           | 410,000 | 237     | 97,170,000  |    |
| 不動テトラ          | 71,800  | 151     | 10,841,800  |    |
| 鉄建建設           | 68,000  | 106     | 7,208,000   |    |
| 安藤建設           | 47,000  | 101     | 4,747,000   |    |
| 太平工業           | 21,000  | 293     | 6,153,000   |    |
| 西松建設           | 120,000 | 137     | 16,440,000  |    |
| 前田建設           | 59,000  | 369     | 21,771,000  |    |
| 奥村組            | 83,000  | 274     | 22,742,000  |    |
| 東鉄工業           | 13,000  | 962     | 12,506,000  |    |
| 戸田建設           | 106,000 | 201     | 21,306,000  |    |
| 熊谷組            | 79,000  | 77      | 6,083,000   |    |
| 北野建設           | 31,000  | 197     | 6,107,000   |    |
| 三井ホーム          | 16,000  | 401     | 6,416,000   |    |
| 矢作建設           | 14,100  | 350     | 4,935,000   |    |
| 大東建託           | 34,100  | 7,990   | 272,459,000 |    |
| NIPPO          | 22,000  | 948     | 20,856,000  |    |
| 東亜道路           | 21,000  | 229     | 4,809,000   |    |
| 前田道路           | 27,000  | 1,119   | 30,213,000  |    |
| 日本道路           | 30,000  | 313     | 9,390,000   |    |

|                 |         |         |             |
|-----------------|---------|---------|-------------|
| 東亜建設            | 89,000  | 125     | 11,125,000  |
| 東洋建設            | 31,400  | 253     | 7,944,200   |
| 五洋建設            | 112,500 | 207     | 23,287,500  |
| 福田組             | 17,000  | 345     | 5,865,000   |
| 住友林業            | 64,000  | 725     | 46,400,000  |
| 日本基礎技術          | 15,800  | 293     | 4,629,400   |
| 日成ビルド工業         | 32,000  | 178     | 5,696,000   |
| エス・パイ・エル        | 58,000  | 139     | 8,062,000   |
| 巴コーポレーション       | 18,800  | 275     | 5,170,000   |
| パナホーム           | 35,000  | 514     | 17,990,000  |
| 大和ハウス           | 227,000 | 1,260   | 286,020,000 |
| ライト工業           | 22,500  | 397     | 8,932,500   |
| 積水ハウス           | 270,000 | 773     | 208,710,000 |
| ユアテック           | 16,000  | 275     | 4,400,000   |
| 中電工             | 14,600  | 753     | 10,993,800  |
| 関電工             | 43,000  | 359     | 15,437,000  |
| きんでん            | 60,000  | 494     | 29,640,000  |
| 東京エネシス          | 12,000  | 381     | 4,572,000   |
| トーエネック          | 16,000  | 442     | 7,072,000   |
| 住友電設            | 7,500   | 804     | 6,030,000   |
| 日本電設工業          | 17,000  | 721     | 12,257,000  |
| 協和エクシオ          | 32,500  | 833     | 27,072,500  |
| 新日本空調           | 9,900   | 465     | 4,603,500   |
| 日本工営            | 33,000  | 278     | 9,174,000   |
| N D S           | 20,000  | 252     | 5,040,000   |
| 九電工             | 18,000  | 370     | 6,660,000   |
| 三機工業            | 24,000  | 389     | 9,336,000   |
| 日揮              | 91,000  | 2,715   | 247,065,000 |
| 中外炉工業           | 33,000  | 214     | 7,062,000   |
| 太平電業            | 13,000  | 486     | 6,318,000   |
| 高砂熱学            | 27,000  | 609     | 16,443,000  |
| N E C ネットズエスアイ  | 8,200   | 1,475   | 12,095,000  |
| 朝日工業社           | 13,000  | 264     | 3,432,000   |
| 大気社             | 13,500  | 1,599   | 21,586,500  |
| ダイダン            | 14,000  | 502     | 7,028,000   |
| 日比谷総合設          | 11,900  | 900     | 10,710,000  |
| 東芝プラントシステム      | 15,000  | 1,100   | 16,500,000  |
| 日本製粉            | 57,000  | 348     | 19,836,000  |
| 日清製粉G本社         | 81,500  | 1,054   | 85,901,000  |
| 昭和産業            | 44,000  | 275     | 12,100,000  |
| 鳥越製粉            | 8,300   | 644     | 5,345,200   |
| 協同飼料            | 60,000  | 94      | 5,640,000   |
| 中部飼料            | 9,900   | 501     | 4,959,900   |
| 日本配合飼料          | 44,000  | 102     | 4,488,000   |
| 日本甜菜糖           | 57,000  | 157     | 8,949,000   |
| 三井製糖            | 37,000  | 252     | 9,324,000   |
| 日本M & Aセンター     | 4,600   | 2,692   | 12,383,200  |
| アコーディア・ゴルフ      | 387     | 76,700  | 29,682,900  |
| パソナグループ         | 93      | 48,000  | 4,464,000   |
| G C A サヴィアングループ | 49      | 99,600  | 4,880,400   |
| エス・エム・エス        | 27      | 162,000 | 4,374,000   |
| テンプホールディングス     | 12,400  | 1,019   | 12,635,600  |
| クックパッド          | 1,900   | 2,423   | 4,603,700   |
| 森永製菓            | 87,000  | 179     | 15,573,000  |
| 中村屋             | 25,000  | 397     | 9,925,000   |

|                 |         |         |             |
|-----------------|---------|---------|-------------|
| 江崎グリコ           | 31,000  | 895     | 27,745,000  |
| 名糖産業            | 5,500   | 911     | 5,010,500   |
| 不二家             | 58,000  | 196     | 11,368,000  |
| 山崎製パン           | 65,000  | 965     | 62,725,000  |
| モロゾフ            | 24,000  | 285     | 6,840,000   |
| 亀田製菓            | 5,100   | 1,911   | 9,746,100   |
| カルビー            | 8,100   | 6,730   | 54,513,000  |
| 森永乳業            | 76,000  | 267     | 20,292,000  |
| ヤクルト            | 52,800  | 3,615   | 190,872,000 |
| 明治ホールディングス      | 26,800  | 3,665   | 98,222,000  |
| 雪印メグミルク         | 18,000  | 1,346   | 24,228,000  |
| プリマハム           | 63,000  | 141     | 8,883,000   |
| 日本ハム            | 69,000  | 1,229   | 84,801,000  |
| 伊藤ハム            | 52,000  | 358     | 18,616,000  |
| 丸大食品            | 45,000  | 285     | 12,825,000  |
| 米久              | 9,700   | 698     | 6,770,600   |
| S Foods         | 8,000   | 768     | 6,144,000   |
| スタジオアリス         | 4,900   | 1,272   | 6,232,800   |
| シミックホールディングス    | 3,800   | 1,177   | 4,472,600   |
| システナ            | 97      | 74,000  | 7,178,000   |
| NECフィールドディング    | 7,700   | 961     | 7,399,700   |
| 新日鉄住金SOL        | 5,800   | 1,553   | 9,007,400   |
| 総合警備保障          | 30,600  | 1,084   | 33,170,400  |
| 日本駐車場開発         | 1,134   | 4,400   | 4,989,600   |
| カカクコム           | 11,900  | 2,837   | 33,760,300  |
| ツクイ             | 4,200   | 1,727   | 7,253,400   |
| エムスリー           | 205     | 151,900 | 31,139,500  |
| ディー・エヌ・エー       | 41,800  | 3,025   | 126,445,000 |
| 博報堂DYHLDGS      | 11,370  | 5,270   | 59,919,900  |
| ぐるなび            | 7,100   | 891     | 6,326,100   |
| PGMホールディングス     | 153     | 70,900  | 10,847,700  |
| サッポロホールディングス    | 155,000 | 249     | 38,595,000  |
| アサヒグループホールディングス | 180,600 | 1,853   | 334,651,800 |
| キリンHD           | 386,000 | 1,011   | 390,246,000 |
| 宝ホールディングス       | 74,000  | 618     | 45,732,000  |
| オエノンホールディングス    | 35,000  | 205     | 7,175,000   |
| 養命酒             | 10,000  | 702     | 7,020,000   |
| 三国コカ・コ・ラ        | 11,100  | 687     | 7,625,700   |
| コカ・コーラウエスト      | 30,100  | 1,280   | 38,528,000  |
| コカコーラセントラルジャパン  | 10,900  | 1,028   | 11,205,200  |
| ダイトードリンク        | 4,300   | 3,435   | 14,770,500  |
| 伊藤園             | 24,400  | 1,521   | 37,112,400  |
| キーコーヒー          | 9,100   | 1,553   | 14,132,300  |
| 日清オイリオグループ      | 37,000  | 296     | 10,952,000  |
| 不二製油            | 20,800  | 1,182   | 24,585,600  |
| J-オイルミルズ        | 37,000  | 217     | 8,029,000   |
| ローソン            | 29,500  | 5,580   | 164,610,000 |
| サンエー            | 3,000   | 2,989   | 8,967,000   |
| カワチ薬品           | 6,000   | 1,597   | 9,582,000   |
| エービーシー・マート      | 9,400   | 3,510   | 32,994,000  |
| アスクル            | 5,800   | 1,232   | 7,145,600   |
| ゲオホールディングス      | 138     | 87,900  | 12,130,200  |
| ポイント            | 7,140   | 2,976   | 21,248,640  |
| 伊藤忠食品           | 2,600   | 2,882   | 7,493,200   |
| くらコーポレーション      | 5,300   | 1,115   | 5,909,500   |

|                |         |         |             |
|----------------|---------|---------|-------------|
| キャンドウ          | 68      | 103,000 | 7,004,000   |
| エレマテック         | 5,400   | 1,033   | 5,578,200   |
| パル             | 2,500   | 3,915   | 9,787,500   |
| エディオン          | 35,300  | 322     | 11,366,600  |
| あらた            | 20,000  | 329     | 6,580,000   |
| サーラコーポレーション    | 9,700   | 475     | 4,607,500   |
| あみやき亭          | 19      | 203,800 | 3,872,200   |
| ひらまつ           | 54      | 90,900  | 4,908,600   |
| 双日             | 522,300 | 104     | 54,319,200  |
| アルフレッサホールディングス | 20,600  | 3,460   | 71,276,000  |
| 大黒天物産          | 1,500   | 2,492   | 3,738,000   |
| ハニーズ           | 7,490   | 1,277   | 9,564,730   |
| キッコーマン         | 75,000  | 1,166   | 87,450,000  |
| 味の素            | 238,000 | 1,179   | 280,602,000 |
| キュービー          | 45,700  | 1,200   | 54,840,000  |
| ハウス食品          | 30,900  | 1,287   | 39,768,300  |
| カゴメ            | 32,500  | 1,644   | 53,430,000  |
| 焼津水産化工         | 8,500   | 750     | 6,375,000   |
| アリアケジャパン       | 8,600   | 1,635   | 14,061,000  |
| ニチレイ           | 104,000 | 447     | 46,488,000  |
| 横浜冷凍           | 20,900  | 567     | 11,850,300  |
| 東洋水産           | 41,000  | 2,260   | 92,660,000  |
| 日清食品HD         | 34,800  | 3,250   | 113,100,000 |
| 永谷園            | 9,000   | 800     | 7,200,000   |
| フジッコ           | 10,000  | 1,009   | 10,090,000  |
| ロックフィールド       | 5,200   | 1,467   | 7,628,400   |
| 日本たばこ産業        | 401,700 | 2,470   | 992,199,000 |
| わらべや日洋         | 5,900   | 1,510   | 8,909,000   |
| 片倉工業           | 12,000  | 677     | 8,124,000   |
| グンゼ            | 67,000  | 204     | 13,668,000  |
| ヒューリック         | 95,200  | 551     | 52,455,200  |
| アルペン           | 5,900   | 1,467   | 8,655,300   |
| アルコニックス        | 3,000   | 1,246   | 3,738,000   |
| ビックカメラ         | 298     | 40,600  | 12,098,800  |
| DCMホールディングス    | 41,900  | 531     | 22,248,900  |
| MonotaRO       | 5,600   | 2,405   | 13,468,000  |
| あいホールディングス     | 13,400  | 539     | 7,222,600   |
| J.フロントリテイリング   | 191,000 | 398     | 76,018,000  |
| ドトール・日レスHD     | 13,800  | 1,044   | 14,407,200  |
| マツモトキヨシHLDGS   | 13,900  | 1,972   | 27,410,800  |
| スタートトゥデイ       | 16,300  | 861     | 14,034,300  |
| ココカラファイン       | 8,500   | 2,578   | 21,913,000  |
| 三越伊勢丹HD        | 159,800 | 734     | 117,293,200 |
| 東洋紡            | 365,000 | 112     | 40,880,000  |
| ユニチカ           | 241,000 | 40      | 9,640,000   |
| 富士紡ホールディングス    | 41,000  | 314     | 12,874,000  |
| 日清紡ホールディングス    | 57,000  | 582     | 33,174,000  |
| 倉敷紡績           | 89,000  | 131     | 11,659,000  |
| ダイワボウHD        | 79,000  | 169     | 13,351,000  |
| シキボウ           | 67,000  | 109     | 7,303,000   |
| 日東紡績           | 69,000  | 280     | 19,320,000  |
| トヨタ紡織          | 29,000  | 852     | 24,708,000  |
| ウエルシアHD        | 2,900   | 2,660   | 7,714,000   |
| クリエイトSDH       | 3,800   | 2,183   | 8,295,400   |
| バイタルKSKHD      | 15,900  | 802     | 12,751,800  |

|                |         |         |             |
|----------------|---------|---------|-------------|
| UKCホールディングス    | 5,200   | 1,643   | 8,543,600   |
| TOKAIホールディングス  | 33,800  | 315     | 10,647,000  |
| 日本毛織           | 28,000  | 555     | 15,540,000  |
| ダイドーリミテッド      | 11,700  | 481     | 5,627,700   |
| 野村不動産HLDS      | 38,500  | 1,424   | 54,824,000  |
| 帝国繊維           | 11,000  | 631     | 6,941,000   |
| ブックオフコーポレーション  | 6,000   | 656     | 3,936,000   |
| 日本コークス工業       | 80,500  | 99      | 7,969,500   |
| あさひ            | 5,100   | 1,130   | 5,763,000   |
| コスモス薬品         | 3,600   | 8,490   | 30,564,000  |
| シップヘルスケアHD     | 11,500  | 2,566   | 29,509,000  |
| セブン&アイ・HLDS    | 333,700 | 2,402   | 801,547,400 |
| ツルハホールディングス    | 6,600   | 6,210   | 40,986,000  |
| サンマルクホールディングス  | 2,600   | 2,985   | 7,761,000   |
| トリドール          | 7,600   | 1,070   | 8,132,000   |
| クスリのアオキ        | 1,300   | 4,780   | 6,214,000   |
| 帝人             | 326,000 | 189     | 61,614,000  |
| 東レ             | 654,000 | 488     | 319,152,000 |
| クラレ            | 142,800 | 1,015   | 144,942,000 |
| 旭化成            | 526,000 | 470     | 247,220,000 |
| サカイオーベックス      | 34,000  | 114     | 3,876,000   |
| 稲葉製作所          | 4,800   | 1,022   | 4,905,600   |
| 宮地エンジニアリングG    | 34,000  | 149     | 5,066,000   |
| 三協・立山HLDS      | 121,000 | 169     | 20,449,000  |
| トーカロ           | 5,500   | 1,336   | 7,348,000   |
| SUMCO          | 53,300  | 576     | 30,700,800  |
| 住江織物           | 33,000  | 155     | 5,115,000   |
| 日本バイリン         | 13,000  | 336     | 4,368,000   |
| 芦森工業           | 37,000  | 104     | 3,848,000   |
| アツギ            | 66,000  | 98      | 6,468,000   |
| ダイニック          | 25,000  | 159     | 3,975,000   |
| セーレン           | 24,200  | 492     | 11,906,400  |
| 小松精練           | 16,000  | 373     | 5,968,000   |
| ワコールホールディングス   | 51,000  | 895     | 45,645,000  |
| ホギメディカル        | 5,400   | 4,045   | 21,843,000  |
| TSIホールディングス    | 43,400  | 482     | 20,918,800  |
| ITホールディングス     | 26,500  | 1,009   | 26,738,500  |
| グリー            | 41,500  | 1,433   | 59,469,500  |
| コーエーテクモHD      | 16,900  | 714     | 12,066,600  |
| 三菱総合研究所        | 4,200   | 1,758   | 7,383,600   |
| ネクソン           | 65,300  | 924     | 60,337,200  |
| 特種東海製紙         | 52,000  | 208     | 10,816,000  |
| ドワンゴ           | 46      | 188,500 | 8,671,000   |
| マクロミル          | 9,300   | 984     | 9,151,200   |
| ティーガイア         | 10,600  | 783     | 8,299,800   |
| GMOペイメントゲートウェイ | 3,400   | 1,397   | 4,749,800   |
| ザッパラス          | 63      | 74,600  | 4,699,800   |
| インターネットイニシアティブ | 9,700   | 2,029   | 19,681,300  |
| SRAホールディングス    | 5,800   | 896     | 5,196,800   |
| 朝日ネット          | 10,000  | 388     | 3,880,000   |
| 王子ホールディングス     | 371,000 | 260     | 96,460,000  |
| 三菱製紙           | 148,000 | 77      | 11,396,000  |
| 北越紀州製紙         | 54,000  | 443     | 23,922,000  |
| 中越パルプ          | 41,000  | 140     | 5,740,000   |
| 大王製紙           | 37,000  | 521     | 19,277,000  |

|                  |         |         |             |
|------------------|---------|---------|-------------|
| 日本製紙 G 本社        | 41,800  | 1,010   | 42,218,000  |
| レンゴー             | 66,000  | 429     | 28,314,000  |
| トーモク             | 36,000  | 226     | 8,136,000   |
| ザ・パック            | 5,900   | 1,447   | 8,537,300   |
| 昭和電工             | 533,000 | 119     | 63,427,000  |
| 住友化学             | 587,000 | 235     | 137,945,000 |
| 住友精化             | 19,000  | 291     | 5,529,000   |
| 日産化学             | 61,500  | 991     | 60,946,500  |
| クレハ              | 60,000  | 284     | 17,040,000  |
| テイカ              | 20,000  | 231     | 4,620,000   |
| 石原産業             | 168,000 | 58      | 9,744,000   |
| 日本曹達             | 56,000  | 361     | 20,216,000  |
| 東ソー              | 235,000 | 177     | 41,595,000  |
| トクヤマ             | 131,000 | 138     | 18,078,000  |
| セントラル硝子          | 79,000  | 243     | 19,197,000  |
| 東亜合成             | 101,000 | 353     | 35,653,000  |
| ダイソー             | 38,000  | 218     | 8,284,000   |
| 電気化学             | 175,000 | 269     | 47,075,000  |
| イビデン             | 49,700  | 1,128   | 56,061,600  |
| 信越化学             | 152,100 | 4,850   | 737,685,000 |
| 日本カ - バイド        | 37,000  | 204     | 7,548,000   |
| 堺 化 学            | 33,000  | 224     | 7,392,000   |
| エア・ウォーター         | 69,000  | 1,036   | 71,484,000  |
| 大陽日酸             | 111,000 | 457     | 50,727,000  |
| 日本化学工業           | 51,000  | 112     | 5,712,000   |
| 日本パ - カライジング     | 21,000  | 1,144   | 24,024,000  |
| 高压ガス             | 16,000  | 412     | 6,592,000   |
| 四国化成             | 15,000  | 420     | 6,300,000   |
| ステラ ケミファ         | 4,300   | 1,456   | 6,260,800   |
| 日本触媒             | 62,000  | 803     | 49,786,000  |
| 大日精化             | 33,000  | 330     | 10,890,000  |
| カネカ              | 104,000 | 414     | 43,056,000  |
| 協和発酵キリン          | 102,000 | 841     | 85,782,000  |
| 三菱瓦斯化学           | 134,000 | 486     | 65,124,000  |
| 三井化学             | 368,000 | 186     | 68,448,000  |
| J S R            | 82,100  | 1,524   | 125,120,400 |
| 東京応化工業           | 16,300  | 1,661   | 27,074,300  |
| 三菱ケミカル H L D G S | 532,500 | 360     | 191,700,000 |
| 日本合成化学           | 20,000  | 650     | 13,000,000  |
| ダイセル             | 102,000 | 502     | 51,204,000  |
| 住友ベ - クライト       | 68,000  | 326     | 22,168,000  |
| 積水化学             | 175,000 | 646     | 113,050,000 |
| 日本ゼオン            | 74,000  | 667     | 49,358,000  |
| アイカ工業            | 23,800  | 1,416   | 33,700,800  |
| 宇部興産             | 408,000 | 171     | 69,768,000  |
| 積水樹脂             | 14,000  | 795     | 11,130,000  |
| タキロン             | 24,000  | 275     | 6,600,000   |
| 旭有機材             | 34,000  | 192     | 6,528,000   |
| 日立化成             | 36,800  | 1,178   | 43,350,400  |
| 大倉工業             | 25,000  | 263     | 6,575,000   |
| 積水化成品            | 24,000  | 203     | 4,872,000   |
| 群栄化学             | 28,000  | 194     | 5,432,000   |
| 日本カ - リット        | 11,500  | 407     | 4,680,500   |
| 日本化薬             | 60,000  | 924     | 55,440,000  |
| イーピーエス           | 52      | 226,000 | 11,752,000  |



|               |         |        |               |
|---------------|---------|--------|---------------|
| パナソニック インフォシス | 2,200   | 1,891  | 4,160,200     |
| フェイス          | 459     | 8,640  | 3,965,760     |
| アミューズ         | 3,400   | 1,576  | 5,358,400     |
| 野村総合研究所       | 44,700  | 1,591  | 71,117,700    |
| ケネディクス        | 862     | 14,010 | 12,076,620    |
| 電通            | 77,100  | 2,016  | 155,433,600   |
| インテージ         | 3,200   | 1,810  | 5,792,000     |
| シンプレクスホールディング | 198     | 22,610 | 4,476,780     |
| イオンファンタジー     | 3,600   | 1,131  | 4,071,600     |
| 日本精化          | 8,900   | 551    | 4,903,900     |
| A D E K A     | 36,800  | 659    | 24,251,200    |
| 日油            | 68,000  | 374    | 25,432,000    |
| ミヨシ油脂         | 57,000  | 102    | 5,814,000     |
| 花 王           | 224,600 | 2,263  | 508,269,800   |
| 第一工業製薬        | 23,000  | 207    | 4,761,000     |
| 三洋化成          | 27,000  | 426    | 11,502,000    |
| 武田薬品          | 317,400 | 3,770  | 1,196,598,000 |
| アステラス製薬       | 188,200 | 4,170  | 784,794,000   |
| 大日本住友製薬       | 61,300  | 970    | 59,461,000    |
| 塩野義製薬         | 124,200 | 1,396  | 173,383,200   |
| 田辺三菱製薬        | 69,700  | 1,119  | 77,994,300    |
| あすか製薬         | 13,000  | 432    | 5,616,000     |
| 日本新薬          | 18,000  | 1,009  | 18,162,000    |
| 中外製薬          | 98,600  | 1,634  | 161,112,400   |
| 科研製薬          | 33,000  | 1,291  | 42,603,000    |
| エーザイ          | 104,400 | 3,460  | 361,224,000   |
| ロート製薬         | 36,000  | 1,051  | 37,836,000    |
| 小野薬品          | 41,200  | 4,515  | 186,018,000   |
| 久光製薬          | 26,400  | 4,290  | 113,256,000   |
| 持田製薬          | 32,000  | 1,104  | 35,328,000    |
| 参天製薬          | 30,400  | 3,535  | 107,464,000   |
| 扶桑薬品          | 35,000  | 294    | 10,290,000    |
| 日本ケミファ        | 16,000  | 519    | 8,304,000     |
| ツムラ           | 23,400  | 2,678  | 62,665,200    |
| 日医工           | 12,800  | 1,630  | 20,864,000    |
| テ ル モ         | 62,000  | 3,490  | 216,380,000   |
| みらかホールディングス   | 22,100  | 3,345  | 73,924,500    |
| キッセイ薬品工業      | 16,000  | 1,546  | 24,736,000    |
| 生化学工業         | 17,600  | 891    | 15,681,600    |
| 栄研化学          | 7,400   | 1,071  | 7,925,400     |
| 日水製薬          | 5,900   | 832    | 4,908,800     |
| 鳥居薬品          | 6,300   | 1,908  | 12,020,400    |
| 東和薬品          | 4,500   | 4,425  | 19,912,500    |
| 沢井製薬          | 5,700   | 8,900  | 50,730,000    |
| ゼリア新薬工業       | 13,000  | 1,276  | 16,588,000    |
| 第一三共          | 267,000 | 1,272  | 339,624,000   |
| キョーリン製薬HD     | 22,400  | 1,754  | 39,289,600    |
| 大幸薬品          | 5,500   | 801    | 4,405,500     |
| ダイト           | 3,100   | 1,363  | 4,225,300     |
| 大塚ホールディングス    | 167,100 | 2,447  | 408,893,700   |
| 大正製薬HD        | 20,300  | 6,070  | 123,221,000   |
| 大日本塗料         | 72,000  | 90     | 6,480,000     |
| 日本ペイント        | 74,000  | 684    | 50,616,000    |
| 関西ペイント        | 95,000  | 880    | 83,600,000    |
| 中国塗料          | 27,000  | 447    | 12,069,000    |

|                 |         |         |             |
|-----------------|---------|---------|-------------|
| 藤倉化成            | 13,300  | 328     | 4,362,400   |
| 太陽ホールディングス      | 7,000   | 2,269   | 15,883,000  |
| D I C           | 312,000 | 148     | 46,176,000  |
| サカタインクス         | 21,000  | 392     | 8,232,000   |
| 東洋インキS Cホールディン  | 75,000  | 342     | 25,650,000  |
| アルプス技研          | 6,600   | 673     | 4,441,800   |
| サニックス           | 16,500  | 250     | 4,125,000   |
| オリエンタルランド       | 24,900  | 10,610  | 264,189,000 |
| ダスキン            | 23,700  | 1,554   | 36,829,800  |
| パーク24           | 41,700  | 1,392   | 58,046,400  |
| 明光ネットワークジャパン    | 10,100  | 848     | 8,564,800   |
| ファルコS Dホールディングス | 6,200   | 990     | 6,138,000   |
| フジ・メディア・HD      | 776     | 119,900 | 93,042,400  |
| ラウンドワン          | 29,000  | 464     | 13,456,000  |
| リゾートトラスト        | 14,500  | 1,620   | 23,490,000  |
| オービック           | 2,640   | 18,290  | 48,285,600  |
| ヤフー             | 5,855   | 27,680  | 162,066,400 |
| ビー・エム・エル        | 5,800   | 2,102   | 12,191,600  |
| トレンドマイクロ        | 31,900  | 2,149   | 68,553,100  |
| もしもしホットライン      | 14,400  | 1,175   | 16,920,000  |
| 東急コミュニティー       | 2,700   | 2,961   | 7,994,700   |
| リソー教育           | 1,068   | 6,430   | 6,867,240   |
| 日本オラクル          | 15,500  | 3,460   | 53,630,000  |
| アルファシステムズ       | 4,000   | 980     | 3,920,000   |
| フューチャーアーキテクト    | 141     | 32,800  | 4,624,800   |
| シーエーシー          | 6,000   | 674     | 4,044,000   |
| ユー・エス・エス        | 9,440   | 8,780   | 82,883,200  |
| オービックビジネスC      | 2,500   | 4,305   | 10,762,500  |
| 伊藤忠テクノソリューションズ  | 9,500   | 3,780   | 35,910,000  |
| アイティフォー         | 13,700  | 303     | 4,151,100   |
| 大塚商会            | 6,800   | 6,540   | 44,472,000  |
| 総合メディカル         | 2,200   | 2,795   | 6,149,000   |
| サイボウズ           | 175     | 25,060  | 4,385,500   |
| セントラルスポーツ       | 4,200   | 1,199   | 5,035,800   |
| 電通国際情報S         | 6,700   | 721     | 4,830,700   |
| ウェザーニューズ        | 2,700   | 2,780   | 7,506,000   |
| WOWOW           | 32      | 187,000 | 5,984,000   |
| 富士フイルムHLDGS     | 181,300 | 1,511   | 273,944,300 |
| コニカミノルタHLDGS    | 215,000 | 588     | 126,420,000 |
| 資生堂             | 149,500 | 1,195   | 178,652,500 |
| ライオン            | 97,000  | 421     | 40,837,000  |
| 高砂香料            | 29,000  | 404     | 11,716,000  |
| マンダム            | 9,100   | 2,199   | 20,010,900  |
| ミルボン            | 4,800   | 2,693   | 12,926,400  |
| ファンケル           | 22,400  | 863     | 19,331,200  |
| コーセー            | 14,700  | 1,751   | 25,739,700  |
| ドクターシーラボ        | 58      | 280,600 | 16,274,800  |
| ポーラ・オルビスHD      | 9,800   | 2,448   | 23,990,400  |
| ノエビアホールディングス    | 5,500   | 1,248   | 6,864,000   |
| エステー            | 7,100   | 889     | 6,311,900   |
| コニシ             | 7,400   | 1,332   | 9,856,800   |
| 長谷川香料           | 10,800  | 1,052   | 11,361,600  |
| 小林製薬            | 12,500  | 4,110   | 51,375,000  |
| 荒川化学工業          | 9,500   | 655     | 6,222,500   |
| 日本高純度化学         | 32      | 183,800 | 5,881,600   |

|               |           |       |             |
|---------------|-----------|-------|-------------|
| アース製薬         | 6,500     | 2,987 | 19,415,500  |
| イハラケミカル       | 17,000    | 373   | 6,341,000   |
| 大成ラミック        | 2,500     | 2,327 | 5,817,500   |
| クミアイ化学        | 21,000    | 373   | 7,833,000   |
| 日本農薬          | 22,000    | 407   | 8,954,000   |
| 昭和シエル石油       | 78,200    | 480   | 37,536,000  |
| コスモ石油         | 234,000   | 160   | 37,440,000  |
| ニチレキ          | 14,000    | 405   | 5,670,000   |
| 東燃ゼネラル石油      | 125,000   | 765   | 95,625,000  |
| ユシロ化学         | 6,600     | 815   | 5,379,000   |
| AOCホールディングス   | 21,500    | 305   | 6,557,500   |
| 出光興産          | 10,100    | 6,760 | 68,276,000  |
| JXホールディングス    | 941,700   | 440   | 414,348,000 |
| 横浜ゴム          | 97,000    | 552   | 53,544,000  |
| 東洋ゴム          | 74,000    | 229   | 16,946,000  |
| ブリヂストン        | 265,800   | 1,989 | 528,676,200 |
| 住友ゴム          | 65,200    | 972   | 63,374,400  |
| オカモト          | 32,000    | 311   | 9,952,000   |
| アキレス          | 76,000    | 110   | 8,360,000   |
| ニッタ           | 8,600     | 1,244 | 10,698,400  |
| 東海ゴム工業        | 15,900    | 803   | 12,767,700  |
| 三ツ星ベルト        | 24,000    | 479   | 11,496,000  |
| バンドー化学        | 32,000    | 260   | 8,320,000   |
| 鬼怒川ゴム         | 18,000    | 526   | 9,468,000   |
| 旭硝子           | 419,000   | 628   | 263,132,000 |
| 日本板硝子         | 396,000   | 92    | 36,432,000  |
| 日本山村硝子        | 38,000    | 175   | 6,650,000   |
| 日本電気硝子        | 151,000   | 470   | 70,970,000  |
| 住友大阪セメント      | 155,000   | 260   | 40,300,000  |
| 太平洋セメント       | 477,000   | 184   | 87,768,000  |
| 日本ヒュ-ム        | 10,000    | 406   | 4,060,000   |
| 日本コンクリ-ト      | 17,000    | 269   | 4,573,000   |
| 東海カーボン        | 77,000    | 289   | 22,253,000  |
| 日本カーボン        | 48,000    | 154   | 7,392,000   |
| 東洋炭素          | 4,500     | 1,565 | 7,042,500   |
| ノリタケ          | 47,000    | 196   | 9,212,000   |
| TOTO          | 133,000   | 564   | 75,012,000  |
| 日本碍子          | 111,000   | 882   | 97,902,000  |
| 日本特殊陶業        | 73,000    | 997   | 72,781,000  |
| MARUWA        | 2,100     | 2,466 | 5,178,600   |
| 品川リフラクトリーズ    | 26,000    | 172   | 4,472,000   |
| 黒崎播磨          | 22,000    | 190   | 4,180,000   |
| フジミインコーポレーテッド | 8,400     | 1,777 | 14,926,800  |
| ニチアス          | 40,000    | 394   | 15,760,000  |
| 新日鐵住金         | 3,587,000 | 189   | 677,943,000 |
| 神戸製鋼所         | 1,185,000 | 77    | 91,245,000  |
| 合同製鐵          | 53,000    | 143   | 7,579,000   |
| JFEホールディングス   | 217,200   | 1,277 | 277,365,166 |
| 日新製鋼HD        | 35,900    | 586   | 21,037,400  |
| 東京製鐵          | 47,500    | 289   | 13,727,500  |
| 共英製鋼          | 8,600     | 1,346 | 11,575,600  |
| 大和工業          | 17,800    | 2,225 | 39,605,000  |
| 東京鐵鋼          | 19,000    | 282   | 5,358,000   |
| 大阪製鐵          | 5,100     | 1,416 | 7,221,600   |
| 淀川製鋼所         | 63,000    | 267   | 16,821,000  |

|              |         |       |             |
|--------------|---------|-------|-------------|
| 東洋鋼鋳         | 23,000  | 217   | 4,991,000   |
| 住友鋼管         | 7,500   | 559   | 4,192,500   |
| 丸一鋼管         | 28,000  | 1,780 | 49,840,000  |
| 大同特殊鋼        | 133,000 | 356   | 47,348,000  |
| 日本冶金工        | 76,500  | 74    | 5,661,000   |
| 山陽特殊製鋼       | 44,000  | 241   | 10,604,000  |
| 愛知製鋼         | 47,000  | 328   | 15,416,000  |
| 日立金属         | 60,000  | 612   | 36,720,000  |
| 大平洋金属        | 57,000  | 278   | 15,846,000  |
| 日本電工         | 35,000  | 197   | 6,895,000   |
| 栗本鉄工所        | 41,000  | 278   | 11,398,000  |
| 日本製鋼所        | 133,000 | 454   | 60,382,000  |
| 三菱製鋼         | 57,000  | 149   | 8,493,000   |
| 日本軽金属HD      | 181,400 | 74    | 13,423,600  |
| 三井金属         | 225,000 | 163   | 36,675,000  |
| 東邦亜鉛         | 52,000  | 308   | 16,016,000  |
| 三菱マテリアル      | 501,000 | 235   | 117,735,000 |
| 住友鋳山         | 220,000 | 1,129 | 248,380,000 |
| DOWAホールディングス | 96,000  | 536   | 51,456,000  |
| 古河機金         | 172,000 | 71    | 12,212,000  |
| 大阪チタニウム      | 8,700   | 1,697 | 14,763,900  |
| 東邦チタニウム      | 15,100  | 727   | 10,977,700  |
| 住友軽金属        | 222,000 | 68    | 15,096,000  |
| 古河スカイ        | 35,000  | 203   | 7,105,000   |
| 古河電工         | 276,000 | 157   | 43,332,000  |
| 住友電工         | 299,900 | 889   | 266,611,100 |
| フジクラ         | 140,000 | 232   | 32,480,000  |
| 昭和電線HLDGS    | 137,000 | 62    | 8,494,000   |
| タツタ電線        | 17,000  | 795   | 13,515,000  |
| 日立電線         | 73,000  | 114   | 8,322,000   |
| リョービ         | 50,000  | 188   | 9,400,000   |
| アサヒHD        | 12,800  | 1,395 | 17,856,000  |
| 東洋製罐         | 60,500  | 984   | 59,532,000  |
| ホッカンホールディングス | 25,000  | 234   | 5,850,000   |
| コロナ          | 4,900   | 1,045 | 5,120,500   |
| 横河ブリッジHLDGS  | 19,000  | 603   | 11,457,000  |
| 駒井ハルテック      | 24,000  | 220   | 5,280,000   |
| 三和ホールディングス   | 85,000  | 333   | 28,305,000  |
| 文化シヤツタ-      | 27,000  | 370   | 9,990,000   |
| LIXILグループ    | 117,700 | 1,746 | 205,504,200 |
| ノーリツ         | 17,100  | 1,420 | 24,282,000  |
| 長府製作所        | 8,200   | 1,874 | 15,366,800  |
| リンナイ         | 13,700  | 5,740 | 78,638,000  |
| ユニプレス        | 14,400  | 1,971 | 28,382,400  |
| ダイニチ工業       | 4,700   | 825   | 3,877,500   |
| 岡部           | 18,900  | 527   | 9,960,300   |
| 東プレ          | 16,900  | 724   | 12,235,600  |
| 高周波熱錬        | 12,900  | 466   | 6,011,400   |
| 東京製鋼         | 66,000  | 103   | 6,798,000   |
| パイオラックス      | 3,900   | 1,780 | 6,942,000   |
| 日本発条         | 61,600  | 690   | 42,504,000  |
| 三浦工業         | 13,300  | 2,026 | 26,945,800  |
| タクマ          | 31,000  | 423   | 13,113,000  |
| ツガミ          | 24,000  | 510   | 12,240,000  |
| オークマ         | 58,000  | 478   | 27,724,000  |

|               |         |        |             |
|---------------|---------|--------|-------------|
| 東芝機械          | 46,000  | 362    | 16,652,000  |
| アマダ           | 130,000 | 470    | 61,100,000  |
| アイダエンジニア      | 22,400  | 589    | 13,193,600  |
| 牧野フライス        | 42,000  | 439    | 18,438,000  |
| オーエスジー        | 35,900  | 1,117  | 40,100,300  |
| 旭ダイヤモンド       | 21,900  | 761    | 16,665,900  |
| 森精機製作所        | 46,400  | 570    | 26,448,000  |
| ディスコ          | 9,400   | 4,385  | 41,219,000  |
| 日東工器          | 5,700   | 1,752  | 9,986,400   |
| 豊田自動織機        | 73,400  | 2,467  | 181,077,800 |
| 大阪機工          | 56,000  | 100    | 5,600,000   |
| 島精機製作所        | 11,800  | 1,275  | 15,045,000  |
| 日阪製作所         | 12,000  | 760    | 9,120,000   |
| やまびこ          | 3,700   | 1,130  | 4,181,000   |
| ナブテスコ         | 42,000  | 1,635  | 68,670,000  |
| 三井海洋開発        | 7,300   | 1,626  | 11,869,800  |
| S M C         | 25,200  | 13,920 | 350,784,000 |
| 新川            | 12,000  | 362    | 4,344,000   |
| ホソカワミクロン      | 18,000  | 457    | 8,226,000   |
| ユニオンツール       | 5,500   | 1,295  | 7,122,500   |
| オイレス工業        | 9,400   | 1,635  | 15,369,000  |
| サト - ホールディングス | 9,300   | 1,328  | 12,350,400  |
| 小松製作所         | 395,800 | 1,847  | 731,042,600 |
| 住友重機械         | 233,000 | 346    | 80,618,000  |
| 日立建機          | 43,800  | 1,443  | 63,203,400  |
| 日工            | 16,000  | 313    | 5,008,000   |
| 巴工業           | 3,800   | 1,531  | 5,817,800   |
| 井関農機          | 86,000  | 205    | 17,630,000  |
| T O W A       | 9,000   | 511    | 4,599,000   |
| 丸山製作所         | 32,000  | 156    | 4,992,000   |
| 北川鉄工所         | 47,000  | 135    | 6,345,000   |
| クボタ           | 451,000 | 875    | 394,625,000 |
| 東洋エンジニア       | 50,000  | 333    | 16,650,000  |
| 三菱化工機         | 38,000  | 139    | 5,282,000   |
| 月島機械          | 14,000  | 696    | 9,744,000   |
| 帝国電機製作所       | 3,800   | 1,180  | 4,484,000   |
| 新東工業          | 19,000  | 561    | 10,659,000  |
| アイチ コーポレーション  | 16,600  | 330    | 5,478,000   |
| 小森コーポレーション    | 22,600  | 633    | 14,305,800  |
| 鶴見製作所         | 8,000   | 650    | 5,200,000   |
| 住友精密          | 16,000  | 346    | 5,536,000   |
| 酒井重工業         | 19,000  | 254    | 4,826,000   |
| 荏原製作所         | 161,000 | 317    | 51,037,000  |
| 西島製作所         | 10,800  | 581    | 6,274,800   |
| 千代田化工建        | 66,000  | 1,186  | 78,276,000  |
| ダイキン工業        | 110,300 | 2,592  | 285,897,600 |
| オルガノ          | 16,000  | 503    | 8,048,000   |
| ト - ヨ - カネツ   | 51,000  | 177    | 9,027,000   |
| 栗田工業          | 46,100  | 1,795  | 82,749,500  |
| 椿本チエイン        | 45,000  | 446    | 20,070,000  |
| 大同工業          | 30,000  | 132    | 3,960,000   |
| 日機装           | 29,000  | 872    | 25,288,000  |
| 新興プランテック      | 19,200  | 654    | 12,556,800  |
| アネスト岩田        | 18,000  | 325    | 5,850,000   |
| ダイフク          | 38,500  | 513    | 19,750,500  |

|               |           |       |             |
|---------------|-----------|-------|-------------|
| 加藤製作所         | 23,000    | 214   | 4,922,000   |
| タダノ           | 40,000    | 612   | 24,480,000  |
| フジテック         | 25,000    | 583   | 14,575,000  |
| C K D         | 25,000    | 488   | 12,200,000  |
| 平和            | 18,300    | 1,278 | 23,387,400  |
| 理想科学工業        | 6,200     | 1,556 | 9,647,200   |
| S A N K Y O   | 24,200    | 3,375 | 81,675,000  |
| 日本金銭機械        | 8,900     | 736   | 6,550,400   |
| マースエンジニアリング   | 4,800     | 1,783 | 8,558,400   |
| ダイコク電機        | 3,700     | 1,840 | 6,808,000   |
| ア マ ノ         | 24,700    | 734   | 18,129,800  |
| J U K I       | 61,000    | 93    | 5,673,000   |
| サンデン          | 48,000    | 318   | 15,264,000  |
| ブラザー工業        | 104,800   | 799   | 83,735,200  |
| マックス          | 14,000    | 998   | 13,972,000  |
| モリタホールディングス   | 16,000    | 787   | 12,592,000  |
| グローリー         | 23,900    | 1,824 | 43,593,600  |
| 大和冷機工業        | 17,000    | 356   | 6,052,000   |
| セガサミーホールディングス | 87,300    | 1,372 | 119,775,600 |
| 日本ピストンリング     | 41,000    | 140   | 5,740,000   |
| リ ケ ン         | 32,000    | 296   | 9,472,000   |
| T P R         | 9,800     | 1,033 | 10,123,400  |
| ホシザキ電機        | 18,000    | 2,243 | 40,374,000  |
| 大豊工業          | 6,900     | 861   | 5,940,900   |
| 日本精工          | 182,000   | 490   | 89,180,000  |
| N T N         | 179,000   | 171   | 30,609,000  |
| ジェイテクト        | 86,300    | 666   | 57,475,800  |
| 不 二 越         | 78,000    | 284   | 22,152,000  |
| ミネベア          | 116,000   | 297   | 34,452,000  |
| 日本トムソン        | 29,000    | 303   | 8,787,000   |
| T H K         | 54,400    | 1,417 | 77,084,800  |
| ユーシン精機        | 4,900     | 1,529 | 7,492,100   |
| イーグル工業        | 12,000    | 594   | 7,128,000   |
| 日本ピラ - 工業     | 10,000    | 502   | 5,020,000   |
| キッツ           | 35,100    | 381   | 13,373,100  |
| 日 立           | 1,895,000 | 476   | 902,020,000 |
| 東 芝           | 1,603,000 | 281   | 450,443,000 |
| 三菱電機          | 811,000   | 642   | 520,662,000 |
| 富士電機          | 251,000   | 176   | 44,176,000  |
| 東洋電機製造        | 20,000    | 222   | 4,440,000   |
| 安川電機          | 91,000    | 658   | 59,878,000  |
| シンフォニア テクノロジー | 56,000    | 143   | 8,008,000   |
| 明 電 舎         | 87,000    | 262   | 22,794,000  |
| オリジン電気        | 15,000    | 449   | 6,735,000   |
| デンヨー          | 8,800     | 911   | 8,016,800   |
| 日立工機          | 23,500    | 590   | 13,865,000  |
| 三桜工業          | 11,700    | 505   | 5,908,500   |
| マキタ           | 49,300    | 3,475 | 171,317,500 |
| 東芝テック         | 51,000    | 414   | 21,114,000  |
| マブチモーター       | 11,800    | 3,470 | 40,946,000  |
| 日本電産          | 43,700    | 5,000 | 218,500,000 |
| ダイヘン          | 49,000    | 237   | 11,613,000  |
| J V C ケンウッド   | 51,500    | 290   | 14,935,000  |
| 日新電機          | 18,000    | 443   | 7,974,000   |
| 大崎電気          | 12,000    | 424   | 5,088,000   |

|              |           |         |             |
|--------------|-----------|---------|-------------|
| オムロン         | 90,200    | 1,827   | 164,795,400 |
| 日東工業         | 12,100    | 1,167   | 14,120,700  |
| I D E C      | 11,900    | 718     | 8,544,200   |
| ジーエス・ユアサ コーポ | 159,000   | 319     | 50,721,000  |
| メルコホールディングス  | 5,400     | 1,529   | 8,256,600   |
| 日本電気         | 1,057,000 | 144     | 152,208,000 |
| 富士通          | 783,000   | 312     | 244,296,000 |
| 沖電気          | 312,000   | 79      | 24,648,000  |
| 電気興業         | 24,000    | 369     | 8,856,000   |
| サンケン電気       | 45,000    | 318     | 14,310,000  |
| アイホン         | 5,300     | 1,256   | 6,656,800   |
| ルネサスエレクトロニクス | 22,300    | 283     | 6,310,900   |
| セイコーエプソン     | 55,600    | 482     | 26,799,200  |
| ワコム          | 155       | 235,000 | 36,425,000  |
| アルバック        | 17,000    | 599     | 10,183,000  |
| アクセル         | 4,300     | 1,930   | 8,299,000   |
| ナナオ          | 7,300     | 1,275   | 9,307,500   |
| 日本信号         | 21,700    | 546     | 11,848,200  |
| 京三製作所        | 20,000    | 280     | 5,600,000   |
| 能美防災         | 12,000    | 520     | 6,240,000   |
| 日本無線         | 23,000    | 205     | 4,715,000   |
| パナソニック       | 926,200   | 403     | 373,258,600 |
| シャープ         | 419,000   | 172     | 72,068,000  |
| アンリツ         | 44,000    | 1,059   | 46,596,000  |
| 富士通ゼネラル      | 20,000    | 756     | 15,120,000  |
| 日立国際電気       | 21,000    | 578     | 12,138,000  |
| ソニー          | 506,500   | 801     | 405,706,500 |
| T D K        | 45,600    | 3,225   | 147,060,000 |
| 帝国通信工業       | 37,000    | 138     | 5,106,000   |
| ミツミ電機        | 32,900    | 418     | 13,752,200  |
| タムラ製作所       | 36,000    | 179     | 6,444,000   |
| アルプス電気       | 61,000    | 518     | 31,598,000  |
| パイオニア        | 101,600   | 193     | 19,608,800  |
| 日本電波工業       | 8,200     | 909     | 7,453,800   |
| ローランド ディー・ジー | 5,200     | 932     | 4,846,400   |
| フオスタ - 電機    | 9,000     | 1,481   | 13,329,000  |
| クラリオン        | 51,000    | 140     | 7,140,000   |
| S M K        | 28,000    | 206     | 5,768,000   |
| 東光           | 48,000    | 205     | 9,840,000   |
| ホシデン         | 23,500    | 489     | 11,491,500  |
| ヒロセ電機        | 14,100    | 9,380   | 132,258,000 |
| 日本航空電子       | 20,000    | 682     | 13,640,000  |
| T O A        | 10,000    | 570     | 5,700,000   |
| ユニデン         | 28,000    | 177     | 4,956,000   |
| アルパイン        | 17,100    | 697     | 11,918,700  |
| アイコム         | 5,200     | 1,737   | 9,032,400   |
| 船井電機         | 8,400     | 931     | 7,820,400   |
| 横河電機         | 82,500    | 873     | 72,022,500  |
| 新電元工業        | 30,000    | 228     | 6,840,000   |
| アズビル         | 22,100    | 1,708   | 37,746,800  |
| 日本光電工業       | 16,300    | 2,705   | 44,091,500  |
| チノ           | 24,000    | 198     | 4,752,000   |
| 堀場製作所        | 16,200    | 2,350   | 38,070,000  |
| アドバンテスト      | 56,300    | 1,100   | 61,930,000  |
| 小野測器         | 13,000    | 365     | 4,745,000   |

|                     |           |        |               |
|---------------------|-----------|--------|---------------|
| エスベック               | 10,500    | 618    | 6,489,000     |
| キーエンス               | 19,800    | 23,020 | 455,796,000   |
| 日置電機                | 5,000     | 1,356  | 6,780,000     |
| シスメックス              | 28,600    | 3,725  | 106,535,000   |
| メガチップス              | 7,000     | 1,850  | 12,950,000    |
| O B A R A G R O U P | 6,800     | 930    | 6,324,000     |
| 日本電産コパル電子           | 11,400    | 411    | 4,685,400     |
| デンソー                | 200,100   | 2,709  | 542,070,900   |
| コーセル                | 12,100    | 1,034  | 12,511,400    |
| 日立メディコ              | 7,000     | 1,021  | 7,147,000     |
| オプテックス              | 6,200     | 962    | 5,964,400     |
| 千代田インテグレ            | 5,200     | 835    | 4,342,000     |
| スタンレー電気             | 62,300    | 1,157  | 72,081,100    |
| 岩崎電気                | 40,000    | 175    | 7,000,000     |
| ウシオ電機               | 48,200    | 941    | 45,356,200    |
| 日本セラミック             | 5,600     | 1,249  | 6,994,400     |
| 日本デジタル研究所           | 8,500     | 865    | 7,352,500     |
| 図 研                 | 7,500     | 517    | 3,877,500     |
| カ シ オ               | 78,700    | 617    | 48,557,900    |
| ファナック               | 84,400    | 13,900 | 1,173,160,000 |
| 日本シイエムケイ            | 20,100    | 276    | 5,547,600     |
| エンプラス               | 3,800     | 3,610  | 13,718,000    |
| ロ ー ム               | 42,400    | 2,349  | 99,597,600    |
| 浜松ホトニクス             | 31,600    | 2,905  | 91,798,000    |
| 三井ハイテック             | 12,600    | 601    | 7,572,600     |
| 新光電気工業              | 28,900    | 575    | 16,617,500    |
| 京 セ ラ               | 67,400    | 7,590  | 511,566,000   |
| 太陽誘電                | 40,500    | 716    | 28,998,000    |
| 村田製作所               | 84,800    | 4,670  | 396,016,000   |
| ユーシン                | 13,600    | 386    | 5,249,600     |
| 双葉電子工業              | 15,200    | 888    | 13,497,600    |
| 日東電工                | 69,900    | 4,295  | 300,220,500   |
| 北陸電気工業              | 44,000    | 97     | 4,268,000     |
| 東海理化電機              | 19,200    | 1,063  | 20,409,600    |
| ニチコン                | 26,500    | 600    | 15,900,000    |
| 日本ケミコン              | 54,000    | 142    | 7,668,000     |
| K O A               | 11,300    | 621    | 7,017,300     |
| 三井造船                | 324,000   | 109    | 35,316,000    |
| 日立造船                | 332,000   | 106    | 35,192,000    |
| 佐世保重工業              | 61,000    | 77     | 4,697,000     |
| 三菱重工業               | 1,358,000 | 383    | 520,114,000   |
| 川崎重工業               | 631,000   | 191    | 120,521,000   |
| I H I               | 556,000   | 183    | 101,748,000   |
| 日本車輛                | 32,000    | 335    | 10,720,000    |
| 近畿車輛                | 17,000    | 273    | 4,641,000     |
| 日産自動車               | 1,023,200 | 799    | 817,536,800   |
| いすゞ自動車              | 472,000   | 483    | 227,976,000   |
| トヨタ自動車              | 1,041,200 | 3,535  | 3,680,642,000 |
| 日野自動車               | 103,000   | 708    | 72,924,000    |
| 三菱自動車工業             | 1,872,000 | 77     | 144,144,000   |
| エフテック               | 4,000     | 1,115  | 4,460,000     |
| 武蔵精密工業              | 9,000     | 1,716  | 15,444,000    |
| 日産車体                | 27,000    | 945    | 25,515,000    |
| 新明和工業               | 36,000    | 498    | 17,928,000    |
| 極東開発工業              | 16,000    | 766    | 12,256,000    |



|             |           |       |               |
|-------------|-----------|-------|---------------|
| 日信工業        | 16,600    | 1,230 | 20,418,000    |
| トピー工業       | 65,000    | 176   | 11,440,000    |
| ティラド        | 32,000    | 193   | 6,176,000     |
| 曙ブレーキ       | 40,700    | 364   | 14,814,800    |
| タチエス        | 11,100    | 1,590 | 17,649,000    |
| N O K       | 39,500    | 1,261 | 49,809,500    |
| フタバ産業       | 26,600    | 320   | 8,512,000     |
| カヤバ工業       | 63,000    | 297   | 18,711,000    |
| シロキ工業       | 25,000    | 188   | 4,700,000     |
| 大同メタル工業     | 13,000    | 628   | 8,164,000     |
| プレス工業       | 37,000    | 351   | 12,987,000    |
| カルソニックカンセイ  | 56,000    | 380   | 21,280,000    |
| 太平洋工業       | 19,000    | 478   | 9,082,000     |
| ケーヒン        | 17,500    | 1,096 | 19,180,000    |
| 河西工業        | 13,000    | 383   | 4,979,000     |
| アイシン精機      | 73,600    | 2,436 | 179,289,600   |
| マ ッ ダ       | 1,291,000 | 130   | 167,830,000   |
| ダイハツ        | 84,000    | 1,463 | 122,892,000   |
| 今仙電機製作所     | 6,900     | 949   | 6,548,100     |
| 本田技研        | 683,900   | 2,732 | 1,868,414,800 |
| スズキ         | 169,600   | 1,956 | 331,737,600   |
| 富士重工業       | 257,000   | 925   | 237,725,000   |
| ヤマハ発動機      | 123,700   | 865   | 107,000,500   |
| ショーワ        | 20,100    | 826   | 16,602,600    |
| 小糸製作所       | 41,000    | 1,129 | 46,289,000    |
| T B K       | 12,000    | 416   | 4,992,000     |
| エクセディ       | 10,900    | 1,805 | 19,674,500    |
| ミツバ         | 16,000    | 545   | 8,720,000     |
| 豊田合成        | 23,200    | 1,724 | 39,996,800    |
| 愛三工業        | 9,500     | 636   | 6,042,000     |
| ヨ ロ ズ       | 6,500     | 1,200 | 7,800,000     |
| エフ・シー・シー    | 13,400    | 1,562 | 20,930,800    |
| シマノ         | 32,200    | 5,450 | 175,490,000   |
| タカタ         | 14,900    | 1,627 | 24,242,300    |
| テイ・エス テック   | 17,700    | 1,463 | 25,895,100    |
| 小 野 建       | 8,000     | 644   | 5,152,000     |
| カッパ・クリエイトHD | 6,350     | 1,750 | 11,112,500    |
| 伯東          | 6,800     | 748   | 5,086,400     |
| ライトオン       | 7,200     | 611   | 4,399,200     |
| ナガイレーベン     | 10,500    | 1,145 | 12,022,500    |
| 三菱食品        | 8,300     | 2,052 | 17,031,600    |
| 良品計画        | 8,600     | 5,260 | 45,236,000    |
| 三城ホールディングス  | 11,800    | 448   | 5,286,400     |
| 松田産業        | 6,900     | 1,021 | 7,044,900     |
| メディパルHD     | 79,900    | 975   | 77,902,500    |
| アズワン        | 5,500     | 1,720 | 9,460,000     |
| シモジマ        | 6,900     | 871   | 6,009,900     |
| ドウシシャ       | 4,200     | 2,215 | 9,303,000     |
| コナカ         | 10,000    | 603   | 6,030,000     |
| コーナン商事      | 11,600    | 958   | 11,112,800    |
| 黒田電気        | 11,100    | 874   | 9,701,400     |
| ネットワンシステムズ  | 30,100    | 800   | 24,080,000    |
| ワタミ         | 9,800     | 1,701 | 16,669,800    |
| ドン・キホーテ     | 21,200    | 3,205 | 67,946,000    |
| メガネトップ      | 13,900    | 1,005 | 13,969,500    |

|                |         |         |               |
|----------------|---------|---------|---------------|
| 西松屋チェーン        | 17,600  | 665     | 11,704,000    |
| ゼンショーホールディングス  | 30,800  | 980     | 30,184,000    |
| ハピネット          | 5,700   | 592     | 3,374,400     |
| 幸楽苑            | 6,600   | 1,196   | 7,893,600     |
| トーマンエレクトロニクス   | 5,000   | 971     | 4,855,000     |
| サイゼリヤ          | 12,200  | 1,157   | 14,115,400    |
| エクセル           | 6,300   | 660     | 4,158,000     |
| マルカキカイ         | 4,000   | 949     | 3,796,000     |
| ガリバーインターナショナル  | 2,850   | 3,120   | 8,892,000     |
| ユナイテッドアローズ     | 9,700   | 2,117   | 20,534,900    |
| ハイデイ日高         | 4,800   | 1,400   | 6,720,000     |
| シークス           | 5,700   | 1,034   | 5,893,800     |
| 京都きもの友禅        | 6,500   | 950     | 6,175,000     |
| コロワイド          | 28,500  | 707     | 20,149,500    |
| 壱番屋            | 3,500   | 2,528   | 8,848,000     |
| マクニカ           | 4,800   | 1,591   | 7,636,800     |
| スギホールディングス     | 12,700  | 2,761   | 35,064,700    |
| 島津製作所          | 97,000  | 526     | 51,022,000    |
| J M S          | 20,000  | 296     | 5,920,000     |
| スター精密          | 15,300  | 802     | 12,270,600    |
| 東京計器           | 40,000  | 141     | 5,640,000     |
| 東京精密           | 15,200  | 1,361   | 20,687,200    |
| マニー            | 2,700   | 3,300   | 8,910,000     |
| ニコン            | 150,900 | 2,284   | 344,655,600   |
| トプコン           | 18,700  | 554     | 10,359,800    |
| オリンパス          | 96,300  | 1,375   | 132,412,500   |
| 理研計器           | 9,300   | 513     | 4,770,900     |
| 大日本スクリーン       | 84,000  | 452     | 37,968,000    |
| キヤノン電子         | 7,700   | 1,772   | 13,644,400    |
| タムロン           | 6,500   | 2,454   | 15,951,000    |
| HOYA           | 196,200 | 1,583   | 310,584,600   |
| キヤノン           | 503,200 | 2,883   | 1,450,725,600 |
| リコー            | 244,000 | 765     | 186,660,000   |
| 日本電産コパル        | 8,000   | 675     | 5,400,000     |
| シチズンホールディングス   | 100,200 | 412     | 41,282,400    |
| リズム時計          | 44,000  | 159     | 6,996,000     |
| パラマウントベッドHD    | 7,300   | 2,667   | 19,469,100    |
| 永大産業           | 14,000  | 349     | 4,886,000     |
| ダンロップスポーツ      | 5,000   | 1,049   | 5,245,000     |
| バンダイナムコHLDGS   | 84,100  | 1,157   | 97,303,700    |
| 共立印刷           | 14,100  | 221     | 3,116,100     |
| フランスベッドHLDGS   | 56,000  | 172     | 9,632,000     |
| パイロットコーポレーション  | 78      | 153,900 | 12,004,200    |
| エイベックス・グループHD  | 15,500  | 1,775   | 27,512,500    |
| トッパン・フォームズ     | 15,200  | 770     | 11,704,000    |
| フジシールインターナショナル | 10,100  | 1,740   | 17,574,000    |
| タカラトミー         | 27,700  | 451     | 12,492,700    |
| アーク            | 33,400  | 173     | 5,778,200     |
| プロネクサス         | 12,700  | 467     | 5,930,900     |
| ウッドワン          | 19,000  | 246     | 4,674,000     |
| 大建工業           | 38,000  | 212     | 8,056,000     |
| きもと            | 9,200   | 614     | 5,648,800     |
| 凸版印刷           | 230,000 | 510     | 117,300,000   |
| 大日本印刷          | 246,000 | 617     | 151,782,000   |
| 共同印刷           | 36,000  | 227     | 8,172,000     |

|                   |         |       |             |
|-------------------|---------|-------|-------------|
| 日本写真印刷            | 13,900  | 903   | 12,551,700  |
| 藤森工業              | 7,000   | 2,233 | 15,631,000  |
| 宝印刷               | 7,600   | 567   | 4,309,200   |
| 前澤化成工業            | 7,900   | 835   | 6,596,500   |
| アシックス             | 75,500  | 1,214 | 91,657,000  |
| ツ ツ ミ             | 4,600   | 1,974 | 9,080,400   |
| ジェイ エス ピー         | 6,200   | 1,095 | 6,789,000   |
| ニ チ ハ             | 10,700  | 930   | 9,951,000   |
| ローランド             | 9,900   | 627   | 6,207,300   |
| エフピコ              | 4,100   | 5,720 | 23,452,000  |
| 小松ウオール工業          | 4,600   | 1,074 | 4,940,400   |
| ヤマハ               | 61,200  | 749   | 45,838,800  |
| 河合楽器              | 39,000  | 150   | 5,850,000   |
| クリナップ             | 11,200  | 557   | 6,238,400   |
| ピジョン              | 6,500   | 3,710 | 24,115,000  |
| 天馬                | 7,800   | 789   | 6,154,200   |
| キングジム             | 7,500   | 647   | 4,852,500   |
| リンテック             | 16,800  | 1,531 | 25,720,800  |
| 信越ポリマー            | 19,400  | 283   | 5,490,200   |
| 東 リ               | 30,000  | 172   | 5,160,000   |
| イトーキ              | 18,700  | 428   | 8,003,600   |
| 任 天 堂             | 46,400  | 9,880 | 458,432,000 |
| 三菱鉛筆              | 7,300   | 1,434 | 10,468,200  |
| 松 風               | 5,700   | 844   | 4,810,800   |
| タカラスタンダ - ド       | 39,000  | 609   | 23,751,000  |
| コ ク ヨ             | 43,200  | 644   | 27,820,800  |
| ナカバヤシ             | 30,000  | 173   | 5,190,000   |
| ニ フ コ             | 18,700  | 1,860 | 34,782,000  |
| グローブライド           | 69,000  | 98    | 6,762,000   |
| 岡村製作所             | 31,000  | 610   | 18,910,000  |
| 日本バルカー            | 38,000  | 213   | 8,094,000   |
| 伊 藤 忠             | 637,700 | 824   | 525,464,800 |
| 丸 紅               | 658,000 | 543   | 357,294,000 |
| スクロール             | 15,100  | 248   | 3,744,800   |
| 高 島               | 19,000  | 260   | 4,940,000   |
| F & A アクアホールディングス | 7,700   | 900   | 6,930,000   |
| 三陽商会              | 51,000  | 241   | 12,291,000  |
| 長瀬産業              | 46,000  | 894   | 41,124,000  |
| 蝶 理               | 6,400   | 882   | 5,644,800   |
| 豊田通商              | 89,200  | 1,898 | 169,301,600 |
| オンワ - ドホールディングス   | 55,000  | 600   | 33,000,000  |
| 三共生興              | 17,700  | 274   | 4,849,800   |
| 兼 松               | 188,000 | 96    | 18,048,000  |
| 美 津 濃             | 41,000  | 388   | 15,908,000  |
| ファミリーマート          | 24,200  | 3,655 | 88,451,000  |
| ルック               | 15,000  | 412   | 6,180,000   |
| 三井物産              | 690,300 | 1,139 | 786,251,700 |
| 日本紙パルプ            | 40,000  | 267   | 10,680,000  |
| 東京エレクトロン          | 68,300  | 3,675 | 251,002,500 |
| 日立ハイテクノロジーズ       | 24,600  | 1,831 | 45,042,600  |
| カメイ               | 11,000  | 723   | 7,953,000   |
| 東都水産              | 32,000  | 126   | 4,032,000   |
| スターゼン             | 30,000  | 239   | 7,170,000   |
| セイコーHD            | 54,000  | 189   | 10,206,000  |
| 山 善               | 32,300  | 567   | 18,314,100  |

|                |         |       |             |
|----------------|---------|-------|-------------|
| 住友商事           | 472,100 | 1,023 | 482,958,300 |
| 日本ユニシス         | 23,800  | 591   | 14,065,800  |
| 内田洋行           | 23,000  | 220   | 5,060,000   |
| 三菱商事           | 622,400 | 1,561 | 971,566,400 |
| 第一実業           | 22,000  | 368   | 8,096,000   |
| キャノンマーケティングJPN | 26,600  | 1,189 | 31,627,400  |
| 西華産業           | 31,000  | 228   | 7,068,000   |
| 菱洋エレクトロ        | 10,100  | 778   | 7,857,800   |
| ユアサ商事          | 92,000  | 147   | 13,524,000  |
| 神鋼商事           | 30,000  | 149   | 4,470,000   |
| 阪和興業           | 81,000  | 272   | 22,032,000  |
| カナデン           | 10,000  | 499   | 4,990,000   |
| 菱電商事           | 13,000  | 461   | 5,993,000   |
| ニプロ            | 43,600  | 602   | 26,247,200  |
| 岩谷産業           | 90,000  | 308   | 27,720,000  |
| すてきナイスグループ     | 41,000  | 192   | 7,872,000   |
| 昭光通商           | 47,000  | 126   | 5,922,000   |
| 兼松エレクトロニクス     | 6,700   | 927   | 6,210,900   |
| 三愛石油           | 21,000  | 362   | 7,602,000   |
| 稲畑産業           | 22,100  | 518   | 11,447,800  |
| ゴ-ルドウイン        | 21,000  | 541   | 11,361,000  |
| ユニ・チャ-ム        | 46,500  | 4,210 | 195,765,000 |
| デサント           | 23,000  | 499   | 11,477,000  |
| ヤマトインタ-ナショナル   | 11,100  | 360   | 3,996,000   |
| 東邦ホールディングス     | 25,900  | 1,576 | 40,818,400  |
| サンゲツ           | 14,200  | 2,129 | 30,231,800  |
| ミツウロコグループ      | 14,800  | 460   | 6,808,000   |
| シナネン           | 19,000  | 344   | 6,536,000   |
| 伊藤忠エネクス        | 20,400  | 415   | 8,466,000   |
| サンリオ           | 20,300  | 2,949 | 59,864,700  |
| リョ-サン          | 13,800  | 1,337 | 18,450,600  |
| 新光商事           | 11,000  | 680   | 7,480,000   |
| トーホ-           | 23,000  | 313   | 7,199,000   |
| 三信電気           | 12,100  | 561   | 6,788,100   |
| 東陽テクニカ         | 12,800  | 939   | 12,019,200  |
| モスフード サービス     | 10,500  | 1,564 | 16,422,000  |
| 加賀電子           | 10,400  | 753   | 7,831,200   |
| 三益半導体          | 8,500   | 625   | 5,312,500   |
| 木曽路            | 10,300  | 1,659 | 17,087,700  |
| 千趣会            | 15,500  | 523   | 8,106,500   |
| ケーヨー           | 16,300  | 450   | 7,335,000   |
| アデランス          | 11,000  | 1,151 | 12,661,000  |
| 上新電機           | 19,000  | 850   | 16,150,000  |
| 日本瓦斯           | 11,000  | 1,253 | 13,783,000  |
| マルエツ           | 21,000  | 268   | 5,628,000   |
| ロイヤルホールディングス   | 14,600  | 1,040 | 15,184,000  |
| いなげや           | 9,200   | 979   | 9,006,800   |
| 島忠             | 17,800  | 1,735 | 30,883,000  |
| チヨダ            | 9,700   | 2,195 | 21,291,500  |
| ライフコーポレーション    | 5,800   | 1,250 | 7,250,000   |
| カスミ            | 18,100  | 521   | 9,430,100   |
| リンガーハット        | 8,900   | 1,043 | 9,282,700   |
| MR MAX         | 12,400  | 310   | 3,844,000   |
| AOKIホールディングス   | 7,500   | 1,904 | 14,280,000  |
| オークワ           | 13,000  | 1,085 | 14,105,000  |

|                 |           |       |               |
|-----------------|-----------|-------|---------------|
| コメリ             | 12,000    | 1,993 | 23,916,000    |
| 青山商事            | 22,300    | 1,499 | 33,427,700    |
| しまむら            | 9,200     | 8,330 | 76,636,000    |
| C F S コーポレーション  | 11,500    | 361   | 4,151,500     |
| 高島屋             | 111,000   | 522   | 57,942,000    |
| 松屋              | 17,300    | 743   | 12,853,900    |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 52,000    | 785   | 40,820,000    |
| ニッセンHD          | 17,500    | 319   | 5,582,500     |
| パルコ             | 16,600    | 829   | 13,761,400    |
| 丸井グループ          | 107,200   | 557   | 59,710,400    |
| クレディセゾン         | 70,300    | 1,832 | 128,789,600   |
| 原信ナルスHLDGS      | 5,600     | 1,488 | 8,332,800     |
| ダイエー            | 54,100    | 161   | 8,710,100     |
| イズミヤ            | 33,000    | 407   | 13,431,000    |
| イオン             | 282,200   | 922   | 260,188,400   |
| ユニー             | 77,600    | 577   | 44,775,200    |
| イズミ             | 20,500    | 1,838 | 37,679,000    |
| 東武ストア           | 19,000    | 260   | 4,940,000     |
| 平和堂             | 16,600    | 1,145 | 19,007,000    |
| フジ              | 9,200     | 1,755 | 16,146,000    |
| ヤオコー            | 4,400     | 3,150 | 13,860,000    |
| ゼビオ             | 10,700    | 1,483 | 15,868,100    |
| ケーズホールディングス     | 20,100    | 1,863 | 37,446,300    |
| Paltaac         | 9,600     | 979   | 9,398,400     |
| 新生銀行            | 705,000   | 140   | 98,700,000    |
| あおぞら銀行          | 296,000   | 254   | 75,184,000    |
| 三菱UFJフィナンシャルG   | 6,060,200 | 377   | 2,284,695,400 |
| りそなホールディングス     | 824,200   | 345   | 284,349,000   |
| 三井住友トラストHD      | 1,673,000 | 250   | 418,250,000   |
| 三井住友フィナンシャルG    | 604,800   | 2,654 | 1,605,139,200 |
| 第四銀行            | 102,000   | 287   | 29,274,000    |
| 北越銀行            | 86,000    | 170   | 14,620,000    |
| 西日本シティ銀行        | 275,000   | 198   | 54,450,000    |
| 千葉銀行            | 307,000   | 492   | 151,044,000   |
| 横浜銀行            | 506,000   | 391   | 197,846,000   |
| 常陽銀行            | 299,000   | 402   | 120,198,000   |
| 群馬銀行            | 177,000   | 396   | 70,092,000    |
| 武蔵野銀行           | 12,500    | 2,739 | 34,237,500    |
| 千葉興業銀行          | 19,200    | 424   | 8,140,800     |
| 筑波銀行            | 37,300    | 271   | 10,108,300    |
| 東京都民銀行          | 16,400    | 696   | 11,414,400    |
| 七十七銀行           | 126,000   | 337   | 42,462,000    |
| 青森銀行            | 63,000    | 233   | 14,679,000    |
| 秋田銀行            | 58,000    | 223   | 12,934,000    |
| 山形銀行            | 51,000    | 368   | 18,768,000    |
| 岩手銀行            | 5,700     | 3,215 | 18,325,500    |
| 東邦銀行            | 69,000    | 265   | 18,285,000    |
| 東北銀行            | 54,000    | 123   | 6,642,000     |
| みちのく銀行          | 49,000    | 165   | 8,085,000     |
| ふくおかフィナンシャルG    | 324,000   | 325   | 105,300,000   |
| 静岡銀行            | 234,000   | 815   | 190,710,000   |
| 十六銀行            | 101,000   | 287   | 28,987,000    |
| スルガ銀行           | 78,000    | 1,066 | 83,148,000    |
| 八十二銀行           | 143,000   | 417   | 59,631,000    |
| 山梨中央銀行          | 52,000    | 335   | 17,420,000    |

|              |            |       |               |
|--------------|------------|-------|---------------|
| 大垣共立銀行       | 103,000    | 290   | 29,870,000    |
| 福井銀行         | 70,000     | 160   | 11,200,000    |
| 北國銀行         | 93,000     | 302   | 28,086,000    |
| 清水銀行         | 3,200      | 2,410 | 7,712,000     |
| 滋賀銀行         | 73,000     | 537   | 39,201,000    |
| 南都銀行         | 78,000     | 411   | 32,058,000    |
| 百五銀行         | 71,000     | 358   | 25,418,000    |
| 京都銀行         | 142,000    | 703   | 99,826,000    |
| 三重銀行         | 35,000     | 174   | 6,090,000     |
| ほくほくフィナンシャルG | 549,000    | 115   | 63,135,000    |
| 広島銀行         | 231,000    | 344   | 79,464,000    |
| 山陰合同銀行       | 47,000     | 597   | 28,059,000    |
| 中国銀行         | 61,000     | 1,151 | 70,211,000    |
| 鳥取銀行         | 34,000     | 162   | 5,508,000     |
| 伊予銀行         | 82,000     | 640   | 52,480,000    |
| 百十四銀行        | 89,000     | 318   | 28,302,000    |
| 四国銀行         | 60,000     | 206   | 12,360,000    |
| 阿波銀行         | 67,000     | 495   | 33,165,000    |
| 鹿児島銀行        | 53,000     | 525   | 27,825,000    |
| 大分銀行         | 51,000     | 288   | 14,688,000    |
| 宮崎銀行         | 57,000     | 207   | 11,799,000    |
| 肥後銀行         | 63,000     | 477   | 30,051,000    |
| 佐賀銀行         | 54,000     | 181   | 9,774,000     |
| 十八銀行         | 55,000     | 210   | 11,550,000    |
| 沖縄銀行         | 6,100      | 3,125 | 19,062,500    |
| 琉球銀行         | 16,400     | 1,010 | 16,564,000    |
| 八千代銀行        | 4,600      | 1,620 | 7,452,000     |
| セブン銀行        | 277,500    | 215   | 59,662,500    |
| みずほフィナンシャルG  | 10,293,100 | 132   | 1,358,689,200 |
| 紀陽ホールディングス   | 311,000    | 114   | 35,454,000    |
| 山口フィナンシャルG   | 78,000     | 751   | 58,578,000    |
| 芙蓉総合リース      | 8,100      | 2,317 | 18,767,700    |
| 興銀リース        | 12,500     | 2,092 | 26,150,000    |
| 東京センチュリーリース  | 19,200     | 1,615 | 31,008,000    |
| SBIホールディングス  | 101,800    | 615   | 62,607,000    |
| 日本証券金融       | 35,000     | 390   | 13,650,000    |
| 大阪証券金融       | 22,900     | 183   | 4,190,700     |
| ポケットカード      | 12,200     | 327   | 3,989,400     |
| 長野銀行         | 38,000     | 152   | 5,776,000     |
| 名古屋銀行        | 76,000     | 288   | 21,888,000    |
| 北洋銀行         | 119,100    | 215   | 25,606,500    |
| 愛知銀行         | 3,100      | 4,350 | 13,485,000    |
| 第三銀行         | 55,000     | 146   | 8,030,000     |
| 中京銀行         | 39,000     | 188   | 7,332,000     |
| 東日本銀行        | 43,000     | 176   | 7,568,000     |
| 大光銀行         | 33,000     | 205   | 6,765,000     |
| 愛媛銀行         | 49,000     | 221   | 10,829,000    |
| トマト銀行        | 38,000     | 149   | 5,662,000     |
| みなと銀行        | 74,000     | 147   | 10,878,000    |
| 京葉銀行         | 65,000     | 364   | 23,660,000    |
| 関西アーバン銀行     | 114,000    | 105   | 11,970,000    |
| 栃木銀行         | 41,000     | 293   | 12,013,000    |
| 北日本銀行        | 3,000      | 2,231 | 6,693,000     |
| 東和銀行         | 83,000     | 84    | 6,972,000     |
| 福島銀行         | 130,000    | 54    | 7,020,000     |

|                 |           |        |             |
|-----------------|-----------|--------|-------------|
| リコーリース          | 6,600     | 1,849  | 12,203,400  |
| イオン クレジットサービス   | 29,700    | 1,611  | 47,846,700  |
| ア コ ム           | 16,450    | 2,250  | 37,012,500  |
| ジャックス           | 47,000    | 319    | 14,993,000  |
| オ リ コ           | 158,500   | 167    | 26,469,500  |
| 日立キャピタル         | 16,500    | 1,554  | 25,641,000  |
| オリックス           | 41,700    | 8,270  | 344,859,000 |
| 三菱UFJリース        | 20,510    | 3,590  | 73,630,900  |
| ジャフコ            | 11,900    | 2,054  | 24,442,600  |
| トモニホールディングス     | 62,500    | 351    | 21,937,500  |
| 大和証券G本社         | 795,000   | 365    | 290,175,000 |
| 野村ホールディングス      | 1,637,300 | 341    | 558,319,300 |
| 岡三証券グループ        | 68,000    | 350    | 23,800,000  |
| 丸三証券            | 31,000    | 329    | 10,199,000  |
| 東洋証券            | 36,000    | 172    | 6,192,000   |
| 東海東京HD          | 91,000    | 335    | 30,485,000  |
| 水戸証券            | 30,000    | 172    | 5,160,000   |
| いちよし証券          | 20,800    | 460    | 9,568,000   |
| 松井証券            | 49,400    | 652    | 32,208,800  |
| NK S Jホールディングス  | 176,800   | 1,563  | 276,338,400 |
| マネックスG          | 924       | 17,200 | 15,892,800  |
| カブドットコム証券       | 34,100    | 278    | 9,479,800   |
| 極東証券            | 12,100    | 738    | 8,929,800   |
| フィデアホール         | 49,700    | 170    | 8,449,000   |
| 池田泉州HD          | 64,600    | 529    | 34,173,400  |
| MS & AD         | 239,000   | 1,430  | 341,770,000 |
| SONY FH         | 77,200    | 1,416  | 109,315,200 |
| 第一生命            | 4,286     | 93,400 | 400,312,400 |
| 東京海上HD          | 309,200   | 2,114  | 653,648,800 |
| NECキャピタルソリューション | 4,200     | 1,148  | 4,821,600   |
| T & Dホールディングス   | 275,300   | 886    | 243,915,800 |
| 三井不動産           | 377,000   | 1,719  | 648,063,000 |
| 三菱地所            | 560,000   | 1,589  | 889,840,000 |
| 平和不動産           | 17,300    | 972    | 16,815,600  |
| 東京建物            | 155,000   | 329    | 50,995,000  |
| ダイビル            | 21,600    | 667    | 14,407,200  |
| 東急不動産           | 175,000   | 483    | 84,525,000  |
| 京阪神ビルディング       | 15,700    | 386    | 6,060,200   |
| 住友不動産           | 192,000   | 2,243  | 430,656,000 |
| 東宝不動産           | 9,800     | 457    | 4,478,600   |
| 大京              | 127,000   | 198    | 25,146,000  |
| テーオーシー          | 28,500    | 440    | 12,540,000  |
| 東京楽天地           | 17,000    | 303    | 5,151,000   |
| レオパレス21         | 67,600    | 259    | 17,508,400  |
| フジ住宅            | 11,700    | 423    | 4,949,100   |
| 空港施設            | 14,000    | 379    | 5,306,000   |
| 住友不動産販売         | 2,930     | 3,545  | 10,386,850  |
| ゴールドクレスト        | 6,800     | 1,174  | 7,983,200   |
| 東栄住宅            | 5,700     | 861    | 4,907,700   |
| リロ・ホールディング      | 2,900     | 3,100  | 8,990,000   |
| 東急リバブル          | 9,000     | 1,167  | 10,503,000  |
| 飯田産業            | 7,900     | 676    | 5,340,400   |
| アーネストワン         | 13,200    | 1,126  | 14,863,200  |
| タカラレーベン         | 9,100     | 825    | 7,507,500   |
| サンヨーハウジ 名古屋     | 47        | 83,400 | 3,919,800   |

|                |           |        |             |
|----------------|-----------|--------|-------------|
| イオンモール         | 36,300    | 2,130  | 77,319,000  |
| フージャースコーポレーション | 115       | 57,900 | 6,658,500   |
| タクトホーム         | 48        | 83,300 | 3,998,400   |
| トーセイ           | 129       | 35,850 | 4,624,650   |
| エヌ・ティ・ティ都市開発   | 507       | 69,800 | 35,388,600  |
| 東武鉄道           | 465,000   | 426    | 198,090,000 |
| 相鉄ホールディングス     | 132,000   | 272    | 35,904,000  |
| 東京急行           | 478,000   | 423    | 202,194,000 |
| 京浜急行           | 208,000   | 757    | 157,456,000 |
| 小田急電鉄          | 261,000   | 841    | 219,501,000 |
| 京王電鉄           | 227,000   | 604    | 137,108,000 |
| 京成電鉄           | 125,000   | 696    | 87,000,000  |
| 富士急行           | 25,000    | 462    | 11,550,000  |
| 新京成電鉄          | 16,000    | 354    | 5,664,000   |
| 東日本旅客鉄道        | 150,500   | 5,410  | 814,205,000 |
| 西日本旅客鉄道        | 70,700    | 3,295  | 232,956,500 |
| 東海旅客鉄道         | 67,600    | 6,530  | 441,428,000 |
| 西日本鉄道          | 102,000   | 342    | 34,884,000  |
| ハマキョウレックス      | 2,800     | 2,462  | 6,893,600   |
| 近畿日本鉄道         | 729,000   | 328    | 239,112,000 |
| 阪急阪神HLDGS      | 514,000   | 435    | 223,590,000 |
| 南海電鉄           | 169,000   | 375    | 63,375,000  |
| 京阪電鉄           | 178,000   | 386    | 68,708,000  |
| 名古屋鉄道          | 282,000   | 220    | 62,040,000  |
| 日本通運           | 323,000   | 296    | 95,608,000  |
| ヤマトホールディングス    | 152,600   | 1,234  | 188,308,400 |
| 山九             | 97,000    | 336    | 32,592,000  |
| 日新             | 36,000    | 197    | 7,092,000   |
| 丸全昭和運輸         | 34,000    | 233    | 7,922,000   |
| センコー           | 36,000    | 346    | 12,456,000  |
| トナミホールディングス    | 22,000    | 174    | 3,828,000   |
| 日本梱包運輸         | 25,700    | 1,013  | 26,034,100  |
| 福山通運           | 50,000    | 416    | 20,800,000  |
| セイノーホールディングス   | 62,000    | 499    | 30,938,000  |
| 神奈川中央交通        | 15,000    | 453    | 6,795,000   |
| 日立物流           | 14,600    | 1,219  | 17,797,400  |
| 日本郵船           | 649,000   | 175    | 113,575,000 |
| 商船三井           | 399,000   | 207    | 82,593,000  |
| 川崎汽船           | 364,000   | 109    | 39,676,000  |
| NSユニテッド海運      | 51,000    | 96     | 4,896,000   |
| 飯野海運           | 38,500    | 256    | 9,856,000   |
| 日本航空           | 68,200    | 3,790  | 258,478,000 |
| 全日本空輸          | 1,591,000 | 177    | 281,607,000 |
| 三菱倉庫           | 59,000    | 1,058  | 62,422,000  |
| 三井倉庫           | 41,000    | 256    | 10,496,000  |
| 住友倉庫           | 58,000    | 358    | 20,764,000  |
| 渋沢倉庫           | 26,000    | 240    | 6,240,000   |
| ヤマタネ           | 58,000    | 109    | 6,322,000   |
| 東陽倉庫           | 22,000    | 186    | 4,092,000   |
| 日本トランスシティ      | 27,000    | 271    | 7,317,000   |
| 安田倉庫           | 8,100     | 540    | 4,374,000   |
| 東洋埠頭           | 37,000    | 128    | 4,736,000   |
| 上組             | 88,000    | 637    | 56,056,000  |
| 郵船ロジスティクス      | 7,300     | 762    | 5,562,600   |
| 近鉄エクスプレス       | 7,600     | 2,491  | 18,931,600  |



|                 |         |         |               |
|-----------------|---------|---------|---------------|
| 東京放送HD          | 44,100  | 805     | 35,500,500    |
| 日本テレビHD         | 72,200  | 1,079   | 77,903,800    |
| テレビ朝日           | 20,400  | 1,129   | 23,031,600    |
| スカパーJSATHD      | 710     | 35,050  | 24,885,500    |
| テレビ東京HD         | 7,100   | 897     | 6,368,700     |
| アイ・ティー・シーネットワーク | 12,400  | 639     | 7,923,600     |
| イー・アクセス         | 887     | 60,800  | 53,929,600    |
| NECモバイルリング      | 3,200   | 3,280   | 10,496,000    |
| 日本電信電話          | 336,800 | 3,685   | 1,241,108,000 |
| KDDI            | 113,100 | 6,100   | 689,910,000   |
| 光通信             | 8,700   | 3,750   | 32,625,000    |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ    | 6,582   | 118,900 | 782,599,800   |
| GMOインターネット      | 27,600  | 502     | 13,855,200    |
| 学研ホールディングス      | 28,000  | 215     | 6,020,000     |
| ゼンリン            | 11,500  | 1,110   | 12,765,000    |
| 角川グループHD        | 7,300   | 2,443   | 17,833,900    |
| 東京電力            | 686,600 | 130     | 89,258,000    |
| 中部電力            | 247,900 | 1,114   | 276,160,600   |
| 関西電力            | 330,900 | 784     | 259,425,600   |
| 中国電力            | 111,700 | 1,189   | 132,811,300   |
| 北陸電力            | 79,500  | 913     | 72,583,500    |
| 東北電力            | 202,600 | 747     | 151,342,200   |
| 四国電力            | 73,100  | 1,121   | 81,945,100    |
| 九州電力            | 178,900 | 772     | 138,110,800   |
| 北海道電力           | 76,000  | 815     | 61,940,000    |
| 沖縄電力            | 5,100   | 2,456   | 12,525,600    |
| 電源開発            | 50,300  | 2,087   | 104,976,100   |
| 東京瓦斯            | 970,000 | 405     | 392,850,000   |
| 大阪瓦斯            | 782,000 | 324     | 253,368,000   |
| 東邦瓦斯            | 205,000 | 479     | 98,195,000    |
| 北海道瓦斯           | 21,000  | 224     | 4,704,000     |
| 西部瓦斯            | 95,000  | 219     | 20,805,000    |
| 静岡瓦斯            | 22,500  | 596     | 13,410,000    |
| 松竹              | 55,000  | 825     | 45,375,000    |
| 東宝              | 57,400  | 1,386   | 79,556,400    |
| エイチ・アイ・エス       | 7,200   | 2,540   | 18,288,000    |
| 東映              | 36,000  | 438     | 15,768,000    |
| NTTデータ          | 494     | 238,800 | 117,967,200   |
| 共立メンテナンス        | 5,200   | 1,739   | 9,042,800     |
| イチネンホールディングス    | 12,200  | 470     | 5,734,000     |
| スペース            | 6,200   | 730     | 4,526,000     |
| アインファーマシーズ      | 4,600   | 4,690   | 21,574,000    |
| 東京テアトル          | 59,000  | 105     | 6,195,000     |
| よみうりランド         | 27,000  | 272     | 7,344,000     |
| 東京都競馬           | 79,000  | 122     | 9,638,000     |
| 常磐興産            | 40,000  | 124     | 4,960,000     |
| カナモト            | 11,000  | 1,047   | 11,517,000    |
| 東京ドーム           | 72,000  | 265     | 19,080,000    |
| DTS             | 9,000   | 1,072   | 9,648,000     |
| スクウェア・エニックス・HD  | 29,100  | 1,109   | 32,271,900    |
| シーイーシー          | 8,500   | 461     | 3,918,500     |
| カプコン            | 16,000  | 1,550   | 24,800,000    |
| 日本空港ビルデング       | 27,400  | 929     | 25,454,600    |
| トランス・コスモス       | 11,900  | 857     | 10,198,300    |
| 乃村工藝社           | 21,000  | 320     | 6,720,000     |

|                 |         |         |                |
|-----------------|---------|---------|----------------|
| ジャステック          | 7,000   | 498     | 3,486,000      |
| S C S K         | 18,700  | 1,409   | 26,348,300     |
| 藤田観光            | 30,000  | 296     | 8,880,000      |
| 日本管財            | 3,200   | 1,490   | 4,768,000      |
| トーカイ            | 4,700   | 2,163   | 10,166,100     |
| セコム             | 87,400  | 4,220   | 368,828,000    |
| アイネス            | 13,000  | 504     | 6,552,000      |
| メイテック           | 13,800  | 1,826   | 25,198,800     |
| T K C           | 7,400   | 1,401   | 10,367,400     |
| アサツー ディ・ケイ      | 14,200  | 1,919   | 27,249,800     |
| 富士ソフト           | 11,800  | 1,663   | 19,623,400     |
| 応用地質            | 10,400  | 950     | 9,880,000      |
| 船井総合研究所         | 11,400  | 538     | 6,133,200      |
| N S D           | 16,900  | 743     | 12,556,700     |
| コナミ             | 36,500  | 1,989   | 72,598,500     |
| ベネッセホールディングス    | 25,500  | 3,600   | 91,800,000     |
| イオンディライト        | 8,400   | 1,697   | 14,254,800     |
| ニチイ学館           | 17,800  | 649     | 11,552,200     |
| ダイセキ            | 13,600  | 1,100   | 14,960,000     |
| 元気寿司            | 4,700   | 1,027   | 4,826,900      |
| トラスコ中山          | 10,000  | 1,412   | 14,120,000     |
| ヤマダ電機           | 36,450  | 2,915   | 106,251,750    |
| オートバックスセブン      | 9,400   | 3,215   | 30,221,000     |
| アークランドサカモト      | 6,000   | 1,230   | 7,380,000      |
| ニトリホールディングス     | 15,650  | 6,130   | 95,934,500     |
| 吉野家ホールディングス     | 213     | 105,200 | 22,407,600     |
| 加藤産業            | 11,900  | 1,466   | 17,445,400     |
| イエローハット         | 8,600   | 1,223   | 10,517,800     |
| 富士エレクトロニクス      | 4,800   | 1,100   | 5,280,000      |
| 松屋フーズ           | 4,500   | 1,471   | 6,619,500      |
| J B C Cホールディングス | 9,700   | 569     | 5,519,300      |
| サガミチェーン         | 12,000  | 645     | 7,740,000      |
| 日 伝             | 3,700   | 2,020   | 7,474,000      |
| 因幡電機産業          | 9,800   | 2,339   | 22,922,200     |
| 住金物産            | 46,000  | 206     | 9,476,000      |
| プレナス            | 9,200   | 1,355   | 12,466,000     |
| ミニストップ          | 6,000   | 1,406   | 8,436,000      |
| アークス            | 13,100  | 1,702   | 22,296,200     |
| バ ロ ー           | 17,300  | 1,276   | 22,074,800     |
| ミスミグループ本社       | 29,900  | 2,170   | 64,883,000     |
| ベ ル ク           | 5,700   | 1,156   | 6,589,200      |
| 大 庄             | 6,500   | 1,038   | 6,747,000      |
| タキヒヨー           | 14,000  | 400     | 5,600,000      |
| ファーストリテイリング     | 16,000  | 18,720  | 299,520,000    |
| ソフトバンク          | 365,200 | 3,090   | 1,128,468,000  |
| スズケン            | 30,600  | 2,455   | 75,123,000     |
| サンドラッグ          | 15,000  | 2,956   | 44,340,000     |
| ペルーナ            | 11,700  | 612     | 7,160,400      |
| 合計              |         |         | 87,306,694,586 |

(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24年12月28日

|                  |                |
|------------------|----------------|
| 資産総額             | 1,109,244,752円 |
| 負債総額             | 752,520円       |
| 純資産総額（ - ）       | 1,108,492,232円 |
| 発行済数量            | 1,920,671,457口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 0.5771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24年12月28日

|                  |                  |
|------------------|------------------|
| 資産総額             | 97,333,784,764円  |
| 負債総額             | 348,794,000円     |
| 純資産総額（ - ）       | 96,984,990,764円  |
| 発行済数量            | 200,529,461,609口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 0.4836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24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C I O（Chief Investment Officer）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

C I O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24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  | 4     | 90,730        |
| 追加型株式投資信託  | 420   | 7,381,068     |
| 株式投資信託 合計  | 424   | 7,471,798     |
| 単位型公社債投資信託 | -     | -             |
| 追加型公社債投資信託 | 17    | 2,449,257     |
| 公社債投資信託 合計 | 17    | 2,449,257     |
| 総合計        | 441   | 9,921,055     |

## 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。

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53期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第54期事業年度に係る中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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。

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<br>(平成23年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日現在) |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部      |                         |                         |
| 流動資産      |                         |                         |
| 現金・預金     | 1,820,358               | 3,745,233               |
| 有価証券      | 18,987,155              | 19,655,070              |
| 前払金       | 579                     | 314                     |
| 前払費用      | 24,840                  | 90,562                  |
| 未収入金      | 6,925                   | 11,931                  |
| 未収委託者報酬   | 6,933,076               | 6,516,540               |
| 未収収益      | 41,963                  | 55,102                  |
| 貯蔵品       | 23,337                  | 11,888                  |
| 繰延税金資産    | 286,080                 | 630,508                 |
| その他       | 501,484                 | 190,450                 |
| 流動資産計     | 28,625,803              | 30,907,602              |
| 固定資産      |                         |                         |
| 有形固定資産    | 1                       | 1                       |
| 建物（純額）    | 967,190                 | 1,003,450               |
| 器具備品（純額）  | 332,407                 | 513,162                 |
| 建設仮勘定     | 634,782                 | 484,571                 |
|           | -                       | 5,715                   |
| 無形固定資産    | 2,414,530               | 2,870,849               |
| ソフトウェア    | 1,364,617               | 2,173,517               |
| ソフトウェア仮勘定 | 1,037,069               | 684,878                 |
| 電話加入権     | 11,850                  | 11,850                  |
| 商標権       | 396                     | 132                     |



|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| その他          |   | 596        |   | 471        |
| 投資その他の資産     |   | 18,825,476 |   | 16,375,520 |
| 投資有価証券       |   | 12,339,547 |   | 10,034,136 |
| 関係会社株式       |   | 5,141,069  |   | 5,141,069  |
| 出資金          |   | 142,215    |   | 136,315    |
| 従業員に対する長期貸付金 |   | 99,889     |   | 112,674    |
| 差入保証金        |   | 609,781    |   | 542,920    |
| 長期前払費用       |   | 7,607      |   | 8,478      |
| 投資不動産(純額)    | 1 | 490,114    | 1 | 409,876    |
| 貸倒引当金        |   | 4,750      |   | 9,950      |
| 固定資産計        |   | 22,207,196 |   | 20,249,820 |
| 資産合計         |   | 50,833,000 |   | 51,157,423 |

(単位:千円)

|              | 前事業年度<br>(平成23年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日現在) |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>負債の部</b>  |                         |                         |
| <b>流動負債</b>  |                         |                         |
| 預り金          | 46,454                  | 55,551                  |
| 未払金          | 6,501,119               | 7,194,946               |
| 未払収益分配金      | 27,599                  | 17,954                  |
| 未払償還金        | 119,838                 | 88,334                  |
| 未払手数料        | 3,725,807               | 3,386,380               |
| その他未払金       | 2,627,872               | 3,702,277               |
| 未払費用         | 2,395,029               | 3,313,011               |
| 未払法人税等       | 895,379                 | 963,539                 |
| 未払消費税等       | 383,973                 | 229,365                 |
| 賞与引当金        | 263,000                 | 307,000                 |
| 本社移転関連費用引当金  | -                       | 346,425                 |
| 資産除去債務       | -                       | 292,000                 |
| その他          | -                       | 87,535                  |
| 流動負債計        | 10,484,955              | 12,789,375              |
| <b>固定負債</b>  |                         |                         |
| 退職給付引当金      | 1,410,635               | 1,670,344               |
| 役員退職慰労引当金    | 59,160                  | 68,068                  |
| 繰延税金負債       | 1,977,913               | 1,782,558               |
| 固定負債計        | 3,447,708               | 3,520,970               |
| 負債合計         | 13,932,663              | 16,310,345              |
| <b>純資産の部</b> |                         |                         |
| <b>株主資本</b>  |                         |                         |
| 資本金          | 15,174,272              | 15,174,272              |
| 資本剰余金        |                         |                         |
| 資本準備金        | 11,495,727              | 11,495,727              |
| 資本剰余金合計      | 11,495,727              | 11,495,727              |
| <b>利益剰余金</b> |                         |                         |
| 利益準備金        | 374,297                 | 374,297                 |
| その他利益剰余金     |                         |                         |

|              |            |            |
|--------------|------------|------------|
| 繰越利益剰余金      | 9,874,176  | 7,715,116  |
| 利益剰余金合計      | 10,248,473 | 8,089,414  |
| 株主資本合計       | 36,918,473 | 34,759,414 |
| 評価・換算差額等     |            |            |
| その他有価証券評価差額金 | 104,040    | 33,879     |
| 繰延ヘッジ損益      | 85,902     | 53,783     |
| 評価・換算差額等合計   | 18,137     | 87,663     |
| 純資産合計        | 36,900,336 | 34,847,077 |
| 負債・純資産合計     | 50,833,000 | 51,157,423 |

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

|              | 前事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成23年 4月 1日<br>至 平成24年 3月31日) |
|--------------|---|---|
| 営業収益         |   |   |
| 委託者報酬        | 72,303,483                                | 72,931,048                                |
| その他営業収益      | 345,390                                   | 401,212                                   |
| 営業収益計        | 72,648,873                                | 73,332,260                                |
| 営業費用         |   |   |
| 支払手数料        | 41,437,322                                | 41,050,089                                |
| 広告宣伝費        | 967,991                                   | 709,853                                   |
| 公告費          | 1,256                                     | 699                                       |
| 受益証券発行費      | 3   | 74  |
| 調査費          | 6,192,360                                 | 7,993,144                                 |
| 調査費          | 831,159                                   | 878,635                                   |
| 委託調査費        | 5,361,200                                 | 7,114,509                                 |
| 委託計算費        | 718,414                                   | 733,156                                   |
| 営業雑経費        | 1,806,147                                 | 1,651,996                                 |
| 通信費          | 287,454                                   | 205,421                                   |
| 印刷費          | 674,758                                   | 472,511                                   |
| 協会費          | 47,465                                    | 52,117                                    |
| 諸会費          | 10,778                                    | 11,971                                    |
| その他営業雑経費     | 785,691                                   | 909,973                                   |
| 営業費用計        | 51,123,496                                | 52,139,015                                |
| 一般管理費        |   |   |
| 給料           | 4,192,794                                 | 4,452,711                                 |
| 役員報酬         | 157,200                                   | 209,630                                   |
| 給料・手当        | 3,545,655                                 | 3,646,155                                 |
| 賞与           | 226,939                                   | 289,926                                   |
| 賞与引当金繰入額     | 263,000                                   | 307,000                                   |
| 福利厚生費        | 619,459                                   | 728,342                                   |
| 交際費          | 68,476                                    | 71,356                                    |
| 寄付金          | 638                                       | 591                                       |
| 旅費交通費        | 266,082                                   | 215,939                                   |
| 租税公課         | 169,305                                   | 171,533                                   |
| 不動産賃借料       | 680,147                                   | 727,939                                   |
| 退職給付費用       | 334,864                                   | 422,030                                   |
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 28,500                                    | 27,988                                    |
| 固定資産減価償却費    | 897,352                                   | 1,107,222                                 |
| 諸経費          | 1,170,318                                 | 1,077,041                                 |
| 一般管理費計       | 8,427,939                                 | 9,002,696                                 |
| 営業利益         | 13,097,437                                | 12,190,548                                |

(単位:千円)

|              | 前事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日) |            | 当事業年度<br>(自 平成23年 4月 1日<br>至 平成24年 3月31日) |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 営業外収益        |   |            |   |            |
| 受取配当金        | 1   | 573,514    |   | 74,753     |
| 有価証券利息       |   | 23,029     |   | 13,537     |
| 受取利息         |   | 2,673      |   | 2,771      |
| 時効成立分配金・償還金  |   | 149,120    |   | 42,189     |
| 投資有価証券売却益    |   | 38,591     |   | 117,695    |
| 有価証券償還益      |   | 3,185      |   | 68,106     |
| その他          |   | 41,908     |   | 54,685     |
| 営業外収益計       |   | 832,022    |   | 373,739    |
| 営業外費用        |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却損    |   | 7,515      |   | 95,389     |
| 有価証券償還損      |   | 277        |   | 67,873     |
| その他          |   | 180,501    |   | 67,829     |
| 営業外費用計       |   | 188,294    |   | 231,091    |
| 経常利益         |   | 13,741,165 |   | 12,333,196 |
| 特別利益         |   |            |   |            |
| 貸倒引当金戻入額     |   | 614,232    |   | -          |
| 特別利益計        |   | 614,232    |   | -          |
| 特別損失         |   |            |   |            |
| 固定資産除却損      | 2   | 1,067      | 2   | 4,871      |
| 減損損失         | 3   | 35,468     | 3   | 76,217     |
| 有価証券評価損      |   | -          |   | 211,376    |
| 本社移転関連費用     |   | -          |   | 346,425    |
| その他          |   | 22,059     |   | 19,547     |
| 特別損失計        |   | 58,595     |   | 658,438    |
| 税引前当期純利益     |   | 14,296,802 |   | 11,674,757 |
| 法人税、住民税及び事業税 |   | 4,834,931  |   | 5,254,642  |
| 法人税等調整額      |   | 256,140    |   | 602,832    |
| 法人税等合計       |   | 5,091,072  |   | 4,651,809  |
| 当期純利益        |   | 9,205,730  |   | 7,022,948  |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

|          | 前事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成23年 4月 1日<br>至 平成24年 3月31日) |
|----------|---|---|
| 株主資本     |   |   |
| 資本金      |   |   |
| 当期首残高    | 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    |   |   |
| 当期首残高    | 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  |   |   |
| 当期首残高    | 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    |   |   |
| 当期首残高    | 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    |   |   |
| 当期首残高    | 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    | -   | -   |
| 繰越利益剰余金  |   |   |
| 当期首残高    | 9,085,103                                 | 9,874,176                                 |
| 当期変動額    |   |   |
| 別途積立金の取崩 | 2,800,000                                 | -   |
| 剰余金の配当   | 11,216,657                                | 9,182,008                                 |
| 当期純利益    | 9,205,730                                 | 7,022,948                                 |
| 当期変動額合計  | 789,072                                   | 2,159,059                                 |
| 当期末残高    | 9,874,176                                 | 7,715,116                                 |
| 利益剰余金合計  |   |   |
| 当期首残高    | 12,259,401                                | 10,248,473                                |
| 当期変動額    |   |   |
| 剰余金の配当   | 11,216,657                                | 9,182,008                                 |

|         |            |           |
|---------|------------|-----------|
| 当期純利益   | 9,205,730  | 7,022,948 |
| 当期変動額合計 | 2,010,927  | 2,159,059 |
| 当期末残高   | 10,248,473 | 8,089,414 |

(単位:千円)

|                         | 前事業年度<br>(自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(自平成23年4月1日<br>至平成24年3月31日) |
|-------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| <b>株主資本合計</b>           |                                      |                                      |
| 当期首残高                   | 38,929,401                           | 36,918,473                           |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 剰余金の配当                  | 11,216,657                           | 9,182,008                            |
| 当期純利益                   | 9,205,730                            | 7,022,948                            |
| 当期変動額合計                 | 2,010,927                            | 2,159,059                            |
| 当期末残高                   | 36,918,473                           | 34,759,414                           |
| <b>評価・換算差額等</b>         |                                      |                                      |
| <b>その他有価証券評価差額金</b>     |                                      |                                      |
| 当期首残高                   | 18,061                               | 104,040                              |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 85,978                               | 137,920                              |
| 当期変動額合計                 | 85,978                               | 137,920                              |
| 当期末残高                   | 104,040                              | 33,879                               |
| <b>繰延ヘッジ損益</b>          |                                      |                                      |
| 当期首残高                   | 55,712                               | 85,902                               |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 141,615                              | 32,119                               |
| 当期変動額合計                 | 141,615                              | 32,119                               |
| 当期末残高                   | 85,902                               | 53,783                               |
| <b>評価・換算差額等合計</b>       |                                      |                                      |
| 当期首残高                   | 73,774                               | 18,137                               |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 55,636                               | 105,800                              |
| 当期変動額合計                 | 55,636                               | 105,800                              |
| 当期末残高                   | 18,137                               | 87,663                               |
| <b>純資産合計</b>            |                                      |                                      |
| 当期首残高                   | 38,855,627                           | 36,900,336                           |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 剰余金の配当                  | 11,216,657                           | 9,182,008                            |
| 当期純利益                   | 9,205,730                            | 7,022,948                            |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 55,636                               | 105,800                              |
| 当期変動額合計                 | 1,955,290                            | 2,053,258                            |
| 当期末残高                   | 36,900,336                           | 34,847,077                           |

## 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。

## 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。

## 3．固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

（リース資産を除く）

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

|      |       |
|------|-------|
| 建物   | 6～47年 |
| 器具備品 | 3～20年 |

## (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。

## (3) 長期前払費用

定額法によっております。

## 4．引当金の計上基準

## (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。

## (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、能力及び実績等に依り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。

#### （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。

#### （５）本社移転関連費用引当金

本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。

### ５．ヘッジ会計の方法

#### （１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。

#### （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

#### （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。

#### （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。

### ６．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### （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。

#### （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。

### 表示方法の変更

#### （損益計算書）

#### １．前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「有価証券償還益」は重要性が増し



たため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた45,094千円は、「有価証券償還益」3,185千円、「その他」41,908千円として組替えております。

2. 前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「有価証券償還損」は重要性が増したため、当事業年度より区分掲記することとしました。また、前事業年度において区分掲記していた「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」、「貯蔵品廃棄損」及び「投資不動産管理費用」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」に表示していた98,613千円、「貯蔵品廃棄損」に表示していた25,533千円、「投資不動産管理費用」に表示していた20,028千円、及び「その他」に表示していた36,603千円は、「有価証券償還損」277千円、「その他」180,501千円として組替えております。

3. 前事業年度において区分掲記していた「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」に表示していた21,290千円は、「その他」として組替えております。

## 追加情報

(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)

当事業年度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。

## 注記事項

(貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

|        | 前事業年度<br>(平成23年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日現在) |
|--------|-------------------------|-------------------------|
| 建物     | 854,118千円               | 986,089千円               |
| 器具備品   | 2,129,756千円             | 2,234,738千円             |
| 投資建物   | 700,991千円               | 712,587千円               |
| 投資器具備品 | 28,141千円                | 22,398千円                |

### 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。

|     | 前事業年度<br>(平成23年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日現在) |
|-----|-------------------------|-------------------------|
| 未払金 | 2,591,913千円             | 3,577,654千円             |

### 3 保証債務

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,372,770千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

#### 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。

|       | 前事業年度<br>（自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日） |
|-------|--|--|
| 受取配当金 | 460,584千円                              | -                                      |

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

|       | 前事業年度<br>（自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日） |
|-------|--|--|
| 器具備品  | 1,067千円                                | 4,812千円                                |
| 投資不動産 | -                                      | 59千円                                   |
| 計     | 1,067千円                                | 4,871千円                                |

#### 3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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つのグループ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。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当事業年度において、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つのグループピ  
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  
（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円で  
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）

|       | 当事業年度期首<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>の総額<br>（百万円） | 1株当たり<br>配当額<br>（円） | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成22年6月25日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 11,216                 | 4,300               | 平成22年<br>3月31日 | 平成22年<br>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

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

|       | 当事業年度期首<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成23年6月24日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 9,182                  | 3,520               | 平成23年<br>3月31日 | 平成23年<br>6月27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24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 7,022百万円  
 配当の原資 利益剰余金  
 1株当たり配当額 2,692円  
 基準日 平成24年3月31日  
 効力発生日 平成24年6月26日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

おります。

未払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、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。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価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止し、中止時点までのヘッジ手段に係る損益は、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで繰り延べております。

##### （ ）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

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）。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

|                            | 貸借対照表<br>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<br>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。

当事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

|                            | 貸借対照表<br>計上額 | 時価         | 差額 |
|----------------------------|--------------|------------|----|
| (1) 現金・預金                  | 3,745,233    | 3,745,233  | -  |
| (2) 未収委託者報酬                | 6,516,540    | 6,516,540  | -  |
| (3) 有価証券及び投資有価証券<br>其他有価証券 | 28,525,516   | 28,525,516 | -  |
| 資産計                        | 38,787,291   | 38,787,291 | -  |
| (1) 未払手数料                  | 3,386,380    | 3,386,380  | -  |
| (2) その他未払金                 | 3,702,277    | 3,702,277  | -  |
| (3) 未払費用(*1)               | 2,764,494    | 2,764,494  | -  |
| 負債計                        | 9,853,152    | 9,853,152  | -  |
| デリバティブ取引(*2)               | (87,535)     | (87,535)   | -  |

(\*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                         | 前事業年度<br>（平成23年3月31日現在） | 当事業年度<br>（平成24年3月31日現在） |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| (1) その他有価証券<br>非上場株式       | 1,172,137               | 1,163,689               |
| (2) 子会社株式及び関連会社株式<br>子会社株式 | 5,141,069               | 5,141,069               |
| (3) 差入保証金                  | 609,781                 | 542,920                 |

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

|                                   | 1年以内      | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>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    | -    |

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

|                                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|-----------------------------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金                             | 3,745,233  | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬                           | 6,516,540  | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券のうち満期があるもの | 836,311    | 2,069,432   | 4,320,954    | -    |
| 合計                                | 11,098,084 | 2,069,432   | 4,320,954    | -    |

## （有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

|  | 貸借対照表計上額<br>（千円）     | 取得原価<br>（千円）         | 差額<br>（千円）     |
|--|----------------------|----------------------|----------------|
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの<br>その他<br>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<br>原価を超えないもの<br>（1）株式<br>（2）その他<br>証券投資信託の受益証券 | 54,283<br>25,277,982 | 55,101<br>25,890,888 | 818<br>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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

|   | 貸借対照表計上額<br>（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額<br>（千円） |
|---|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの<br>その他<br>証券投資信託の受益証券 | 6,864,572        | 6,497,516    | 367,056    |
| 小計  | 6,864,572        | 6,497,516    | 367,056    |
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えないもの<br>（1）株式             | 49,871           | 55,101       | 5,230      |



|                        |            |            |         |
|------------------------|------------|------------|---------|
| (2) その他<br>証券投資信託の受益証券 | 21,611,072 | 21,918,194 | 307,122 |
| 小計                     | 21,660,944 | 21,973,296 | 312,352 |
| 合計                     | 28,525,516 | 28,470,813 | 54,703  |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）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. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

| 種類                 | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他<br>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           |

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

| 種類                 | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他<br>証券投資信託の受益証券 | 16,215,351  | 117,695         | 95,389          |
| 合計                 | 16,215,351  | 117,695         | 95,389          |

### 4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、その他有価証券（その他）について211,376千円の減損処理を行っておりません。

(デリバティブ取引関係)

#### 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。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

該当事項はありません。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

株式関連

(単位：千円)

| 区分 | デリバティブ<br>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<br>以外の<br>取引 | 株価指数先物取引<br>売建<br>TOPIX先物 | 1,669,315 | - | 87,535 | 87,535 |
| 合計                |                           | 1,669,315 | - | 87,535 | 87,535 |

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表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。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

株式関連

（単位：千円）

| ヘッジ<br>会計の<br>方法 | デリバティブ<br>取引の種類等          | 主な<br>ヘッジ<br>対象 | 契約額等      |       | 時価      |
|------------------|---------------------------|-----------------|-----------|-------|---------|
|                  |                           |                 |           | うち1年超 |         |
| 原則的<br>処理<br>方法  | 株価指数先物取引<br>売建<br>TOPIX先物 | 投資<br>有価証券      | 2,435,030 | -     | 183,430 |
| 合計               |                           |                 | 2,435,030 | -     | 183,430 |

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、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。

### 2. 退職給付債務に関する事項

|         | 前事業年度<br>（平成23年3月31日現在） | 当事業年度<br>（平成24年3月31日現在） |
|---------|-------------------------|-------------------------|
| 退職給付債務  | 1,410,635千円             | 1,670,344千円             |
| 退職給付引当金 | 1,410,635千円             | 1,670,344千円             |

### 3. 退職給付費用に関する事項

|        | 前事業年度<br>（自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日） | 当事業年度<br>（自平成23年4月1日<br>至平成24年3月31日） |
|--------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 勤務費用   | 191,300千円                            | 261,341千円                            |
| その他    | 143,564千円                            | 160,689千円                            |
| 退職給付費用 | 334,864千円                            | 422,030千円                            |

（注）「その他」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）

## 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

（単位：千円）

|              | 前事業年度（平成23年3月31日<br>現在） | 当事業年度（平成24年3月31日<br>現在） |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| 繰延税金資産       |                         |                         |
| 減損損失         | 928,499                 | 838,826                 |
| 退職給付引当金      | 573,987                 | 599,247                 |
| 連結法人間取引（譲渡損） | 294,850                 | 258,256                 |
| 未払事業税        | 212,062                 | 212,753                 |
| 投資有価証券評価損    | 216,468                 | 191,138                 |
| 本社移転関連費用引当金  | -                       | 131,676                 |
| 賞与引当金        | 107,014                 | 116,690                 |
| 出資金評価損       | 128,238                 | 114,425                 |
| 資産除去債務       | -                       | 110,989                 |
| 有価証券評価損      | -                       | 80,344                  |
| 器具備品         | 38,093                  | 33,365                  |
| その他有価証券評価差額金 | 125,395                 | 27,099                  |
| 役員退職慰労引当金    | 24,072                  | 25,804                  |
| 未払社会保険料      | 11,722                  | 14,071                  |
| その他          | 28,763                  | 27,487                  |
| 繰延税金資産小計     | 2,689,169               | 2,782,177               |
| 評価性引当額       | 1,547,609               | 1,379,241               |
| 繰延税金資産合計     | 1,141,560               | 1,402,935               |
| 繰延税金負債       |                         |                         |
| 連結法人間取引（譲渡益） | 2,772,301               | 2,428,233               |
| 建物（資産除去債務）   | -                       | 76,837                  |
| 繰延ヘッジ損益      | 58,934                  | 29,783                  |
| その他有価証券評価差額金 | -                       | 18,241                  |
| その他          | 2,156                   | 1,888                   |
| 繰延税金負債合計     | 2,833,392               | 2,554,985               |
| 繰延税金負債の純額    | 1,691,832               | 1,152,049               |

## 2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

（単位：％）

|                      | 前事業年度<br>（平成23年3月31日現在） | 当事業年度<br>（平成24年3月31日現在） |
|----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 法定実効税率               | 40.69                   | -                       |
| （調整）                 |                         |                         |
| 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 | - |

（注）当事業年度は、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。

### 3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率の変更により繰延税金負債の純額（繰延税金資産の金額を控除した金額）が211,604千円減少し、法人税等調整額が205,949千円減少しております。

### （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

#### 2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

#### 3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

| 変動の内容        | 前事業年度<br>（自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日） |
|--------------|--|--|
| 期首残高         | -                                      | -                                      |
| 見積りの変更に伴う増加額 | -                                      | 292,000                                |
| 期末残高         | -                                      | 292,000                                |

#### 4．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

当事業年度において、平成24年度中に予定している本社移転計画により、合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

### （セグメント情報等）

[ セグメント情報 ]

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 ]

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 ]

前事業年度（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 |

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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 | 76,217     | 76,217 |

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称   | 所在地       | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(千円) | 科目 | 期末残高<br>(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。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                                  | 所在地       | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容       | 取引金額<br>(千円) | 科目 | 期末残高<br>(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<br>(注) | 1,372,770    | -  | -            |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

| 種類          | 会社等の名称           | 所在地     | 資本金または出資金<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係       | 取引の内容        | 取引金額<br>(千円) | 科目    | 期末残高<br>(千円) |
|-------------|------------------|---------|--------------------|---------|---------------------------|-----------------|--------------|--------------|-------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券㈱            | 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・マーケッツ㈱ | 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。

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

| 種類          | 会社等の名称              | 所在地     | 資本金または出資金(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 | 19,792,278 | 未払手数料 | 2,376,978 |
| 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 | 595,391    | 未払手数料 | 76,686    |
| 同一の親会社をもつ会社 | (株)大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区  | 3,000          | 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    | 1,233,996  | 未払費用  | 245,735   |

(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) 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。

(3) 大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年4月1日をもって合併いたしました。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

| 前事業年度<br>（自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日）    | 当事業年度<br>（自 平成23年 4月 1日<br>至 平成24年 3月31日）    |
|--|--|
| 1株当たり純資産額 14,146.05円<br>1株当たり当期純利益 3,529.09円 | 1株当たり純資産額 13,358.92円<br>1株当たり当期純利益 2,692.30円 |

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

（注）2．1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<br>（自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成23年 4月 1日<br>至 平成24年 3月31日） |
|-----------------|---|---|
| 当期純利益（千円）       | 9,205,730                                 | 7,022,948                                 |
| 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）

該当事項はありません。

（追加情報）

前事業年度（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）<br>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。

当事業年度（自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）

該当事項はありません。

[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<br>(平成24年9月30日) |
|------------|---|--------------------------|
| 資産の部       |   |                          |
| 流動資産       |   |                          |
| 現金・預金      |   | 1,833,296                |
| 有価証券       |   | 16,491,682               |
| 未収委託者報酬    |   | 6,074,374                |
| 貯蔵品        |   | 9,897                    |
| 繰延税金資産     |   | 576,334                  |
| その他        |   | 421,905                  |
| 流動資産計      |   | 25,407,491               |
| 固定資産       |   |                          |
| 有形固定資産     | 1 | 812,139                  |
| 無形固定資産     |   |                          |
| ソフトウェア     |   | 2,304,771                |
| その他        |   | 710,794                  |
| 無形固定資産合計   |   | 3,015,566                |
| 投資その他の資産   |   |                          |
| 投資有価証券     |   | 13,513,781               |
| その他        | 1 | 2,247,303                |
| 貸倒引当金      |   | 9,950                    |
| 投資その他の資産合計 |   | 15,751,135               |
| 固定資産計      |   | 19,578,842               |
| 資産合計       |   | 44,986,333               |

(単位:千円)

|             |   | 当中間会計期間末<br>(平成24年9月30日) |
|-------------|---|--------------------------|
| 負債の部        |   |                          |
| 流動負債        |   |                          |
| 未払金         |   | 4,702,038                |
| 未払費用        |   | 3,673,584                |
| 未払法人税等      |   | 743,636                  |
| 賞与引当金       |   | 426,400                  |
| 本社移転関連費用引当金 |   | 346,425                  |
| 資産除去債務      |   | 292,000                  |
| その他         | 3 | 270,950                  |
| 流動負債計       |   | 10,455,035               |
| 固定負債        |   |                          |
| 繰延税金負債      |   | 1,465,584                |
| 退職給付引当金     |   | 1,864,115                |
| 役員退職慰労引当金   |   | 47,925                   |

|              |            |
|--------------|------------|
| 固定負債計        | 3,377,624  |
| 負債合計         | 13,832,659 |
| 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      | 4,314,536  |
| 利益剰余金合計      | 4,688,834  |
| 株主資本合計       | 31,358,834 |
| 評価・換算差額等     |            |
| その他有価証券評価差額金 | 408,812    |
| 繰延ヘッジ損益      | 203,652    |
| 評価・換算差額等合計   | 205,160    |
| 純資産合計        | 31,153,673 |
| 負債・純資産合計     | 44,986,333 |

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

|              | 当中間会計期間<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成24年9月30日) |            |
|--------------|--|------------|
| 営業収益         |  |            |
| 委託者報酬        |  | 35,929,057 |
| その他営業収益      |  | 221,982    |
| 営業収益計        |  | 36,151,039 |
| 営業費用         |  |            |
| 支払手数料        |  | 20,053,264 |
| その他営業費用      |  | 5,549,289  |
| 営業費用計        |  | 25,602,554 |
| 一般管理費        | 1  | 5,244,843  |
| 営業利益         |  | 5,303,641  |
| 営業外収益        | 2  | 410,550    |
| 営業外費用        | 1, 3                                     | 62,244     |
| 経常利益         |  | 5,651,948  |
| 特別利益         |  | 39,827     |
| 特別損失         |  | 14,428     |
| 税引前中間純利益     |  | 5,677,347  |
| 法人税、住民税及び事業税 |  | 2,153,585  |
| 法人税等調整額      |  | 97,806     |
| 中間純利益        |  | 3,621,569  |

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

|           | 当中間会計期間<br>(自平成24年4月1日<br>至平成24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     | 7,715,116                              |
| 当中間期変動額   |  |
| 剰余金の配当    | 7,022,149                              |
| 中間純利益     | 3,621,569                              |
| 当中間期変動額合計 | 3,400,580                              |
| 当中間期末残高   | 4,314,536                              |

(単位:千円)

|         | 当中間会計期間<br>(自平成24年4月1日<br>至平成24年9月30日) |
|---------|--|
| 利益剰余金合計 |  |
| 当期首残高   | 8,089,414                              |
| 当中間期変動額 |  |

|                           |            |
|---------------------------|------------|
| 剰余金の配当                    | 7,022,149  |
| 中間純利益                     | 3,621,569  |
| 当中間期変動額合計                 | 3,400,580  |
| 当中間期末残高                   | 4,688,834  |
| 株主資本合計                    |            |
| 当期首残高                     | 34,759,414 |
| 当中間期変動額                   |            |
| 剰余金の配当                    | 7,022,149  |
| 中間純利益                     | 3,621,569  |
| 当中間期変動額合計                 | 3,400,580  |
| 当中間期末残高                   | 31,358,834 |
| 評価・換算差額等                  |            |
| その他有価証券評価差額金              |            |
| 当期首残高                     | 33,879     |
| 当中間期変動額                   |            |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額(純額) | 442,692    |
| 当中間期変動額合計                 | 442,692    |
| 当中間期末残高                   | 408,812    |
| 繰延ヘッジ損益                   |            |
| 当期首残高                     | 53,783     |
| 当中間期変動額                   |            |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額(純額) | 149,868    |
| 当中間期変動額合計                 | 149,868    |
| 当中間期末残高                   | 203,652    |
| 評価・換算差額等合計                |            |
| 当期首残高                     | 87,663     |
| 当中間期変動額                   |            |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額(純額) | 292,823    |
| 当中間期変動額合計                 | 292,823    |
| 当中間期末残高                   | 205,160    |
| 純資産合計                     |            |
| 当期首残高                     | 34,847,077 |
| 当中間期変動額                   |            |
| 剰余金の配当                    | 7,022,149  |
| 中間純利益                     | 3,621,569  |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額(純額) | 292,823    |
| 当中間期変動額合計                 | 3,693,404  |
| 当中間期末残高                   | 31,153,673 |

## 重要な会計方針

|                      | 当中間会計期間<br>(自 平成24年 4月 1日<br>至 平成24年 9月30日)  |
|----------------------|--|
| 1. 資産の評価基準及び<br>評価方法 | <p>(1) 有価証券<br/>子会社株式及び関連会社株式<br/>移動平均法による原価法により計上しております。<br/>         其他有価証券<br/>         時価のあるもの<br/>         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<br/>         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<br/>         定）を採用しております。<br/>         時価のないもの<br/>         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<br/>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<br>の方法  | <p>(1) 有形固定資産及び投資不動産<br/>定率法によっております。<br/>         なお、主な耐用年数は以下の通りであります。<br/>         建物 6～47年<br/>         器具備品 3～20年</p> <p>(2) 無形固定資産<br/>定額法によっております。<br/>         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<br/>         期間（5年）に基づいております。</p> <p>(3) 長期前払費用<br/>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<br/>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<br/>         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<br/>         価法により計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金<br/>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<br/>         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<br/>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<br/>         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<br/>         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<br/>         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<br/>         ります。<br/>         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<br/>         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<br/>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<br/>         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>(5) 本社移転関連費用引当金<br/>本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固<br/>         定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上してありま<br/>         す。</p> |

|                             |  |
|-----------------------------|--|
| 4．ヘッジ会計の方法                  | <p>(1) ヘッジ会計の方法<br/>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<br/>ヘッジ手段・・・株価指数先物<br/>ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針<br/>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<br/>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<br/>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<br/>連結納税制度を適用しております。</p>   |

## 会計方針の変更等

|  |
|--|
| <p>当中間会計期間<br/>(自 平成24年 4月 1日<br/>至 平成24年 9月30日)</p>   |
| <p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)<br/>当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年 4月 1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。<br/>なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。</p> |

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
| <p>当中間会計期間末<br/>(平成24年 9月30日)</p> |   |
| 1．減価償却累計額                         |   |
| 有形固定資産                            | 3,428,406千円   |
| 投資その他の資産                          | 741,362千円   |
| 2．債務保証                            | <p>子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,329,090千円に対して保証を行っております。</p> |
| 3．消費税等の取扱い                        | <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。</p>               |

## (中間損益計算書関係)

|  |  |
|--|--|
| <p>当中間会計期間<br/>(自 平成24年 4月 1日<br/>至 平成24年 9月30日)</p> |  |
| 1．減価償却累計額  |  |

|               |           |
|---------------|-----------|
| 有形固定資産        | 207,578千円 |
| 無形固定資産        | 440,371千円 |
| 投資その他の資産      | 7,190千円   |
| 2. 営業外収益の主要項目 |           |
| 受取配当金         | 219,419千円 |
| 投資有価証券売却益     | 90,397千円  |
| 有価証券償還益       | 64,318千円  |
| 3. 営業外費用の主要項目 |           |
| 有価証券償還損       | 35,545千円  |
| 投資不動産管理費用     | 7,903千円   |
| 投資不動産償却費      | 6,376千円   |

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24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<br>株式数（千株） | 当中間会計期間<br>増加株式数（千株） | 当中間会計期間<br>減少株式数（千株） | 当中間会計期間末<br>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<br>（百万円） | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|-----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成24年6月25日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 7,022           | 2,692           | 平成24年<br>3月31日 | 平成24年<br>6月26日 |

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24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「4．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

##### ( ) デリバティブ取引

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

#### 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24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<br>計上額 | 時価         | 差額 |
|-----------------------------|----------------|------------|----|
| (1) 現金・預金                   | 1,833,296      | 1,833,296  | -  |
| (2) 未収委託者報酬                 | 6,074,374      | 6,074,374  | -  |
| (3) 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券 | 23,805,225     | 23,805,225 | -  |



|                  |            |            |   |
|------------------|------------|------------|---|
| 資産計              | 31,712,896 | 31,712,896 | - |
| (1) 未払金          | 4,702,038  | 4,702,038  | - |
| (2) 未払費用(*1)     | 2,991,665  | 2,991,665  | - |
| 負債計              | 7,693,704  | 7,693,704  | - |
| 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 | -          | -          | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの  | (2,304)    | (2,304)    | - |
| デリバティブ取引計        | (2,304)    | (2,304)    | - |

(\*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   | 1,059,169  |
| 子会社株式   | 5,141,069  |
| 長期差入保証金 | 1,587,878  |

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<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|---------------------------------------|-----------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金                                 | 1,833,296 | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬                               | 6,074,374 | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券のうち満期<br>があるもの | 267,222   | 1,676,395   | 3,587,421    | -    |
| 合計                                    | 8,174,892 | 1,676,395   | 3,587,421    | -    |

## （有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24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<br>計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------------|------------------------|--------------|------------|
| 中間貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの  |                        |              |            |
| 証券投資信託の受益証券                | 2,985,292              | 2,807,373    | 177,919    |
| 小計                         | 2,985,292              | 2,807,373    | 177,919    |
| 中間貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えないもの |                        |              |            |
| 株式                         | 31,019                 | 55,101       | 24,082     |
| 証券投資信託の受益証券                | 20,788,914             | 21,578,724   | 789,810    |
| 小計                         | 20,819,933             | 21,633,826   | 813,892    |
| 合計                         | 23,805,225             | 24,441,199   | 635,973    |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,059,169千円）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24年4月1日 至 平成24年9月30日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当する取引はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

## 株式関連

（単位：千円）

| ヘッジ<br>会計の<br>方法 | デリバティブ<br>取引の種類等          | 主な<br>ヘッジ<br>対象 | 契約額等      |       | 時価    | 当該時価の<br>算定方法               |
|------------------|---------------------------|-----------------|-----------|-------|-------|-----------------------------|
|                  |                           |                 |           | うち1年超 |       |                             |
| 原則的<br>処理方<br>法  | 株価指数先物取引<br>売建<br>TOPIX先物 | 投資<br>有価証券      | 1,408,896 | -     | 2,304 | 東京証券取引所から公表された価格<br>によっている。 |
| 合計               |                           |                 | 1,408,896 | -     | 2,304 |                             |

## （資産除去債務関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

## 2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を平成23年12月から平成24年12月までの1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

## 3．当該資産除去債務の総額の増減

| 変動の内容      | 金額        |
|------------|-----------|
| 期首残高       | 292,000千円 |
| 時の経過による調整額 | -         |
| 中間期末残高     | 292,000千円 |

## （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24年4月1日 至 平成24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24年4月1日 至 平成24年9月30日）

## 1．サービスごとの情報

当社のサービスは、単一であ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24年 4月 1日 至 平成24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24年 4月 1日 至 平成24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24年 4月 1日 至 平成24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<br>（自 平成24年 4月 1日<br>至 平成24年 9月30日）                |            |
|--|------------|
| 1株当たり純資産額  | 11,943.02円 |
| 1株当たり中間純利益金額   | 1,388.35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<br>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)  | 3,621,569  |
| 普通株式に係る中間純利益(千円)   | 3,621,569  |
| 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

平成24年12月3日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・本店の所在地の変更(東京都千代田区に変更)

##### 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 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1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<br>単位：百万円<br>（平成24年3月<br>末日現在） | 事業の内容 |
|--------------|--------------------------------------|-------|
| 日本生命保険相互会社   | 1,200,000                            | （注1）  |
| 三井住友信託銀行株式会社 | （ ）342,037                           | （注2）  |

（ ）資本金の額は、平成24年4月1日現在のものです。

（注1）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

（注2）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2 【関係業務の概要】

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

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

## 3 【資本関係】

該当ありません。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

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24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へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。



### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

平成24年12月28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23年12月1日から平成24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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの平成24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。

### 利害関係

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）](#)△

## 独立監査人の監査報告書

平成24年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成24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。

### 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、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24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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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24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24年4月1日から平成24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。